

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年3月12日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（７）【申込期間】

平成30年 3月13日から平成30年 9月11日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（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）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式	年1回	グローバル	ファミ	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	リーファ	()		
大型株	年2回		ンド		TOPIX	条件付運用型
中小型株				なし		
債券	年4回	日本	ファン		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ド・オ		()	ショート型 /
公債	(隔月)	欧州	ブ・ファ			絶対収益追求
社債			ンズ			型
その他債券	年12回					その他
クレジット属性	(毎月)	アジア				()
()	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
その他資産	()	アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株						
式、債券)資産配		中近東				
分固定型))		(中東)				
資産複合		エマージン				
()		グ				
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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1) 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 >

● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」といいます。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

<投資対象とするマザーファンド>

国内株式	日本株式マザーファンド	「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」に連動する投資成果を目標とします。
外国株式	外国株式マザーファンド	「MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。
外国債券	外国債券マザーファンド	「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。

※各マザーファンドの運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

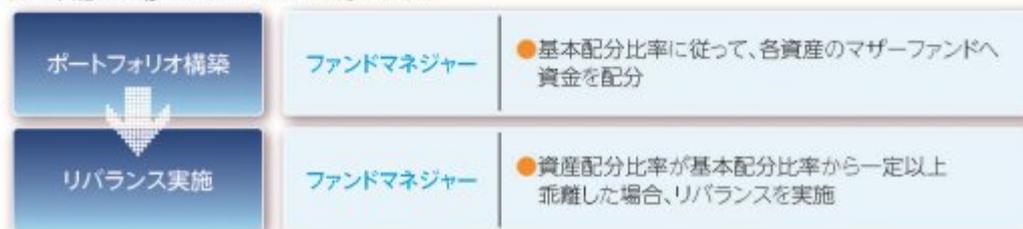
基本配分比率



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。

ポートフォリオ構築プロセス

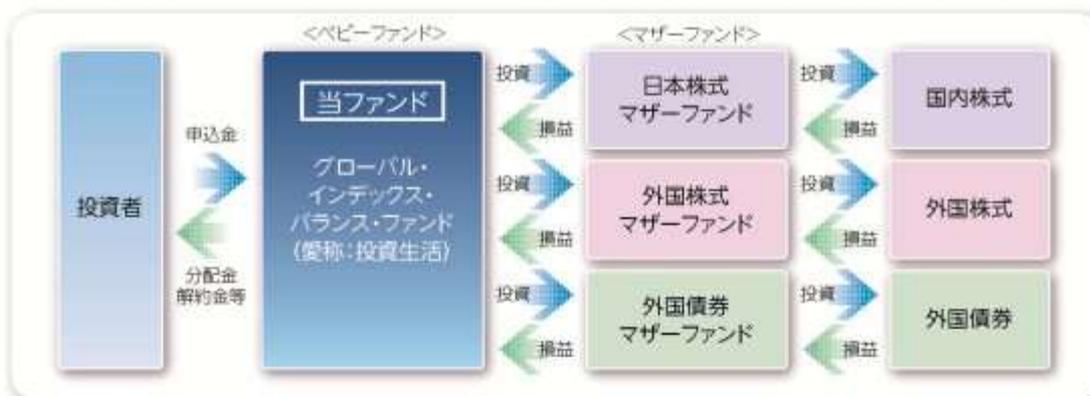
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

● ファンドの仕組み

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



● 主な投資制限

- 株式への投資割合 …………… 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
- 外貨建資産への投資割合 …… 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

● 分配方針

年1回、毎決算時(決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。)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。

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド: [TOPIX(東証株価指数、配当込み)]

[TOPIX(東証株価指数)]とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

[「配当込み」指数]は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

外国株式マザーファンド: [MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)]

[MSCIコクサイ・インデックス]とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

外国債券マザーファンド: [FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)]

[FTSE世界国債インデックス]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年3月3日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

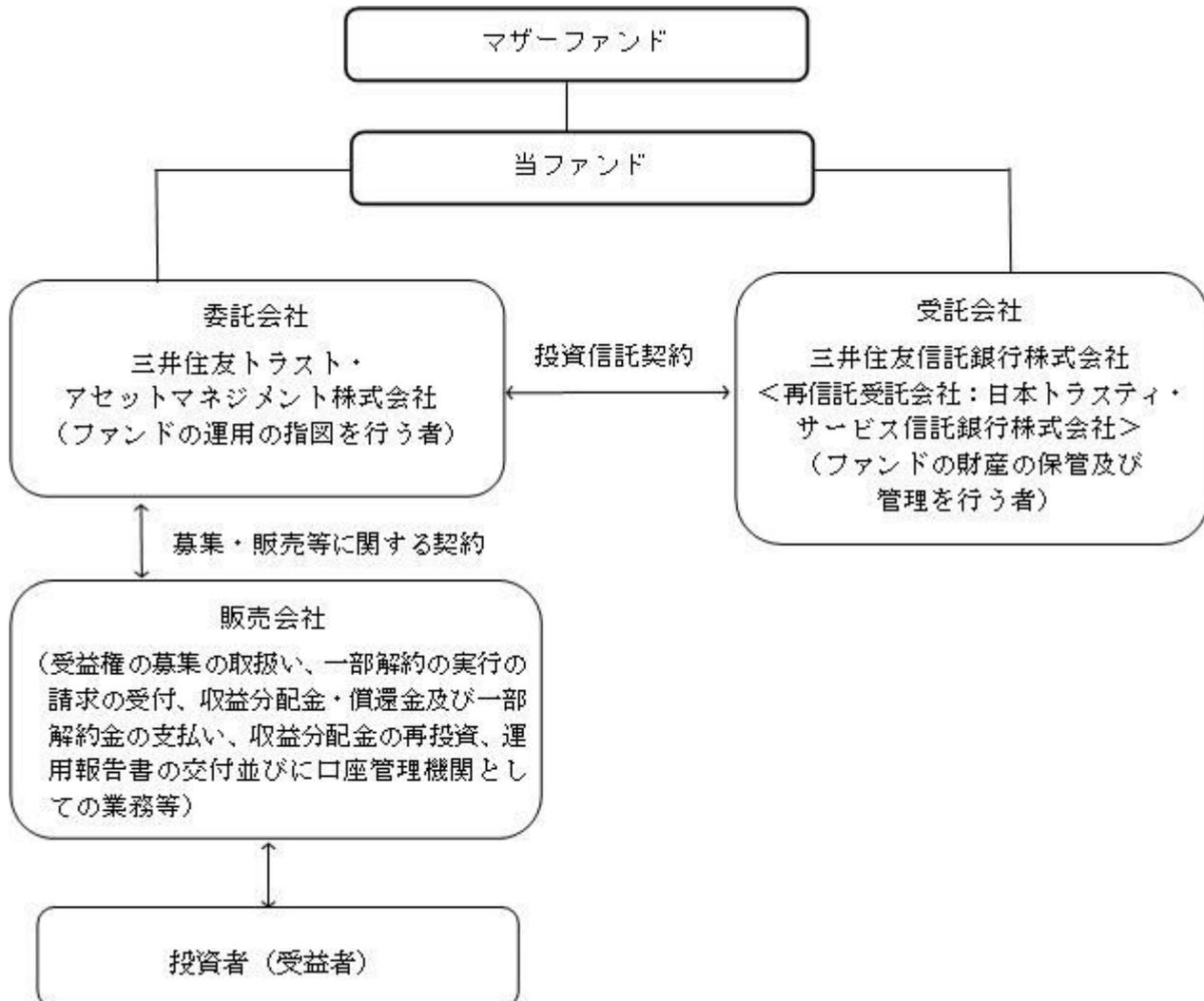
平成22年9月11日 ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成29年12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】

運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．国内において行われ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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、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、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、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。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。）を行うことができます。
- J．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。

（2）【投資対象】

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。

- A．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、後記（5）投資制限〈約款に定める投資制限〉J.、K.及びL.に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権（上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。）
4. 約束手形（上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。）

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、
「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（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. 株券又は新株引受権証券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（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。）
 6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（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。）
 7. 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。）
 8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
 9. 資産の流動化に関する法律に定め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。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 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
 12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1. から11. までの証券又は証券の性質を有するもの
 13. 投資信託又は外国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、振替受益権を含みます。）
 14. 投資証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。）
 15. 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。）
 16. オプションを表示する証券又は証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 17. 預託証券（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。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 19. 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せん。）
 20. 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。）
 21. 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
 22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1. の証券又は証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証券のうち上記1. 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2．から6．までの証券並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記2．から6．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13．の証券及び上記14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記 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上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

上記 の規定にかかわらず、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A．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

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品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

株式への投資は、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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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、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。

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、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。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、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、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。

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. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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、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。

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金

利に係る先物取引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、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、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。

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. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

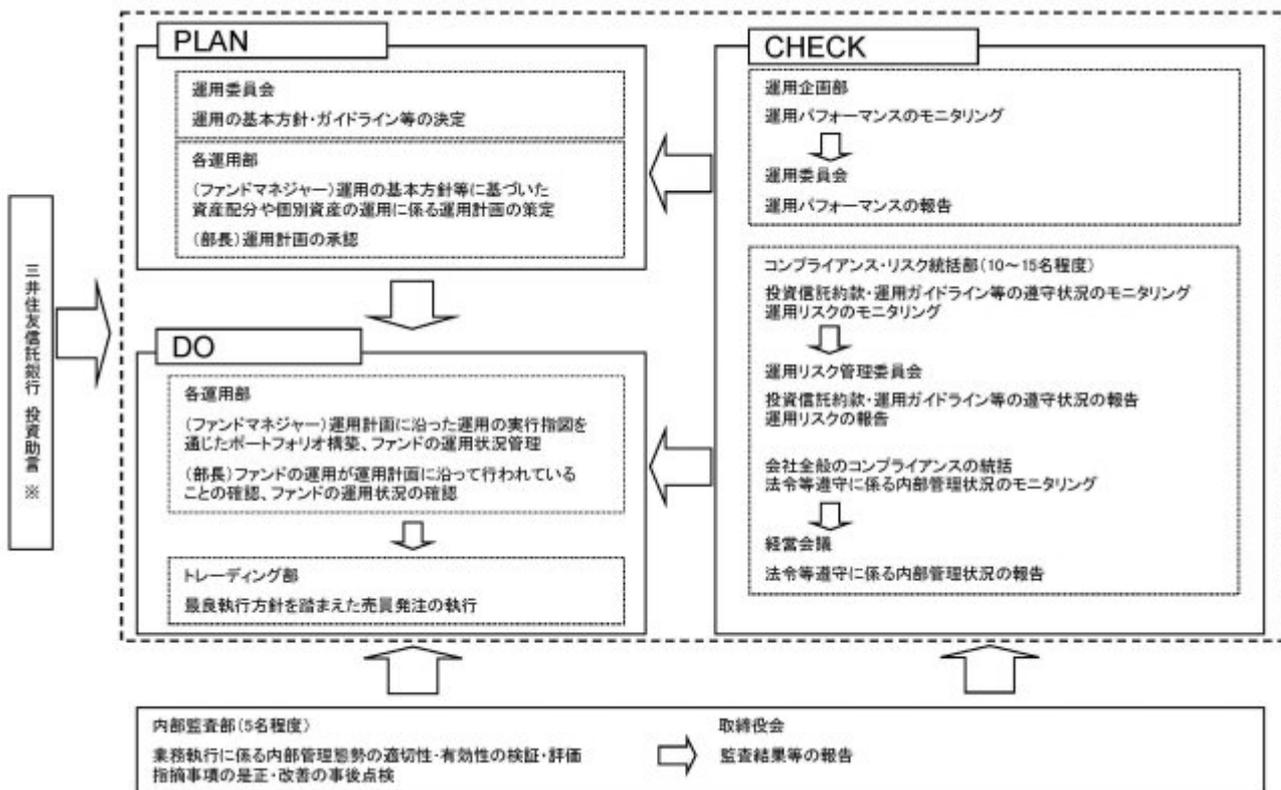
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

C．新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D．同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

G．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H．投資する株式等の範囲

イ．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、金融商品取引所等（金融商品取引所（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では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等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、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。

ロ．上記イ．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、

I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとし、

J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の取引所におけ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を行うことの指図をすることができます。

す。

ハ．委託会社は、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外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として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。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、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の指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として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。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の

a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

a．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、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。

b．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、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。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債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。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、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。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提

供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

二．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

Q．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、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。

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）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。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S．再投資の指図

委託会社は、上記R．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T．資金の借入れ

イ．委託会社は、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て（一部解約に伴う支払資金の手当て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てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、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。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、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。

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ⅴ．利害関係人等との取引等
- イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記Ⅰ．からⅣ．まで及びⅥ．からⅧ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記Ⅰ．からⅣ．まで及びⅥ．からⅧ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。
- 二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。
- Ⅵ．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。
- Ⅶ．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、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、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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



*2013年1月～2017年12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)^{**}
 先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{**}
 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)^{**}
 日本国債… NOMURA-BPI国債^{**}
 先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{**}
 新興国債… JPモルガン・ガバナメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)^{**}

(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、ファンドの認定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

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

*4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入を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、野村證券株式会社が、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

*5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、取扱いまたは誤認につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%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

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以下の率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。

支払先		純資産総額		主な役務
		100億円以下の部分	100億円超の部分	
信託報酬総額 (純資産総額に対して)		年率0.648% (税抜0.6%) ()	年率0.54% (税抜0.5%)	
内訳 (純資産総額に対して)	委託会社	年率0.324% (税抜0.3%)	年率0.27% (税抜0.25%)	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%)	年率0.216% (税抜0.2%)	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%)	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

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

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の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。

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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま（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、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 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「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成29年12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29年12月29日現在の状況について記載してあります。

【グローバル・インデックス・バランス・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	3,554,600,409	99.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,933,015	0.25
合計(純資産総額)		3,563,533,424	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	643,625,621	1.6235	1,044,926,196	1.8730	1,205,510,788	33.83
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	449,508,273	2.3581	1,059,985,459	2.6681	1,199,333,023	33.66
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	474,282,897	2.2886	1,085,478,040	2.4242	1,149,756,598	32.26

(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	99.75
合計	99.75

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（平成20年 6月10日）	522,933,234	522,933,234	10,627	10,627
第2期計算期間末（平成21年 6月10日）	1,311,145,790	1,311,145,790	7,776	7,776
第3期計算期間末（平成22年 6月10日）	1,596,924,893	1,596,924,893	7,467	7,467
第4期計算期間末（平成23年 6月10日）	1,894,852,177	1,894,852,177	7,723	7,723
第5期計算期間末（平成24年 6月11日）	1,957,886,772	1,957,886,772	7,323	7,323
第6期計算期間末（平成25年 6月10日）	2,447,708,994	2,452,312,536	10,634	10,654
第7期計算期間末（平成26年 6月10日）	2,498,609,731	2,502,660,953	12,335	12,355
第8期計算期間末（平成27年 6月10日）	3,184,301,741	3,188,483,833	15,228	15,248
第9期計算期間末（平成28年 6月10日）	2,877,411,328	2,877,411,328	13,131	13,131
第10期計算期間末（平成29年 6月12日）	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905	14,905
平成28年12月末日	3,186,948,601		14,477	
平成29年 1月末日	3,152,234,407		14,349	
2月末日	3,174,991,398		14,460	
3月末日	3,180,769,439		14,472	
4月末日	3,208,744,920		14,593	
5月末日	3,251,125,809		14,850	
6月末日	3,306,835,062		15,154	
7月末日	3,324,812,447		15,206	
8月末日	3,340,569,426		15,247	
9月末日	3,437,056,025		15,754	
10月末日	3,486,618,639		16,157	
11月末日	3,488,325,130		16,274	
12月末日	3,563,533,424		16,586	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成20年 3月 3日～平成20年 6月10日	0
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	0
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	0
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	0
第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	0
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	20
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	20
第8期計算期間	平成26年 6月11日～平成27年 6月10日	20
第9期計算期間	平成27年 6月11日～平成28年 6月10日	0

第10期計算期間	平成28年 6月11日～平成29年 6月12日	0
----------	-------------------------	---

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成20年 3月 3日～平成20年 6月10日	6.3
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	26.8
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	4.0
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	3.4
第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	5.2
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	45.5
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	16.2
第8期計算期間	平成26年 6月11日～平成27年 6月10日	23.6
第9期計算期間	平成27年 6月11日～平成28年 6月10日	13.8
第10期計算期間	平成28年 6月11日～平成29年 6月12日	13.5
第11期中間計算期間	平成29年 6月13日～平成29年12月12日	10.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成20年 3月 3日～平成20年 6月10日	510,143,440	18,045,396	492,098,044
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	1,395,056,723	201,040,178	1,686,114,589
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	816,801,713	364,200,118	2,138,716,184
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	487,758,083	267,858,897	2,673,563,819
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	366,034,410	642,194,197	2,025,611,326
第8期計算期間	平成26年 6月11日～平成27年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	平成27年 6月11日～平成28年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	平成28年 6月11日～平成29年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期中間計算期間	平成29年 6月13日～平成29年12月12日	122,317,797	161,241,585	2,158,299,225

(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)

日本株式マザーファンド

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	241,795,505,280	98.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,513,320,764	1.03
合計(純資産総額)		244,308,826,044	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,543,800,000	1.04

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,133,300	6,693.31	7,585,531,344	7,213.00	8,174,492,900	3.35
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,495,600	726.32	4,717,884,256	826.40	5,367,963,840	2.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	414,100	8,436.21	3,493,436,160	8,920.00	3,693,772,000	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	656,500	4,997.18	3,280,648,687	5,301.00	3,480,106,500	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	695,900	4,453.77	3,099,384,000	4,868.00	3,387,641,200	1.39
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	839,000	3,433.59	2,880,789,011	3,862.00	3,240,218,000	1.33
日本	株式	ソニー	電気機器	622,200	3,461.90	2,153,995,880	5,083.00	3,162,642,600	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	45,800	44,296.42	2,028,776,120	63,120.00	2,890,896,000	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,491,700	210.82	2,633,584,500	204.60	2,555,801,820	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	88,600	21,431.07	1,898,793,289	27,060.00	2,397,516,000	0.98
日本	株式	任天堂	その他製品	57,400	24,298.87	1,394,755,548	41,190.00	2,364,306,000	0.97
日本	株式	KDDI	情報・通信業	823,700	3,000.30	2,471,350,842	2,804.50	2,310,066,650	0.95

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	343,300	4,738.37	1,626,682,460	6,401.00	2,197,463,300	0.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	501,800	3,324.56	1,668,264,564	4,200.00	2,107,560,000	0.86
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	578,800	3,739.77	2,164,579,544	3,631.00	2,101,622,800	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	644,300	2,556.06	1,646,870,175	3,113.00	2,005,705,900	0.82
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,238,000	656.39	1,469,017,080	877.90	1,964,740,200	0.80
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	687,200	1,752.66	1,204,433,045	2,800.00	1,924,160,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	162,600	9,635.47	1,566,728,023	11,450.00	1,861,770,000	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	167,400	10,317.20	1,727,100,110	10,995.00	1,840,563,000	0.75
日本	株式	小松製作所	機械	450,200	2,767.83	1,246,081,089	4,078.00	1,835,915,600	0.75
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	677,200	2,717.96	1,840,606,777	2,661.00	1,802,029,200	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	384,800	4,499.40	1,731,371,144	4,683.00	1,802,018,400	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	346,400	4,738.35	1,641,366,978	5,141.00	1,780,842,400	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	112,200	10,862.36	1,218,757,602	15,810.00	1,773,882,000	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,064,900	1,202.78	1,280,843,210	1,649.50	1,756,552,550	0.72
日本	株式	花王	化学	229,200	5,380.48	1,233,206,238	7,619.00	1,746,274,800	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	932,100	1,673.87	1,560,214,292	1,871.50	1,744,425,150	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	329,400	4,099.95	1,350,524,790	5,238.00	1,725,397,200	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	127,200	11,280.78	1,434,915,216	13,335.00	1,696,212,000	0.69

(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	0.34
		建設業	3.27
		食料品	4.41
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.17
		医薬品	4.35
		石油・石炭製品	0.72
		ゴム製品	0.97
		ガラス・土石製品	1.04
		鉄鋼	1.19
		非鉄金属	1.00
		金属製品	0.71
		機械	5.59
		電気機器	13.55
輸送用機器	8.82		
精密機器	1.57		

その他製品	2.02
電気・ガス業	1.50
陸運業	3.89
海運業	0.24
空運業	0.63
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.21
卸売業	4.66
小売業	4.64
銀行業	7.44
証券、商品先物取引業	0.98
保険業	2.26
その他金融業	1.18
不動産業	2.23
サービス業	4.17
小計	98.97
合計	98.97

(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	140円		2,528,363,620	2,543,800,000	1.04

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

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

外国株式マザーファンド

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	126,786,533,447	57.90
	イギリス	14,499,198,655	6.62
	フランス	8,347,692,332	3.81

	ドイツ	8,337,944,021	3.81
	カナダ	8,208,579,272	3.75
	スイス	7,543,290,791	3.45
	オーストラリア	5,259,246,613	2.40
	オランダ	4,123,119,504	1.88
	アイルランド	2,972,091,192	1.36
	スペイン	2,754,248,353	1.26
	スウェーデン	2,232,567,733	1.02
	香港	1,959,153,122	0.89
	イタリア	1,667,030,213	0.76
	シンガポール	1,619,727,758	0.74
	デンマーク	1,561,213,927	0.71
	ジャージー	1,019,214,930	0.47
	バミューダ	980,732,820	0.45
	ベルギー	937,267,844	0.43
	フィンランド	806,492,553	0.37
	ケイマン	616,168,549	0.28
	ノルウェー	566,228,893	0.26
	キュラソー	537,023,695	0.25
	イスラエル	389,646,107	0.18
	ルクセンブルク	274,334,748	0.13
	オーストリア	230,675,450	0.11
	ニュージーランド	152,574,256	0.07
	ポルトガル	127,137,370	0.06
	パナマ	124,996,161	0.06
	リベリア	124,546,774	0.06
	英ヴァージン諸島	58,002,149	0.03
	パプアニューギニア	47,224,769	0.02
	マン島	35,385,003	0.02
	モーリシャス	15,215,500	0.01
	小計	204,914,504,504	93.59
投資信託受益証券	オーストラリア	116,893,577	0.05
	香港	37,199,073	0.02
	シンガポール	14,021,605	0.01
	小計	168,114,255	0.08
投資証券	アメリカ	3,900,121,746	1.78

	オーストラリア	466,962,445	0.21
	フランス	300,354,518	0.14
	イギリス	189,038,376	0.09
	香港	110,157,003	0.05
	シンガポール	92,145,131	0.04
	カナダ	47,144,157	0.02
	小計	5,105,923,376	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,770,374,167	4.01
	合計(純資産総額)	218,958,916,302	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,811,720,515	2.65
	買建	カナダ	396,060,644	0.18
	買建	ドイツ	1,356,989,204	0.62
	買建	イギリス	678,295,683	0.31
	買建	オーストラリア	373,153,074	0.17

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

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

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		998,454,300	0.46
	売建		109,229,000	0.05

(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	260,103	14,722.76	3,829,436,645	19,332.03	5,028,321,600	2.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	368,223	7,199.22	2,650,922,068	9,686.35	3,566,740,538	1.63
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	20,534	91,438.47	1,877,597,543	134,029.29	2,752,157,646	1.26
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	119,169	14,974.75	1,784,527,174	20,104.95	2,395,887,978	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	176,834	9,805.00	1,733,859,138	12,180.26	2,153,885,865	0.98
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	134,953	12,814.20	1,729,314,733	15,883.28	2,143,496,286	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	212,904	9,390.29	1,999,232,431	9,494.25	2,021,365,931	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,723	90,551.42	1,423,739,977	118,439.82	1,862,229,290	0.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,972	92,986.56	1,392,194,926	119,322.34	1,786,494,224	0.82
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	503,259	2,612.55	1,314,794,333	3,367.40	1,694,674,357	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	236,745	6,390.14	1,512,836,061	6,926.89	1,639,908,940	0.75
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	156,261	8,397.40	1,312,187,028	9,687.09	1,513,714,996	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	63,712	18,484.53	1,177,687,012	22,550.27	1,436,723,439	0.66
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	308,017	4,635.26	1,427,738,880	4,427.34	1,363,695,985	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	95,085	12,761.09	1,213,388,243	14,190.54	1,349,307,496	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	127,969	9,880.72	1,264,425,858	10,403.91	1,331,377,959	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	59,134	15,423.37	912,045,562	21,445.14	1,268,136,909	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	204,596	5,426.26	1,110,191,091	6,037.59	1,235,266,764	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	235,730	4,098.50	966,141,762	5,222.86	1,231,184,788	0.56
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	298,373	3,643.12	1,087,008,644	4,109.80	1,226,256,339	0.56
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	48,510	18,176.04	881,720,185	25,173.00	1,221,142,715	0.56
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	91,766	9,698.78	890,019,163	12,921.54	1,185,758,957	0.54
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,012,263	1,043.89	1,056,697,803	1,158.46	1,172,673,078	0.54

アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	136,629	6,513.31	889,908,398	8,484.03	1,159,165,901	0.53
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	250,704	3,536.90	886,714,978	4,360.67	1,093,237,412	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	235,730	4,214.90	993,578,377	4,552.76	1,073,224,472	0.49
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	111,545	8,468.99	944,673,601	9,548.54	1,065,092,117	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	203,166	4,696.28	954,124,423	5,166.36	1,049,628,696	0.48
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	35,217	27,269.34	960,344,445	28,564.80	1,005,966,702	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	71,438	11,828.84	845,028,672	13,486.55	963,452,159	0.44

(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	6.55
		素材	4.90
		資本財	7.22
		商業・専門サービス	0.98
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	1.50
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.82
		メディア	2.21
		小売	3.81
		食品・生活必需品小売り	1.66
		食品・飲料・タバコ	5.13
		家庭用品・パーソナル用品	1.97
		ヘルスケア機器・サービス	3.99
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.76
		銀行	9.39
		各種金融	4.46
		保険	3.95
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	9.87
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	2.47		
公益事業	2.93		

		半導体・半導体製造装置	2.78
		小計	93.59
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.33
合計			95.99

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	383	アメリカドル	51,090,263.5	5,773,199,775	51,431,155	5,811,720,515	2.65
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	23	カナダドル	4,399,313.5	395,718,249	4,403,120	396,060,644	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	32	スイスフラン	2,975,264	343,523,981	2,979,200	343,978,432	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	214	ユーロ	7,638,623	1,030,755,787	7,507,120	1,013,010,772	0.46
	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	4,180,996	368,638,417	4,232,200	373,153,074	0.17
	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	59	イギリスポンド	4,392,476.25	667,436,766	4,463,940	678,295,683	0.31

(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	6,605,000.00	747,176,094	745,440,300	0.34
	ユーロ	買建	1,200,000.00	159,958,200	161,892,000	0.07
	イギリスポンド	買建	600,000.00	90,586,560	91,122,000	0.04
	アメリカドル	売建	650,000.00	73,407,100	73,411,000	0.03
	カナダドル	売建	100,000.00	8,996,000	8,992,000	0.00
	ユーロ	売建	120,000.00	16,182,960	16,191,600	0.01
	イギリスポンド	売建	70,000.00	10,633,700	10,634,400	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。

外国債券マザーファンド

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	63,092,897,738	41.97
	フランス	15,076,970,830	10.03
	イタリア	14,382,991,682	9.57
	ドイツ	10,675,425,417	7.10
	イギリス	10,496,127,176	6.98
	スペイン	8,567,449,961	5.70
	ベルギー	3,791,022,742	2.52
	オランダ	3,282,522,184	2.18
	オーストラリア	3,229,702,751	2.15
	カナダ	3,216,346,831	2.14
	オーストリア	2,343,192,686	1.56
	アイルランド	1,180,244,627	0.79
	メキシコ	1,083,544,357	0.72
	ポーランド	957,521,053	0.64
	フィンランド	913,057,100	0.61
	南アフリカ	864,223,611	0.57
	デンマーク	861,935,253	0.57
	スウェーデン	698,679,613	0.46
	マレーシア	662,586,046	0.44
	シンガポール	568,450,659	0.38
ノルウェー	430,184,417	0.29	
スイス	259,349,230	0.17	
	小計	146,634,425,964	97.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,696,218,728	2.46
合計(純資産総額)		150,330,644,692	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	680,012,805	0.45

	買建	ドイツ	910,221,577	0.61
--	----	-----	-------------	------

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		2,182,942,171	1.45
	売建		1,604,847,163	1.07

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

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

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 3.625% 02/15/20	9,800,000	12,029.12	1,178,854,409	11,703.91	1,146,984,090	3.625	2020/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	8,250,000	11,254.01	928,456,385	11,155.99	920,369,406	1.375	2020/4/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,500,000	11,447.87	858,590,792	12,114.21	908,565,773	3.125	2044/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	8,100,000	10,979.72	889,357,927	10,944.18	886,478,869	1.625	2023/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	10,422.27	865,048,748	10,493.13	870,930,413	1.500	2026/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	7,250,000	11,707.93	848,824,925	11,581.93	839,690,222	2.750	2024/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	7,050,000	10,879.64	767,014,620	11,561.67	815,097,777	2.875	2045/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	7,500,000	10,046.83	753,512,250	10,726.52	804,489,070	2.500	2046/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/15/19	7,100,000	11,166.82	792,844,445	11,108.40	788,696,674	0.875	2019/9/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/21	6,900,000	11,534.77	795,899,303	11,369.48	784,494,757	2.250	2021/3/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	6,700,000	10,938.80	732,900,230	11,590.22	776,545,349	2.875	2043/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	5,850,000	12,524.20	732,665,869	13,178.21	770,925,413	3.625	2044/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	10,788.75	766,001,858	10,748.15	763,118,741	1.375	2023/9/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	11,395.80	763,518,882	11,319.73	758,421,979	2.375	2024/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	7,450,000	9,688.40	721,786,483	10,163.02	757,145,165	2.250	2046/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	6,750,000	10,982.47	741,316,725	10,995.33	742,184,971	2.000	2025/8/15	0.49
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	4,330,000	16,482.66	713,699,361	16,969.85	734,794,592	3.500	2026/4/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	11,934.87	745,929,878	11,691.02	730,689,208	3.125	2021/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	11,181.13	726,773,977	11,184.60	726,999,168	2.250	2025/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	11,253.46	731,475,549	11,174.79	726,361,769	2.000	2023/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	5,900,000	11,918.91	703,216,199	11,611.16	685,059,011	3.375	2019/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 07/31/22	6,000,000	11,313.86	678,832,021	11,206.44	672,386,960	2.000	2022/7/31	0.45
ドイツ	国債証券	DBR 3.5% 07/04/19	4,650,000	14,884.32	692,121,159	14,358.62	667,676,204	3.500	2019/7/4	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	11,037.84	667,789,320	11,026.87	667,125,830	2.000	2025/2/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	11,195.76	671,745,674	11,111.50	666,690,472	1.375	2020/10/31	0.44
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	4,350,000	15,583.69	677,890,825	15,323.31	666,564,164	3.250	2021/10/25	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	5,900,000	11,372.28	670,964,699	11,253.64	663,964,763	1.500	2019/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 05/31/22	5,850,000	11,261.58	658,802,431	11,160.34	652,879,905	1.875	2022/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.625% 08/15/19	5,500,000	11,946.73	657,070,620	11,614.84	638,816,201	3.625	2019/8/15	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 09/01/19	4,350,000	14,844.81	645,749,534	14,496.73	630,608,153	4.250	2019/9/1	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.54
合計	97.54

(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	24	アメリカ ドル	2,788,033.44	315,047,778	2,785,687.44	314,782,680	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカ ドル	1,858,810	210,045,530	1,857,656.25	209,915,156	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカ ドル	1,371,786	155,011,818	1,374,468.75	155,314,969	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	12	ユーロ	1,344,128	181,376,632	1,343,460	181,286,492	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	14	ユーロ	1,846,416	249,155,376	1,842,540	248,632,348	0.17
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	3,567,508	481,399,529	3,559,380	480,302,737	0.32

(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	8,810,000.00	995,083,242	994,296,600	0.66
	カナダドル	買建	1,130,707.90	100,724,605	101,616,754	0.07
	ユーロ	買建	6,830,000.00	918,317,945	921,435,300	0.61
	イギリスポンド	買建	1,090,347.14	165,274,480	165,591,037	0.11
	デンマーククローネ	買建	136.90	2,477	2,480	0.00
	アメリカドル	売建	2,943,000.00	332,364,762	332,382,420	0.22
	カナダドル	売建	479,000.00	43,090,840	43,071,680	0.03
	メキシコペソ	売建	19,228,600.87	110,135,436	109,987,596	0.07
	ユーロ	売建	6,899,000.00	930,385,342	930,882,070	0.62
	イギリスポンド	売建	404,000.00	61,371,640	61,375,680	0.04
	スウェーデンクローナ	売建	664,113.61	9,102,270	9,098,356	0.01
	ノルウェークローネ	売建	105,000.00	1,437,796	1,437,450	0.00
	デンマーククローネ	売建	3,086,000.00	55,896,409	55,918,320	0.04
	ポーランドズロチ	売建	100,000.00	3,227,520	3,227,000	0.00
	オーストラリアドル	売建	67,321.13	5,933,347	5,932,337	0.00
	シンガポールドル	売建	117,538.60	9,924,336	9,926,134	0.01
	南アフリカランド	売建	4,577,350.94	41,600,193	41,608,120	0.03

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2008年3月3日

作成基準日：2017年12月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額	16,586円
純資産総額	35.64億円

※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(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:60円

決算期	2013年6月	2014年6月	2015年6月	2016年6月	2017年6月
分配金	20円	20円	20円	0円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	33.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
外国株式マザーファンド	33.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ハードウェア	-	-	0.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.4%
		FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
外国債券マザーファンド	32.3%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.2%
		T 1.375% 04/30/20	アメリカ	国債	-	1.375%	2020/04/30	0.2%
		T 3.125% 08/15/44	アメリカ	国債	-	3.125%	2044/08/15	0.2%
		T 1.625% 04/30/23	アメリカ	国債	-	1.625%	2023/04/30	0.2%

※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)を再投資したもとして計算しております。

※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。

※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口単位とします。）。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 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

<一部解約代金の支払い>

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

<受付不可日>

ありません。

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

一部解約の実行の請求の受け付け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>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式、国内上場投信の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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。）の評価方法

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。

公社債等の評価方法

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。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における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20年 3月 3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】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成20年3月3日から平成20年6月10日までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管

理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(平成28年 6月11日から平成29年 6月12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】

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成28年 6月10日現在)	第10期 (平成29年 6月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,787,151	993,329
コール・ローン	17,028,768	9,303,477
親投資信託受益証券	2,862,301,682	3,264,776,909
未収入金	5,475,746	11,020,763
流動資産合計	2,887,593,347	3,286,094,478
資産合計		
	2,887,593,347	3,286,094,478
負債の部		
流動負債		
未払解約金	760,778	495,440
未払受託者報酬	778,550	872,230
未払委託者報酬	8,563,995	9,594,421
未払利息	42	22
その他未払費用	78,654	87,177
流動負債合計	10,182,019	11,049,290
負債合計		
	10,182,019	11,049,290
純資産の部		
元本等		
元本	2,191,360,846	2,197,223,013
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	686,050,482	1,077,822,175
(分配準備積立金)	1,123,970,724	1,068,376,873
元本等合計	2,877,411,328	3,275,045,188
純資産合計		
	2,877,411,328	3,275,045,188
負債純資産合計		
	2,887,593,347	3,286,094,478

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	平成27年 6月11日 至 平成28年 6月10日	自	平成28年 6月11日 至 平成29年 6月12日
営業収益				
受取利息		7,033		16
有価証券売買等損益		421,648,230		417,916,725
営業収益合計		421,641,197		417,916,741
営業費用				
支払利息		2,117		8,107
受託者報酬		1,614,733		1,650,939
委託者報酬		17,761,946		18,160,118
その他費用		162,200		165,313
営業費用合計		19,540,996		19,984,477
営業利益又は営業損失（ ）		441,182,193		397,932,264
経常利益又は経常損失（ ）		441,182,193		397,932,264
当期純利益又は当期純損失（ ）		441,182,193		397,932,264
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（ ）		19,536,195		25,737,748
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,093,255,244		686,050,482
剰余金増加額又は欠損金減少額		133,573,719		98,816,600
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		133,573,719		98,816,600
剰余金減少額又は欠損金増加額		119,132,483		79,239,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		119,132,483		79,239,423
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		686,050,482		1,077,822,175

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第10期計算期間は平成28年 6月11日から平成29年 6月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (平成28年 6月10日現在)	第10期 (平成29年 6月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,191,360,846口	2,197,223,013口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3131円 (13,131円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4905円 (14,905円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 平成27年 6月11日 至 平成28年 6月10日			第10期 自 平成28年 6月11日 至 平成29年 6月12日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	48,779,637円	費用控除後の配当等収益額	A	65,724,166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	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	533,782,282円	収益調整金額	C	660,430,911円
分配準備積立金額	D	1,075,191,087円	分配準備積立金額	D	1,002,652,707円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,657,753,006円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,728,807,784円
当ファンドの期末残存口数	F	2,191,360,846口	当ファンドの期末残存口数	F	2,197,223,013口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,564円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,868円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 平成28年 6月11日 至 平成29年 6月12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10期 (平成29年 6月12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9期	第10期
	自 平成27年 6月11日 至 平成28年 6月10日	自 平成28年 6月11日 至 平成29年 6月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,091,046,497円	2,191,360,846円
期中追加設定元本額	331,285,768円	259,687,608円
期中一部解約元本額	230,971,419円	253,825,441円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (平成28年 6月10日現在)	第10期 (平成29年 6月12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	398,894,265	391,922,392
合計	398,894,265	391,922,392

（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	日本株式マザーファンド	675,015,268	1,094,402,254	
	外国株式マザーファンド	468,843,487	1,104,032,643	
	外国債券マザーファンド	467,079,287	1,066,342,012	
合計		1,610,938,042	3,264,776,909	

(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。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	平成29年 6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	203,752,023
コール・ローン	1,908,333,261
株式	222,542,633,840
未収入金	33,419,218
未収配当金	1,554,337,042
前払金	20,371,600
差入委託証拠金	124,392,000
流動資産合計	226,387,238,984
資産合計	226,387,238,984
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,372,140
未払金	1,548,960
未払解約金	190,434,592
未払利息	4,690
その他未払費用	3,792
流動負債合計	212,364,174
負債合計	212,364,174

	平成29年 6月12日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	139,501,925,120
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,672,949,690
元本等合計	226,174,874,810
純資産合計	226,174,874,810
負債純資産合計	226,387,238,984

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 6月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,501,925,120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 1.6213円 (1万口当たり純資産額) (16,213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29年 6月12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29年 6月12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29年 6月12日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 6月11日
期首元本額	156,957,655,657円
期中追加設定元本額	9,706,731,478円
期中一部解約元本額	27,162,462,015円
期末元本額	139,501,925,120円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	892,939,315円
D C 日本株式インデックスファンド	342,099,980円
D C 日本株式インデックスファンド L	51,091,073,681円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,236,992,396円
D C バランスファンド 3 0	1,886,059,720円
D C バランスファンド 5 0	2,868,498,349円
D C バランスファンド 7 0	1,429,948,368円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	675,015,268円
日本株式インデックス e	1,975,103,721円
インデックスコレクション（国内株式）	9,800,137,028円

区分	平成29年 6月12日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,614,992,680円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,237,767,329円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,004,220,358円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,443,532,671円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,424,819,757円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,157,841,778円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	332,864,254円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	3,259,599,300円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	207,533,515円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	962,251,534円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	60,358,564円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,141,499,170円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,909,898,040円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	883,717,302円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	14,795,141,555円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,205,589,740円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	2,465,834,282円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,239,204,963円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	66,178,442円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	699,836,089円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	123,022,646円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,541,801,550円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	105,807,848円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	105,620,412円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	51,401,146円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,478,114,700円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,322,802,207円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	36,326,074円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	603,669,101円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	9,299,635,032円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	182,234,404円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	81,395,819円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	15,544,816円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	237,470,002円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,335,735円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	194,479円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	10,703,816,068
合計	10,703,816,068

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」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29年 6月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,244,012,140	-	3,223,640,000	20,372,140
	合計	3,244,012,140	-	3,223,640,000	20,372,140

(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	4,200	3,110.00	13,062,000	
日本水産	139,600	675.00	94,230,000	
マルハニチロ	20,400	3,100.00	63,240,000	
カネコ種苗	3,700	1,478.00	5,468,600	
サカタのタネ	15,900	3,380.00	53,742,000	
ホクト	10,900	2,018.00	21,996,200	
ホクリヨウ	1,500	952.00	1,428,000	
住石ホールディングス	30,000	98.00	2,940,000	
日鉄鉱業	3,000	5,990.00	17,970,000	
三井松島産業	6,600	1,344.00	8,870,400	
国際石油開発帝石	566,400	1,029.00	582,825,600	
日本海洋掘削	3,800	2,220.00	8,436,000	
石油資源開発	17,000	2,223.00	37,791,000	
K&Oエナジーグループ	7,200	1,796.00	12,931,200	
ショーボンドホールディングス	10,400	5,810.00	60,424,000	
ミライト・ホールディングス	33,100	1,170.00	38,727,000	

タマホーム	8,100	639.00	5,175,900	
サンヨーホームズ	2,300	648.00	1,490,400	
ファーストコーポレーション	2,400	1,056.00	2,534,400	
インベスターズクラウド	1,400	4,590.00	6,426,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	1,283.00	3,849,000	
安藤・間	77,300	715.00	55,269,500	
東急建設	38,200	941.00	35,946,200	
コムシスホールディングス	42,000	2,413.00	101,346,000	
ミサワホーム	13,100	1,015.00	13,296,500	
ピーアールホールディングス	10,700	385.00	4,119,500	
高松コンストラクショングループ	8,100	2,828.00	22,906,800	
東建コーポレーション	4,000	10,190.00	40,760,000	
ソネック	1,300	763.00	991,900	
ヤマウラ	5,100	901.00	4,595,100	
大成建設	547,000	971.00	531,137,000	
大林組	322,500	1,240.00	399,900,000	
清水建設	329,000	1,110.00	365,190,000	
飛鳥建設	106,000	168.00	17,808,000	
長谷工コーポレーション	125,500	1,480.00	185,740,000	
松井建設	11,900	875.00	10,412,500	
銭高組	15,000	438.00	6,570,000	
鹿島建設	473,000	871.00	411,983,000	
不動テトラ	86,900	181.00	15,728,900	
大末建設	3,800	1,022.00	3,883,600	
鉄建建設	66,000	349.00	23,034,000	
西松建設	124,000	596.00	73,904,000	
三井住友建設	412,000	122.00	50,264,000	
大豊建設	39,000	545.00	21,255,000	
前田建設工業	71,000	1,224.00	86,904,000	
佐田建設	7,700	436.00	3,357,200	
ナカノフドー建設	8,400	638.00	5,359,200	
奥村組	88,000	734.00	64,592,000	
東鉄工業	12,900	3,465.00	44,698,500	
イチケン	10,000	394.00	3,940,000	
浅沼組	38,000	325.00	12,350,000	
戸田建設	125,000	705.00	88,125,000	
熊谷組	169,000	341.00	57,629,000	
青木あすなろ建設	7,100	880.00	6,248,000	
北野建設	23,000	321.00	7,383,000	
植木組	15,000	259.00	3,885,000	
三井ホーム	14,000	722.00	10,108,000	
矢作建設工業	14,600	915.00	13,359,000	

ピーエス三菱	12,000	501.00	6,012,000	
日本ハウスホールディングス	22,000	529.00	11,638,000	
大東建託	38,900	17,410.00	677,249,000	
新日本建設	12,900	979.00	12,629,100	
N I P P O	25,000	2,264.00	56,600,000	
東亜道路工業	20,000	491.00	9,820,000	
前田道路	34,000	2,248.00	76,432,000	
日本道路	32,000	577.00	18,464,000	
東亜建設工業	8,700	1,930.00	16,791,000	
若築建設	62,000	164.00	10,168,000	
東洋建設	30,900	420.00	12,978,000	
五洋建設	119,300	627.00	74,801,100	
大林道路	11,300	939.00	10,610,700	
世紀東急工業	15,700	578.00	9,074,600	
福田組	17,000	1,048.00	17,816,000	
住友林業	74,000	1,780.00	131,720,000	
日本基礎技術	12,000	373.00	4,476,000	
日成ビルド工業	32,000	653.00	20,896,000	
巴コーポレーション	13,600	353.00	4,800,800	
パナホーム	41,000	1,198.00	49,118,000	
大和ハウス工業	317,600	3,605.00	1,144,948,000	
ライト工業	20,700	1,248.00	25,833,600	
積水ハウス	329,300	1,945.00	640,488,500	
日特建設	9,200	573.00	5,271,600	
北陸電気工事	5,200	917.00	4,768,400	
ユアテック	17,000	749.00	12,733,000	
西部電気工業	1,800	2,296.00	4,132,800	
四電工	8,000	493.00	3,944,000	
中電工	12,100	2,831.00	34,255,100	
関電工	43,000	1,164.00	50,052,000	
きんでん	71,500	1,739.00	124,338,500	
東京エネシス	11,100	983.00	10,911,300	
トーエネック	15,000	663.00	9,945,000	
住友電設	7,400	1,609.00	11,906,600	
日本電設工業	17,500	2,271.00	39,742,500	
協和エクシオ	42,100	1,891.00	79,611,100	
新日本空調	8,300	1,496.00	12,416,800	
N D S	1,700	2,958.00	5,028,600	
九電工	20,900	3,960.00	82,764,000	
三機工業	23,800	1,187.00	28,250,600	
日揮	100,300	1,788.00	179,336,400	
中外炉工業	33,000	216.00	7,128,000	

ヤマト	9,800	582.00	5,703,600
太平電業	15,000	1,311.00	19,665,000
高砂熱学工業	29,600	1,780.00	52,688,000
三晃金属工業	1,000	3,245.00	3,245,000
朝日工業社	2,500	3,050.00	7,625,000
明星工業	19,600	637.00	12,485,200
大気社	14,300	3,015.00	43,114,500
ダイダン	14,000	1,249.00	17,486,000
日比谷総合設備	12,000	1,798.00	21,576,000
東芝プラントシステム	17,500	1,703.00	29,802,500
OSJBホールディングス	33,000	287.00	9,471,000
東洋エンジニアリング	65,000	260.00	16,900,000
千代田化工建設	78,000	640.00	49,920,000
新興プランテック	22,100	834.00	18,431,400
日本製粉	32,000	1,803.00	57,696,000
日清製粉グループ本社	117,900	1,876.00	221,180,400
日東富士製粉	700	3,900.00	2,730,000
昭和産業	44,000	609.00	26,796,000
鳥越製粉	8,500	807.00	6,859,500
中部飼料	11,800	1,427.00	16,838,600
フィード・ワン	64,700	233.00	15,075,100
東洋精糖	16,000	117.00	1,872,000
日本甜菜製糖	5,500	2,218.00	12,199,000
三井製糖	7,600	3,280.00	24,928,000
塩水港精糖	11,500	249.00	2,863,500
日新製糖	4,600	1,847.00	8,496,200
森永製菓	21,000	7,220.00	151,620,000
中村屋	2,500	5,090.00	12,725,000
江崎グリコ	26,900	6,410.00	172,429,000
名糖産業	4,600	1,445.00	6,647,000
不二家	61,000	257.00	15,677,000
山崎製パン	78,800	2,355.00	185,574,000
第一屋製パン	17,000	124.00	2,108,000
モロゾフ	16,000	638.00	10,208,000
亀田製菓	6,000	5,620.00	33,720,000
寿スピリッツ	10,200	3,840.00	39,168,000
カルビー	43,900	4,550.00	199,745,000
森永乳業	96,000	910.00	87,360,000
六甲バター	4,800	2,703.00	12,974,400
ヤクルト本社	57,700	7,860.00	453,522,000
明治ホールディングス	63,700	9,210.00	586,677,000
雪印メグミルク	23,200	3,395.00	78,764,000

プリマハム	68,000	637.00	43,316,000
日本ハム	75,000	3,605.00	270,375,000
林兼産業	3,500	838.00	2,933,000
丸大食品	51,000	517.00	26,367,000
S Foods	5,800	3,880.00	22,504,000
伊藤ハム米久ホールディングス	62,000	1,014.00	62,868,000
サッポロホールディングス	35,200	3,235.00	113,872,000
アサヒグループホールディングス	201,700	4,426.00	892,724,200
キリンホールディングス	462,900	2,450.50	1,134,336,450
宝ホールディングス	77,800	1,194.00	92,893,200
オエノンホールディングス	27,000	274.00	7,398,000
養命酒製造	3,300	2,093.00	6,906,900
コカ・コーラボトラーズジャパン	67,800	3,360.00	227,808,000
サントリー食品インターナショナル	73,700	5,450.00	401,665,000
ダイドーグループホールディングス	4,900	5,630.00	27,587,000
伊藤園	31,900	4,275.00	136,372,500
キーコーヒー	9,500	2,204.00	20,938,000
ユニカフェ	2,900	985.00	2,856,500
ジャパンフーズ	1,400	1,351.00	1,891,400
日清オイリオグループ	62,000	651.00	40,362,000
不二製油グループ本社	28,700	2,693.00	77,289,100
かどや製油	1,100	5,270.00	5,797,000
J - オイルミルズ	5,000	4,035.00	20,175,000
キッコーマン	75,200	3,605.00	271,096,000
味の素	221,500	2,481.50	549,652,250
キューピー	54,700	2,891.00	158,137,700
ハウス食品グループ本社	39,800	2,922.00	116,295,600
カゴメ	38,600	3,635.00	140,311,000
焼津水産化学工業	5,100	1,236.00	6,303,600
アリアケジャパン	8,800	8,140.00	71,632,000
ピエトロ	1,300	1,633.00	2,122,900
エバラ食品工業	2,600	2,091.00	5,436,600
ニチレイ	52,900	3,295.00	174,305,500
東洋水産	52,900	4,310.00	227,999,000
イトアンド	1,200	2,297.00	2,756,400
大冷	1,100	1,828.00	2,010,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	2,795.00	559,000
日清食品ホールディングス	42,000	7,220.00	303,240,000
永谷園ホールディングス	10,000	1,415.00	14,150,000
一正蒲鉾	3,700	1,350.00	4,995,000
フジッコ	10,400	2,592.00	26,956,800
ロック・フィールド	10,400	1,971.00	20,498,400

日本たばこ産業	595,900	4,127.00	2,459,279,300
ケンコーマヨネーズ	5,800	3,130.00	18,154,000
わらべや日洋ホールディングス	6,300	3,070.00	19,341,000
なとり	5,400	2,047.00	11,053,800
イフジ産業	1,700	773.00	1,314,100
北の達人コーポレーション	4,600	843.00	3,877,800
ユーグレナ	37,100	1,187.00	44,037,700
ミヨシ油脂	37,000	144.00	5,328,000
理研ビタミン	3,200	4,415.00	14,128,000
片倉工業	12,600	1,356.00	17,085,600
グンゼ	75,000	383.00	28,725,000
東洋紡	398,000	205.00	81,590,000
ユニチカ	276,000	80.00	22,080,000
富士紡ホールディングス	4,900	3,265.00	15,998,500
倉敷紡績	102,000	260.00	26,520,000
シキボウ	54,000	142.00	7,668,000
日本毛織	28,400	892.00	25,332,800
トーア紡コーポレーション	4,300	547.00	2,352,100
ダイドーリミテッド	11,400	436.00	4,970,400
帝国繊維	10,600	1,883.00	19,959,800
帝人	82,200	2,072.00	170,318,400
東レ	729,200	911.30	664,519,960
サカイオーベックス	2,400	1,708.00	4,099,200
住江織物	27,000	249.00	6,723,000
日本フェルト	5,900	514.00	3,032,600
イチカワ	7,000	307.00	2,149,000
日東製網	1,100	1,856.00	2,041,600
アツギ	85,000	124.00	10,540,000
ダイニック	19,000	186.00	3,534,000
セーレン	25,100	1,736.00	43,573,600
ソトー	3,800	1,149.00	4,366,200
東海染工	18,000	134.00	2,412,000
小松精練	14,200	733.00	10,408,600
ワコールホールディングス	60,000	1,432.00	85,920,000
ホギメディカル	6,300	7,770.00	48,951,000
レナウン	27,300	135.00	3,685,500
クラウドディア	3,300	606.00	1,999,800
T S Iホールディングス	41,400	779.00	32,250,600
三陽商会	58,000	164.00	9,512,000
オンワードホールディングス	65,000	802.00	52,130,000
ルック	25,000	235.00	5,875,000
ゴールドウイン	4,300	7,150.00	30,745,000

デサント	22,900	1,400.00	32,060,000	
キング	5,000	399.00	1,995,000	
ヤマトインターナショナル	6,700	426.00	2,854,200	
特種東海製紙	5,800	4,095.00	23,751,000	
王子ホールディングス	393,000	569.00	223,617,000	
日本製紙	45,000	2,177.00	97,965,000	
三菱製紙	14,300	762.00	10,896,600	
北越紀州製紙	56,100	890.00	49,929,000	
中越パルプ工業	40,000	241.00	9,640,000	
巴川製紙所	15,000	247.00	3,705,000	
大王製紙	40,000	1,488.00	59,520,000	
阿波製紙	2,400	607.00	1,456,800	
レンゴー	96,900	645.00	62,500,500	
トモク	32,000	372.00	11,904,000	
ザ・パック	7,100	3,505.00	24,885,500	
クラレ	169,200	2,036.00	344,491,200	
旭化成	627,000	1,152.00	722,304,000	
共和レザー	5,900	922.00	5,439,800	
昭和電工	66,900	2,446.00	163,637,400	
住友化学	740,000	599.00	443,260,000	
住友精化	4,200	5,360.00	22,512,000	
日産化学工業	55,100	3,750.00	206,625,000	
ラサ工業	38,000	140.00	5,320,000	
クレハ	7,600	5,590.00	42,484,000	
多木化学	7,000	910.00	6,370,000	
テイカ	15,000	1,013.00	15,195,000	
石原産業	18,000	1,091.00	19,638,000	
片倉コープアグリ	14,000	269.00	3,766,000	
日東エフシー	5,900	898.00	5,298,200	
日本曹達	60,000	604.00	36,240,000	
東ソー	291,000	1,081.00	314,571,000	
トクヤマ	156,000	522.00	81,432,000	
セントラル硝子	102,000	471.00	48,042,000	
東亜合成	62,900	1,325.00	83,342,500	
大阪ソーダ	43,000	521.00	22,403,000	
関東電化工業	20,600	897.00	18,478,200	
デンカ	208,000	574.00	119,392,000	
信越化学工業	180,200	9,995.00	1,801,099,000	
日本カーバイド工業	34,000	161.00	5,474,000	
堺化学工業	38,000	417.00	15,846,000	
エア・ウォーター	82,900	1,979.00	164,059,100	
大陽日酸	77,400	1,172.00	90,712,800	

日本化学工業	37,000	215.00	7,955,000
日本パーカラライジング	51,400	1,659.00	85,272,600
高压ガス工業	14,900	800.00	11,920,000
チタン工業	12,000	190.00	2,280,000
四国化成工業	14,000	1,336.00	18,704,000
戸田工業	20,000	274.00	5,480,000
ステラ ケミファ	4,900	2,908.00	14,249,200
保土谷化学工業	3,500	4,055.00	14,192,500
日本触媒	15,800	7,370.00	116,446,000
大日精化工業	42,000	856.00	35,952,000
カネカ	136,000	841.00	114,376,000
三菱瓦斯化学	93,600	2,283.00	213,688,800
三井化学	457,000	576.00	263,232,000
J S R	101,000	1,882.00	190,082,000
東京応化工業	18,800	3,815.00	71,722,000
大阪有機化学工業	6,500	1,358.00	8,827,000
三菱ケミカルホールディングス	677,200	874.00	591,872,800
K Hネオケム	16,400	2,130.00	34,932,000
ダイセル	135,500	1,260.00	170,730,000
住友ベークライト	89,000	755.00	67,195,000
積水化学工業	228,200	1,984.00	452,748,800
日本ゼオン	85,000	1,139.00	96,815,000
アイカ工業	32,200	3,340.00	107,548,000
宇部興産	506,000	281.00	142,186,000
積水樹脂	15,500	2,101.00	32,565,500
タキロンシーアイ	21,000	578.00	12,138,000
旭有機材	32,000	244.00	7,808,000
日立化成	55,900	3,150.00	176,085,000
ニチバン	10,000	950.00	9,500,000
リケンテクノス	21,800	592.00	12,905,600
大倉工業	24,000	604.00	14,496,000
積水化成品工業	14,000	830.00	11,620,000
群栄化学工業	2,400	3,635.00	8,724,000
タイガースポリマー	5,000	760.00	3,800,000
ミライアル	3,700	1,094.00	4,047,800
ダイキアクシス	1,700	2,318.00	3,940,600
ダイキョーニシカワ	17,600	1,521.00	26,769,600
日本化薬	65,000	1,603.00	104,195,000
カーリットホールディングス	9,400	585.00	5,499,000
日本精化	8,300	981.00	8,142,300
扶桑化学工業	7,200	3,830.00	27,576,000
A D E K A	43,200	1,707.00	73,742,400

日油	78,000	1,447.00	112,866,000
ハリマ化成グループ	8,600	795.00	6,837,000
花王	250,700	6,856.00	1,718,799,200
第一工業製薬	22,000	499.00	10,978,000
日華化学	3,200	1,181.00	3,779,200
ニイタカ	1,500	1,718.00	2,577,000
三洋化成工業	6,300	5,310.00	33,453,000
有機合成薬品工業	6,700	278.00	1,862,600
大日本塗料	58,000	287.00	16,646,000
日本ペイントホールディングス	77,600	4,240.00	329,024,000
関西ペイント	105,600	2,415.00	255,024,000
神東塗料	8,000	204.00	1,632,000
中国塗料	28,800	830.00	23,904,000
日本特殊塗料	7,000	1,627.00	11,389,000
藤倉化成	13,700	647.00	8,863,900
太陽ホールディングス	8,200	5,010.00	41,082,000
D I C	39,700	3,820.00	151,654,000
サカタインクス	20,500	1,765.00	36,182,500
東洋インキＳＣホールディングス	99,000	573.00	56,727,000
T & K T O K A	7,300	1,170.00	8,541,000
富士フィルムホールディングス	199,300	4,028.00	802,780,400
資生堂	190,700	3,759.00	716,841,300
ライオン	124,800	2,410.00	300,768,000
高砂香料工業	6,600	4,230.00	27,918,000
マンダム	10,100	5,940.00	59,994,000
ミルボン	5,400	6,160.00	33,264,000
ファンケル	21,400	2,120.00	45,368,000
コーセー	16,300	12,750.00	207,825,000
コタ	4,200	1,216.00	5,107,200
シーズ・ホールディングス	13,100	3,650.00	47,815,000
シーボン	1,200	2,479.00	2,974,800
ポーラ・オルビスホールディングス	41,000	3,020.00	123,820,000
ノエビアホールディングス	6,300	5,430.00	34,209,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	940.00	1,786,000
エステー	6,900	2,321.00	16,014,900
アグロ カネショウ	3,900	1,606.00	6,263,400
コニシ	15,800	1,557.00	24,600,600
長谷川香料	12,700	2,246.00	28,524,200
星光P M C	5,500	1,285.00	7,067,500
小林製薬	26,900	6,810.00	183,189,000
荒川化学工業	8,600	2,005.00	17,243,000
メック	7,800	1,331.00	10,381,800

日本高純度化学	2,800	2,297.00	6,431,600
タカラバイオ	28,700	1,496.00	42,935,200
JCU	6,300	3,930.00	24,759,000
新田ゼラチン	6,100	724.00	4,416,400
OATアグリオ	1,200	1,541.00	1,849,200
デクセリアルズ	26,400	991.00	26,162,400
アース製薬	7,200	5,800.00	41,760,000
北興化学工業	9,800	473.00	4,635,400
大成ラミック	3,100	2,932.00	9,089,200
クミアイ化学工業	42,600	661.00	28,158,600
日本農薬	25,000	646.00	16,150,000
アキレス	8,200	1,902.00	15,596,400
有沢製作所	17,000	856.00	14,552,000
日東電工	72,500	8,989.00	651,702,500
レック	6,300	2,837.00	17,873,100
きもと	18,200	248.00	4,513,600
藤森工業	7,500	3,430.00	25,725,000
前澤化成工業	6,600	1,234.00	8,144,400
JSP	4,700	2,836.00	13,329,200
エフピコ	8,900	6,080.00	54,112,000
天馬	6,600	2,055.00	13,563,000
信越ポリマー	19,700	806.00	15,878,200
東リ	24,100	370.00	8,917,000
ニフコ	17,600	5,890.00	103,664,000
日本バルカー工業	7,800	2,176.00	16,972,800
ユニ・チャーム	203,500	2,940.00	598,290,000
協和発酵キリン	120,200	1,976.00	237,515,200
武田薬品工業	376,900	5,601.00	2,111,016,900
アステラス製薬	1,026,700	1,355.50	1,391,691,850
大日本住友製薬	71,100	1,678.00	119,305,800
塩野義製薬	127,500	5,890.00	750,975,000
田辺三菱製薬	117,100	2,461.00	288,183,100
わかもと製薬	11,000	274.00	3,014,000
あすか製薬	10,900	1,660.00	18,094,000
日本新薬	23,000	6,670.00	153,410,000
バイオフェルミン製薬	1,600	3,105.00	4,968,000
中外製薬	100,000	4,145.00	414,500,000
科研製薬	18,800	5,950.00	111,860,000
エーザイ	123,700	6,056.00	749,127,200
ロート製薬	49,200	2,310.00	113,652,000
小野薬品工業	228,200	2,232.00	509,342,400
久光製薬	28,400	5,480.00	155,632,000

持田製薬	6,700	7,850.00	52,595,000
参天製薬	181,500	1,499.00	272,068,500
扶桑薬品工業	3,400	2,789.00	9,482,600
日本ケミファ	1,400	5,250.00	7,350,000
ツムラ	33,700	4,225.00	142,382,500
日医工	23,500	1,650.00	38,775,000
キッセイ薬品工業	17,800	2,835.00	50,463,000
生化学工業	18,600	1,798.00	33,442,800
栄研化学	8,400	3,195.00	26,838,000
日水製薬	4,000	1,419.00	5,676,000
鳥居薬品	6,900	2,694.00	18,588,600
JCRファーマ	7,700	2,604.00	20,050,800
東和薬品	4,600	5,090.00	23,414,000
富士製薬工業	3,300	3,835.00	12,655,500
沢井製薬	17,100	6,040.00	103,284,000
ゼリア新薬工業	20,600	1,731.00	35,658,600
第一三共	295,700	2,399.00	709,384,300
キョーリン製薬ホールディングス	24,600	2,317.00	56,998,200
大幸薬品	5,000	1,908.00	9,540,000
ダイト	6,000	2,309.00	13,854,000
大塚ホールディングス	216,100	4,867.00	1,051,758,700
大正製薬ホールディングス	21,500	8,500.00	182,750,000
ペプチドリーム	18,800	6,560.00	123,328,000
日本コークス工業	81,600	97.00	7,915,200
昭和シェル石油	89,800	1,059.00	95,098,200
ニチレキ	12,300	1,258.00	15,473,400
ユシロ化学工業	5,400	1,477.00	7,975,800
ビーピー・カストロール	4,100	1,919.00	7,867,900
富士石油	23,400	342.00	8,002,800
MORESCO	3,500	1,990.00	6,965,000
出光興産	47,700	3,255.00	155,263,500
JXTGホールディングス	1,532,300	491.00	752,359,300
コスモエネルギーホールディングス	30,300	1,697.00	51,419,100
横浜ゴム	60,600	2,264.00	137,198,400
東洋ゴム工業	53,000	2,221.00	117,713,000
ブリヂストン	339,200	4,852.00	1,645,798,400
住友ゴム工業	94,000	1,945.00	182,830,000
藤倉ゴム工業	8,400	650.00	5,460,000
オカモト	30,000	1,351.00	40,530,000
フコク	4,200	947.00	3,977,400
ニッタ	9,000	3,425.00	30,825,000
住友理工	18,600	1,129.00	20,999,400

三ツ星ベルト	23,000	1,180.00	27,140,000
バンドー化学	18,300	1,062.00	19,434,600
日東紡績	81,000	538.00	43,578,000
旭硝子	495,000	932.00	461,340,000
日本板硝子	45,800	874.00	40,029,200
石塚硝子	14,000	214.00	2,996,000
日本山村硝子	41,000	181.00	7,421,000
日本電気硝子	208,000	766.00	159,328,000
オハラ	4,000	1,143.00	4,572,000
住友大阪セメント	187,000	490.00	91,630,000
太平洋セメント	606,000	362.00	219,372,000
日本ヒューム	9,800	678.00	6,644,400
日本コンクリート工業	22,700	388.00	8,807,600
三谷セキサン	5,100	2,772.00	14,137,200
アジアパイルホールディングス	12,800	698.00	8,934,400
東海カーボン	94,100	656.00	61,729,600
日本カーボン	50,000	379.00	18,950,000
東洋炭素	5,600	1,913.00	10,712,800
ノリタケカンパニーリミテド	5,700	3,645.00	20,776,500
TOTO	73,800	4,300.00	317,340,000
日本碍子	126,900	2,189.00	277,784,100
日本特殊陶業	86,600	2,355.00	203,943,000
MARUWA	3,700	4,035.00	14,929,500
品川リフラクトリーズ	26,000	276.00	7,176,000
黒崎播磨	22,000	426.00	9,372,000
ヨータイ	6,000	377.00	2,262,000
イソライト工業	5,600	381.00	2,133,600
東京窯業	13,000	200.00	2,600,000
ニッカトー	3,500	509.00	1,781,500
フジインコーポレーテッド	8,600	2,265.00	19,479,000
ニチアス	53,000	1,302.00	69,006,000
ニチハ	13,400	4,065.00	54,471,000
新日鐵住金	453,000	2,441.00	1,105,773,000
神戸製鋼所	173,700	1,079.00	187,422,300
中山製鋼所	11,300	636.00	7,186,800
合同製鐵	5,600	1,799.00	10,074,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	274,600	1,882.50	516,934,500
日新製鋼	32,700	1,262.00	41,267,400
東京製鐵	50,800	905.00	45,974,000
共英製鋼	10,700	1,725.00	18,457,500
大和工業	20,200	2,687.00	54,277,400
東京鐵鋼	21,000	413.00	8,673,000

大阪製鐵	6,300	2,112.00	13,305,600	
淀川製鋼所	13,900	3,050.00	42,395,000	
東洋鋼鈹	24,000	405.00	9,720,000	
丸一鋼管	33,600	3,345.00	112,392,000	
モリ工業	3,100	2,255.00	6,990,500	
大同特殊鋼	168,000	640.00	107,520,000	
日本高周波鋼業	35,000	80.00	2,800,000	
日本冶金工業	83,100	235.00	19,528,500	
山陽特殊製鋼	60,000	601.00	36,060,000	
愛知製鋼	5,900	4,245.00	25,045,500	
日立金属	102,200	1,467.00	149,927,400	
日本金属	2,400	1,586.00	3,806,400	
大平洋金属	64,000	288.00	18,432,000	
新日本電工	56,800	399.00	22,663,200	
栗本鐵工所	4,800	1,970.00	9,456,000	
虹技	14,000	213.00	2,982,000	
日本鑄鉄管	10,000	166.00	1,660,000	
三菱製鋼	70,000	257.00	17,990,000	
日亜鋼業	14,000	280.00	3,920,000	
日本精線	7,000	691.00	4,837,000	
シンニッタン	8,200	695.00	5,699,000	
新家工業	22,000	189.00	4,158,000	
大紀アルミニウム工業所	17,000	613.00	10,421,000	
日本軽金属ホールディングス	258,600	272.00	70,339,200	
三井金属鉱業	273,000	432.00	117,936,000	
東邦亜鉛	57,000	451.00	25,707,000	
三菱マテリアル	62,700	3,250.00	203,775,000	
住友金属鉱山	260,000	1,376.50	357,890,000	
D O W A ホールディングス	111,000	854.00	94,794,000	
古河機械金属	157,000	193.00	30,301,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,652.00	18,172,000	
東邦チタニウム	17,000	759.00	12,903,000	
U A C J	142,000	290.00	41,180,000	
古河電気工業	33,700	5,270.00	177,599,000	
住友電気工業	378,500	1,730.50	654,994,250	
フジクラ	132,200	999.00	132,067,800	
昭和電線ホールディングス	119,000	83.00	9,877,000	
東京特殊電線	1,600	2,020.00	3,232,000	
タツタ電線	18,800	575.00	10,810,000	
沖電線	12,000	225.00	2,700,000	
カナレ電気	1,400	2,403.00	3,364,200	
平河ヒューテック	5,000	1,468.00	7,340,000	

リョービ	61,000	466.00	28,426,000
アーレスティ	11,600	1,100.00	12,760,000
アサヒホールディングス	15,100	1,883.00	28,433,300
稲葉製作所	5,400	1,400.00	7,560,000
宮地エンジニアリンググループ	29,000	254.00	7,366,000
トーカロ	6,600	3,650.00	24,090,000
アルファC o	3,400	2,400.00	8,160,000
SUMCO	104,900	1,811.00	189,973,900
川田テクノロジーズ	1,900	6,660.00	12,654,000
RS Technologies	500	8,860.00	4,430,000
東洋製罐グループホールディングス	71,400	1,875.00	133,875,000
ホッカシホールディングス	26,000	444.00	11,544,000
コロナ	5,300	1,123.00	5,951,900
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,648.00	29,169,600
駒井ハルテック	1,900	2,226.00	4,229,400
高田機工	9,000	269.00	2,421,000
三和ホールディングス	99,700	1,242.00	123,827,400
文化シャッター	28,000	865.00	24,220,000
三協立山	13,200	1,645.00	21,714,000
アルインコ	6,900	1,072.00	7,396,800
東洋シャッター	2,500	645.00	1,612,500
LIXILグループ	139,900	2,679.00	374,792,100
日本フィルコン	7,400	595.00	4,403,000
ノーリツ	19,700	2,191.00	43,162,700
長府製作所	10,700	2,710.00	28,997,000
リンナイ	17,100	10,060.00	172,026,000
ダイニチ工業	5,100	755.00	3,850,500
日東精工	14,400	461.00	6,638,400
三洋工業	13,000	211.00	2,743,000
岡部	20,900	1,001.00	20,920,900
ジーテクト	10,500	2,047.00	21,493,500
東プレ	19,300	3,065.00	59,154,500
高周波熱錬	18,300	1,041.00	19,050,300
東京製綱	6,800	1,716.00	11,668,800
サンコール	5,400	616.00	3,326,400
モリテック スチール	5,200	289.00	1,502,800
パイオラックス	15,200	3,035.00	46,132,000
エイチワン	7,600	1,214.00	9,226,400
日本発條	94,600	1,182.00	111,817,200
中央発條	11,000	349.00	3,839,000
アドバネクス	1,700	1,565.00	2,660,500
立川ブラインド工業	4,200	1,033.00	4,338,600

三益半導体工業	8,500	1,798.00	15,283,000
日本ドライケミカル	1,300	2,352.00	3,057,600
日本製鋼所	33,200	1,742.00	57,834,400
三浦工業	41,100	2,234.00	91,817,400
タクマ	32,200	1,063.00	34,228,600
ツガミ	28,000	761.00	21,308,000
オークマ	65,000	1,011.00	65,715,000
東芝機械	60,000	505.00	30,300,000
アマダホールディングス	135,200	1,283.00	173,461,600
アイダエンジニアリング	28,500	1,034.00	29,469,000
滝澤鉄工所	29,000	171.00	4,959,000
富士機械製造	30,600	1,648.00	50,428,800
牧野フライス製作所	50,000	902.00	45,100,000
オーエスジー	45,800	2,221.00	101,721,800
ダイジェット工業	18,000	172.00	3,096,000
旭ダイヤモンド工業	28,300	802.00	22,696,600
D M G 森精機	58,200	1,760.00	102,432,000
ソディック	25,500	1,236.00	31,518,000
ディスコ	11,800	18,990.00	224,082,000
日東工器	5,800	2,495.00	14,471,000
パンチ工業	3,600	1,228.00	4,420,800
富士ダイス	3,600	743.00	2,674,800
豊和工業	7,000	758.00	5,306,000
O K K	43,000	125.00	5,375,000
東洋機械金属	6,800	770.00	5,236,000
島精機製作所	13,200	5,090.00	67,188,000
N C ホールディングス	3,300	874.00	2,884,200
フリー	5,900	1,294.00	7,634,600
ヤマシンフィルタ	2,600	2,089.00	5,431,400
日阪製作所	13,700	939.00	12,864,300
やまびこ	18,400	1,210.00	22,264,000
ペガサスミシン製造	9,600	728.00	6,988,800
ナブテスコ	52,200	3,260.00	170,172,000
三井海洋開発	10,100	2,409.00	24,330,900
レオン自動機	8,500	1,064.00	9,044,000
S M C	30,100	34,940.00	1,051,694,000
新川	8,400	691.00	5,804,400
ホソカワミクロン	3,600	4,795.00	17,262,000
ユニオンツール	4,300	3,270.00	14,061,000
オイレス工業	12,300	1,923.00	23,652,900
日精エー・エス・ビー機械	3,200	3,630.00	11,616,000
サトーホールディングス	12,500	2,666.00	33,325,000

日本エアーテック	3,200	849.00	2,716,800
日精樹脂工業	8,400	1,069.00	8,979,600
オカダアイヨン	2,800	1,351.00	3,782,800
ワイエイシイホールディングス	3,700	1,503.00	5,561,100
小松製作所	463,400	2,775.50	1,286,166,700
住友重機械工業	293,000	728.00	213,304,000
日立建機	44,900	2,625.00	117,862,500
日工	3,000	2,193.00	6,579,000
巴工業	4,100	1,815.00	7,441,500
井関農機	104,000	229.00	23,816,000
TOWA	8,200	1,726.00	14,153,200
丸山製作所	2,300	1,745.00	4,013,500
北川鉄工所	4,600	2,311.00	10,630,600
ローツェ	4,700	2,912.00	13,686,400
タカキタ	3,400	524.00	1,781,600
クボタ	480,700	1,850.50	889,535,350
荏原実業	2,800	1,497.00	4,191,600
三菱化工機	33,000	249.00	8,217,000
月島機械	19,000	1,253.00	23,807,000
帝国電機製作所	7,300	1,155.00	8,431,500
新東工業	22,800	1,121.00	25,558,800
澁谷工業	8,500	3,295.00	28,007,500
アイチ コーポレーション	14,200	770.00	10,934,000
小森コーポレーション	24,100	1,437.00	34,631,700
鶴見製作所	7,500	1,743.00	13,072,500
住友精密工業	16,000	350.00	5,600,000
酒井重工業	22,000	331.00	7,282,000
荏原製作所	45,500	3,115.00	141,732,500
石井鐵工所	1,500	1,618.00	2,427,000
西島製作所	9,900	1,089.00	10,781,100
北越工業	10,800	919.00	9,925,200
ダイキン工業	131,000	11,060.00	1,448,860,000
オルガノ	19,000	545.00	10,355,000
トーヨーカネツ	48,000	309.00	14,832,000
栗田工業	55,400	3,010.00	166,754,000
椿本チエイン	57,000	934.00	53,238,000
大同工業	22,000	291.00	6,402,000
木村化工機	11,100	370.00	4,107,000
アネスト岩田	17,400	985.00	17,139,000
ダイフク	47,900	3,365.00	161,183,500
サムコ	2,600	916.00	2,381,600
加藤製作所	5,400	3,055.00	16,497,000

油研工業	19,000	230.00	4,370,000	
タダノ	50,200	1,334.00	66,966,800	
フジテック	27,900	1,295.00	36,130,500	
C K D	28,700	1,729.00	49,622,300	
キトー	12,100	1,160.00	14,036,000	
平和	29,700	2,445.00	72,616,500	
理想科学工業	9,500	2,135.00	20,282,500	
S A N K Y O	26,700	3,785.00	101,059,500	
日本金銭機械	8,800	1,168.00	10,278,400	
マースエンジニアリング	5,400	2,360.00	12,744,000	
福島工業	5,900	4,240.00	25,016,000	
オーイズミ	4,000	571.00	2,284,000	
ダイコク電機	4,000	1,701.00	6,804,000	
竹内製作所	17,500	1,916.00	33,530,000	
アマノ	29,700	2,436.00	72,349,200	
J U K I	15,100	1,461.00	22,061,100	
サンデンホールディングス	59,000	296.00	17,464,000	
蛇の目マシン工業	9,300	904.00	8,407,200	
マックス	15,000	1,608.00	24,120,000	
グローリー	30,700	3,640.00	111,748,000	
新晃工業	8,900	1,856.00	16,518,400	
大和冷機工業	15,400	1,212.00	18,664,800	
セガサミーホールディングス	95,200	1,427.00	135,850,400	
日本ピストンリング	3,700	2,276.00	8,421,200	
リケン	4,400	4,905.00	21,582,000	
T P R	10,700	3,675.00	39,322,500	
ツバキ・ナカシマ	10,800	2,112.00	22,809,600	
ホシザキ	28,000	9,710.00	271,880,000	
大豊工業	7,800	1,402.00	10,935,600	
日本精工	197,100	1,370.00	270,027,000	
N T N	222,000	518.00	114,996,000	
ジェイテクト	102,300	1,632.00	166,953,600	
不二越	97,000	579.00	56,163,000	
日本トムソン	30,800	593.00	18,264,400	
T H K	67,800	3,225.00	218,655,000	
ユーシン精機	4,200	2,780.00	11,676,000	
前澤給装工業	3,600	1,557.00	5,605,200	
イーグル工業	10,400	1,806.00	18,782,400	
前澤工業	6,400	319.00	2,041,600	
日本ピラー工業	9,700	1,696.00	16,451,200	
キッツ	46,000	990.00	45,540,000	
マキタ	125,100	4,095.00	512,284,500	

日立造船	76,500	540.00	41,310,000
三菱重工業	1,608,000	429.70	690,957,600
I H I	737,000	407.00	299,959,000
スター精密	16,800	1,625.00	27,300,000
日清紡ホールディングス	53,300	1,084.00	57,777,200
イビデン	67,200	1,975.00	132,720,000
コニカミノルタ	224,700	896.00	201,331,200
ブラザー工業	124,000	2,617.00	324,508,000
ミネベアミツミ	174,600	1,853.00	323,533,800
日立製作所	2,304,000	672.30	1,548,979,200
東芝	1,245,000	329.10	409,729,500
三菱電機	1,023,600	1,605.50	1,643,389,800
富士電機	289,000	584.00	168,776,000
東洋電機製造	4,100	1,591.00	6,523,100
安川電機	111,200	2,416.00	268,659,200
シンフォニアテクノロジー	62,000	375.00	23,250,000
明電舎	88,000	374.00	32,912,000
オリジン電気	14,000	299.00	4,186,000
山洋電気	25,000	1,071.00	26,775,000
デンヨー	8,900	1,925.00	17,132,500
東芝テック	60,000	597.00	35,820,000
芝浦メカトロニクス	16,000	346.00	5,536,000
マブチモーター	26,800	6,080.00	162,944,000
日本電産	124,400	11,720.00	1,457,968,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	1,664.00	4,992,000
東光高岳	4,900	1,633.00	8,001,700
ダブル・スコープ	9,300	1,667.00	15,503,100
ダイヘン	52,000	868.00	45,136,000
ヤーマン	1,200	7,340.00	8,808,000
JVCケンウッド	71,000	305.00	21,655,000
ミマキエンジニアリング	8,700	662.00	5,759,400
第一精工	4,500	2,058.00	9,261,000
日新電機	19,300	1,223.00	23,603,900
大崎電気工業	19,000	849.00	16,131,000
オムロン	102,000	4,750.00	484,500,000
日東工業	14,100	1,804.00	25,436,400
I D E C	12,500	1,506.00	18,825,000
不二電機工業	1,100	1,359.00	1,494,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	185,000	506.00	93,610,000
サクサホールディングス	24,000	203.00	4,872,000
メルコホールディングス	5,300	3,330.00	17,649,000
テクノメディカ	2,200	1,974.00	4,342,800

日本電気	1,319,000	291.00	383,829,000
富士通	925,000	779.80	721,315,000
沖電気工業	41,600	1,666.00	69,305,600
岩崎通信機	42,000	83.00	3,486,000
電気興業	27,000	574.00	15,498,000
サンケン電気	56,000	481.00	26,936,000
ナカヨ	10,000	403.00	4,030,000
アイホン	5,400	1,868.00	10,087,200
ルネサスエレクトロニクス	49,700	1,037.00	51,538,900
セイコーエプソン	142,900	2,297.00	328,241,300
ワコム	75,000	349.00	26,175,000
アルバック	16,200	6,140.00	99,468,000
アクセル	4,000	771.00	3,084,000
E I Z O	9,500	4,305.00	40,897,500
ジャパンディスプレイ	180,400	209.00	37,703,600
日本信号	26,500	1,039.00	27,533,500
京三製作所	22,000	536.00	11,792,000
能美防災	10,900	1,569.00	17,102,100
ホーチキ	7,000	1,620.00	11,340,000
エレコム	8,300	2,437.00	20,227,100
日本無線	5,900	1,364.00	8,047,600
パナソニック	1,102,000	1,478.50	1,629,307,000
アンリツ	70,000	1,021.00	71,470,000
富士通ゼネラル	32,600	2,444.00	79,674,400
日立国際電気	25,400	2,620.00	66,548,000
ソニー	677,800	4,066.00	2,755,934,800
T D K	54,100	7,250.00	392,225,000
帝国通信工業	21,000	210.00	4,410,000
タムラ製作所	37,000	530.00	19,610,000
アルプス電気	88,600	3,015.00	267,129,000
池上通信機	30,000	153.00	4,590,000
パイオニア	144,200	202.00	29,128,400
日本電波工業	9,300	861.00	8,007,300
鈴木	3,700	730.00	2,701,000
日本トリム	2,300	4,285.00	9,855,500
ローランド ディー . ジー .	4,900	2,656.00	13,014,400
フォスター電機	11,200	1,694.00	18,972,800
クラリオン	51,000	397.00	20,247,000
S M K	25,000	381.00	9,525,000
ヨコオ	6,900	1,487.00	10,260,300
ホシデン	29,100	1,207.00	35,123,700
ヒロセ電機	15,500	15,500.00	240,250,000

日本航空電子工業	28,000	1,521.00	42,588,000
TOA	11,300	1,106.00	12,497,800
日立マクセル	14,300	2,247.00	32,132,100
古野電気	12,400	681.00	8,444,400
ユニデンホールディングス	28,000	255.00	7,140,000
アルパイン	22,900	1,532.00	35,082,800
スミダコーポレーション	8,800	1,706.00	15,012,800
アイコム	5,300	2,603.00	13,795,900
リオン	3,700	1,596.00	5,905,200
本多通信工業	4,100	1,476.00	6,051,600
船井電機	10,800	854.00	9,223,200
横河電機	104,000	1,898.00	197,392,000
新電元工業	37,000	554.00	20,498,000
アズビル	29,100	4,225.00	122,947,500
東亜ディーケーケー	4,800	629.00	3,019,200
日本光電工業	40,100	2,478.00	99,367,800
チノー	3,400	1,232.00	4,188,800
共和電業	10,900	440.00	4,796,000
日本電子材料	3,800	702.00	2,667,600
堀場製作所	19,000	7,040.00	133,760,000
アドバンテスト	65,400	2,087.00	136,489,800
小野測器	4,700	770.00	3,619,000
エスベック	8,500	1,645.00	13,982,500
キーエンス	43,500	49,060.00	2,134,110,000
日置電機	5,000	2,236.00	11,180,000
シスメックス	74,600	6,680.00	498,328,000
日本マイクロニクス	16,800	1,210.00	20,328,000
メガチップス	9,000	2,520.00	22,680,000
OBARA GROUP	5,600	5,720.00	32,032,000
澤藤電機	6,000	521.00	3,126,000
コーセル	13,300	1,412.00	18,779,600
イリソ電子工業	4,000	9,210.00	36,840,000
新日本無線	8,200	646.00	5,297,200
オブテックスグループ	7,300	3,770.00	27,521,000
千代田インテグレ	5,100	2,184.00	11,138,400
アイ・オー・データ機器	4,000	1,284.00	5,136,000
レーザーテック	21,100	1,783.00	37,621,300
スタンレー電気	68,500	3,360.00	230,160,000
岩崎電気	35,000	171.00	5,985,000
ウシオ電機	58,300	1,458.00	85,001,400
岡谷電機産業	5,300	432.00	2,289,600
ハリオス テクノ ホールディング	9,000	787.00	7,083,000

日本セラミック	7,900	2,684.00	21,203,600
遠藤照明	4,900	1,145.00	5,610,500
古河電池	7,000	768.00	5,376,000
双信電機	4,900	297.00	1,455,300
山一電機	9,000	1,879.00	16,911,000
図研	6,300	1,611.00	10,149,300
日本電子	35,000	594.00	20,790,000
カシオ計算機	77,200	1,681.00	129,773,200
ファナック	97,300	21,615.00	2,103,139,500
日本シイエムケイ	20,700	942.00	19,499,400
エンプラス	4,400	3,315.00	14,586,000
大真空	3,600	1,528.00	5,500,800
ローム	46,400	8,530.00	395,792,000
浜松ホトニクス	69,900	3,410.00	238,359,000
三井ハイテック	12,700	1,798.00	22,834,600
新光電気工業	36,300	897.00	32,561,100
京セラ	157,500	6,394.00	1,007,055,000
太陽誘電	46,700	1,631.00	76,167,700
村田製作所	100,700	15,595.00	1,570,416,500
ユーシン	13,300	719.00	9,562,700
双葉電子工業	15,700	1,955.00	30,693,500
北陸電気工業	39,000	135.00	5,265,000
ニチコン	30,200	1,166.00	35,213,200
日本ケミコン	83,000	421.00	34,943,000
K O A	13,300	2,076.00	27,610,800
市光工業	20,000	804.00	16,080,000
小糸製作所	57,500	5,790.00	332,925,000
ミツバ	17,800	2,082.00	37,059,600
S C R E E Nホールディングス	19,700	8,180.00	161,146,000
キャノン電子	8,800	2,253.00	19,826,400
キャノン	516,600	3,908.00	2,018,872,800
リコー	288,500	970.00	279,845,000
M U T O Hホールディングス	13,000	242.00	3,146,000
東京エレクトロン	64,000	16,395.00	1,049,280,000
トヨタ紡織	33,600	2,169.00	72,878,400
芦森工業	23,000	214.00	4,922,000
ユニプレス	18,500	2,625.00	48,562,500
豊田自動織機	87,400	5,670.00	495,558,000
モリタホールディングス	16,800	1,694.00	28,459,200
三櫻工業	12,200	777.00	9,479,400
デンソー	236,600	4,799.00	1,135,443,400
東海理化電機製作所	25,300	2,032.00	51,409,600

三井造船	357,000	153.00	54,621,000
川崎重工業	750,000	322.00	241,500,000
名村造船所	29,000	610.00	17,690,000
サノヤスホールディングス	15,100	247.00	3,729,700
ニチュ三菱フォークリフト	14,300	736.00	10,524,800
近畿車輛	1,400	2,582.00	3,614,800
日産自動車	1,131,900	1,077.00	1,219,056,300
いすゞ自動車	278,100	1,335.50	371,402,550
トヨタ自動車	1,165,600	5,880.00	6,853,728,000
日野自動車	137,000	1,238.00	169,606,000
三菱自動車工業	353,000	738.00	260,514,000
エフテック	5,800	1,417.00	8,218,600
レシップホールディングス	3,100	906.00	2,808,600
G M B	1,900	1,212.00	2,302,800
ファルテック	1,700	1,279.00	2,174,300
武蔵精密工業	11,200	3,185.00	35,672,000
日産車体	42,400	1,077.00	45,664,800
新明和工業	40,000	879.00	35,160,000
極東開発工業	19,700	1,808.00	35,617,600
日信工業	21,500	1,792.00	38,528,000
トピー工業	7,900	3,275.00	25,872,500
ティラド	37,000	340.00	12,580,000
曙ブレーキ工業	44,600	364.00	16,234,400
タチエス	16,300	2,052.00	33,447,600
N O K	46,500	2,385.00	110,902,500
フタバ産業	30,200	899.00	27,149,800
K Y B	108,000	558.00	60,264,000
大同メタル工業	12,100	961.00	11,628,100
プレス工業	51,100	506.00	25,856,600
ミクニ	12,300	447.00	5,498,100
太平洋工業	21,600	1,433.00	30,952,800
ケーヒン	22,100	1,550.00	34,255,000
河西工業	13,000	1,403.00	18,239,000
アイシン精機	87,800	5,640.00	495,192,000
富士機工	9,700	738.00	7,158,600
マツダ	304,300	1,526.50	464,513,950
今仙電機製作所	8,800	1,194.00	10,507,200
本田技研工業	863,500	3,066.00	2,647,491,000
スズキ	190,200	5,287.00	1,005,587,400
S U B A R U	297,900	3,713.00	1,106,102,700
安永	5,300	1,203.00	6,375,900
ヤマハ発動機	135,600	2,941.00	398,799,600

ショーワ	25,700	1,066.00	27,396,200
T B K	12,400	508.00	6,299,200
エクセディ	13,100	3,125.00	40,937,500
豊田合成	31,000	2,706.00	83,886,000
愛三工業	16,900	902.00	15,243,800
盟和産業	1,500	1,192.00	1,788,000
ヨロズ	9,000	1,808.00	16,272,000
エフ・シー・シー	15,700	2,219.00	34,838,300
シマノ	38,700	16,770.00	648,999,000
テイ・エス テック	22,300	3,300.00	73,590,000
ジャムコ	5,800	2,596.00	15,056,800
テルモ	147,100	4,405.00	647,975,500
クリエートメディック	3,200	992.00	3,174,400
日機装	33,200	1,085.00	36,022,000
島津製作所	123,500	2,155.00	266,142,500
J M S	18,000	316.00	5,688,000
長野計器	7,600	733.00	5,570,800
ブイ・テクノロジー	1,900	21,050.00	39,995,000
東京計器	33,000	280.00	9,240,000
愛知時計電機	1,300	4,000.00	5,200,000
インターアクション	3,700	755.00	2,793,500
オーバル	9,600	263.00	2,524,800
東京精密	18,600	3,955.00	73,563,000
マニー	11,700	2,959.00	34,620,300
ニコン	167,200	1,768.00	295,609,600
トプコン	48,300	1,858.00	89,741,400
オリンパス	153,200	3,980.00	609,736,000
理研計器	8,500	2,113.00	17,960,500
タムロン	8,500	2,000.00	17,000,000
H O Y A	197,400	5,445.00	1,074,843,000
シード	1,200	2,469.00	2,962,800
ノーリツ鋼機	9,800	897.00	8,790,600
エー・アンド・デイ	8,900	450.00	4,005,000
シチズン時計	105,100	761.00	79,981,100
リズム時計工業	39,000	225.00	8,775,000
大研医器	8,600	776.00	6,673,600
メニコン	6,600	3,375.00	22,275,000
松風	5,100	1,298.00	6,619,800
セイコーホールディングス	68,000	447.00	30,396,000
ニプロ	66,400	1,445.00	95,948,000
スノーピーク	1,500	3,485.00	5,227,500
パラマウントベッドホールディングス	9,200	4,780.00	43,976,000

トランザクション	4,300	1,018.00	4,377,400
S H O - B I	3,200	434.00	1,388,800
ニホンフラッシュ	4,500	1,469.00	6,610,500
前田工織	9,600	1,553.00	14,908,800
永大産業	13,000	512.00	6,656,000
アートネイチャー	10,200	722.00	7,364,400
ダンロップスポーツ	6,000	1,089.00	6,534,000
バンダイナムコホールディングス	105,800	3,890.00	411,562,000
アイフィスジャパン	2,100	727.00	1,526,700
共立印刷	16,000	339.00	5,424,000
S H O E I	4,300	2,910.00	12,513,000
フランスベッドホールディングス	12,000	963.00	11,556,000
パイロットコーポレーション	16,700	4,590.00	76,653,000
萩原工業	2,700	2,766.00	7,468,200
トッパン・フォームズ	17,100	1,165.00	19,921,500
フジシールインターナショナル	21,500	2,926.00	62,909,000
タカラトミー	37,300	1,401.00	52,257,300
廣済堂	9,700	360.00	3,492,000
A s - m e エステール	2,600	708.00	1,840,800
アーク	40,600	112.00	4,547,200
タカノ	4,200	1,111.00	4,666,200
プロネクサス	9,000	1,245.00	11,205,000
ホクシン	6,800	172.00	1,169,600
ウッドワン	16,000	289.00	4,624,000
大建工業	6,800	2,401.00	16,326,800
凸版印刷	271,000	1,240.00	336,040,000
大日本印刷	277,000	1,230.00	340,710,000
図書印刷	13,000	507.00	6,591,000
共同印刷	30,000	382.00	11,460,000
日本写真印刷	16,700	3,000.00	50,100,000
光村印刷	8,000	258.00	2,064,000
宝印刷	5,000	1,626.00	8,130,000
アシックス	95,300	1,926.00	183,547,800
ツツミ	3,600	2,111.00	7,599,600
小松ウオール工業	3,200	2,054.00	6,572,800
ヤマハ	64,600	3,570.00	230,622,000
河合楽器製作所	3,800	2,318.00	8,808,400
クリナップ	11,200	844.00	9,452,800
ピジョン	58,000	3,995.00	231,710,000
兼松サステック	10,000	213.00	2,130,000
キングジム	8,000	939.00	7,512,000
リンテック	22,800	2,629.00	59,941,200

イトーキ	20,200	793.00	16,018,600
任天堂	59,100	34,020.00	2,010,582,000
三菱鉛筆	7,900	6,430.00	50,797,000
タカスタンダード	19,800	1,867.00	36,966,600
コクヨ	49,900	1,489.00	74,301,100
ナカバヤシ	17,000	300.00	5,100,000
グロープライド	4,600	1,944.00	8,942,400
岡村製作所	33,500	1,028.00	34,438,000
美津濃	51,000	634.00	32,334,000
東京電力ホールディングス	814,000	455.00	370,370,000
中部電力	316,200	1,493.00	472,086,600
関西電力	391,600	1,579.00	618,336,400
中国電力	132,700	1,256.00	166,671,200
北陸電力	94,000	1,054.00	99,076,000
東北電力	239,700	1,629.00	390,471,300
四国電力	86,400	1,396.00	120,614,400
九州電力	211,900	1,390.00	294,541,000
北海道電力	89,800	865.00	77,677,000
沖縄電力	15,510	2,576.00	39,953,760
電源開発	76,400	2,823.00	215,677,200
エフオン	4,700	1,064.00	5,000,800
イーレックス	12,100	976.00	11,809,600
東京瓦斯	1,029,000	600.90	618,326,100
大阪瓦斯	931,000	447.20	416,343,200
東邦瓦斯	239,000	854.00	204,106,000
北海道瓦斯	24,000	271.00	6,504,000
広島ガス	19,900	352.00	7,004,800
西部瓦斯	108,000	265.00	28,620,000
静岡ガス	29,500	742.00	21,889,000
メタウォーター	5,400	3,140.00	16,956,000
SBSホールディングス	9,500	789.00	7,495,500
東武鉄道	513,000	601.00	308,313,000
相鉄ホールディングス	154,000	539.00	83,006,000
東京急行電鉄	521,000	810.00	422,010,000
京浜急行電鉄	263,000	1,362.00	358,206,000
小田急電鉄	153,700	2,244.00	344,902,800
京王電鉄	268,000	924.00	247,632,000
京成電鉄	71,900	2,905.00	208,869,500
富士急行	26,000	1,171.00	30,446,000
新京成電鉄	12,000	419.00	5,028,000
東日本旅客鉄道	185,600	10,780.00	2,000,768,000
西日本旅客鉄道	92,400	7,672.00	708,892,800

東海旅客鉄道	79,800	18,070.00	1,441,986,000
西武ホールディングス	132,500	2,089.00	276,792,500
鴻池運輸	13,600	1,585.00	21,556,000
西日本鉄道	115,000	473.00	54,395,000
ハマキョウレックス	6,200	2,605.00	16,151,000
サカイ引越センター	4,400	4,265.00	18,766,000
近鉄グループホールディングス	966,000	425.00	410,550,000
阪急阪神ホールディングス	121,200	3,915.00	474,498,000
南海電気鉄道	203,000	578.00	117,334,000
京阪ホールディングス	215,000	710.00	152,650,000
神戸電鉄	23,000	401.00	9,223,000
名古屋鉄道	349,000	506.00	176,594,000
山陽電気鉄道	35,000	567.00	19,845,000
日本通運	357,000	692.00	247,044,000
ヤマトホールディングス	171,600	2,264.00	388,502,400
山九	126,000	725.00	91,350,000
丸運	5,200	270.00	1,404,000
丸全昭和運輸	32,000	455.00	14,560,000
センコーグループホールディングス	45,500	684.00	31,122,000
トナミホールディングス	20,000	421.00	8,420,000
ニッコンホールディングス	32,500	2,506.00	81,445,000
日本石油輸送	1,100	2,621.00	2,883,100
福山通運	58,000	705.00	40,890,000
セイノーホールディングス	68,100	1,465.00	99,766,500
神奈川中央交通	11,000	725.00	7,975,000
日立物流	20,000	2,505.00	50,100,000
丸和運輸機関	2,400	3,535.00	8,484,000
C & F ロジホールディングス	10,000	1,376.00	13,760,000
九州旅客鉄道	95,300	3,665.00	349,274,500
日本郵船	811,000	204.00	165,444,000
商船三井	503,000	326.00	163,978,000
川崎汽船	366,000	283.00	103,578,000
N S ユナイテッド海運	45,000	219.00	9,855,000
飯野海運	51,500	461.00	23,741,500
共栄タンカー	14,000	209.00	2,926,000
乾汽船	7,000	894.00	6,258,000
日本航空	168,600	3,346.00	564,135,600
A N A ホールディングス	1,781,000	379.00	674,999,000
パスコ	9,000	350.00	3,150,000
ランコム	2,800	5,700.00	15,960,000
日新	39,000	500.00	19,500,000
三菱倉庫	63,000	1,444.00	90,972,000

三井倉庫ホールディングス	56,000	315.00	17,640,000
住友倉庫	70,000	719.00	50,330,000
澁澤倉庫	25,000	350.00	8,750,000
東陽倉庫	16,500	293.00	4,834,500
日本トランスシティ	22,000	454.00	9,988,000
ケイヒン	18,000	160.00	2,880,000
中央倉庫	5,500	1,087.00	5,978,500
安田倉庫	7,500	728.00	5,460,000
東洋埠頭	28,000	179.00	5,012,000
宇徳	7,800	436.00	3,400,800
上組	114,000	1,151.00	131,214,000
サンリツ	2,300	569.00	1,308,700
キムラユニティー	2,400	1,169.00	2,805,600
キューソー流通システム	3,000	2,542.00	7,626,000
郵船ロジスティクス	8,800	1,002.00	8,817,600
近鉄エクスプレス	17,200	1,823.00	31,355,600
東海運	5,200	427.00	2,220,400
エーアイティー	5,900	1,018.00	6,006,200
内外トランスライン	2,900	1,266.00	3,671,400
NEC ネットエスアイ	10,400	2,524.00	26,249,600
システナ	7,600	2,316.00	17,601,600
デジタルアーツ	4,200	3,940.00	16,548,000
新日鉄住金ソリューションズ	14,800	2,676.00	39,604,800
キューブシステム	5,500	889.00	4,889,500
コア	4,000	1,579.00	6,316,000
ソフトクリエイトホールディングス	4,600	1,358.00	6,246,800
T I S	31,400	3,145.00	98,753,000
ネオス	2,900	474.00	1,374,600
電算システム	3,300	1,710.00	5,643,000
グリー	57,700	1,003.00	57,873,100
コーエーテクモホールディングス	22,500	2,353.00	52,942,500
三菱総合研究所	4,100	3,125.00	12,812,500
ボルテージ	1,700	1,409.00	2,395,300
電算	1,100	2,212.00	2,433,200
A G S	2,400	1,662.00	3,988,800
ファインデックス	7,100	920.00	6,532,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,658.00	3,647,600
ブレインパッド	2,100	1,226.00	2,574,600
K L a b	18,100	1,655.00	29,955,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,900	1,715.00	11,833,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	1,230.00	1,845,000
ネクソン	104,200	2,208.00	230,073,600

アイスタイル	20,000	865.00	17,300,000
エムアップ	2,700	2,171.00	5,861,700
エイチーム	6,400	3,195.00	20,448,000
テクノスジャパン	7,300	1,172.00	8,555,600
コロプラ	30,400	1,119.00	34,017,600
モバイルクリエイト	7,100	417.00	2,960,700
ブロードリーフ	23,400	705.00	16,497,000
ハーツユナイテッドグループ	5,000	1,691.00	8,455,000
メディアドゥ	2,700	2,372.00	6,404,400
ブイキューブ	5,200	615.00	3,198,000
サイバーリンクス	1,500	1,289.00	1,933,500
フィックスターズ	1,600	3,185.00	5,096,000
VOYAGE GROUP	4,700	2,163.00	10,166,100
オブティム	2,000	3,200.00	6,400,000
セレス	2,300	1,596.00	3,670,800
ベリサーブ	1,100	3,600.00	3,960,000
ティーガイア	9,500	2,098.00	19,931,000
日本アジアグループ	10,800	415.00	4,482,000
豆蔵ホールディングス	7,000	991.00	6,937,000
テクマトリックス	5,900	1,728.00	10,195,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	198,800	287.00	57,055,600
GMOペイメントゲートウェイ	6,700	6,500.00	43,550,000
ザッパラス	5,000	549.00	2,745,000
システムリサーチ	1,000	2,272.00	2,272,000
インターネットイニシアティブ	13,900	2,020.00	28,078,000
さくらインターネット	7,800	927.00	7,230,600
GMOクラウド	2,100	3,985.00	8,368,500
SRAホールディングス	5,000	3,045.00	15,225,000
Minor iソリューションズ	2,100	1,262.00	2,650,200
朝日ネット	8,700	492.00	4,280,400
アドソル日進	2,500	1,192.00	2,980,000
フリービット	7,000	863.00	6,041,000
コムチュア	1,600	5,020.00	8,032,000
サイバーコム	1,700	1,086.00	1,846,200
メディカル・データ・ビジョン	4,200	2,348.00	9,861,600
gumi	10,800	1,202.00	12,981,600
ショーケース・ティービー	1,500	1,107.00	1,660,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,400	2,039.00	2,854,600
PCIホールディングス	1,600	2,592.00	4,147,200
パイプドHD	1,700	1,029.00	1,749,300
アイビーシー	1,000	1,096.00	1,096,000
オープンドア	1,300	3,395.00	4,413,500

LINE	21,200	3,920.00	83,104,000
オークネット	3,000	1,356.00	4,068,000
AOI TYO Holdings	7,800	974.00	7,597,200
マクロミル	12,200	2,304.00	28,108,800
ソルクシーズ	3,700	860.00	3,182,000
フェイス	2,500	1,280.00	3,200,000
ハイマックス	1,300	1,610.00	2,093,000
野村総合研究所	70,800	4,230.00	299,484,000
サイバネットシステム	7,800	717.00	5,592,600
CEホールディングス	1,400	1,085.00	1,519,000
インタージホールディングス	5,400	2,145.00	11,583,000
東邦システムサイエンス	3,200	669.00	2,140,800
ソースネクスト	5,800	631.00	3,659,800
フォーカスシステムズ	4,900	937.00	4,591,300
クレスコ	2,200	3,610.00	7,942,000
フジ・メディア・ホールディングス	98,700	1,474.00	145,483,800
オービック	32,700	6,300.00	206,010,000
ジャストシステム	15,300	1,709.00	26,147,700
TDCソフトウェアエンジニアリング	4,200	1,240.00	5,208,000
ヤフー	678,900	488.00	331,303,200
トレンドマイクロ	50,200	5,670.00	284,634,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,700	1,326.00	3,580,200
日本オラクル	15,200	6,490.00	98,648,000
アルファシステムズ	3,100	2,121.00	6,575,100
フューチャー	12,900	848.00	10,939,200
CAC Holdings	7,100	1,063.00	7,547,300
ソフトバンク・テクノロジー	4,600	2,167.00	9,968,200
トーセ	2,600	1,703.00	4,427,800
オービックビジネスコンサルタント	4,800	5,670.00	27,216,000
伊藤忠テクノソリューションズ	21,500	3,865.00	83,097,500
アイティフォー	12,400	630.00	7,812,000
東計電算	1,700	2,621.00	4,455,700
エクスネット	1,800	899.00	1,618,200
大塚商会	25,500	6,660.00	169,830,000
サイボウズ	12,700	516.00	6,553,200
ソフトブレーン	13,100	543.00	7,113,300
電通国際情報サービス	5,900	2,661.00	15,699,900
デジタルガレージ	18,300	2,004.00	36,673,200
EMシステムズ	3,300	2,333.00	7,698,900
ウェザーニューズ	3,200	3,830.00	12,256,000
C I J	8,100	574.00	4,649,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,773.00	1,773,000

日本エンタープライズ	9,900	262.00	2,593,800
WOWOW	4,500	3,225.00	14,512,500
スカラ	6,600	845.00	5,577,000
日本コロムビア	2,800	747.00	2,091,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	8,000	752.00	6,016,000
ネットワンシステムズ	41,100	1,139.00	46,812,900
システムソフト	22,800	152.00	3,465,600
アルゴグラフィックス	4,400	2,644.00	11,633,600
マーベラス	16,000	1,113.00	17,808,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,500	1,450.00	25,375,000
日本ユニシス	26,200	1,810.00	47,422,000
兼松エレクトロニクス	6,000	3,435.00	20,610,000
東京放送ホールディングス	62,400	1,875.00	117,000,000
日本テレビホールディングス	86,500	1,789.00	154,748,500
朝日放送	9,400	787.00	7,397,800
テレビ朝日ホールディングス	25,900	1,954.00	50,608,600
スカパーJ S A Tホールディングス	61,700	487.00	30,047,900
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,233.00	17,194,100
日本BS放送	3,200	1,202.00	3,846,400
ビジョン	1,500	5,440.00	8,160,000
U-NEXT	2,500	1,254.00	3,135,000
ワイヤレスゲート	4,400	1,542.00	6,784,800
コネクシオ	8,400	1,925.00	16,170,000
日本通信	79,200	161.00	12,751,200
クロップス	2,100	565.00	1,186,500
日本電信電話	760,300	5,246.00	3,988,533,800
KDDI	936,900	3,007.00	2,817,258,300
光通信	11,400	11,420.00	130,188,000
NTTドコモ	697,100	2,702.50	1,883,912,750
エムティーアイ	12,800	631.00	8,076,800
GMOインターネット	34,600	1,440.00	49,824,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,300	696.00	904,800
カドカワ	27,500	1,398.00	38,445,000
学研ホールディングス	3,200	3,180.00	10,176,000
ゼンリン	12,500	2,622.00	32,775,000
昭文社	5,500	741.00	4,075,500
インプレスホールディングス	7,800	138.00	1,076,400
アイネット	5,400	1,280.00	6,912,000
松竹	62,000	1,405.00	87,110,000
東宝	62,000	3,310.00	205,220,000
東映	35,000	1,038.00	36,330,000
エヌ・ティ・ティ・データ	58,500	6,040.00	353,340,000

ピー・シー・エー	1,400	1,483.00	2,076,200
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,027.00	1,745,900
D T S	9,800	3,330.00	32,634,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,500	3,570.00	130,305,000
シーイーシー	5,600	2,000.00	11,200,000
カプコン	22,200	2,669.00	59,251,800
アイ・エス・ビー	1,900	1,625.00	3,087,500
ジャステック	6,000	1,202.00	7,212,000
S C S K	25,800	4,970.00	128,226,000
日本システムウエア	3,100	1,740.00	5,394,000
アイネス	12,000	1,120.00	13,440,000
T K C	8,800	3,160.00	27,808,000
富士ソフト	14,100	3,220.00	45,402,000
N S D	20,100	2,046.00	41,124,600
コナミホールディングス	42,800	6,170.00	264,076,000
福井コンピュータホールディングス	2,800	3,535.00	9,898,000
J B C Cホールディングス	8,000	842.00	6,736,000
ミロク情報サービス	9,400	2,228.00	20,943,200
ソフトバンクグループ	426,300	9,228.00	3,933,896,400
ハウスイ	8,000	118.00	944,000
高千穂交易	3,700	1,105.00	4,088,500
伊藤忠食品	2,300	4,720.00	10,856,000
エレマテック	3,800	1,797.00	6,828,600
J A L U X	3,100	2,649.00	8,211,900
あらた	4,300	3,640.00	15,652,000
トーメンデバイス	1,400	2,213.00	3,098,200
東京エレクトロン デバイス	3,400	1,701.00	5,783,400
フィールズ	7,300	1,178.00	8,599,400
双日	559,300	269.00	150,451,700
アルフレッサ ホールディングス	112,000	2,099.00	235,088,000
横浜冷凍	22,300	1,073.00	23,927,900
神栄	13,000	165.00	2,145,000
山下医科器械	800	1,723.00	1,378,400
ラサ商事	4,100	964.00	3,952,400
ラクーン	6,100	599.00	3,653,900
アルコニックス	5,400	1,956.00	10,562,400
神戸物産	5,100	4,710.00	24,021,000
あい ホールディングス	13,500	2,972.00	40,122,000
ディーブイエックス	3,400	1,304.00	4,433,600
ダイワボウホールディングス	80,000	406.00	32,480,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,500	1,622.00	28,385,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,800	910.00	16,198,000

八洲電機	7,300	721.00	5,263,300
メディアスホールディングス	1,500	3,125.00	4,687,500
UKCホールディングス	6,100	1,944.00	11,858,400
OCHIホールディングス	2,800	1,346.00	3,768,800
TOKAIホールディングス	41,600	824.00	34,278,400
大阪工機	1,500	771.00	1,156,500
三洋貿易	5,200	2,309.00	12,006,800
ビューティガレージ	1,300	1,821.00	2,367,300
ウイン・パートナーズ	6,800	1,233.00	8,384,400
ミタチ産業	2,200	660.00	1,452,000
シップヘルスケアホールディングス	18,200	3,270.00	59,514,000
明治電機工業	3,300	1,286.00	4,243,800
デリカフーズ	2,000	1,439.00	2,878,000
スターティア	2,200	570.00	1,254,000
コメダホールディングス	17,100	1,878.00	32,113,800
富士興産	3,500	496.00	1,736,000
協栄産業	12,000	180.00	2,160,000
小野建	8,200	1,683.00	13,800,600
佐島電機	7,000	814.00	5,698,000
エコートレーディング	2,200	692.00	1,522,400
伯東	6,500	1,398.00	9,087,000
コンドーテック	7,500	925.00	6,937,500
中山福	5,500	824.00	4,532,000
ナガイレーベン	12,500	2,491.00	31,137,500
三菱食品	10,400	3,330.00	34,632,000
松田産業	6,900	1,509.00	10,412,100
第一興商	15,400	5,050.00	77,770,000
メディバルホールディングス	94,700	2,066.00	195,650,200
SPK	2,000	2,616.00	5,232,000
萩原電気	3,200	2,271.00	7,267,200
アズワン	7,400	5,290.00	39,146,000
スズデン	3,400	1,198.00	4,073,200
尾家産業	3,100	1,227.00	3,803,700
シモジマ	5,800	1,143.00	6,629,400
ドウシシャ	11,100	2,048.00	22,732,800
小津産業	2,100	2,174.00	4,565,400
高速	5,600	1,055.00	5,908,000
たけびし	3,300	1,422.00	4,692,600
黒田電気	12,900	2,218.00	28,612,200
リックス	2,100	1,859.00	3,903,900
丸文	8,400	759.00	6,375,600
ハピネット	7,900	2,068.00	16,337,200

橋本総業ホールディングス	2,000	1,683.00	3,366,000
日本ライフライン	10,800	4,305.00	46,494,000
エクセル	4,100	1,453.00	5,957,300
マルカキカイ	3,100	1,882.00	5,834,200
I D O M	25,500	652.00	16,626,000
日本エム・ディ・エム	7,100	823.00	5,843,300
進和	5,600	1,998.00	11,188,800
エスケイジャパン	1,900	287.00	545,300
ダイترون	4,300	1,244.00	5,349,200
シークス	6,800	4,335.00	29,478,000
田中商事	2,900	722.00	2,093,800
オーハシテクニカ	5,300	1,413.00	7,488,900
白銅	2,400	1,576.00	3,782,400
伊藤忠商事	693,600	1,605.50	1,113,574,800
丸紅	932,000	699.50	651,934,000
高島	16,000	210.00	3,360,000
長瀬産業	57,000	1,614.00	91,998,000
蝶理	6,000	2,078.00	12,468,000
豊田通商	105,500	3,405.00	359,227,500
三共生興	14,500	388.00	5,626,000
兼松	201,000	220.00	44,220,000
ツカモトコーポレーション	17,000	125.00	2,125,000
三井物産	856,400	1,509.00	1,292,307,600
日本紙パルプ商事	49,000	410.00	20,090,000
日立ハイテクノロジーズ	32,800	4,395.00	144,156,000
カメイ	12,300	1,434.00	17,638,200
東都水産	1,500	1,829.00	2,743,500
O U Gホールディングス	15,000	263.00	3,945,000
スターゼン	4,000	4,785.00	19,140,000
山善	36,400	1,102.00	40,112,800
椿本興業	11,000	442.00	4,862,000
住友商事	596,200	1,442.50	860,018,500
内田洋行	4,400	2,566.00	11,290,400
三菱商事	710,600	2,298.50	1,633,314,100
第一実業	22,000	614.00	13,508,000
キャノンマーケティングジャパン	27,000	2,354.00	63,558,000
西華産業	29,000	371.00	10,759,000
佐藤商事	8,500	883.00	7,505,500
菱洋エレクトロ	8,800	1,743.00	15,338,400
東京産業	9,500	442.00	4,199,000
ユアサ商事	9,000	3,410.00	30,690,000
神鋼商事	2,400	2,566.00	6,158,400

小林産業	7,000	289.00	2,023,000
阪和興業	95,000	795.00	75,525,000
カナデン	9,100	1,119.00	10,182,900
菱電商事	15,000	784.00	11,760,000
フルサト工業	5,200	1,700.00	8,840,000
岩谷産業	105,000	717.00	75,285,000
すてきナイスグループ	40,000	149.00	5,960,000
昭光通商	34,000	95.00	3,230,000
ニチモウ	14,000	174.00	2,436,000
極東貿易	15,000	269.00	4,035,000
イワキ	14,000	370.00	5,180,000
三愛石油	25,400	1,063.00	27,000,200
稲畑産業	22,700	1,398.00	31,734,600
G S Iクレオス	23,000	144.00	3,312,000
明和産業	8,800	430.00	3,784,000
ワキタ	20,200	1,224.00	24,724,800
東邦ホールディングス	30,300	2,178.00	65,993,400
サンゲツ	32,500	1,936.00	62,920,000
ミツウロコグループホールディングス	15,300	727.00	11,123,100
シナネンホールディングス	4,100	2,231.00	9,147,100
伊藤忠エネクス	20,900	950.00	19,855,000
サンリオ	29,200	2,137.00	62,400,400
サンワテクノス	5,600	1,417.00	7,935,200
リョーサン	14,100	4,190.00	59,079,000
新光商事	10,400	1,374.00	14,289,600
トーホー	4,300	2,900.00	12,470,000
三信電気	10,500	1,429.00	15,004,500
東陽テクニカ	10,900	1,062.00	11,575,800
モスフードサービス	12,400	3,415.00	42,346,000
加賀電子	8,600	2,247.00	19,324,200
ソーダニッカ	9,900	520.00	5,148,000
立花エレテック	6,400	1,470.00	9,408,000
フォーバル	4,200	716.00	3,007,200
P A L T A C	15,200	3,840.00	58,368,000
三谷産業	10,200	397.00	4,049,400
ヤマタネ	4,700	1,515.00	7,120,500
丸紅建材リース	9,000	220.00	1,980,000
日鉄住金物産	8,300	5,250.00	43,575,000
トラスコ中山	21,600	2,452.00	52,963,200
オートバックスセブン	35,100	1,751.00	61,460,100
モリト	7,600	899.00	6,832,400
加藤産業	14,800	3,060.00	45,288,000

イノテック	8,200	678.00	5,559,600	
イエローハット	8,900	2,655.00	23,629,500	
J Kホールディングス	9,600	649.00	6,230,400	
日伝	3,900	3,565.00	13,903,500	
北沢産業	8,000	200.00	1,600,000	
杉本商事	5,500	1,530.00	8,415,000	
因幡電機産業	13,300	4,135.00	54,995,500	
バイテックホールディングス	3,900	1,387.00	5,409,300	
ミスミグループ本社	106,800	2,413.00	257,708,400	
アルテック	8,100	218.00	1,765,800	
タキヒヨー	14,000	451.00	6,314,000	
蔵王産業	1,600	1,452.00	2,323,200	
スズケン	43,100	3,505.00	151,065,500	
ジェコス	6,500	1,185.00	7,702,500	
ルネサスイーストン	8,800	591.00	5,200,800	
ローソン	29,900	7,520.00	224,848,000	
サンエー	7,200	5,000.00	36,000,000	
カワチ薬品	7,400	2,688.00	19,891,200	
エービーシー・マート	17,200	6,400.00	110,080,000	
ハードオフコーポレーション	4,300	1,124.00	4,833,200	
アスクル	9,900	3,280.00	32,472,000	
ゲオホールディングス	15,900	1,162.00	18,475,800	
アダストリア	14,600	2,995.00	43,727,000	
ジーフット	5,800	782.00	4,535,600	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,200	712.00	854,400	
くらコーポレーション	6,200	5,080.00	31,496,000	
キャンドゥ	5,100	1,699.00	8,664,900	
パルグループホールディングス	4,900	2,815.00	13,793,500	
エディオン	36,800	1,021.00	37,572,800	
サーラコーポレーション	11,900	680.00	8,092,000	
ワッツ	3,900	1,272.00	4,960,800	
ハローズ	3,200	2,384.00	7,628,800	
あみやき亭	1,800	4,155.00	7,479,000	
ひらまつ	13,200	641.00	8,461,200	
ゲンキー	3,900	2,981.00	11,625,900	
大黒天物産	2,300	5,530.00	12,719,000	
ハニーズホールディングス	9,300	1,209.00	11,243,700	
ファーマライズホールディングス	2,300	521.00	1,198,300	
アルペン	7,300	1,986.00	14,497,800	
クオール	10,700	1,704.00	18,232,800	
ジンズ	6,400	6,140.00	39,296,000	
ビックカメラ	54,400	1,160.00	63,104,000	

D C Mホールディングス	57,500	943.00	54,222,500
MonotaRO	33,600	3,730.00	125,328,000
東京一番フーズ	2,700	577.00	1,557,900
ダイヤモンドダイニング	2,100	2,373.00	4,983,300
きちり	2,700	664.00	1,792,800
アークランドサービスホールディングス	4,000	4,015.00	16,060,000
J．フロント リテイリング	119,900	1,662.00	199,273,800
ドトール・日レスホールディングス	16,600	2,342.00	38,877,200
マツモトキヨシホールディングス	17,900	6,400.00	114,560,000
ブロンコビリー	5,000	2,677.00	13,385,000
スタートトゥデイ	86,500	2,823.00	244,189,500
トレジャー・ファクトリー	2,800	781.00	2,186,800
物語コーポレーション	2,700	5,840.00	15,768,000
ココカラファイン	9,900	5,670.00	56,133,000
三越伊勢丹ホールディングス	188,500	1,170.00	220,545,000
Hamee	3,100	1,382.00	4,284,200
ウエルシアホールディングス	25,000	3,995.00	99,875,000
クリエイトSDホールディングス	14,000	2,618.00	36,652,000
丸善CHIホールディングス	11,100	351.00	3,896,100
ミサワ	2,100	455.00	955,500
ティーライフ	1,400	1,677.00	2,347,800
エー・ピーカンパニー	1,700	949.00	1,613,300
チムニー	2,900	2,797.00	8,111,300
シュッピン	3,700	1,866.00	6,904,200
ネクステージ	3,900	1,450.00	5,655,000
ジョイフル本田	15,400	3,480.00	53,592,000
鳥貴族	3,500	2,541.00	8,893,500
キリン堂ホールディングス	3,200	854.00	2,732,800
ホットランド	4,500	1,543.00	6,943,500
すかいらーく	40,700	1,766.00	71,876,200
綿半ホールディングス	3,800	2,120.00	8,056,000
ヨシックス	1,400	1,527.00	2,137,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,400	1,155.00	36,267,000
ブックオフコーポレーション	5,400	780.00	4,212,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,100	852.00	3,493,200
B E E N O S	1,700	1,465.00	2,490,500
あさひ	7,200	1,347.00	9,698,400
日本調剤	3,400	3,645.00	12,393,000
コスモス薬品	4,800	23,220.00	111,456,000
トーエル	4,600	883.00	4,061,800
一六堂	2,500	387.00	967,500
オンリー	1,600	917.00	1,467,200

セブン&アイ・ホールディングス	396,400	4,686.00	1,857,530,400
薬王堂	4,800	3,370.00	16,176,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,400	1,000.00	25,400,000
ツルハホールディングス	19,000	11,990.00	227,810,000
サンマルクホールディングス	6,100	3,360.00	20,496,000
フェリシモ	2,800	1,056.00	2,956,800
トリドールホールディングス	11,700	2,841.00	33,239,700
TOKYO BASE	1,300	3,785.00	4,920,500
サツドラホールディングス	1,300	2,043.00	2,655,900
ダイユー・リックホールディングス	3,100	776.00	2,405,600
パロックジャパンリミテッド	7,700	1,192.00	9,178,400
クスリのアオキホールディングス	7,500	5,270.00	39,525,000
スシローグローバルホールディングス	8,600	3,275.00	28,165,000
LIXILビバ	9,000	2,026.00	18,234,000
メディカルシステムネットワーク	10,900	492.00	5,362,800
総合メディカル	4,600	4,890.00	22,494,000
はるやまホールディングス	4,500	1,020.00	4,590,000
ノジマ	14,900	1,700.00	25,330,000
カップ・クリエイト	13,300	1,286.00	17,103,800
ライトオン	8,100	1,028.00	8,326,800
良品計画	12,600	29,110.00	366,786,000
三城ホールディングス	11,900	468.00	5,569,200
アドヴァン	9,700	1,165.00	11,300,500
アルビス	2,500	4,845.00	12,112,500
コナカ	12,300	597.00	7,343,100
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,552.00	1,862,400
G-7ホールディングス	2,900	2,262.00	6,559,800
イオン北海道	9,600	599.00	5,750,400
コジマ	16,400	304.00	4,985,600
ヒマラヤ	2,600	832.00	2,163,200
コーナン商事	13,500	2,122.00	28,647,000
エコス	3,800	1,196.00	4,544,800
マルシェ	2,200	835.00	1,837,000
ドンキホーテホールディングス	61,300	4,225.00	258,992,500
西松屋チェーン	16,700	1,183.00	19,756,100
ゼンショーホールディングス	49,100	2,062.00	101,244,200
幸楽苑ホールディングス	6,000	1,879.00	11,274,000
ハークスレイ	2,400	1,088.00	2,611,200
サイゼリヤ	14,000	3,185.00	44,590,000
V Tホールディングス	32,100	553.00	17,751,300
魚力	3,000	1,246.00	3,738,000
ポブラ	2,400	555.00	1,332,000

フジ・コーポレーション	1,600	1,899.00	3,038,400
ユニテッドアローズ	12,600	3,320.00	41,832,000
ハイデイ日高	10,400	2,395.00	24,908,000
京都きもの友禅	6,100	922.00	5,624,200
コロワイド	31,400	1,880.00	59,032,000
ピーシーデポコーポレーション	13,100	574.00	7,519,400
壱番屋	6,700	3,765.00	25,225,500
トップカルチャー	3,500	499.00	1,746,500
P L A N T	2,200	1,219.00	2,681,800
スギホールディングス	20,800	5,980.00	124,384,000
ヴィア・ホールディングス	7,300	964.00	7,037,200
スクロール	14,700	365.00	5,365,500
ヨンドシーホールディングス	9,600	2,678.00	25,708,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	41,600	6,090.00	253,344,000
木曽路	11,600	2,707.00	31,401,200
サトレストランシステムズ	11,200	905.00	10,136,000
千趣会	17,200	818.00	14,069,600
タカキュー	8,300	196.00	1,626,800
ケーヨー	16,300	782.00	12,746,600
上新電機	22,000	1,458.00	32,076,000
日本瓦斯	17,400	3,715.00	64,641,000
ベスト電器	31,400	157.00	4,929,800
ロイヤルホールディングス	15,600	2,450.00	38,220,000
いなげや	10,600	1,822.00	19,313,200
島忠	24,500	2,645.00	64,802,500
チヨダ	11,200	2,816.00	31,539,200
ライフコーポレーション	7,400	3,200.00	23,680,000
リンガーハット	10,700	2,404.00	25,722,800
MrMax	12,000	559.00	6,708,000
テンアライド	8,800	397.00	3,493,600
AOKIホールディングス	18,900	1,471.00	27,801,900
オークワ	14,000	1,255.00	17,570,000
コメリ	14,600	2,784.00	40,646,400
青山商事	19,800	3,915.00	77,517,000
しまむら	11,000	13,950.00	153,450,000
はせがわ	5,100	460.00	2,346,000
高島屋	159,000	1,116.00	177,444,000
松屋	21,600	977.00	21,103,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,600	1,921.00	93,360,600
近鉄百貨店	36,000	358.00	12,888,000
パルコ	9,100	1,214.00	11,047,400
丸井グループ	100,200	1,688.00	169,137,600

アクシアル リテイリング	7,300	4,230.00	30,879,000
イオン	389,700	1,692.50	659,567,250
イズミ	17,200	6,190.00	106,468,000
東武ストア	1,100	3,010.00	3,311,000
平和堂	19,200	2,378.00	45,657,600
フジ	10,500	2,790.00	29,295,000
ヤオコー	10,700	4,665.00	49,915,500
ゼビオホールディングス	12,900	1,833.00	23,645,700
ケーズホールディングス	40,100	2,231.00	89,463,100
Olympicグループ	5,800	593.00	3,439,400
日産東京販売ホールディングス	14,500	410.00	5,945,000
アインホールディングス	12,400	8,110.00	100,564,000
元気寿司	2,400	2,230.00	5,352,000
ヤマダ電機	316,800	564.00	178,675,200
アークランドサカモト	16,200	1,452.00	23,522,400
ニトリホールディングス	40,900	16,520.00	675,668,000
グルメ杵屋	7,000	1,092.00	7,644,000
愛眼	6,900	203.00	1,400,700
ケーユーホールディングス	5,000	984.00	4,920,000
吉野家ホールディングス	33,000	1,818.00	59,994,000
松屋フーズ	4,600	4,190.00	19,274,000
サガミチェーン	11,900	1,393.00	16,576,700
関西スーパーマーケット	7,900	1,525.00	12,047,500
王将フードサービス	6,900	4,170.00	28,773,000
プレナス	10,600	2,331.00	24,708,600
ミニストップ	7,000	2,206.00	15,442,000
アークス	17,700	2,401.00	42,497,700
パローホールディングス	20,400	2,488.00	50,755,200
藤久	800	1,745.00	1,396,000
ベルク	4,200	5,330.00	22,386,000
大庄	5,100	1,767.00	9,011,700
ファーストリテイリング	15,800	36,890.00	582,862,000
サンドラッグ	36,000	4,175.00	150,300,000
サクスパー ホールディングス	9,100	1,183.00	10,765,300
ヤマザワ	2,000	1,781.00	3,562,000
やまや	2,000	1,620.00	3,240,000
ベルーナ	20,400	1,270.00	25,908,000
島根銀行	2,000	1,304.00	2,608,000
じもとホールディングス	67,900	199.00	13,512,100
めぶきフィナンシャルグループ	456,700	424.00	193,640,800
東京TYフィナンシャルグループ	13,700	2,982.00	40,853,400
九州フィナンシャルグループ	155,300	695.00	107,933,500

ゆうちょ銀行	268,100	1,413.00	378,825,300
富山第一銀行	24,200	505.00	12,221,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	613,800	543.70	333,723,060
西日本フィナンシャルホールディングス	64,200	1,122.00	72,032,400
新生銀行	901,000	191.00	172,091,000
あおぞら銀行	599,000	427.00	255,773,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,170,200	733.30	5,257,907,660
りそなホールディングス	1,107,900	595.20	659,422,080
三井住友トラスト・ホールディングス	197,500	3,861.00	762,547,500
三井住友フィナンシャルグループ	758,300	4,256.00	3,227,324,800
第四銀行	116,000	512.00	59,392,000
北越銀行	10,200	2,668.00	27,213,600
千葉銀行	365,000	785.00	286,525,000
群馬銀行	210,400	628.00	132,131,200
武蔵野銀行	15,100	3,420.00	51,642,000
千葉興業銀行	26,100	589.00	15,372,900
筑波銀行	39,600	334.00	13,226,400
七十七銀行	148,000	515.00	76,220,000
青森銀行	73,000	392.00	28,616,000
秋田銀行	61,000	333.00	20,313,000
山形銀行	53,000	490.00	25,970,000
岩手銀行	6,200	4,435.00	27,497,000
東邦銀行	85,000	395.00	33,575,000
東北銀行	48,000	150.00	7,200,000
みちのく銀行	57,000	184.00	10,488,000
ふくおかフィナンシャルグループ	384,000	527.00	202,368,000
静岡銀行	250,000	940.00	235,000,000
十六銀行	127,000	346.00	43,942,000
スルガ銀行	96,800	2,582.00	249,937,600
八十二銀行	182,700	674.00	123,139,800
山梨中央銀行	59,000	456.00	26,904,000
大垣共立銀行	146,000	320.00	46,720,000
福井銀行	81,000	280.00	22,680,000
北國銀行	101,000	420.00	42,420,000
清水銀行	3,200	3,550.00	11,360,000
富山銀行	1,800	4,330.00	7,794,000
滋賀銀行	89,000	585.00	52,065,000
南都銀行	10,800	3,200.00	34,560,000
百五銀行	85,000	458.00	38,930,000
京都銀行	169,000	1,009.00	170,521,000
紀陽銀行	35,600	1,921.00	68,387,600
三重銀行	4,200	2,390.00	10,038,000

ほくほくフィナンシャルグループ	63,000	1,691.00	106,533,000
広島銀行	279,000	472.00	131,688,000
山陰合同銀行	56,100	893.00	50,097,300
中国銀行	67,100	1,613.00	108,232,300
鳥取銀行	3,000	1,693.00	5,079,000
伊予銀行	135,100	842.00	113,754,200
百十四銀行	104,000	362.00	37,648,000
四国銀行	73,000	311.00	22,703,000
阿波銀行	81,000	766.00	62,046,000
大分銀行	54,000	434.00	23,436,000
宮崎銀行	63,000	381.00	24,003,000
佐賀銀行	57,000	275.00	15,675,000
十八銀行	58,000	312.00	18,096,000
沖縄銀行	9,200	4,390.00	40,388,000
琉球銀行	19,500	1,520.00	29,640,000
セブン銀行	355,000	424.00	150,520,000
みずほフィナンシャルグループ	12,858,200	200.70	2,580,640,740
高知銀行	34,000	132.00	4,488,000
山口フィナンシャルグループ	89,000	1,313.00	116,857,000
長野銀行	3,100	1,975.00	6,122,500
名古屋銀行	7,700	4,145.00	31,916,500
北洋銀行	154,600	393.00	60,757,800
愛知銀行	3,200	6,380.00	20,416,000
第三銀行	5,400	1,674.00	9,039,600
中京銀行	3,900	2,306.00	8,993,400
大光銀行	32,000	230.00	7,360,000
愛媛銀行	12,000	1,411.00	16,932,000
トマト銀行	3,700	1,566.00	5,794,200
みなと銀行	8,600	2,078.00	17,870,800
京葉銀行	77,000	477.00	36,729,000
関西アーバン銀行	13,200	1,294.00	17,080,800
栃木銀行	52,300	482.00	25,208,600
北日本銀行	2,900	3,130.00	9,077,000
東和銀行	177,000	130.00	23,010,000
福島銀行	103,000	87.00	8,961,000
大東銀行	49,000	166.00	8,134,000
トモニホールディングス	78,100	555.00	43,345,500
フィデアホールディングス	91,900	186.00	17,093,400
池田泉州ホールディングス	100,500	464.00	46,632,000
F P G	34,700	988.00	34,283,600
S B I ホールディングス	107,100	1,451.00	155,402,100
ジャフコ	15,800	4,310.00	68,098,000

大和証券グループ本社	861,000	663.20	571,015,200
野村ホールディングス	1,936,200	685.40	1,327,071,480
岡三証券グループ	81,000	688.00	55,728,000
丸三証券	30,200	896.00	27,059,200
東洋証券	34,000	247.00	8,398,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	108,700	596.00	64,785,200
光世証券	26,000	161.00	4,186,000
水戸証券	29,600	314.00	9,294,400
いちよし証券	21,200	925.00	19,610,000
松井証券	54,100	916.00	49,555,600
だいこう証券ビジネス	5,600	630.00	3,528,000
マネックスグループ	103,600	278.00	28,800,800
カブドットコム証券	70,700	364.00	25,734,800
極東証券	12,700	1,687.00	21,424,900
岩井コスモホールディングス	9,000	1,226.00	11,034,000
藍澤証券	17,900	674.00	12,064,600
マネーパートナーズグループ	13,500	512.00	6,912,000
かんぽ生命保険	35,800	2,473.00	88,533,400
S O M P Oホールディングス	198,000	4,389.00	869,022,000
アニコム ホールディングス	6,400	2,274.00	14,553,600
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	283,000	3,967.00	1,122,661,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	90,700	1,824.00	165,436,800
第一生命ホールディングス	571,100	1,993.00	1,138,202,300
東京海上ホールディングス	381,400	4,955.00	1,889,837,000
T & Dホールディングス	345,200	1,711.50	590,809,800
アドバンスクリエイト	2,200	1,917.00	4,217,400
全国保証	26,700	4,560.00	121,752,000
クレディセゾン	71,800	2,183.00	156,739,400
アクリーティブ	7,800	387.00	3,018,600
芙蓉総合リース	10,800	5,910.00	63,828,000
興銀リース	17,800	2,553.00	45,443,400
東京センチュリー	19,100	4,325.00	82,607,500
日本証券金融	41,700	571.00	23,810,700
アイフル	158,800	378.00	60,026,400
ポケットカード	7,100	733.00	5,204,300
リコーリース	7,400	3,495.00	25,863,000
イオンフィナンシャルサービス	60,500	2,241.00	135,580,500
アコム	190,200	498.00	94,719,600
ジャックス	52,000	502.00	26,104,000
オリエントコーポレーション	204,800	192.00	39,321,600
日立キャピタル	22,300	2,622.00	58,470,600
アプラスフィナンシャル	45,700	108.00	4,935,600

オリックス	670,700	1,733.50	1,162,658,450
三菱UFJリース	240,200	570.00	136,914,000
日本取引所グループ	294,500	1,954.00	575,453,000
イー・ギャランティ	2,800	2,704.00	7,571,200
アサックス	1,600	1,678.00	2,684,800
NECキャピタルソリューション	3,800	1,698.00	6,452,400
いちご	90,100	332.00	29,913,200
日本駐車場開発	114,200	162.00	18,500,400
ヒューリック	197,600	1,040.00	205,504,000
三栄建築設計	3,900	1,620.00	6,318,000
野村不動産ホールディングス	63,500	2,313.00	146,875,500
三重交通グループホールディングス	16,900	390.00	6,591,000
サムティ	7,600	1,180.00	8,968,000
ディア・ライフ	8,400	407.00	3,418,800
エー・ディー・ワークス	88,500	41.00	3,628,500
日本商業開発	5,400	1,611.00	8,699,400
プレサンスコーポレーション	14,700	1,386.00	20,374,200
ユニゾホールディングス	7,800	2,874.00	22,417,200
THEグローバル社	4,400	620.00	2,728,000
日本管理センター	7,000	1,326.00	9,282,000
サンセイランディック	2,300	778.00	1,789,400
エストラスト	2,000	689.00	1,378,000
フージャースホールディングス	12,200	928.00	11,321,600
オープンハウス	15,400	3,400.00	52,360,000
東急不動産ホールディングス	229,100	661.00	151,435,100
飯田グループホールディングス	79,000	1,874.00	148,046,000
ムゲンエステート	4,400	890.00	3,916,000
ファーストブラザーズ	1,300	1,502.00	1,952,600
ハウズドゥ	1,500	1,760.00	2,640,000
シーアールイー	1,600	1,656.00	2,649,600
ケイアイスター不動産	2,700	1,989.00	5,370,300
パーク24	48,100	2,875.00	138,287,500
パラカ	3,000	2,001.00	6,003,000
三井不動産	502,200	2,619.00	1,315,261,800
三菱地所	704,400	2,088.00	1,470,787,200
平和不動産	17,900	1,805.00	32,309,500
東京建物	109,900	1,536.00	168,806,400
ダイビル	24,400	1,139.00	27,791,600
京阪神ビルディング	15,800	660.00	10,428,000
住友不動産	227,000	3,419.00	776,113,000
大京	177,000	223.00	39,471,000
テーオーシー	37,000	1,052.00	38,924,000

東京楽天地	16,000	566.00	9,056,000
レオパレス21	119,600	649.00	77,620,400
スターツコーポレーション	12,900	2,632.00	33,952,800
フジ住宅	12,100	715.00	8,651,500
空港施設	11,500	589.00	6,773,500
明和地所	5,200	830.00	4,316,000
ゴールドクレスト	8,500	2,307.00	19,609,500
日本エスリード	3,700	1,953.00	7,226,100
日神不動産	11,300	565.00	6,384,500
日本エスコン	16,600	460.00	7,636,000
タカラレーベン	40,600	517.00	20,990,200
サンヨーハウジング名古屋	5,100	1,043.00	5,319,300
イオンモール	61,000	2,151.00	131,211,000
ファースト住建	3,500	1,559.00	5,456,500
トーセイ	12,900	785.00	10,126,500
穴吹興産	1,000	2,981.00	2,981,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	58,800	1,082.00	63,621,600
サンフロンティア不動産	10,200	1,149.00	11,719,800
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	796.00	6,845,600
インテリックス	2,900	838.00	2,430,200
ランドビジネス	5,600	297.00	1,663,200
グランディハウス	8,300	430.00	3,569,000
日本空港ビルデング	30,200	4,450.00	134,390,000
日本工営	6,700	3,110.00	20,837,000
L i f u l l	24,900	728.00	18,127,200
ジェイエイシーリクルートメント	6,200	1,681.00	10,422,200
日本M&Aセンター	28,900	4,265.00	123,258,500
メンバーズ	2,600	724.00	1,882,400
中広	1,300	722.00	938,600
タケエイ	8,900	1,092.00	9,718,800
トラスト・テック	4,100	2,108.00	8,642,800
コシダカホールディングス	4,800	2,619.00	12,571,200
パソナグループ	7,600	937.00	7,121,200
C D S	2,300	1,379.00	3,171,700
リンクアンドモチベーション	23,700	859.00	20,358,300
G C A	8,900	919.00	8,179,100
エス・エム・エス	14,200	3,225.00	45,795,000
テンブホールディングス	77,600	2,103.00	163,192,800
リニカル	5,900	1,723.00	10,165,700
クックパッド	22,400	869.00	19,465,600
エスクリ	4,100	715.00	2,931,500
アイ・ケイ・ケイ	4,800	771.00	3,700,800

学情	4,200	1,244.00	5,224,800
スタジオアリス	4,100	2,323.00	9,524,300
シミックホールディングス	5,300	1,396.00	7,398,800
N J S	2,300	1,385.00	3,185,500
総合警備保障	36,500	5,310.00	193,815,000
カカクコム	71,500	1,573.00	112,469,500
アイロムグループ	3,100	1,491.00	4,622,100
セントケア・ホールディング	1,500	1,616.00	2,424,000
サイネックス	1,100	980.00	1,078,000
ルネサンス	5,300	1,990.00	10,547,000
ディップ	13,000	2,398.00	31,174,000
オプトホールディング	7,400	1,458.00	10,789,200
ツクイ	24,100	668.00	16,098,800
キャリアデザインセンター	2,100	1,386.00	2,910,600
エムスリー	86,800	3,110.00	269,948,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,800	570.00	4,446,000
プラス	700	1,120.00	784,000
アウトソーシング	6,500	5,420.00	35,230,000
ウェルネット	7,600	1,484.00	11,278,400
ワールドホールディングス	3,100	2,413.00	7,480,300
ディー・エヌ・エー	45,000	2,539.00	114,255,000
博報堂D Yホールディングス	139,000	1,463.00	203,357,000
ぐるなび	14,500	1,796.00	26,042,000
エスアールジータカミヤ	11,400	551.00	6,281,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	268.00	3,055,200
ファンコミュニケーションズ	25,500	963.00	24,556,500
ライク	1,900	3,240.00	6,156,000
ビジネス・ブレークスルー	4,400	394.00	1,733,600
W D Bホールディングス	3,600	2,238.00	8,056,800
ティア	5,100	786.00	4,008,600
C D G	700	1,791.00	1,253,700
バリューコマース	9,400	611.00	5,743,400
インフォマート	42,600	867.00	36,934,200
J Pホールディングス	29,800	292.00	8,701,600
E P Sホールディングス	13,800	1,686.00	23,266,800
レッグス	2,300	771.00	1,773,300
プレステージ・インターナショナル	19,000	1,132.00	21,508,000
アミューズ	5,600	3,010.00	16,856,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,064.00	6,398,400
クイック	5,200	1,452.00	7,550,400
T A C	7,300	237.00	1,730,100
ケネディクス	127,200	565.00	71,868,000

電通	111,700	5,430.00	606,531,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	790.00	3,950,000
ぴあ	3,100	3,585.00	11,113,500
イオンファンタジー	3,000	3,155.00	9,465,000
シーティーエス	5,400	1,163.00	6,280,200
ネクシィーズグループ	3,600	1,688.00	6,076,800
みらかホールディングス	25,600	4,870.00	124,672,000
アルプス技研	4,000	3,705.00	14,820,000
ダイオーズ	1,900	1,224.00	2,325,600
日本空調サービス	10,100	657.00	6,635,700
オリエンタルランド	108,400	7,529.00	816,143,600
ダスキン	24,700	2,885.00	71,259,500
明光ネットワークジャパン	11,600	1,420.00	16,472,000
ファルコホールディングス	4,800	1,511.00	7,252,800
ラウンドワン	31,300	1,069.00	33,459,700
リゾートトラスト	38,800	2,132.00	82,721,600
ビー・エム・エル	13,100	2,244.00	29,396,400
ワタベウェディング	1,700	548.00	931,600
りらいあコミュニケーションズ	16,600	1,213.00	20,135,800
リソー教育	17,100	928.00	15,868,800
早稲田アカデミー	1,300	1,352.00	1,757,600
ユー・エス・エス	121,400	2,223.00	269,872,200
東京個別指導学院	3,300	1,468.00	4,844,400
サイバーエージェント	60,300	3,610.00	217,683,000
楽天	512,400	1,350.50	691,996,200
クリーク・アンド・リバー社	4,800	1,007.00	4,833,600
テー・オー・ダブリュー	8,100	838.00	6,787,800
セントラルスポーツ	3,400	4,265.00	14,501,000
フルキャストホールディングス	10,400	1,323.00	13,759,200
リソルホールディングス	11,000	368.00	4,048,000
テクノプロ・ホールディングス	16,300	4,450.00	72,535,000
アトラ	1,700	716.00	1,217,200
インターワークス	2,100	1,138.00	2,389,800
Keeper 技研	1,500	2,635.00	3,952,500
ファーストロジック	700	2,889.00	2,022,300
三機サービス	1,100	1,339.00	1,472,900
デザインワン・ジャパン	1,800	1,466.00	2,638,800
イー・ガーディアン	4,700	1,998.00	9,390,600
リブセンス	6,800	606.00	4,120,800
ジャパンマテリアル	7,300	2,101.00	15,337,300
ベクトル	8,200	1,747.00	14,325,400
ウチヤマホールディングス	5,200	453.00	2,355,600

サクセスホールディングス	1,200	1,415.00	1,698,000	
キャリアリンク	2,700	610.00	1,647,000	
I B J	8,000	684.00	5,472,000	
アサンテ	3,700	1,805.00	6,678,500	
N・フィールド	4,800	1,387.00	6,657,600	
バリューHR	1,100	2,903.00	3,193,300	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	5,480.00	9,316,000	
ライドオン・エクスプレス	2,600	888.00	2,308,800	
E R Iホールディングス	2,900	835.00	2,421,500	
アビスト	1,300	3,705.00	4,816,500	
ウィルグループ	4,100	926.00	3,796,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,300	2,098.00	4,825,400	
日本ビューホテル	2,200	1,376.00	3,027,200	
リクルートホールディングス	219,000	5,910.00	1,294,290,000	
エラン	1,400	2,576.00	3,606,400	
土木管理総合試験所	1,700	698.00	1,186,600	
日本郵政	261,600	1,359.00	355,514,400	
ベルシステム24ホールディングス	15,600	1,068.00	16,660,800	
一蔵	1,200	1,090.00	1,308,000	
L I T A L I C O	1,200	1,578.00	1,893,600	
エボラブルアジア	1,900	2,933.00	5,572,700	
ソラスト	6,400	1,440.00	9,216,000	
リログループ	50,200	2,184.00	109,636,800	
東祥	2,900	5,450.00	15,805,000	
エイチ・アイ・エス	16,400	3,290.00	53,956,000	
ラックランド	1,900	2,175.00	4,132,500	
共立メンテナンス	16,300	3,490.00	56,887,000	
イチネンホールディングス	10,500	1,180.00	12,390,000	
建設技術研究所	6,400	1,159.00	7,417,600	
スペース	5,400	1,482.00	8,002,800	
燦ホールディングス	2,100	2,034.00	4,271,400	
スバル興業	7,000	595.00	4,165,000	
東京テアトル	38,000	142.00	5,396,000	
タナベ経営	2,000	1,381.00	2,762,000	
ナガワ	1,800	3,995.00	7,191,000	
よみうりランド	20,000	488.00	9,760,000	
東京都競馬	69,000	272.00	18,768,000	
カナモト	14,000	3,585.00	50,190,000	
東京ドーム	40,300	1,036.00	41,750,800	
西尾レントオール	8,100	3,365.00	27,256,500	
トランス・コスモス	11,700	2,305.00	26,968,500	
乃村工藝社	21,500	2,417.00	51,965,500	

藤田観光	34,000	366.00	12,444,000	
KNT-CTホールディングス	57,000	148.00	8,436,000	
日本管財	8,600	1,892.00	16,271,200	
トーカイ	4,400	4,375.00	19,250,000	
白洋舎	1,100	3,030.00	3,333,000	
セコム	104,300	8,465.00	882,899,500	
セントラル警備保障	4,500	1,993.00	8,968,500	
丹青社	17,400	1,140.00	19,836,000	
メイテック	11,600	4,650.00	53,940,000	
アサツー ディ・ケイ	16,200	2,836.00	45,943,200	
応用地質	9,500	1,534.00	14,573,000	
船井総研ホールディングス	12,700	2,593.00	32,931,100	
進学会	4,200	574.00	2,410,800	
オオバ	8,400	509.00	4,275,600	
いであ	1,900	1,073.00	2,038,700	
学究社	2,800	1,521.00	4,258,800	
ベネッセホールディングス	33,600	4,045.00	135,912,000	
イオンディライト	11,300	3,570.00	40,341,000	
ナック	6,400	977.00	6,252,800	
ニチイ学館	17,800	1,063.00	18,921,400	
ダイセキ	17,500	2,387.00	41,772,500	
ステップ	3,400	1,413.00	4,804,200	
合 計	143,754,610		222,542,633,840	

(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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	平成29年 6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	平成29年 6月12日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	8,181,015,153
金銭信託	106,188,928
コール・ローン	994,561,235
株式	191,181,239,728
投資信託受益証券	165,425,706
投資証券	4,937,917,747
派生商品評価勘定	244,790,902
未収入金	3,466,792
未収配当金	410,836,368
差入委託証拠金	1,477,144,106
流動資産合計	207,702,586,665
資産合計	207,702,586,665
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,340,808
前受金	233,008,198
未払解約金	276,045,800
未払利息	2,444
その他未払費用	1,872
流動負債合計	552,399,122
負債合計	552,399,122
純資産の部	
元本等	
元本	87,969,112,695
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,181,074,848
元本等合計	207,150,187,543
純資産合計	207,150,187,543
負債純資産合計	207,702,586,665

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

平成29年 6月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 6月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	87,969,112,695口

		平成29年 6月12日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3548円 (23,548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29年 6月12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29年 6月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		

	平成29年 6月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 6月11日
期首元本額	111,407,571,420円
期中追加設定元本額	7,730,090,204円
期中一部解約元本額	31,168,548,929円
期末元本額	87,969,112,695円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,113,818,506円
D C 外国株式インデックスファンド	4,464,863,038円
D C 外国株式インデックスファンド L	18,347,300,689円
D C バランスファンド 3 0	662,573,764円
D C バランスファンド 5 0	1,337,592,600円

区分	平成29年 6月12日現在
DCバランスファンド70	742,683,564円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	468,843,487円
外国株式インデックスe	6,306,023,119円
インデックスコレクション（外国株式）	4,401,333,918円
インデックスコレクション（バランス株式30）	1,612,136,751円
インデックスコレクション（バランス株式50）	577,044,431円
インデックスコレクション（バランス株式70）	515,610,862円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,399,819,121円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,241,405,800円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,493,945,724円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	225,052,309円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	2,238,042,612円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	139,646,803円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	647,415,918円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	20,284,402円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	3,840,481,898円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	906,464,524円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	532,977,801円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	10,111,983,391円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	938,022,975円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	4,975,300,299円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,506,538,988円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	44,528,543円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	481,582,184円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	82,502,532円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	213,564,506円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	639,623,468円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	36,393,226円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	994,556,126円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	25,011,321円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	184,059,504円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	479,306,777円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	20,777,214円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	11,551,583,916
投資信託受益証券	14,212,065
投資証券	229,043,461

合計	11,794,839,442
----	----------------

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」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29年 6月12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	10,559,718,916	-	10,792,727,114	233,008,198
	合計	10,559,718,916	-	10,792,727,114	233,008,198

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成29年 6月12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	1,000,228,794	-	968,843,010	31,385,784
	アメリカドル	762,455,094	-	736,313,010	26,142,084
	ユーロ	149,112,600	-	148,212,000	900,600
	イギリスポンド	88,661,100	-	84,318,000	4,343,100
	売建	235,064,880	-	235,237,200	172,320
	アメリカドル	189,397,560	-	189,573,200	175,640
	カナダドル	14,748,696	-	14,747,400	1,296
	イギリスポンド	30,918,624	-	30,916,600	2,024
	合計	1,235,293,674	-	1,204,080,210	31,558,104

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	29,804	47.98	1,429,995.92	
	ANTERO RESOURCES CORP	8,092	21.50	173,978.00	
	APACHE CORP	20,175	48.34	975,259.50	
	BAKER HUGHES	21,381	55.53	1,187,286.93	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,594	22.88	562,710.72	
	CHENIERE ENERGY INC	10,538	49.25	518,996.50	
	CHEVRON CORP	99,457	106.40	10,582,224.80	
	CIMAREX ENERGY CO	5,025	99.89	501,947.25	
	CONCHO RESOURCES INC	7,763	123.88	961,680.44	
	CONOCOPHILLIPS	66,184	44.82	2,966,366.88	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,386	35.24	189,802.64	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,155	106.71	229,960.05	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,055	32.58	816,291.90	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,750	90.15	428,212.50	
	EOG RESOURCES INC	30,786	90.08	2,773,202.88	
	EQT CORPORATION	8,816	56.49	498,015.84	
	EXXON MOBIL	217,993	82.13	17,903,765.09	
	HALLIBURTON CO	46,130	44.85	2,068,930.50	
	HELMERICH & PAYNE	6,339	53.27	337,678.53	
	HESS CORP	15,109	45.49	687,308.41	
	HOLLYFRONTIER CORP	10,931	25.66	280,489.46	
	KINDER MORGAN INC	101,244	19.08	1,931,735.52	
	MARATHON OIL CORP	44,903	12.54	563,083.62	
	MARATHON PETROLEUM CORP	28,113	54.71	1,538,062.23	
	MURPHY OIL CORP	9,351	25.21	235,738.71	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	20,041	34.21	685,602.61	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	11,699	30.06	351,671.94	
	NOBLE ENERGY INC	22,795	29.12	663,790.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,797	61.01	2,489,024.97	
	ONEOK INC	11,140	49.45	550,873.00	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	12,200	28.05	342,210.00	
	PHILLIPS 66	22,938	79.57	1,825,176.66	
PIONEER NATURAL RESOURCES	9,047	169.45	1,533,014.15		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,984	26.27	130,929.68		
RANGE RESOURCES CORP	11,219	23.17	259,944.23		

SCHLUMBERGER	73,117	69.68	5,094,792.56
TARGA RESOURCES CORP	10,350	45.77	473,719.50
TECHNIPFMC PLC	23,499	28.54	670,661.46
TESORO CORP	6,913	91.78	634,475.14
VALERO ENERGY CORP	24,125	65.26	1,574,397.50
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	48,849	4.46	217,866.54
WILLIAMS COS	43,439	29.39	1,276,672.21
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,960	145.85	1,598,516.00
ALBEMARLE CORP	5,954	115.40	687,091.60
AVERY DENNISON CORP	5,207	84.09	437,856.63
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	33.59	364,249.96
BALL CORP	17,586	40.28	708,364.08
CELANESE CORP-SERIES A	7,587	90.12	683,740.44
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,239	27.25	333,512.75
CROWN HOLDINGS INC	7,348	57.36	421,481.28
DOW CHEMICAL CO	63,565	64.74	4,115,198.10
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	45,275	82.90	3,753,297.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,768	82.56	641,326.08
ECOLAB INC	13,990	133.81	1,872,001.90
FMC CORP	7,713	76.62	590,970.06
FREEMONT-MCMORAN INC	68,713	12.36	849,292.68
INT'L PAPER CO	20,773	54.89	1,140,229.97
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,198	137.20	575,965.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,465	81.88	1,511,914.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,194	234.82	750,015.08
MONSANTO CO	23,394	117.52	2,749,262.88
MOSAIC CO/THE	17,569	23.51	413,047.19
NEWMONT MINING CORP	28,196	34.30	967,122.80
NUCOR CORP	16,931	59.79	1,012,304.49
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,966	104.95	521,181.70
PPG INDUSTRIES INC	13,368	109.93	1,469,544.24
PRAXAIR INC	15,218	136.19	2,072,539.42
SEALED AIR CORP	9,792	44.14	432,218.88
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,205	352.91	1,483,986.55
STEEL DYNAMICS INC	12,240	36.03	441,007.20
VULCAN MATERIALS CO	7,023	130.33	915,307.59
WESTROCK CO	13,307	57.30	762,491.10
WR GRACE & CO	3,649	70.65	257,801.85
3 M COMPANY	31,288	206.93	6,474,425.84
ACUITY BRANDS INC	2,326	177.18	412,120.68
AERCAP HOLDINGS NV	7,756	45.41	352,199.96
AGCO CORP	3,843	67.21	258,288.03

ALLEGION PLC	4,805	77.23	371,090.15
AMETEK INC	12,258	62.38	764,654.04
ARCONIC INC	20,136	27.36	550,920.96
BOEING CO	30,527	190.03	5,801,045.81
CATERPILLAR	31,244	105.92	3,309,364.48
CUMMINS INC	8,511	159.23	1,355,206.53
DEERE&CO	14,242	125.95	1,793,779.90
DOVER CORP	8,227	83.02	683,005.54
EATON CORP	24,084	75.74	1,824,122.16
EMERSON ELECTRIC CO	34,290	60.71	2,081,745.90
FASTENAL CO	15,334	43.52	667,335.68
FLOWSERVE CORP	7,966	47.30	376,791.80
FLUOR CORP	8,177	46.35	379,003.95
FORTIVE CORP	16,538	63.09	1,043,382.42
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,144	63.31	515,596.64
GENERAL DYNAMICS CORP	13,456	199.47	2,684,068.32
GENERAL ELECTRIC CO	458,499	27.94	12,810,462.06
GRAINGER (WW) INC	2,999	176.33	528,813.67
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10,197	31.51	321,307.47
HONEYWELL INTL INC	37,924	133.79	5,073,851.96
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,490	193.47	481,740.30
IDEX CORP	3,855	110.99	427,866.45
ILLINOIS TOOL WORKS	16,290	144.80	2,358,792.00
INGERSOLL-RAND PLC	13,741	88.11	1,210,719.51
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,073	54.95	388,661.35
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,900	66.60	725,940.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	12,000	42.40	508,800.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	49,975	42.07	2,102,448.25
L3 TECHNOLOGIES INC	4,096	166.29	681,123.84
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,937	178.66	346,064.42
LOCKHEED MARTIN CORP	13,689	277.00	3,791,853.00
MASCO CORP	16,388	37.22	609,961.36
MIDDLEBY CORP	3,030	130.95	396,778.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,934	256.69	2,293,268.46
PACCAR INC	18,660	64.01	1,194,426.60
PARKER HANNIFIN CORP	7,097	157.04	1,114,512.88
PENTAIR PLC	9,130	66.26	604,953.80
RAYTHEON COMPANY	15,673	160.94	2,522,412.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,819	162.13	1,105,564.47
ROCKWELL COLLIN	8,737	104.99	917,297.63
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,396	228.84	1,234,820.64
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,985	42.18	378,987.30

SMITH (A.O.) CORP	8,653	56.04	484,914.12
SNAP-ON INC	2,943	157.51	463,551.93
STANLEY BLACK&DECKER	8,013	139.99	1,121,739.87
TEXTRON	14,314	47.29	676,909.06
TRANSDIGM GROUP INC	2,824	269.93	762,282.32
UNITED RENTALS INC	4,452	110.22	490,699.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	40,145	120.64	4,843,092.80
WABCO HOLDINGS INC	2,741	124.21	340,459.61
WABTEC CORP	4,324	86.07	372,166.68
XYLEM INC	9,461	53.97	510,610.17
CINTAS CORP	4,438	123.70	548,980.60
EQUIFAX INC	6,359	135.52	861,771.68
IHS MARKIT LTD	19,029	46.32	881,423.28
MANPOWER GROUP	3,912	104.65	409,390.80
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,961	37.67	714,260.87
REPUBLIC SERVICES INC	12,626	63.94	807,306.44
ROBERT HALF INTL INC	6,347	47.25	299,895.75
ROLLINS INC	4,760	42.47	202,157.20
STERICYCLE INC	4,468	79.01	353,016.68
VERISK ANALYTICS INC	8,428	80.07	674,829.96
WASTE CONNECTIONS INC	9,310	95.54	889,477.40
WASTE MANAGEMENT INC	23,564	72.65	1,711,924.60
AMERCO	376	358.11	134,649.36
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,277	50.27	315,544.79
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,489	67.86	508,203.54
CSX CORP	48,432	53.05	2,569,317.60
DELTA AIR LINES INC	9,273	53.01	491,561.73
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,151	54.81	501,566.31
FEDEX CORP	13,479	206.40	2,782,065.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,727	88.46	418,150.42
KANSAS CITY SOUTHERN	5,677	99.59	565,372.43
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	3,900	76.25	297,375.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,566	118.92	1,851,108.72
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,809	59.46	464,323.14
UNION PACIFIC CORP	42,669	109.75	4,682,922.75
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,613	78.83	363,642.79
UNITED PARCEL SERVICE B	36,106	107.03	3,864,425.18
AUTOLIV INC	4,653	111.94	520,856.82
BORGWARNER INC	10,770	42.96	462,679.20
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	14,411	85.69	1,234,878.59
FORD MOTOR COMPANY	197,869	11.13	2,202,281.97
GENERAL MOTORS CO	70,421	34.34	2,418,257.14

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	13,776	35.45	488,359.20
HARLEY-DAVIDSON	9,347	53.28	498,008.16
LEAR CORP	3,994	145.63	581,646.22
TESLA INC	6,864	357.32	2,452,644.48
COACH INC	14,838	46.72	693,231.36
DR HORTON INC	18,752	33.62	630,442.24
GARMIN LTD	6,761	51.89	350,828.29
HANESBRANDS INC	19,888	22.07	438,928.16
HASBRO INC	5,941	107.90	641,033.90
LEGGETT & PLATT INC	7,015	52.17	365,972.55
LENNAR CORP-CL A	11,135	52.00	579,020.00
LULULEMON ATHLETICA INC	5,051	51.70	261,136.70
MATTEL INC	18,030	22.27	401,528.10
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	8,077	35.70	288,348.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,344	240.16	803,095.04
NEWELL BRANDS INC	25,059	53.24	1,334,141.16
NIKE B	69,409	53.46	3,710,605.14
NVR INC	179	2,376.09	425,320.11
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	87.41	257,160.22
PULTE GROUP INC	15,636	23.44	366,507.84
PVH CORP	4,007	105.59	423,099.13
RALPH LAUREN CORPORATION	3,612	70.15	253,381.80
TOLL BROTHERS INC	8,145	37.84	308,206.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,148	21.88	243,918.24
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,227	20.21	226,897.67
VF CORP	17,586	55.33	973,033.38
WHIRLPOOL CORP	3,979	190.98	759,909.42
ARAMARK	12,256	39.54	484,602.24
BLOCK H & R INC	10,235	26.19	268,054.65
CARNIVAL CORPORATION	18,586	63.34	1,177,237.24
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,327	460.85	611,547.95
DARDEN RESTAURANTS INC	6,174	92.12	568,748.88
DOMINO'S PIZZA INC	2,536	206.19	522,897.84
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,476	64.75	678,321.00
LAS VEGAS SANDS CORP	20,593	63.69	1,311,568.17
MARRIOTT INTL A	16,995	102.42	1,740,627.90
MCDONALD'S CORP	43,586	151.48	6,602,407.28
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	11,411	22.53	257,089.83
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,294	31.98	776,922.12
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	8,374	51.13	428,162.62
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,118	109.82	1,001,338.76
STARBUCKS CORP	77,416	62.19	4,814,501.04

VAIL RESORTS INC	2,021	202.10	408,444.10
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	5,351	98.90	529,213.90
WYNN RESORTS LTD	4,295	129.59	556,589.05
YUM BRANDS INC	17,449	73.10	1,275,521.90
CBS CORP-CL B	19,291	60.71	1,171,156.61
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,269	332.84	3,750,773.96
COMCAST CORP-CL A	248,630	40.69	10,116,754.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,886	26.10	205,824.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,985	25.27	328,130.95
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,018	65.02	781,410.36
INTERPUBLIC GROUP OF COS	19,962	24.07	480,485.34
LIBERTY BROADBAND-C	5,651	86.82	490,619.82
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,871	29.35	377,763.85
LIBERTY GLOBAL PLC-C	32,293	28.24	911,954.32
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	10,552	40.08	422,924.16
LIBERTY SIRIUSXM-A	4,837	40.25	194,689.25
NEWS CORP-CLASS A	22,501	13.65	307,138.65
OMNICOM GROUP	12,545	81.50	1,022,417.50
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,724	67.20	317,452.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	83,565	5.20	434,538.00
THE WALT DISNEY CO	83,051	105.62	8,771,846.62
TIME WARNER INC	40,965	99.19	4,063,318.35
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	56,353	28.16	1,586,900.48
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	23,286	27.70	645,022.20
VIACOM INC-CLASS B	18,443	35.40	652,882.20
ADVANCE AUTO PARTS	3,895	128.36	499,962.20
AMAZON.COM	21,327	978.31	20,864,417.37
AUTONATION INC	4,199	40.65	170,689.35
AUTOZONE INC	1,536	606.36	931,368.96
BED BATH & BEYOND INC	7,413	35.64	264,199.32
BEST BUY COMPANY INC	15,140	58.13	880,088.20
CARMAX INC	10,070	59.61	600,272.70
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,631	40.02	225,352.62
DOLLAR GENERAL CORP	14,982	75.22	1,126,946.04
DOLLAR TREE INC	12,532	75.38	944,662.16
EXPEDIA INC	6,557	143.59	941,519.63
FOOT LOCKER INC	7,039	54.78	385,596.42
GAP	14,100	22.83	321,903.00
GENUINE PARTS CO	7,885	91.61	722,344.85
HOME DEPOT	63,993	152.96	9,788,369.28
KOHL'S CORP	9,438	37.87	357,417.06
L BRANDS INC	12,863	52.30	672,734.90

LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	21,896	23.79	520,905.84
LKQ CORP	15,658	31.97	500,586.26
LOWES COMPANIES	45,561	78.65	3,583,372.65
MACY'S INC	17,317	22.70	393,095.90
NETFLIX INC	22,925	158.03	3,622,837.75
NORDSTROM INC	6,807	47.16	321,018.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,031	232.84	1,171,418.04
PRICELINE GROUP INC/THE	2,579	1,842.12	4,750,827.48
ROSS STORES INC	21,123	61.96	1,308,781.08
SIGNET JEWELERS LTD	3,385	59.49	201,373.65
STAPLES INC	32,302	9.25	298,793.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	28,436	56.90	1,618,008.40
TIFFANY & CO	6,588	94.69	623,817.72
TJX COMPANIES INC	34,808	73.68	2,564,653.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,923	57.02	394,749.46
TRIPADVISOR INC	5,778	37.48	216,559.44
ULTA BEAUTY INC	3,147	307.87	968,866.89
COSTCO WHOLESALE CORP	23,358	180.38	4,213,316.04
CVS HEALTH CORP	53,750	79.71	4,284,412.50
KROGER CO	47,772	30.78	1,470,422.16
SYSCO CORP	27,677	55.19	1,527,493.63
WAL-MART STORES	80,640	79.42	6,404,428.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	48,069	80.99	3,893,108.31
WHOLE FOODS MKT INC	16,270	35.73	581,327.10
ALTRIA GROUP INC	101,827	75.46	7,683,865.42
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,648	42.02	1,287,828.96
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,158	49.16	548,527.28
BUNGE LIMITED	7,376	79.06	583,146.56
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,577	56.54	598,023.58
COCA-COLA CO	214,259	45.32	9,710,217.88
CONAGRA BRANDS INC	22,086	38.76	856,053.36
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,993	181.00	1,627,733.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,762	91.40	892,246.80
GENERAL MILLS INC	30,220	57.09	1,725,259.80
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,645	114.02	871,682.90
HORMEL FOODS CORP	14,782	34.77	513,970.14
INGREDION INC	3,629	115.83	420,347.07
JM SMUCKER CO	6,179	127.16	785,721.64
KELLOGG CO	13,991	72.66	1,016,586.06
KRAFT HEINZ CO/THE	32,503	90.83	2,952,247.49
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,060	104.40	632,664.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	9,809	89.97	882,515.73

MOLSON COORS BREWING CO -B	10,015	87.40	875,311.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	79,963	45.62	3,647,912.06
MONSTER BEVERAGE CORP	21,245	50.05	1,063,312.25
PEPSICO INC	74,959	115.94	8,690,746.46
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	81,495	120.12	9,789,179.40
REYNOLDS AMERICAN INC	45,681	65.31	2,983,426.11
TYSON FOODS INC	15,439	60.75	937,919.25
CHURCH & DWIGHT CO INC	13,701	53.00	726,153.00
CLOROX COMPANY	6,840	137.14	938,037.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,907	75.77	3,326,833.39
COTY INC-CL A	25,578	18.74	479,331.72
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,816	96.35	1,138,471.60
KIMBERLY-CLARK CORP	19,119	128.77	2,461,953.63
PROCTER & GAMBLE CO	134,333	88.16	11,842,797.28
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,000	131.93	131,930.00
ABBOTT LABORATORIES	91,973	47.29	4,349,403.17
AETNA INC	18,728	149.79	2,805,267.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,700	148.85	550,745.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,757	92.10	806,519.70
ANTHEM INC	14,060	186.92	2,628,095.20
BARD C R INC	3,908	314.25	1,228,089.00
BAXTER INTERNATIONAL	26,069	58.91	1,535,724.79
BECTON DICKINSON & CO	11,804	192.00	2,266,368.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	72,601	27.82	2,019,759.82
CARDINAL HEALTH	17,047	75.20	1,281,934.40
CENTENE CORP	8,821	77.50	683,627.50
CERNER CORP	16,236	66.28	1,076,122.08
CIGNA CORP	13,696	166.74	2,283,671.04
DANAHER CORP	33,242	84.49	2,808,616.58
DAVITA INC	7,925	64.47	510,924.75
DENTSPLY SIRONA INC	12,246	63.34	775,661.64
DEXCOM INC	4,100	68.99	282,859.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,370	116.12	1,320,284.40
ENVISION HEALTHCARE	6,373	56.15	357,843.95
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	31,585	61.41	1,939,634.85
HCA HEALTHCARE INC	15,967	83.57	1,334,362.19
HENRY SCHEIN INC	4,073	185.75	756,559.75
HOLOGIC INC	13,238	44.67	591,341.46
HUMANA INC	7,948	229.69	1,825,576.12
IDEXX LABORATORIES INC	4,528	164.56	745,127.68
INTUITIVE SURGICAL INC	2,065	916.34	1,892,242.10
LABORATORY CRP OF AMER	5,465	140.61	768,433.65

MCKESSON CORP	11,052	163.39	1,805,786.28
MEDNAX INC	4,910	55.98	274,861.80
MEDTRONIC PLC	72,051	86.51	6,233,132.01
PATTERSON COMPANIES INC	3,985	46.13	183,828.05
QUEST DIAGNOSTICS	7,350	108.41	796,813.50
RESMED INC	7,447	73.48	547,205.56
STRYKER CORP	17,987	141.87	2,551,815.69
TELEFLEX INC	2,222	200.00	444,400.00
THE COOPER COS INC	2,574	237.43	611,144.82
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,563	181.46	9,175,161.98
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,744	113.43	538,111.92
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,742	102.27	484,964.34
VCA INC	4,086	92.46	377,791.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	61.66	329,942.66
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,664	125.01	1,333,106.64
ABBVIE INC	83,616	69.67	5,825,526.72
AGILENT TECHNOLOGIES	17,232	59.21	1,020,306.72
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,946	105.38	1,258,869.48
ALKERMES PLC	7,727	61.66	476,446.82
ALLERGAN PLC	17,564	232.36	4,081,171.04
AMGEN	38,643	164.06	6,339,770.58
BIOGEN INC	11,296	259.89	2,935,717.44
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,127	90.23	823,529.21
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,704	53.75	4,714,090.00
CELGENE CORP	40,791	118.19	4,821,088.29
GILEAD SCIENCES INC	68,514	64.70	4,432,855.80
ILLUMINA INC	7,823	174.08	1,361,827.84
INCYTE CORP	9,025	119.04	1,074,336.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,158	154.91	489,205.78
JOHNSON & JOHNSON	142,650	131.53	18,762,754.50
LILLY (ELI) & CO	52,034	81.04	4,216,835.36
MALLINCKRODT PLC	6,146	40.29	247,622.34
MERCK & CO	144,824	64.39	9,325,217.36
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,336	593.95	793,517.20
MYLAN NV	24,169	40.09	968,935.21
PERRIGO CO PLC	6,543	71.52	467,955.36
PFIZER	312,671	32.77	10,246,228.67
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	7,818	86.15	673,520.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,140	475.79	1,969,770.60
SEATTLE GENETICS INC	5,000	64.81	324,050.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,344	106.70	143,404.80
TESARO INC	1,865	138.78	258,824.70

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	48,940	30.22	1,478,966.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,688	174.93	3,618,951.84
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,483	130.19	323,261.77
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,212	122.66	1,620,583.92
WATERS CORP	4,117	184.99	761,603.83
ZOETIS INC	24,981	62.59	1,563,560.79
BANK OF AMERICA CORP	526,814	23.67	12,469,687.38
BB&T CORP	43,279	44.11	1,909,036.69
CIT GROUP INC	7,240	46.05	333,402.00
CITIGROUP	145,526	64.45	9,379,150.70
CITIZENS FINANCIAL GROUP	27,198	36.34	988,375.32
COMERICA INC	9,119	72.67	662,677.73
EAST WEST BANCORP INC	7,270	58.43	424,786.10
FIFTH THIRD BANCORP	40,172	25.06	1,006,710.32
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,928	100.15	793,989.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	57,546	13.29	764,786.34
JPMORGAN CHASE & CO	188,099	86.96	16,357,089.04
KEY CORP	57,456	18.62	1,069,830.72
M & T BANK CORP	7,425	163.36	1,212,948.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,490	13.67	389,458.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,390	17.67	342,621.30
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	25,380	123.17	3,126,054.60
REGIONS FINL CORP	65,411	14.40	941,918.40
SIGNATURE BANK	2,827	152.69	431,654.63
SUNTRUST BANKS	26,146	56.55	1,478,556.30
SVB FINANCIAL GROUP	2,657	180.66	480,013.62
US BANCORP	88,812	52.89	4,697,266.68
WELLS FARGO & CO	250,432	53.80	13,473,241.60
ZIONS BANCORPORATION	10,223	42.34	432,841.82
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,891	162.49	469,758.59
ALLY FINANCIAL INC	22,374	19.69	440,544.06
AMERICAN EXPRESS	40,090	80.31	3,219,627.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,406	126.49	1,063,274.94
BANK NEW YORK CO	54,229	49.40	2,678,912.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	65,512	170.00	11,137,040.00
BLACKROCK INC	6,489	418.50	2,715,646.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,737	80.07	2,060,761.59
CBOE HOLDINGS INC	5,103	89.75	457,994.25
CME GROUP INC	18,106	124.39	2,252,205.34
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,009	60.57	1,272,515.13
E*TRADE FINANCIAL CORP	13,960	36.94	515,682.40
EATON VANCE CORP	6,907	48.71	336,439.97

FRANKLIN RESOURCES INC	17,434	43.68	761,517.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,791	222.44	4,179,870.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	31,774	63.97	2,032,582.78
INVESCO LTD	20,710	34.32	710,767.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	17,074	25.28	431,630.72
MOODY'S CORP	9,148	116.82	1,068,669.36
MORGAN STANLEY	73,249	44.91	3,289,612.59
MSCI INC	5,262	104.02	547,353.24
NASDAQ INC	5,829	70.54	411,177.66
NAVIENT CORP	14,116	15.26	215,410.16
NORTHERN TRUST CORP	11,434	91.75	1,049,069.50
PRICE T ROWE GROUP INC	12,927	73.27	947,161.29
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,570	78.29	514,365.30
S&P GLOBAL INC	13,815	146.81	2,028,180.15
SCHWAB (CHARLES) CORP	63,695	41.29	2,629,966.55
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,949	52.03	413,586.47
STATE STREET CORP	20,560	87.35	1,795,916.00
SYNCHRONY FINANCIAL	43,982	28.70	1,262,283.40
TD AMERITRADE HOLDING CORP	13,431	39.76	534,016.56
VOYA FINANCIAL INC	9,470	36.97	350,105.90
AFLAC	21,748	78.00	1,696,344.00
ALLEGHANY CORP	782	591.43	462,498.26
ALLSTATE CORP	19,626	87.37	1,714,723.62
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,742	99.48	372,254.16
AMERICAN INT'L GROUP	51,276	64.18	3,290,893.68
AON PLC	14,024	132.64	1,860,143.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,494	92.80	602,643.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,410	57.88	544,650.80
ASSURANT INC	3,303	101.68	335,849.04
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	3,657	50.03	182,959.71
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,145	64.95	334,167.75
CHUBB LTD	24,859	146.56	3,643,335.04
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,280	71.78	594,338.40
EVEREST RE GROUP LTD	2,083	255.57	532,352.31
FNF GROUP	12,921	42.69	551,597.49
HARTFORD FINANCIAL SVCS	20,072	51.51	1,033,908.72
LINCOLN NATIONAL CORP	12,127	68.25	827,667.75
LOEWS CORP	15,181	47.47	720,642.07
MARKEL CORP	742	992.01	736,071.42
MARSH & MCLENNAN COS	27,505	78.23	2,151,716.15
METLIFE INC	49,879	52.84	2,635,606.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,287	64.91	992,279.17

PROGRESSIVE CORP	30,884	43.48	1,342,836.32
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	22,952	107.75	2,473,078.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,350	127.94	428,599.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,393	142.43	340,834.99
TORCHMARK CORP	5,657	76.76	434,231.32
TRAVELERS COS INC/THE	14,578	125.23	1,825,602.94
UNUM GROUP	12,274	46.49	570,618.26
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,900	145.66	1,005,054.00
WR BERKLEY CORP	5,098	69.08	352,169.84
XL GROUP LTD	14,226	42.57	605,600.82
CBRE GROUP INC-A	16,045	34.94	560,612.30
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	61,800	7.81	482,658.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	120.43	268,558.90
WEYERHAEUSER CO	39,835	33.23	1,323,717.05
ACCENTURE PLC-CL A	33,147	125.82	4,170,555.54
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,857	58.03	2,138,811.71
ADOBE SYSTEMS INC	25,878	138.05	3,572,457.90
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,160	48.13	440,870.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,578	241.36	622,226.08
ALPHABET INC-CL A	15,618	970.12	15,151,334.16
ALPHABET INC-CL C	16,618	949.83	15,784,274.94
ANSYS INC	4,355	124.52	542,284.60
AUTODESK INC	10,608	105.95	1,123,917.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	24,083	100.11	2,410,949.13
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,994	74.24	444,994.56
CA INC	15,952	31.71	505,837.92
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,121	34.72	525,001.12
CDK GLOBAL INC	6,693	60.46	404,658.78
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,045	110.80	780,586.00
CITRIX SYSTEMS INC	8,265	78.32	647,314.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	32,358	66.31	2,145,658.98
COSTAR GROUP INC	1,650	252.55	416,707.50
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	11,825	62.56	739,772.00
DXC TECHNOLOGY CO	14,743	75.10	1,107,199.30
EBAY	53,847	34.94	1,881,414.18
ELECTRONIC ARTS INC	16,075	110.46	1,775,644.50
FACEBOOK INC-A	123,824	149.60	18,524,070.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,603	84.61	1,404,779.83
FIRST DATA CORP- CLASS A	13,900	18.62	258,818.00
FISERV INC	11,558	122.86	1,420,015.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,920	143.94	708,184.80
FORTINET INC	8,520	37.32	317,966.40

GARTNER INC	4,357	118.71	517,219.47
GLOBAL PAYMENTS INC	8,140	89.10	725,274.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	47,422	154.10	7,307,730.20
INTUIT INC	12,992	140.21	1,821,608.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,919	103.27	404,715.13
LEIDOS HOLDINGS	7,207	55.37	399,051.59
MASTERCARD INC-CLASS A	49,995	123.04	6,151,384.80
MERCADOLIBRE INC	1,990	275.07	547,389.30
MICROSOFT CORP	386,072	70.32	27,148,583.04
MOBILEYE NV	10,632	62.30	662,373.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	13,610	18.62	253,418.20
ORACLE CORP	161,528	45.03	7,273,605.84
PAYCHEX INC	17,304	58.56	1,013,322.24
PAYPAL HOLDINGS INC	60,031	53.40	3,205,655.40
RED HAT INC	9,532	88.85	846,918.20
SABRE CORP	10,169	22.66	230,429.54
SALESFORCE.COM INC	34,449	87.27	3,006,364.23
SERVICENOW INC	8,805	103.74	913,430.70
SPLUNK INC	6,861	58.27	399,790.47
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,654	37.23	322,188.42
SYMANTEC CORP	33,140	29.71	984,589.40
SYNOPSYS INC	8,003	74.93	599,664.79
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	8,723	59.47	518,756.81
TWITTER INC	33,767	16.90	570,662.30
VANTIV INC - CL A	8,513	63.12	537,340.56
VERISIGN INC	4,957	92.33	457,679.81
VISA INC-CLASS A SHARES	97,593	94.56	9,228,394.08
VMWARE INC-CLASS A	3,506	87.63	307,230.78
WESTERN UNION CO	25,608	19.01	486,808.08
WORKDAY INC-CLASS A	6,446	97.97	631,514.62
YAHOO	48,369	54.02	2,612,893.38
ZILLOW GROUP INC-C	6,531	44.44	290,237.64
AMPHENOL CORPORATION	16,415	75.76	1,243,600.40
APPLE INC	275,980	148.98	41,115,500.40
ARISTA NETWORKS INC	2,310	149.46	345,252.60
ARROW ELECTRONICS INC	5,228	77.11	403,131.08
AVNET INC	6,677	38.64	257,999.28
CDW CORP/DE	8,508	60.79	517,201.32
CISCO SYSTEMS	262,982	31.37	8,249,745.34
COMMSCOPE HOLDING CO INC	9,775	37.53	366,855.75
CORNING	50,662	28.95	1,466,664.90
F5 NETWORKS INC	3,273	129.30	423,198.90

FLEX LTD	27,142	17.33	470,370.86
FLIR SYSTEMS INC	6,707	36.85	247,152.95
HARRIS CORP	6,589	109.06	718,596.34
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	88,882	16.99	1,510,105.18
HP INC	91,182	17.80	1,623,039.60
JUNIPER NETWORKS INC	20,221	28.61	578,522.81
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,912	86.17	681,777.04
NETAPP INC	14,061	39.52	555,690.72
PALO ALTO NETWORKS INC	4,678	134.04	627,039.12
SEAGATE TECHNOLOGY	15,615	42.37	661,607.55
TE CONNECTIVITY LTD	18,927	79.59	1,506,399.93
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,193	36.32	479,169.76
WESTERN DIGITAL CORP	15,197	86.01	1,307,093.97
XEROX CORP	45,164	6.94	313,438.16
AT&T INC	322,738	38.79	12,519,007.02
CENTURYLINK INC	28,961	26.11	756,171.71
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	16,253	62.36	1,013,537.08
SPRINT CORP	39,898	8.12	323,971.76
T-MOBILE US INC	15,330	63.84	978,667.20
VERIZON COMMUNICATIONS	214,151	46.72	10,005,134.72
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,550	32.23	243,336.50
AES CORP	33,217	11.72	389,303.24
ALLIANT ENERGY CORPORATION	11,999	41.26	495,078.74
AMEREN CORPORATION	12,859	56.29	723,833.11
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,216	71.86	1,883,881.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,437	79.26	747,976.62
ATMOS ENERGY CORP	5,476	83.64	458,012.64
CENTERPOINT ENERGY INC	21,644	28.24	611,226.56
CMS ENERGY CORP	14,825	46.98	696,478.50
CONSOLIDATED EDISON INC	16,221	83.25	1,350,398.25
DOMINION ENERGY INC	33,459	79.28	2,652,629.52
DTE ENERGY COMPANY	9,536	108.98	1,039,233.28
DUKE ENERGY CORP	36,797	85.72	3,154,238.84
EDISON INTL	17,352	81.29	1,410,544.08
ENTERGY CORP	9,495	79.28	752,763.60
EVERSOURCE ENERGY	16,859	62.30	1,050,315.70
EXELON CORP	49,225	36.62	1,802,619.50
FIRSTENERGY CORP	22,564	29.11	656,838.04
NEXTERA ENERGY INC	24,958	140.24	3,500,109.92
NISOURCE INC	18,907	25.77	487,233.39
OGE ENERGY CORP	11,648	35.37	411,989.76
PG&E CORP	26,962	68.41	1,844,470.42

	PINNACLE WEST CAPITAL	5,873	87.99	516,765.27
	PPL CORPORATION	36,190	39.20	1,418,648.00
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,919	44.33	1,193,319.27
	SCANA CORP	6,890	68.05	468,864.50
	SEMPRA ENERGY	12,653	115.00	1,455,095.00
	SOUTHERN CO	52,360	50.68	2,653,604.80
	UGI CORP	8,757	49.74	435,573.18
	WEC ENERGY GROUP INC	16,778	63.13	1,059,195.14
	WESTAR ENERGY INC	8,314	52.96	440,309.44
	XCEL ENERGY INC	27,031	47.35	1,279,917.85
	ADVANCED MICRO DEVICES	42,000	12.28	515,760.00
	ANALOG DEVICES	19,397	78.60	1,524,604.20
	APPLIED MATERIALS	57,679	44.74	2,580,558.46
	BROADCOM LTD	21,033	243.34	5,118,170.22
	INTEL CORP	248,327	35.71	8,867,757.17
	KLA-TENCOR CORP	8,294	101.98	845,822.12
	LAM RESEARCH CORP	8,662	157.78	1,366,690.36
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	22,843	17.26	394,270.18
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,006	47.08	706,482.48
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,468	83.48	957,348.64
	MICRON TECHNOLOGY	55,509	30.60	1,698,575.40
	NVIDIA CORP	28,242	149.60	4,225,003.20
	NXP SEMICONDUCTORS NV	18,155	108.58	1,971,269.90
	QORVO INC	6,735	75.27	506,943.45
	QUALCOMM	77,426	57.05	4,417,153.30
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,875	107.01	1,056,723.75
	TEXAS INSTRUMENTS	52,391	80.90	4,238,431.90
	XILINX INC	13,395	65.40	876,033.00
	アメリカドル 小計	16,377,034		1,130,191,488.30 (124,581,007,755)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,078	30.04	242,663.12
	ARC RESOURCES LTD	20,535	17.28	354,844.80
	CAMECO CORP	19,186	12.81	245,772.66
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,499	39.34	2,301,350.66
	CENOVUS ENERGY INC	52,049	11.10	577,743.90
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,742	11.75	314,218.50
	ENBRIDGE	86,658	52.12	4,516,614.96
	ENCANA CORP	53,774	12.63	679,165.62
	HUSKY ENERGY INC	18,846	15.47	291,547.62
	IMPERIAL OIL	15,145	37.99	575,358.55
	INTER PIPELINE LTD	18,189	26.33	478,916.37
	KEYERA CORP	11,025	42.13	464,483.25

PEMBINA PIPELINE CORP	20,428	44.20	902,917.60
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,644	24.63	237,531.72
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,603	29.59	372,922.77
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	15,297	24.52	375,082.44
SUNCOR ENERGY	88,410	41.25	3,646,912.50
TOURMALINE OIL CORP	12,981	27.72	359,833.32
TRANSCANADA CORP	45,744	63.89	2,922,584.16
VERESEN INC	18,252	18.62	339,852.24
VERMILION ENERGY INC	6,153	44.65	274,731.45
AGNICO EAGLE MINES	11,538	64.85	748,239.30
AGRIUM INC	6,794	127.74	867,865.56
BARRICK GOLD CORP	61,196	21.96	1,343,864.16
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,850	65.31	512,683.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	34,446	11.93	410,940.78
FRANCO-NEVADA CORP	9,197	97.55	897,167.35
GOLDCORP INC	44,166	18.07	798,079.62
KINROSS GOLD CORP	60,197	5.82	350,346.54
METHANEX CORP	4,891	56.62	276,928.42
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	43,643	22.89	998,988.27
TECK RESOURCES LTD-CL B	29,349	24.14	708,484.86
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	3.59	174,269.37
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,936	60.25	176,894.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22,516	27.04	608,832.64
YAMANA GOLD INC	62,705	3.53	221,348.65
BOMBARDIER B	104,404	2.37	247,437.48
CAE INC	14,339	22.18	318,039.02
FINNING INTERNATIONAL INC	10,642	26.54	282,438.68
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	52.60	461,565.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	39,803	106.55	4,241,009.65
CP RAILWAY LIMITED	7,287	206.37	1,503,818.19
LINAMAR CORP	2,700	62.56	168,912.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,064	61.20	1,227,916.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,580	40.86	554,878.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,505	77.28	889,106.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,329	28.75	613,208.75
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,390	149.17	505,686.30
DOLLARAMA INC	5,699	125.06	712,716.94
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	21,995	62.24	1,368,968.80
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	20.64	151,291.20
JEAN COUTU GROUP INC A	4,000	22.00	88,000.00
LOBLAW COMPANIES LTD	11,468	76.01	871,682.68
METRO INC	11,606	44.33	514,493.98

	WESTON (GEORGE) LTD	2,481	120.86	299,853.66
	SAPUTO INC	10,742	43.22	464,269.24
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	19,503	16.83	328,235.49
	BANK MONTREAL	34,269	93.90	3,217,859.10
	BANK NOVA SCOTIA	64,283	78.57	5,050,715.31
	CANADIAN IMPERIAL BANK	20,992	107.43	2,255,170.56
	NATIONAL BANK OF CANADA	17,560	54.54	957,722.40
	ROYAL BANK OF CANADA	77,427	95.28	7,377,244.56
	TORONTO-DOMINION BANK	97,536	65.69	6,407,139.84
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	46,964	51.34	2,411,131.76
	CI FINANCIAL CORP	11,799	26.71	315,151.29
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	21,290	9.80	208,642.00
	IGM FINANCIAL INC	3,890	40.00	155,600.00
	ONEX CORP	4,702	100.19	471,093.38
	THOMSON REUTERS CORP	14,949	59.17	884,532.33
	TRISURA GROUP LTD-WI	276	21.98	6,066.48
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,185	585.47	693,781.95
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,947	34.15	510,440.05
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,595	50.14	330,673.30
	INTACT FINANCIAL CORP	6,703	94.36	632,495.08
	MANULIFE FINANCIAL CORP	104,362	24.09	2,514,080.58
	POWER CORP OF CANADA	17,809	29.19	519,844.71
	POWER FINANCIAL CORP	12,518	33.07	413,970.26
	SUN LIFE FINANCIAL INC	32,193	45.89	1,477,336.77
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	20.68	144,760.00
	CGI GROUP INC - CL A	10,917	67.14	732,967.38
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,112	696.55	774,563.60
	OPEN TEXT CORP	13,349	44.03	587,756.47
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,015	122.80	493,042.00
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	14.85	372,363.75
	BCE INC	7,663	60.59	464,301.17
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,878	62.75	1,184,594.50
	TELUS CORP	11,560	44.74	517,194.40
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	50.52	220,873.44
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	40.87	244,320.86
	EMERA INC	710	48.63	34,527.30
	FORTIS INC	22,416	45.17	1,012,530.72
	HYDRO ONE LTD	14,740	23.39	344,768.60
	カナダドル 小計	2,180,881		89,322,766.19 (7,319,107,461)
ユーロ	ENAGAS	11,653	26.48	308,629.70
	ENI	135,670	13.90	1,885,813.00

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,776	13.53	375,948.16
NESTE OIL OYJ	5,819	34.88	202,966.72
OMV AG	8,029	48.21	387,118.23
REPSOL SA	59,590	14.83	883,719.70
SAIPEM SPA	34,761	3.44	119,577.84
SNAM SPA	117,058	4.19	491,409.48
TENARIS SA	24,795	13.77	341,427.15
TOTAL SA	121,529	45.69	5,553,267.65
VOPAK	3,661	40.95	149,917.95
AIR LIQUIDE	20,688	109.80	2,271,542.40
AKZO NOBEL	13,376	76.75	1,026,608.00
ARCELORMITTAL	34,943	19.00	663,917.00
ARKEMA	3,446	96.08	331,091.68
BASF SE	48,190	86.59	4,172,772.10
COVESTRO AG	4,602	64.40	296,368.80
CRH PLC	43,853	32.72	1,435,089.42
EVONIK INDUSTRIES AG	9,556	30.18	288,400.08
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,446	50.44	224,256.24
HEIDELBERGCEMENT AG	7,740	84.44	653,565.60
IMERYS SA	2,111	78.30	165,291.30
K+S AG	11,391	23.32	265,638.12
KONINKLIJKE DSM NV	9,563	66.07	631,827.41
LANXESS	5,302	70.47	373,631.94
LINDE AG	9,816	179.30	1,760,008.80
SOLVAY SA	3,732	119.60	446,347.20
STORA ENSO OYJ R	28,950	11.87	343,636.50
SYMRISE AG	6,301	64.33	405,343.33
THYSSEN KRUPP	18,853	24.27	457,562.31
UMICORE	5,655	62.87	355,529.85
UPM KYMMENE OYJ	28,303	25.81	730,500.43
VOESTALPINE AG	5,948	40.90	243,273.20
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,034	35.95	396,672.30
AIRBUS SE	30,840	75.41	2,325,644.40
ALSTOM	8,179	31.26	255,675.54
ANDRITZ AG	3,617	54.50	197,126.50
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,606	29.77	137,143.65
BOUYGUES ORD	12,252	38.33	469,680.42
BRENTAG AG	7,892	52.20	411,962.40
CNH INDUSTRIAL NV	53,801	10.32	555,226.32
DASSAULT AVIATION SA	121	1,319.00	159,599.00
EIFFAGE	2,966	81.78	242,559.48
FERROVIAL SA	25,431	19.91	506,458.36

GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	12,322	20.32	250,383.04
GEA GROUP AG	10,660	37.12	395,699.20
HOCHTIEF AG	1,172	166.80	195,489.60
KONE OYJ-B	17,919	45.20	809,938.80
KONINKLIJKE PHILIPS	48,759	32.02	1,561,263.18
LEGRAND SA	14,055	60.97	856,933.35
LEONARDO SPA	22,011	16.04	353,056.44
MAN SE	1,966	94.24	185,275.84
METSO OYJ	6,409	31.46	201,627.14
OSRAM LICHT AG	4,227	70.72	298,933.44
PRYSMIAN SPA	11,275	25.94	292,473.50
REXEL SA	17,749	14.88	264,105.12
SAFRAN SA	16,550	79.20	1,310,760.00
SAINT-GOBAIN	26,455	49.97	1,321,956.35
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,894	68.92	2,060,294.48
SIEMENS	40,161	129.40	5,196,833.40
THALES SA	5,447	98.22	535,004.34
VINCI S.A.	26,231	78.01	2,046,280.31
WARTSILA OYJ	7,800	53.70	418,860.00
ZODIAC AEROSPACE	11,896	23.60	280,745.60
BUREAU VERITAS SA	13,374	20.43	273,230.82
EDENRED	12,153	23.99	291,611.23
RANDSTAD HOLDING NV	6,192	52.28	323,717.76
RELX NV	52,684	18.48	973,600.32
SOCIETE BIC SA	1,751	109.35	191,471.85
WOLTERS KLUWER	15,914	38.41	611,256.74
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	33,687	16.33	550,277.14
ADP	1,532	138.20	211,722.40
AENA SA	3,526	183.70	647,726.20
ATLANTIA SPA	21,779	26.00	566,254.00
BOLLORE	52,200	4.07	212,715.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	11,228	18.60	208,840.80
DEUTSCHE POST AG-REG	51,312	31.91	1,637,365.92
FRAPORT AG	2,688	75.84	203,857.92
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	26,998	10.26	277,134.47
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	32,810	6.66	218,711.46
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,492	84.43	1,476,849.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	73.53	230,957.73
CONTINENTAL AG	5,793	198.70	1,151,069.10
DAIMLER AG	51,090	65.46	3,344,351.40
FERRARI NV	6,911	81.70	564,628.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47,541	9.71	461,623.11

MICHELIN	8,895	118.00	1,049,610.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	36.72	226,085.04
PEUGEOT SA	25,293	17.99	455,021.07
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,826	50.91	398,421.66
RENAULT SA	9,193	84.11	773,223.23
SCHAEFFLER AG	8,942	14.98	133,995.87
VALEO SA	12,585	61.38	772,467.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,789	132.60	1,298,021.40
VOLKSWAGEN STAMM	1,911	137.85	263,431.35
ADIDAS AG	9,968	170.00	1,694,560.00
CHRISTIAN DIOR	2,856	255.65	730,136.40
HERMES INTERNATIONAL	1,084	439.55	476,472.20
HUGO BOSS AG	3,285	65.46	215,036.10
KERING	4,000	295.70	1,182,800.00
LUXOTTICA GROUP SPA	8,719	53.55	466,902.45
LVMH	14,620	227.90	3,331,898.00
SEB SA	820	159.25	130,585.00
ACCOR	9,765	41.56	405,833.40
PADDY POWER PLC	4,606	96.68	445,308.08
SODEXO	4,814	120.45	579,846.30
ALTICE NV -A	19,337	23.26	449,778.62
ALTICE NV -B	4,665	23.25	108,484.57
AXEL SPRINGER SE	1,924	55.37	106,531.88
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	24.06	208,763.87
JC DECAUX SA	3,750	28.25	105,937.50
LAGADERE S.C.A	6,893	27.99	192,935.07
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	11,988	36.91	442,477.08
PUBLICIS GROUPE	10,064	65.43	658,487.52
RTL GROUP	2,176	68.93	150,006.91
SES	18,856	22.65	427,088.40
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	61.15	173,115.65
VIVENDI	54,331	20.05	1,089,336.55
INDITEX	58,034	36.40	2,112,727.77
ZALANDO SE	4,525	44.84	202,901.00
CARREFOUR	29,746	23.13	688,173.71
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	54.05	178,256.90
COLRUYT SA	3,653	47.65	174,083.71
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	32,188	5.55	178,707.77
JERONIMO MARTINS	13,062	17.72	231,523.95
KONINKLIJKE AHOLD NV	68,108	19.28	1,313,122.24
METRO STAMM	8,880	28.95	257,120.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,614	101.55	4,124,351.70

COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,354	36.51	414,591.31
DANONE (GROUPE)	31,387	66.91	2,100,104.17
HEINEKEN HOLDING NV	6,086	81.99	498,991.14
HEINEKEN NV	12,214	87.27	1,065,915.78
KERRY GROUP PLC-A	8,164	78.64	642,016.96
PERNOD-RICARD	11,244	121.00	1,360,524.00
REMY COINTREAU	1,720	101.60	174,752.00
BEIERSDORF AG	5,172	96.29	498,011.88
HENKEL AG & CO KGAA	6,137	111.05	681,513.85
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,372	125.70	1,178,060.40
LOREAL	13,409	190.05	2,548,380.45
UNILEVER NV-CVA	86,998	50.25	4,371,649.50
ESSILOR INTERNATIONAL	10,972	118.25	1,297,439.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,260	86.83	977,705.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	21,693	77.76	1,686,847.68
BAYER	43,413	119.05	5,168,317.65
EUROFINS SCIENTIFIC	510	491.25	250,537.50
GRIFOLS SA	15,514	25.00	387,927.57
IPSEN	1,866	119.55	223,080.30
MERCK KGAA	6,731	106.80	718,870.80
ORION OYJ-CLASS B	5,393	58.00	312,794.00
QIAGEN N.V.	11,006	30.84	339,425.04
RECORDATI SPA	5,195	36.52	189,721.40
SANOFI	61,052	86.14	5,259,019.28
UCB (GROUPE)	6,519	62.56	407,828.64
ABN AMRO GROUP NV-CVA	14,621	23.00	336,356.10
BANCO BILBAO VIZCAYA	357,200	7.45	2,663,997.60
BANCO DE SABADELL SA	278,761	1.75	489,504.31
BANCO SANTANDER SA	766,603	6.12	4,691,610.36
BANK OF IRELAND	1,403,709	0.23	322,853.07
BANKIA SA	51,949	4.24	220,419.60
BANKINTER SA	34,589	8.29	286,915.75
BNP PARIBAS	58,875	64.51	3,798,026.25
CAIXABANK	197,029	4.19	826,142.59
COMMERZBANK AG	54,713	9.48	518,843.37
CREDIT AGRICOLE SA	59,026	14.25	841,120.50
ERSTE GROUP BANK AG	15,662	33.40	523,110.80
ING GROEP NV-CVA	203,766	15.52	3,162,448.32
INTESA SANPAOLO	676,100	2.58	1,748,394.60
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.41	107,391.61
KBC GROEP NV	13,138	69.41	911,908.58
MEDIOBANCA	29,447	8.59	252,949.73

NATIXIS	50,808	6.06	308,048.90
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	24.18	190,239.21
SOCIETE GENERALE	40,785	48.00	1,957,680.00
UNICREDIT SPA	100,649	16.13	1,623,468.37
DEUTSCHE BANK NAMEN	109,510	15.81	1,731,900.65
DEUTSCHE BOERSE	10,099	92.77	936,884.23
EURAZEO	2,123	64.33	136,572.59
EXOR NV	6,186	50.15	310,227.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,647	86.45	401,733.15
WENDEL	1,767	136.95	241,990.65
AEGON	91,649	4.50	412,695.44
AGEAS	9,709	36.20	351,465.80
ALLIANZ SE-REG	23,978	173.85	4,168,575.30
ASSICURAZIONI GENERALI	62,096	14.07	873,690.72
AXA	103,271	24.02	2,481,085.77
CNP ASSURANCES	8,406	19.88	167,153.31
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	106.10	324,453.80
MAPFRE SA	56,454	3.21	181,668.97
MUENCHENER RUECKVERSICH.	8,513	177.30	1,509,354.90
NN GROUP NV	15,703	31.82	499,669.46
POSTE ITALIANE SPA	25,777	6.30	162,395.10
SAMPO OYJ-A SHS	23,796	45.64	1,086,049.44
SCOR SE	9,111	34.85	317,518.35
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	59,209	1.97	117,056.19
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,334	35.17	644,806.78
IMMOFINANZ AG	5,856	2.03	11,887.68
VONOVIA SE	24,338	35.99	876,046.31
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	23,242	53.38	1,240,657.96
ATOS SE	4,649	130.75	607,856.75
CAPGEMINI SA	8,567	92.93	796,131.31
DASSAULT SYSTEMES SA	6,718	83.28	559,475.04
GEMALTO	4,187	52.19	218,519.53
SAP SE	51,591	96.00	4,952,736.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,110	48.88	298,687.35
INGENICO GROUP	3,351	80.91	271,129.41
NOKIA OYJ	311,196	5.81	1,808,048.76
DEUTSCHE TELEKOM	174,030	17.12	2,980,263.75
ELISA A	7,434	34.82	258,851.88
ILIAD SA	1,337	225.85	301,961.45
KPN (KON.)	179,463	3.02	542,337.18
ORANGE	105,871	15.27	1,616,650.17
PROXIMUS	7,531	32.72	246,451.97

	TELECOM ITALIA ORD	601,141	0.82	495,941.32
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.68	234,738.72
	TELEFONICA	241,591	10.06	2,430,405.46
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	4.40	180,194.63
	E.ON SE	114,214	8.79	1,004,740.55
	ELECTRICITE DE FRANCE	27,578	9.67	266,872.30
	ENDESA	16,465	22.17	365,029.05
	ENEL	425,703	4.89	2,085,093.29
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	125,070	3.27	409,103.97
	ENGIE	83,695	13.93	1,165,871.35
	FORTUM OYJ	23,370	14.47	338,163.90
	GAS NATURAL SDG SA	18,170	21.95	398,831.50
	IBERDROLA SA	305,307	7.15	2,182,945.05
	INNOGY SE	6,865	35.72	245,217.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	22,517	20.37	458,671.29
	RWE STAMM	28,428	19.73	560,884.44
	SUEZ	17,194	16.40	281,981.60
	TERNA SPA	78,997	5.15	406,834.55
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	19.26	478,754.51
	ASML HOLDING NV	19,908	119.90	2,386,969.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	59,598	20.38	1,214,905.23
	STMICROELECTRONICS	32,695	15.32	500,887.40
	ユーロ 小計	11,507,796		207,241,333.87 (25,596,377,146)
イギリスポンド	BP PLC	1,026,788	4.67	4,803,314.26
	PETROFAC LTD	14,944	3.53	52,871.87
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	233,136	21.06	4,911,009.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	196,544	21.52	4,229,626.88
	ANGLO AMERICAN PLC	68,953	10.81	745,381.93
	ANTOFAGASTA PLC	21,571	8.25	177,960.75
	BHP BILLTON PLC	111,738	12.07	1,349,236.35
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,750	39.50	306,125.00
	FRESNILLO PLC	10,869	17.25	187,490.25
	GLENCORE PLC	649,682	2.95	1,916,561.90
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,810	29.84	292,730.40
	MONDI PLC	18,808	20.58	387,068.64
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,790	76.00	364,040.00
	RIO TINTO PLC REG	65,724	32.64	2,145,559.98
	ASHTREAD GROUP PLC	25,722	16.35	420,554.70
	BAE SYSTEMS PLC	167,432	6.77	1,133,514.64
	BUNZL PLC	17,241	24.08	415,163.28
	COBHAM PLC	79,000	1.30	102,858.00

DCC PLC	4,508	73.25	330,211.00
IMI PLC	14,582	12.50	182,275.00
MEGGITT PLC	43,669	4.97	217,165.93
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	85,704	9.08	778,620.84
SMITHS GROUP PLC	20,046	16.15	323,742.90
TRAVIS PERKINS PLC	15,153	15.57	235,932.21
WEIR GROUP PLC/THE	12,587	19.01	239,278.87
WOLSELEY LTD	13,206	48.82	644,716.92
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	8.82	130,689.42
CAPITA GROUP PLC	40,800	5.33	217,668.00
EXPERIAN PLC	49,812	16.23	808,448.76
G4S PLC	77,964	3.37	263,050.53
INTERTEK GROUP PLC	8,212	43.48	357,057.76
RELX PLC	57,010	16.94	965,749.40
EASYJET PLC	9,909	13.29	131,690.61
ROYAL MAIL PLC	44,164	4.36	192,687.53
NEW GKN	87,193	3.46	301,862.16
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.76	293,888.17
BURBERRY GROUP PLC	22,630	17.43	394,440.90
PERSIMMON PLC	15,742	23.79	374,502.18
TAYLOR WIMPAY PLC	166,048	1.77	294,735.20
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	30.93	202,591.50
CARNIVAL PLC	9,818	50.35	494,336.30
COMPASS GROUP PLC	86,815	16.69	1,448,942.35
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,215	44.33	452,830.95
MERLIN ENTERTAINME	43,424	5.05	219,291.20
TUI AG-DI	25,079	11.55	289,662.45
WHITBREAD PLC	9,381	39.83	373,645.23
ITV PLC	185,979	1.84	342,201.36
PEARSON	41,558	7.17	298,178.65
SKY PLC	53,491	9.80	524,479.25
WPP PLC	67,507	16.73	1,129,392.11
DIXONS CARPHONE PLC	47,902	3.13	150,268.57
KINGFISHER PLC	114,680	3.10	355,508.00
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	3.60	296,610.76
NEXT PLC	7,084	42.76	302,911.84
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.44	273,303.29
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.65	217,347.70
TESCO	428,684	1.80	774,846.33
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,423	29.41	541,820.43
BRITISH AMERICAN TOBACCO	99,485	55.18	5,489,582.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,465	23.29	173,859.85

DIAGEO	133,965	23.26	3,116,025.90
IMPERIAL BRANDS PLC	50,883	35.62	1,812,706.87
TATE & LYLE	29,097	7.29	212,117.13
RECKITT BENCKISER PLC	34,845	79.54	2,771,571.30
UNILEVER PLC	68,284	43.28	2,955,672.94
CONVATEC GROUP PLC	57,895	3.23	187,290.32
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	21,500	7.95	171,032.50
SMITH & NEPHEW PLC	45,722	13.60	621,819.20
ASTRAZENECA	66,353	53.37	3,541,259.61
GLAXOSMITHKLINE	260,024	16.98	4,415,207.52
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,870	16.31	112,049.70
SHIRE PLC	48,011	43.45	2,086,318.00
BARCLAYS	899,712	2.06	1,858,804.99
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,043,463	6.95	7,259,372.09
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,743,638	0.70	2,620,920.96
ROYAL BANK OF SCOTLAND	182,932	2.50	458,976.38
STANDARD CHARTERED PLC	173,592	7.80	1,354,364.78
3I GROUP PLC	49,801	9.30	463,398.30
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,195	2.91	160,727.84
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,303	13.80	211,181.40
INVESTEC PLC	32,355	5.77	186,850.12
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	16,341	34.54	564,418.14
PROVIDENT FINANCIAL PLC	8,699	29.80	259,230.20
SCHRODERS PLC	7,525	31.39	236,209.75
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	20.70	204,350.40
AVIVA PIC	214,069	5.32	1,138,847.08
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.54	243,891.49
LEGAL & GENERAL GROUP	311,918	2.58	805,372.27
OLD MUTUAL PLC	256,145	1.97	505,117.94
PRUDENTIAL	137,067	17.95	2,460,352.65
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	6.25	323,339.71
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.85	316,726.80
STANDARD LIFE PLC	101,039	3.88	392,132.35
AUTO TRADER GROUP PLC	60,396	4.20	253,663.20
SAGE GROUP PLC	55,165	6.97	384,775.87
WORLDPAY GROUP PLC	105,272	3.12	329,396.08
BT GROUP PLC	447,788	2.94	1,319,855.13
INMARSAT PLC	27,245	8.24	224,498.80
VODAFONE GROUP PLC	1,395,536	2.21	3,084,832.32
CENTRICA PLC	286,017	1.98	568,601.79
NATIONAL GRID PLC	183,148	10.20	1,868,109.60
SEVERN TRENT PLC	11,927	25.03	298,532.81

	SSE PLC	53,154	14.95	794,652.30
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	9.93	344,903.46
	イギリスbond 小計	16,014,784		99,470,571.37 (13,979,594,100)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	677.50	276,420.00
	GIVAUDAN-REG	485	1,966.00	953,510.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	24,065	57.00	1,371,705.00
	SIKA AG-BR	113	6,330.00	715,290.00
	ABB LTD	104,676	24.58	2,572,936.08
	GEBERIT AG-REG	1,943	450.40	875,127.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,159	200.30	232,147.70
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,118	205.30	434,825.40
	ADECCO GROUP AG-REG	8,484	73.25	621,453.00
	SGS SA	286	2,320.00	663,520.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,765	159.10	439,911.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,716	79.30	2,197,878.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,601	362.30	580,042.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	71.50	214,786.00
	DUFREY AG-REG	1,811	162.30	293,925.30
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,370.00	176,730.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	70,260.00	421,560.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	5,830.00	326,480.00
	NESTLE SA - REGISTERED	163,710	80.95	13,252,324.50
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	164.50	439,544.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	491	546.00	268,086.00
	ACTELION LTD-REG	5,129	275.00	1,410,475.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,893	203.20	791,057.60
	NOVARTIS	117,445	78.80	9,254,666.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	36,952	247.80	9,156,705.60
	VIFOR PHARMA AG	2,190	105.70	231,483.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	123,087	13.43	1,653,058.41
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,624	50.00	581,200.00
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	74.85	171,331.65
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	897	600.00	538,200.00
	UBS GROUP AG	194,695	15.49	3,015,825.55
	BALOISE HOLDING AG	2,548	149.10	379,906.80
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,672	322.90	539,888.80	
SWISS RE LTD	17,150	87.25	1,496,337.50	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,995	284.90	2,277,775.50	
SWISS PRIME SITE-REG	3,622	90.40	327,428.80	
SWISSCOM	1,348	458.60	618,192.80	
		880,234		59,771,735.79

スイスフラン 小計				(6,802,023,532)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	165.40	1,529,950.00
	BOLIDEN AB	15,596	244.60	3,814,781.60
	ALFA LAVAL AB	17,624	174.20	3,070,100.80
	ASSA ABLOY AB-B	52,882	195.10	10,317,278.20
	ATLAS COPCO A	35,494	330.70	11,737,865.80
	ATLAS COPCO B	20,386	296.30	6,040,371.80
	SANDVIK AB	56,003	142.60	7,986,027.80
	SKANSKA B	17,528	207.60	3,638,812.80
	SKF AB-B	18,223	184.10	3,354,854.30
	VOLVO B	81,887	147.60	12,086,521.20
	SECURITAS B	18,644	145.30	2,708,973.20
	ELECTROLUX AB-SER B	14,061	284.10	3,994,730.10
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	86.60	1,891,430.60
	HENNES & MAURITZ B	50,200	206.60	10,371,320.00
	ICA GRUPPEN AB	5,879	317.60	1,867,170.40
	SWEDISH MATCH AB	10,846	304.50	3,302,607.00
	SCA SV CELLULOSA B	32,079	302.10	9,691,065.90
	GETINGE AB-B SHS	8,952	182.60	1,634,635.20
	NORDEA BANK AB	161,201	112.30	18,102,872.30
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	79,882	105.90	8,459,503.80
	SVENSKA HANDELSBK A	80,582	123.80	9,976,051.60
	SWEDBANK AB-A	47,835	211.60	10,121,886.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	211.00	1,821,141.00
	INVESTOR AB-B SHS	24,001	408.70	9,809,208.70
KINNEVIK AB - B	13,657	259.20	3,539,894.40	
LUNDBERGS AB-B SHS	1,030	702.00	723,060.00	
ERICSSON (LM) B	161,884	63.40	10,263,445.60	
HEXAGON AB-B SHS	13,447	385.50	5,183,818.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,878	503.00	1,950,634.00	
TELE2 AB-B SHS	18,919	89.95	1,701,764.05	
TELIA CO AB	135,286	39.11	5,291,035.46	
スウェーデンクローナ 小計		1,237,608		185,982,812.11 (2,354,542,401)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	58,948	146.50	8,635,882.00
	NORSK HYDRO	79,134	46.47	3,677,356.98
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,504	315.10	3,309,810.40
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	178.00	837,668.00
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,934	190.00	747,460.00
	MARINE HARVEST	20,286	146.60	2,973,927.60
	ORKLA	40,706	84.60	3,443,727.60
	DNB ASA	50,688	143.80	7,288,934.40

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	135.50	1,511,231.50	
	TELENOR ASA	38,611	136.30	5,262,679.30	
	ノルウェークローネ 小計	318,670		37,688,677.78 (489,199,037)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,228	472.50	2,470,230.00	
	NOVOZYMES A/S	12,241	300.00	3,672,300.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	11,809	614.50	7,256,630.50	
	ISS A/S	8,803	273.10	2,404,099.30	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	12,050.00	2,397,950.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	348	12,610.00	4,388,280.00	
	DSV A/S	10,005	408.30	4,085,041.50	
	PANDORA A/S	5,915	628.50	3,717,577.50	
	CARLSBERG AS-B	5,961	712.50	4,247,212.50	
	COLOPLAST-B	6,257	573.50	3,588,389.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,846	172.30	834,965.80	
	GENMAB A/S	3,049	1,404.00	4,280,796.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	349.50	1,274,626.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	95,327	284.90	27,158,662.30	
	DANSKE BANK A/S	36,739	252.00	9,258,228.00	
	TRYG A/S	5,192	137.30	712,861.60	
	TDC A/S	43,672	37.65	1,644,250.80	
DONG ENERGY A/S	6,850	296.00	2,027,600.00		
	デンマーククローネ 小計	266,088		85,419,701.80 (1,418,821,246)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	31.65	405,784.65	
	OIL SEARCH LTD	68,668	6.80	466,942.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	92,410	7.32	676,441.20	
	SANTOS	109,387	3.12	341,287.44	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	39,530	30.31	1,198,154.30	
	ALUMINA LIMITED	135,453	1.97	266,842.41	
	AMCOR	59,759	15.94	952,558.46	
	BHP BILLITON LTD	170,504	23.54	4,013,664.16	
	BLUESCOPE STEEL LTD	30,171	12.01	362,353.71	
	BORAL LIMITED	48,785	6.87	335,152.95	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,834	4.86	378,273.24	
	INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.52	285,971.84	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,221	19.69	457,221.49	
	NEWCREST MINING LIMITED	39,517	21.74	859,099.58	
	ORICA LTD	19,570	20.18	394,922.60	
	RIO TINTO LTD	22,142	62.94	1,393,617.48	
SOUTH32 LTD	272,725	2.67	728,175.75		
CIMIC GROUP LIMITED	6,260	39.24	245,642.40		

BRAMBLES LTD	81,398	10.21	831,073.58
SEEK LTD	17,113	16.38	280,310.94
AURIZON HOLDINGS LTD	119,504	5.44	650,101.76
QANTAS AIRWAYS LIMITED	32,962	5.32	175,357.84
TRANSURBAN GROUP	106,431	12.43	1,322,937.33
ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,499	22.26	701,167.74
CROWN RESORTS LTD	22,372	12.86	287,703.92
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	54.69	162,648.06
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	35.85	107,119.80
TABCORP HOLDINGS	46,982	4.54	213,298.28
TATTS GROUP LTD	69,654	4.14	288,367.56
REA GROUP LTD	3,000	63.60	190,800.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	3.62	134,016.02
WESFARMERS LTD	59,789	40.06	2,395,147.34
WOOLWORTHS LTD	67,676	25.95	1,756,192.20
COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,080	8.90	312,212.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,741	13.13	482,409.33
COCHLEAR LIMITED	3,025	151.04	456,896.00
HEALTHSCOPE LTD	92,574	2.10	194,405.40
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,451	68.25	508,530.75
SONIC HEALTHCARE LTD	19,613	23.09	452,864.17
CSL LIMITED	24,136	135.05	3,259,566.80
AUST AND NZ BANKING GROUP	155,651	27.71	4,313,089.21
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	10.89	207,977.22
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	10.57	252,401.03
COMMONWEALTH BANK OF AUST	90,686	79.19	7,181,424.34
NATIONAL AUSTRALIA BANK	141,217	29.40	4,151,779.80
WESTPAC BANKING	178,154	29.97	5,339,275.38
AMP LTD	155,734	4.99	777,112.66
ASX LTD	10,197	50.52	515,152.44
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	12.72	388,354.32
MACQUARIE GROUP LIMITED	16,018	86.51	1,385,717.18
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	124,658	6.26	780,359.08
MEDIBANK PRIVATE LTD	157,000	2.78	436,460.00
QBE INSURANCE GROUP	70,777	12.85	909,484.45
SUNCORP GROUP LIMITED	66,486	14.12	938,782.32
COMPUTERSHARE LIMITED	28,680	14.29	409,837.20
TELSTRA CORP	216,367	4.37	945,523.79
TPG TELECOM LTD	22,697	5.60	127,103.20
AGL ENERGY LTD	34,713	25.32	878,933.16
AUSNET SERVICES	117,666	1.67	196,502.22
	3,890,191		59,060,501.88

オーストラリアドル 小計				(4,902,612,261)
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,101	7.66	307,173.66
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	7.10	348,709.40
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	8.47	186,340.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	105,967	3.68	389,958.56
	CONTACT ENERGY LTD	36,737	5.17	189,930.29
	MERCURY NZ LTD	27,226	3.27	89,029.02
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	2.87	183,777.58
ニュージーランドドル 小計		345,179		1,694,918.51 (134,559,580)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	143,948	100.00	14,394,800.00
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	15.34	1,127,490.00
	MTR CORP	77,500	44.10	3,417,750.00
	LI & FUNG	377,400	2.99	1,128,426.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	66,500	36.30	2,413,950.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	31.70	1,489,900.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	125,000	47.10	5,887,500.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	16.42	991,768.00
	SANDS CHINA LTD	127,800	36.10	4,613,580.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	90,000	12.76	1,148,400.00
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	7.98	1,117,200.00
	WYNN MACAU LTD	70,000	17.78	1,244,600.00
	WH GROUP LTD	438,000	7.36	3,223,680.00
	BANK EAST ASIA	67,964	33.80	2,297,183.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	35.15	6,889,400.00
	HANG SENG BANK	40,500	163.90	6,637,950.00
	FIRST PACIFIC CO	112,000	5.89	659,680.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	61,900	205.40	12,714,260.00
	AIA GROUP LTD	630,600	56.30	35,502,780.00
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	142,948	61.05	8,726,975.40
	HANG LUNG GROUP LTD	34,000	33.80	1,149,200.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	117,000	21.15	2,474,550.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	63,274	46.00	2,910,604.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	38.00	1,178,000.00
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	27.70	1,024,900.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	10.70	3,263,500.00
	SINO LAND CO	186,600	13.58	2,534,028.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	77,000	121.50	9,355,500.00
SWIRE PACIFIC A	28,500	79.00	2,251,500.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	26.50	1,775,500.00	
WHARF HOLDINGS	61,000	69.55	4,242,550.00	
WHEELLOCK & CO LTD	40,000	63.30	2,532,000.00	

	PCCW LTD	212,000	4.44	941,280.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	66.25	2,120,000.00	
	CLP HOLDINGS	87,500	84.15	7,363,125.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	444,428	15.00	6,666,420.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	70.45	5,178,075.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	119.00	1,392,300.00	
	香港ドル 小計	4,997,462		173,980,304.60	(2,460,081,507)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	77,300	6.41	495,493.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	3.13	194,060.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.77	281,996.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	83,600	1.23	102,828.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.41	274,499.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,500	10.08	327,600.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	17,000	5.15	87,550.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	319,700	1.19	380,443.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	3.25	274,787.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	43.45	199,870.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.37	180,086.40	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.46	265,728.00	
	DBS GROUP	95,300	20.72	1,974,616.00	
	OCBC BANK	167,950	10.68	1,793,706.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	70,400	23.60	1,661,440.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	7.38	313,650.00	
	CAPITALAND LTD	149,000	3.60	536,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	10.95	240,900.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	130,900	2.96	387,464.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	7.67	148,798.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	436,080	3.74	1,630,939.20		
STARHUB LTD	21,000	2.71	56,910.00		
	シンガポールドル 小計	2,588,000		11,809,764.10	(940,647,710)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	860	230.90	198,574.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	15.33	436,659.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	670	442.30	296,341.00	
	BANK HAPUALIM BM	64,237	23.39	1,502,503.43	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,035	17.16	1,407,720.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	63.80	400,153.60	
	AZRIELI GROUP	3,267	193.00	630,531.00	
	NICE LTD	3,244	275.00	892,100.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	6.18	724,881.66	
		306,250		6,489,465.01	

イスラエルシェケル 小計			(202,665,992)	
合 計	60,910,177		191,181,239,728	(191,181,239,728)

(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	299,000	121,095.00	
	アメリカドル 小計		299,000	121,095.00	(13,348,301)
	オーストラリアドル	APA GROUP	58,685	548,117.90	
		LENLEASE GROUP	27,483	440,277.66	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	396,275.25	
	オーストラリアドル 小計		140,083	1,384,670.81	(114,941,523)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	933,400.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	165,000	1,692,900.00	
	香港ドル 小計		295,000	2,626,300.00	(37,135,882)
	投資信託受益証券合計			734,083	165,425,706
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	17,365	370,742.75	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,187	496,703.81	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,729	2,961,134.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	53,901	653,819.13	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,313	1,425,961.87	
		BOSTON PROPERTIES	8,178	1,024,212.72	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,955	301,070.85	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	446,352.86	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	26,900	381,711.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	19,229	1,962,511.74	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,441	956,534.12	
		DUKE REALTY CORP	18,713	532,384.85	
		EQUINIX INC	4,086	1,794,612.06	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,460	1,316,079.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,477	925,681.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,639	494,738.28	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,790	472,537.20	
		GGP INC	30,510	711,493.20	
		HCP INC	24,801	773,295.18	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	39,222	720,900.36	
IRON MOUNTAIN INC	13,197	439,592.07			

	KIMCO REALTY CORP	22,428	416,039.40	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,682	321,030.78	
	MACERICH CO/THE	7,181	419,011.35	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,265	671,608.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	276,086.00	
	PROLOGIS INC	28,159	1,608,723.67	
	PUBLIC STORAGE	7,860	1,631,421.60	
	REALTY INCOME CORP	13,723	759,019.13	
	REGENCY CENTERS CORP	8,074	503,575.38	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	6,582	883,962.60	
	SIMON PROPERTY GROUP	16,780	2,610,968.00	
	SL GREEN REALTY CORP	5,123	543,960.14	
	UDR INC	14,110	567,504.20	
	VENTAS INC	18,846	1,260,232.02	
	VEREIT INC	51,309	426,890.88	
	VORNADO REALTY TRUST	9,035	846,127.75	
	WELLTOWER INC	19,307	1,418,099.15	
アメリカドル 小計		603,010	34,326,329.73	(3,783,791,326)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,959	229,853.72	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	228,097.50	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	2,942	94,232.26	
カナダドル 小計		21,846	552,183.48	(45,245,914)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902	158,303.46	
	GECINA SA	2,385	327,222.00	
	ICADE	1,843	137,358.79	
	KLEPIERRE	11,404	430,329.94	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,256	1,227,538.80	
ユーロ 小計		1,628,374	2,280,752.99	(281,695,801)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,566	313,504.95	
	HAMMERSON PLC	46,892	276,428.34	
	INTU PROPERTIES PLC	53,831	142,867.47	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	40,691	431,324.60	
	SEGRO PLC	45,745	228,953.72	
イギリスポンド 小計		236,725	1,393,079.08	(195,783,333)
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	48,367	493,343.40	
	GOODMAN GROUP	94,201	785,636.34	
	GPT GROUP	106,799	542,538.92	

	MIRVAC GROUP	195,169	431,323.49
	SCENTRE GROUP	277,205	1,158,716.90
	STOCKLAND	121,481	566,101.46
	VICINITY CENTERS	198,963	545,158.62
	WESTFIELD CORP	101,837	855,430.80
	オーストラリアドル 小計	1,144,022	5,378,249.93 (446,448,526)
香港ドル	LINK REIT	118,500	7,495,125.00
	香港ドル 小計	118,500	7,495,125.00 (105,981,067)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	324,810.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	180,400.00
	CAPITALAND MALL TRUST	144,600	278,355.00
	SUNTEC REIT	113,000	207,920.00
	シンガポールドル 小計	487,900	991,485.00 (78,971,780)
	投資証券合計	4,240,377	4,937,917,747 (4,937,917,747)
	合計		5,103,343,453 (5,103,343,453)

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 609銘柄	97.0%			63.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 38銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式 92銘柄	99.4%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	98.9%			13.0%
	投資証券 6銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.6%			7.1%
	投資証券 5銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%

デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	89.7%			2.5%
	投資信託受 益証券	3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券	8銘柄			8.2%	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%			1.3%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式	22銘柄	92.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	平成29年 6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	106,279,219
金銭信託	139,585,092
コール・ローン	1,307,348,363
国債証券	153,605,404,392
派生商品評価勘定	2,022,807
未収入金	2,701,806
未収利息	1,249,331,459
前払費用	30,668,889
差入委託証拠金	128,193,021
流動資産合計	156,571,535,048
資産合計	156,571,535,048
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,365,468
前受金	2,022,807
未払金	30,061,102
未払解約金	326,792,939

	平成29年 6月12日現在
項目	金額（円）
未払利息	3,213
その他未払費用	2,490
流動負債合計	375,248,019
負債合計	375,248,019
純資産の部	
元本等	
元本	68,417,295,002
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,778,992,027
元本等合計	156,196,287,029
純資産合計	156,196,287,029
負債純資産合計	156,571,535,048

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成29年 6月12日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	68,417,295,002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 2.2830円 (1万口当たり純資産額) (22,830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29年 6月12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29年 6月12日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 6月11日
期首元本額	74,640,797,505円
期中追加設定元本額	8,687,907,090円

区分	平成29年 6月12日現在
期中一部解約元本額	14,911,409,593円
期末元本額	68,417,295,002円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,520,717,654円
D C 外国債券インデックスファンド	1,797,844,350円
D C 外国債券インデックスファンド L	10,827,182,342円
D C バランスファンド 3 0	625,671,770円
D C バランスファンド 5 0	631,881,266円
D C バランスファンド 7 0	119,930,790円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	467,079,287円
外国債券インデックス e	1,561,282,870円
インデックスコレクション（外国債券）	2,815,634,240円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	1,531,602,575円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	273,743,667円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	75,175,527円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,281,018,380円
外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,358,682,349円
外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,400,399,910円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	507,792,568円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	2,171,099,962円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	690,567,142円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,067,118,146円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	10,886,173円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,978,284,287円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	2,972,639,154円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	954,247,506円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	9,795,070,457円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	458,849,277円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	5,981,077,299円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	2,328,105,114円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	183,491,963円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	700,020,288円
V A バランス株式 4 0（適格機関投資家専用）	170,526,805円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	146,675,789円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	73,215,749円
バランス V A 2 0（適格機関投資家専用）	138,705,178円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	4,098,330,227円
バランス V A 2 0 L（適格機関投資家専用）	18,541,469円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	392,760,272円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	121,096,540円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	2,139,703,086円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	30,549,751円

区分	平成29年 6月12日現在
世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	93,823円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,970,286,178
合計		1,970,286,178

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」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29年 6月12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	836,879,306	-	838,902,113	2,022,807
	合計	836,879,306	-	838,902,113	2,022,807

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成29年 6月12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	1,141,000,344	-	1,124,763,800	16,236,544
	アメリカドル	529,382,142	-	522,395,400	6,986,742
	カナダドル	61,999,406	-	61,447,500	551,906
	ユーロ	455,398,748	-	449,576,400	5,822,348
	イギリスポンド 売建	94,220,048	-	91,344,500	2,875,548
	イギリスポンド	47,262,085	-	47,391,009	128,924
	イギリスポンド	47,262,085	-	47,391,009	128,924

合計	1,188,262,429	-	1,172,154,809	16,365,468
----	---------------	---	---------------	------------

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 06/15/19	2,800,000.00	2,773,855.70	
		T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,949,703.10	
		T 0.875% 09/15/19	7,100,000.00	7,021,397.81	
		T 0.875% 10/15/18	6,000,000.00	5,968,669.74	
		T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,981,726.68	
		T 1.125% 05/31/19	2,850,000.00	2,838,486.37	
		T 1.125% 06/15/18	1,900,000.00	1,897,696.93	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,913,284.52	
		T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,162,244.30	
		T 1.25% 01/31/20	4,000,000.00	3,980,040.44	
		T 1.25% 03/31/19	2,920,000.00	2,915,896.52	
		T 1.25% 03/31/21	2,300,000.00	2,266,348.99	
		T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,996,836.12	
		T 1.25% 11/15/18	9,000,000.00	8,994,819.69	
		T 1.25% 12/15/18	5,500,000.00	5,496,302.73	
		T 1.25% 12/31/18	5,000,000.00	4,996,272.10	
		T 1.375% 01/31/21	6,550,000.00	6,493,478.34	
		T 1.375% 02/28/19	4,050,000.00	4,054,091.87	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,988,618.10	
		T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,224,893.27	
		T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,968,342.83	
		T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,981,702.35	
		T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,504,298.91	

T 1.375% 07/31/18	3,000,000.00	3,003,807.09
T 1.375% 08/31/20	3,350,000.00	3,331,366.59
T 1.375% 09/30/18	5,970,000.00	5,977,855.14
T 1.375% 09/30/20	5,200,000.00	5,168,052.96
T 1.375% 09/30/23	5,000,000.00	4,829,126.25
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,959,389.30
T 1.375% 11/30/18	3,000,000.00	3,003,712.83
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,703,665.29
T 1.5% 01/31/19	1,900,000.00	1,905,736.06
T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,966,097.18
T 1.5% 02/28/19	5,900,000.00	5,917,739.05
T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	4,112,016.13
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,912,679.52
T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,354,078.55
T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	7,822,978.91
T 1.5% 08/31/18	2,500,000.00	2,507,144.15
T 1.5% 10/31/19	3,200,000.00	3,207,878.46
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,009,882.80
T 1.5% 12/31/18	2,500,000.00	2,507,537.52
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,503,677.07
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,423,956.85
T 1.625% 04/30/19	4,000,000.00	4,021,857.68
T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	7,972,690.27
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,157,282.79
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,279,164.20
T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	4,021,915.60
T 1.625% 07/31/19	3,500,000.00	3,519,024.28
T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,203,249.98
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,387,118.88
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,953,461.32
T 1.625% 12/31/19	2,250,000.00	2,261,338.80
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,632,136.48
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,649,037.60
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,497,743.90
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,996,980.50
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,595,130.02
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,734,351.41
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,811,934.86
T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	3,014,627.04
T 1.875% 05/31/22	5,850,000.00	5,875,365.19
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,234,823.29
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,606,937.03

T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,002,789.30
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,521,604.45
T 1% 03/15/19	1,550,000.00	1,541,510.29
T 1% 05/31/18	5,600,000.00	5,587,202.09
T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,191,784.99
T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,777,518.49
T 1% 09/15/18	2,350,000.00	2,342,157.81
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,957,848.65
T 1% 11/30/19	2,600,000.00	2,574,524.23
T 2.125% 01/31/21	5,000,000.00	5,088,744.30
T 2.125% 03/31/24	4,200,000.00	4,232,485.74
T 2.125% 05/15/25	5,250,000.00	5,254,028.06
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,051,828.45
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,117,076.45
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,949,940.92
T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	1,018,065.68
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,034,149.40
T 2.125% 12/31/22	4,600,000.00	4,662,881.40
T 2.25% 02/15/27	2,600,000.00	2,608,713.06
T 2.25% 03/31/21	6,900,000.00	7,054,679.23
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,804,659.22
T 2.25% 07/31/18	1,500,000.00	1,516,791.64
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,599,237.91
T 2.25% 08/15/46	5,850,000.00	5,119,897.41
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,063,202.40
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,549,208.44
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,558,653.77
T 2.375% 05/31/18	1,500,000.00	1,516,313.85
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,529,449.07
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,850,939.74
T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,415,052.13
T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	4,969,745.21
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	7,872,906.12
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,817,511.96
T 2.5% 08/15/23	5,000,000.00	5,165,326.20
T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,480,361.79
T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,431,238.06
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,047,714.42
T 2.75% 02/15/24	7,250,000.00	7,596,808.82
T 2.75% 08/15/42	2,550,000.00	2,512,052.04
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,663,763.98
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,853,214.41
T 2.875% 05/15/43	6,700,000.00	6,735,472.01

T 2.875% 08/15/45	8,200,000.00	8,210,506.74
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,136,222.69
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,543,654.19
T 2% 02/15/25	7,550,000.00	7,499,836.44
T 2% 02/28/21	6,150,000.00	6,233,370.44
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,570,457.25
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,056,654.80
T 2% 07/31/22	6,000,000.00	6,054,612.84
T 2% 08/15/25	7,950,000.00	7,869,020.34
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,249,922.08
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,248,721.00
T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,352,273.20
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,653,545.50
T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,838,304.25
T 2% 11/30/22	500,000.00	503,701.33
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,417,630.58
T 3.125% 02/15/42	1,800,000.00	1,900,635.73
T 3.125% 02/15/43	1,270,000.00	1,336,361.89
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,743,273.77
T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,595,172.62
T 3.125% 08/15/44	7,500,000.00	7,889,312.92
T 3.125% 11/15/41	1,600,000.00	1,690,563.64
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,650,526.18
T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	6,177,611.93
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,245,828.37
T 3.5% 05/15/20	300,000.00	317,291.21
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,360,381.05
T 3.625% 02/15/21	4,050,000.00	4,339,545.84
T 3.625% 02/15/44	5,850,000.00	6,715,605.78
T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	5,765,432.20
T 3.625% 08/15/43	2,500,000.00	2,866,433.35
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,286,001.88
T 3.75% 11/15/18	2,000,000.00	2,069,172.08
T 3.75% 11/15/43	1,400,000.00	1,640,036.91
T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,844,913.97
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,528,136.38
T 3% 05/15/45	1,000,000.00	1,026,384.82
T 3% 05/15/47	2,000,000.00	2,054,426.30
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,105,898.68
T 4.0% 08/15/18	300,000.00	309,647.01
T 4.25% 05/15/39	1,200,000.00	1,506,303.99
T 4.25% 11/15/40	1,400,000.00	1,759,171.51

	T 4.375% 02/15/38	700,000.00	895,523.49
	T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	2,043,346.01
	T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,729,122.91
	T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,340,051.69
	T 4.5% 02/15/36	1,500,000.00	1,945,752.60
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,300,390.14
	T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,622,320.75
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,980,286.03
	T 4.75% 02/15/41	350,000.00	471,677.37
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	896,423.34
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	651,449.38
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,168,237.96
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,017,567.58
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	329,665.75
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	783,912.58
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,430,335.59
	T 6.25% 05/15/30	1,200,000.00	1,726,270.53
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,692,082.23
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	615,635.95
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,293,754.80
	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,201,765.40
	アメリカドル 小計	601,210,000.00	612,460,685.58 (67,511,541,371)
カナダドル	CAN 0.5% 02/01/19	200,000.00	199,340.00
	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	832,128.75
	CAN 0.5% 08/01/18	1,700,000.00	1,696,455.50
	CAN 0.5% 11/01/18	1,450,000.00	1,446,099.50
	CAN 0.75% 09/01/21	1,500,000.00	1,490,137.50
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,057,166.25
	CAN 1.5% 03/01/20	1,730,000.00	1,763,017.05
	CAN 1.5% 06/01/23	1,500,000.00	1,537,320.00
	CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,471,677.50
	CAN 1.75% 03/01/19	1,550,000.00	1,577,535.75
	CAN 1.75% 09/01/19	1,100,000.00	1,124,084.50
	CAN 1% 06/01/27	350,000.00	336,241.50
	CAN 2.25% 06/01/25	530,000.00	570,711.95
	CAN 2.5% 06/01/24	1,350,000.00	1,471,533.75
	CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,194,248.00
	CAN 2.75% 12/01/48	970,000.00	1,129,860.85
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	430,029.25
	CAN 3.25% 06/01/21	1,700,000.00	1,856,646.50
	CAN 3.5% 06/01/20	3,250,000.00	3,506,945.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,570,000.00	2,054,274.35

	CAN 3.75% 06/01/19	2,090,000.00	2,212,578.50
	CAN 4.0% 06/01/41	1,340,000.00	1,835,136.70
	CAN 4.25% 06/01/18	1,650,000.00	1,706,826.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,350,000.00	1,959,147.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,050,000.00	1,620,895.50
	CAN 5% 06/01/37	1,200,000.00	1,799,670.00
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	773,032.80
	カナダドル 小計	34,410,000.00	38,652,739.95 (3,167,205,511)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,283,968.00
	MBONO 10% 12/05/24	26,900,000.00	31,482,549.50
	MBONO 4.75% 06/14/18	23,300,000.00	22,767,944.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	3,600,000.00	3,290,184.00
	MBONO 5% 12/11/19	12,550,000.00	11,957,891.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	14,000,000.00	13,669,740.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	26,800,000.00	26,281,152.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,300,000.00	7,511,590.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	12,950,000.00	13,632,983.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	16,350,000.00	17,355,852.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,250,000.00	8,720,621.25
	MBONO 8.5% 05/31/29	9,450,000.00	10,496,162.25
	MBONO 8.5% 11/18/38	9,950,000.00	11,355,835.50
	MBONO 8.5% 12/13/18	21,600,000.00	22,030,704.00
	MBONO 8% 06/11/20	14,950,000.00	15,327,188.50
	MBONO 8% 11/07/47	3,000,000.00	3,279,870.00
	MBONO 8% 12/07/23	6,550,000.00	6,872,718.50
	メキシコペソ 小計	223,900,000.00	234,316,954.50 (1,422,303,913)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,430,000.00	1,490,217.30
	BGB 0.8% 06/22/27	450,000.00	458,622.00
	BGB 1.25% 06/22/18	850,000.00	866,269.00
	BGB 1.6% 06/22/47	550,000.00	539,511.50
	BGB 1.9% 06/22/38	500,000.00	549,242.50
	BGB 1% 06/22/26	1,440,000.00	1,512,604.80
	BGB 1% 06/22/31	1,100,000.00	1,098,746.00
	BGB 2.15% 06/22/66	240,000.00	252,841.20
	BGB 2.25% 06/22/23	1,580,000.00	1,810,229.70
	BGB 2.25% 06/22/57	300,000.00	328,864.50
	BGB 2.6% 06/22/24	1,350,000.00	1,588,956.75
	BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	1,188,120.00
	BGB 3.75% 09/28/20	2,100,000.00	2,399,218.50
	BGB 3% 06/22/34	650,000.00	838,935.50

BGB 3% 09/28/19	1,170,000.00	1,267,431.75
BGB 4.0% 03/28/19	1,300,000.00	1,408,400.50
BGB 4.25% 03/28/41	1,630,000.00	2,555,921.50
BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,503,537.50
BGB 4.25% 09/28/22	1,450,000.00	1,800,117.00
BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,297,239.25
BGB 4% 03/28/22	790,000.00	956,535.95
BGB 4% 03/28/32	760,000.00	1,077,372.20
BGB 5.5% 03/28/28	1,580,000.00	2,399,403.80
BGB 5% 03/28/35	1,630,000.00	2,651,724.75
BKO 0% 12/14/18	850,000.00	860,144.75
BTPS 0.3% 10/15/18	1,300,000.00	1,309,964.50
BTPS 0.35% 11/01/21	3,300,000.00	3,267,808.50
BTPS 0.65% 10/15/23	1,650,000.00	1,591,590.00
BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,215,126.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,800,000.00	1,695,924.00
BTPS 1.45% 09/15/22	250,000.00	256,933.75
BTPS 1.5% 06/01/25	1,750,000.00	1,726,716.25
BTPS 1.5% 08/01/19	1,300,000.00	1,342,789.50
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,319,044.50
BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	407,337.75
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,815,336.50
BTPS 2.2% 06/01/27	570,000.00	576,526.50
BTPS 2.25% 09/01/36	1,320,000.00	1,221,356.40
BTPS 2.5% 05/01/19	1,000,000.00	1,049,250.00
BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,914,228.00
BTPS 2.7% 03/01/47	1,800,000.00	1,623,303.00
BTPS 2.8% 03/01/67	420,000.00	354,364.50
BTPS 2% 12/01/25	1,650,000.00	1,679,081.25
BTPS 3.25% 09/01/46	900,000.00	907,510.50
BTPS 3.5% 03/01/30	3,270,000.00	3,660,111.00
BTPS 3.5% 06/01/18	150,000.00	155,574.00
BTPS 3.5% 12/01/18	1,800,000.00	1,898,037.00
BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,926,742.00
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,747,346.00
BTPS 3.75% 08/01/21	2,400,000.00	2,717,976.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,900,000.00	2,186,985.50
BTPS 4.25% 02/01/19	3,250,000.00	3,483,918.75
BTPS 4.25% 03/01/20	2,600,000.00	2,888,119.00
BTPS 4.25% 09/01/19	4,350,000.00	4,761,031.50
BTPS 4.5% 02/01/20	2,250,000.00	2,508,930.00
BTPS 4.5% 03/01/19	3,800,000.00	4,103,962.00
BTPS 4.5% 03/01/24	2,410,000.00	2,888,903.15

BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,735,055.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	500,000.00	596,192.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	1,950,000.00	2,056,938.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	2,550,000.00	3,094,017.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,990,000.00	4,687,013.10	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,250,000.00	2,803,095.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,550,000.00	1,966,074.25	
BTPS 4% 02/01/37	2,100,000.00	2,465,536.50	
BTPS 4% 09/01/20	2,870,000.00	3,215,246.65	
BTPS 5.0% 08/01/39	1,740,000.00	2,291,797.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,600,000.00	3,409,744.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	2,098,667.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,350,000.00	4,146,295.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	1,500,000.00	2,095,410.00	
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,736,106.75	
BTPS 5% 03/01/25	2,300,000.00	2,861,372.50	
BTPS 5% 08/01/34	2,800,000.00	3,659,796.00	
BTPS 5% 09/01/40	1,850,000.00	2,413,861.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	1,250,000.00	1,760,856.25	
BTPS 6% 05/01/31	3,300,000.00	4,656,910.50	
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	511,092.75	
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,653,740.00	
DBR 0.25% 02/15/27	1,030,000.00	1,028,923.65	
DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	729,883.00	
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,105,450.00	
DBR 0% 08/15/26	1,850,000.00	1,819,521.25	
DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,154,730.50	
DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,506,111.60	
DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,617,583.75	
DBR 1.5% 09/04/22	500,000.00	550,345.00	
DBR 1.75% 02/15/24	1,800,000.00	2,036,907.00	
DBR 1.75% 07/04/22	2,500,000.00	2,778,862.50	
DBR 1% 08/15/24	2,900,000.00	3,136,393.50	
DBR 1% 08/15/25	2,750,000.00	2,971,760.00	
DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	2,081,032.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,650,000.00	4,090,098.75	
DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,371,062.75	
DBR 2.5% 07/04/44	1,770,000.00	2,349,144.00	
DBR 2.5% 08/15/46	1,820,000.00	2,438,672.60	
DBR 2% 01/04/22	1,870,000.00	2,086,751.70	
DBR 2% 08/15/23	1,350,000.00	1,540,269.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,250,000.00	2,482,380.00	

DBR 3.25% 07/04/21	1,300,000.00	1,505,250.50
DBR 3.25% 07/04/42	1,350,000.00	2,011,581.00
DBR 3.5% 07/04/19	4,500,000.00	4,897,867.50
DBR 3.75% 01/04/19	2,630,000.00	2,817,584.75
DBR 3% 07/04/20	2,150,000.00	2,395,680.50
DBR 4.0% 01/04/37	1,950,000.00	3,060,690.75
DBR 4.25% 07/04/18	2,650,000.00	2,792,305.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,220,000.00	2,032,221.10
DBR 4.75% 07/04/28	800,000.00	1,180,668.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,770,000.00	2,914,968.75
DBR 4.75% 07/04/40	1,420,000.00	2,541,324.30
DBR 5.5% 01/04/31	1,520,000.00	2,506,814.40
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,328,232.50
DBR 6.25% 01/04/24	1,100,000.00	1,568,710.00
DBR 6.25% 01/04/30	800,000.00	1,364,912.00
DBR 6.5% 07/04/27	800,000.00	1,297,056.00
FRTR 0.25% 11/25/20	2,050,000.00	2,101,752.25
FRTR 0.25% 11/25/26	1,550,000.00	1,504,786.50
FRTR 0.5% 05/25/25	3,600,000.00	3,661,344.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,255,253.75
FRTR 0.5% 11/25/19	1,000,000.00	1,026,415.00
FRTR 0% 02/25/19	500,000.00	505,142.50
FRTR 0% 02/25/20	2,200,000.00	2,231,922.00
FRTR 0% 05/25/20	1,500,000.00	1,523,460.00
FRTR 0% 05/25/21	1,000,000.00	1,016,255.00
FRTR 1.25% 05/25/36	1,450,000.00	1,424,944.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,550,000.00	2,705,244.00
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,888,782.00
FRTR 1.75% 05/25/66	400,000.00	380,088.00
FRTR 1.75% 06/25/39	600,000.00	632,532.00
FRTR 1.75% 11/25/24	2,550,000.00	2,848,426.50
FRTR 1% 05/25/19	1,050,000.00	1,082,907.00
FRTR 1% 11/25/18	300,000.00	307,056.00
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,356,838.40
FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,753,052.95
FRTR 2.25% 10/25/22	2,100,000.00	2,378,481.00
FRTR 2.5% 05/25/30	2,950,000.00	3,512,815.75
FRTR 2.5% 10/25/20	3,750,000.00	4,132,406.25
FRTR 2.75% 10/25/27	3,300,000.00	3,985,740.00
FRTR 3.25% 05/25/45	2,700,000.00	3,658,918.50
FRTR 3.25% 10/25/21	4,350,000.00	5,045,695.50
FRTR 3.5% 04/25/20	3,000,000.00	3,350,985.00
FRTR 3.5% 04/25/26	4,350,000.00	5,520,063.00

FRTR 3.75% 04/25/21	4,050,000.00	4,711,972.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,550,000.00	3,918,614.25	
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,356,337.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,250,000.00	5,730,453.75	
FRTR 4.25% 10/25/18	2,800,000.00	2,987,012.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	3,900,000.00	4,975,386.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,700,000.00	4,325,764.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,450,000.00	3,842,237.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,370,000.00	2,188,869.55	
FRTR 4% 04/25/60	1,150,000.00	1,878,289.25	
FRTR 4% 10/25/38	2,300,000.00	3,412,590.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	2,650,000.00	4,064,835.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	2,700,000.00	4,494,028.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,050,000.00	3,025,933.25	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,800,000.00	2,718,684.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,643,544.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	240,000.00	251,497.20	
IRISH 1.7% 05/15/37	370,000.00	375,664.70	
IRISH 1% 05/15/26	570,000.00	586,051.20	
IRISH 2.4% 05/15/30	830,000.00	953,201.05	
IRISH 2% 02/18/45	590,000.00	605,649.75	
IRISH 3.4% 03/18/24	590,000.00	716,634.65	
IRISH 3.9% 03/20/23	500,000.00	613,312.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	750,000.00	824,505.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,100,000.00	1,255,490.50	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	853,960.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,200,000.00	1,652,256.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	520,000.00	598,426.40	
IRISH 5% 10/18/20	730,000.00	863,268.80	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,500,000.00	1,537,065.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	810,000.00	816,038.55	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,550,000.00	1,576,396.50	
NETHER 0% 01/15/22	550,000.00	560,021.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	610,000.00	629,355.30	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,550,000.00	1,732,876.75	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,600,000.00	1,814,072.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,220,000.00	1,531,636.80	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,080,000.00	1,505,314.80	
NETHER 2% 07/15/24	1,600,000.00	1,829,088.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	1,300,000.00	1,502,754.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,720,000.00	1,942,258.40	
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	368,055.00	

NETHER 3.75% 01/15/42	1,400,000.00	2,216,291.00
NETHER 4.0% 07/15/18	1,800,000.00	1,893,456.00
NETHER 4% 01/15/37	1,320,000.00	2,058,896.40
NETHER 4% 07/15/19	1,310,000.00	1,440,312.25
NETHER 5.5% 01/15/28	1,200,000.00	1,830,426.00
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,006,859.00
OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,854,684.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,450,000.00	1,483,618.25
OBL 0% 04/08/22	950,000.00	971,175.50
OBL 0% 04/17/20	1,050,000.00	1,071,451.50
OBL 1% 02/22/19	2,300,000.00	2,369,655.50
OBL 1% 10/12/18	1,450,000.00	1,484,901.50
RAGB 0.25% 10/18/19	100,000.00	102,063.50
RAGB 0.75% 10/20/26	1,050,000.00	1,079,505.00
RAGB 0% 07/15/23	150,000.00	150,727.50
RAGB 1.15% 10/19/18	250,000.00	256,087.50
RAGB 1.2% 10/20/25	1,160,000.00	1,249,929.00
RAGB 1.65% 10/21/24	800,000.00	890,264.00
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	782,211.50
RAGB 1.95% 06/18/19	750,000.00	789,206.25
RAGB 2.4% 05/23/34	510,000.00	619,650.00
RAGB 3.15% 06/20/44	860,000.00	1,206,291.90
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,558,082.50
RAGB 3.5% 09/15/21	1,450,000.00	1,694,368.50
RAGB 3.65% 04/20/22	800,000.00	955,220.00
RAGB 3.8% 01/26/62	300,000.00	508,887.00
RAGB 3.9% 07/15/20	1,100,000.00	1,252,256.50
RAGB 4.15% 03/15/37	1,180,000.00	1,808,019.60
RAGB 4.35% 03/15/19	1,500,000.00	1,632,337.50
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,328,209.25
RAGB 6.25% 07/15/27	520,000.00	822,244.80
RFGB 0.5% 04/15/26	490,000.00	497,911.05
RFGB 0.75% 04/15/31	390,000.00	388,268.40
RFGB 0.875% 09/15/25	250,000.00	263,398.75
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	253,771.25
RFGB 1.125% 09/15/18	520,000.00	532,248.60
RFGB 1.5% 04/15/23	770,000.00	845,105.80
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	417,718.80
RFGB 2.625% 07/04/42	430,000.00	569,330.75
RFGB 2.75% 07/04/28	480,000.00	594,537.60
RFGB 2% 04/15/24	300,000.00	341,167.50
RFGB 3.375% 04/15/20	850,000.00	946,789.50
RFGB 3.5% 04/15/21	1,000,000.00	1,153,810.00

	RFGB 4.375% 07/04/19	300,000.00	331,401.00	
	RFGB 4% 07/04/25	480,000.00	628,982.40	
	SPGB 0.25% 01/31/19	400,000.00	403,562.00	
	SPGB 0.4% 04/30/22	170,000.00	171,445.85	
	SPGB 0.75% 07/30/21	1,000,000.00	1,031,600.00	
	SPGB 1.15% 07/30/20	1,000,000.00	1,040,855.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	1,050,000.00	1,049,170.50	
	SPGB 1.4% 01/31/20	1,850,000.00	1,930,419.50	
	SPGB 1.5% 04/30/27	950,000.00	956,146.50	
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,305,762.50	
	SPGB 1.95% 04/30/26	1,760,000.00	1,865,186.40	
	SPGB 1.95% 07/30/30	1,700,000.00	1,722,100.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,150,000.00	2,320,140.25	
	SPGB 2.35% 07/30/33	450,000.00	461,484.00	
	SPGB 2.75% 04/30/19	550,000.00	581,911.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	2,200,000.00	2,488,552.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	860,000.00	881,444.10	
	SPGB 3.45% 07/30/66	400,000.00	428,720.00	
	SPGB 3.75% 10/31/18	1,450,000.00	1,534,129.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,900,000.00	2,284,769.00	
	SPGB 4.1% 07/30/18	3,100,000.00	3,256,643.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,640,000.00	2,111,746.00	
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,659,272.00	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,850,000.00	2,290,799.50	
	SPGB 4.6% 07/30/19	2,600,000.00	2,870,309.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,850,000.00	2,364,253.75	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	1,916,413.85	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,400,000.00	1,773,184.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	1,800,000.00	2,101,590.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,350,000.00	1,906,227.00	
	SPGB 4% 04/30/20	2,050,000.00	2,297,096.75	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,010,000.00	1,380,523.55	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,070,000.00	1,569,256.65	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,450,000.00	3,134,260.50	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,647,910.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,550,000.00	2,313,514.50	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,000,000.00	2,529,780.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,588,251.75	
	SPGB 6.0% 01/31/29	3,100,000.00	4,537,780.00	
	ユーロ 小計	420,410,000.00	498,307,251.10 (61,545,928,583)	
イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	1,200,000.00	1,204,416.00	

	UKT 1.25% 07/22/18	2,880,000.00	2,916,172.80
	UKT 1.5% 01/22/21	1,400,000.00	1,464,827.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,800,000.00	1,888,146.00
	UKT 1.5% 07/22/47	250,000.00	239,710.00
	UKT 1.75% 07/22/19	2,900,000.00	3,001,703.00
	UKT 1.75% 07/22/57	400,000.00	421,334.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,050,000.00	2,192,762.00
	UKT 1.75% 09/07/37	550,000.00	557,807.25
	UKT 2.25% 09/07/23	2,000,000.00	2,207,670.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,150,000.00	1,529,879.50
	UKT 2.75% 09/07/24	1,600,000.00	1,834,104.00
	UKT 2% 07/22/20	3,050,000.00	3,225,405.50
	UKT 2% 09/07/25	1,450,000.00	1,588,794.00
	UKT 3.25% 01/22/44	2,780,000.00	3,681,428.90
	UKT 3.5% 01/22/45	1,150,000.00	1,600,213.50
	UKT 3.5% 07/22/68	1,780,000.00	3,024,024.20
	UKT 3.75% 07/22/52	1,380,000.00	2,168,407.80
	UKT 3.75% 09/07/19	850,000.00	920,061.25
	UKT 3.75% 09/07/20	1,490,000.00	1,664,970.70
	UKT 3.75% 09/07/21	1,050,000.00	1,205,783.25
	UKT 4.25% 03/07/36	2,000,000.00	2,863,860.00
	UKT 4.25% 06/07/32	1,250,000.00	1,728,525.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,600,000.00	2,362,368.00
	UKT 4.25% 12/07/27	1,050,000.00	1,388,661.75
	UKT 4.25% 12/07/40	1,400,000.00	2,094,925.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,850,000.00	2,943,701.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,360,000.00	2,247,821.60
	UKT 4.25% 12/07/55	1,530,000.00	2,709,063.90
	UKT 4.5% 03/07/19	800,000.00	861,572.00
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,565,907.05
	UKT 4.5% 12/07/42	1,750,000.00	2,767,493.75
	UKT 4.75% 03/07/20	2,390,000.00	2,695,633.20
	UKT 4.75% 12/07/30	1,350,000.00	1,930,709.25
	UKT 4.75% 12/07/38	950,000.00	1,484,693.25
	UKT 4% 01/22/60	1,340,000.00	2,364,255.80
	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,408,463.00
	UKT 5% 03/07/25	1,850,000.00	2,447,651.75
	UKT 6.0% 12/07/28	950,000.00	1,454,958.25
	UKT 8% 06/07/21	800,000.00	1,048,732.00
	イギリスポンド 小計	61,200,000.00	78,906,616.70 (11,089,535,911)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	570,000.00	625,170.30
	SWISS 2% 04/28/21	250,000.00	277,368.75

	SWISS 3% 05/12/19	490,000.00	527,455.60
	SWISS 4% 02/11/23	300,000.00	379,663.50
	SWISS 4% 04/08/28	520,000.00	755,019.20
スイスフラン 小計		2,130,000.00	2,564,677.35 (291,860,282)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	2,900,000.00	2,931,131.50
	SGB 1.5% 11/13/23	6,800,000.00	7,445,218.00
	SGB 1% 11/12/26	5,360,000.00	5,655,094.80
	SGB 2.5% 05/12/25	5,350,000.00	6,311,796.25
	SGB 3.5% 03/30/39	4,250,000.00	5,928,750.00
	SGB 3.5% 06/01/22	8,450,000.00	10,019,503.00
	SGB 4.25% 03/12/19	8,950,000.00	9,737,197.25
	SGB 5% 12/01/20	8,400,000.00	10,013,892.00
スウェーデンクローナ 小計		50,460,000.00	58,042,582.80 (734,819,098)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,150,000.00	3,183,153.75
	NGB 1.75% 02/17/27	2,050,000.00	2,104,591.50
	NGB 1.75% 03/13/25	3,490,000.00	3,604,873.35
	NGB 2% 05/24/23	4,650,000.00	4,889,358.75
	NGB 3.75% 05/25/21	7,400,000.00	8,235,534.00
	NGB 3% 03/14/24	3,800,000.00	4,244,638.00
	NGB 4.5% 05/22/19	6,500,000.00	6,992,115.00
ノルウェークローネ 小計		31,040,000.00	33,254,264.35 (431,640,351)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/18	3,310,000.00	3,350,580.60
	DGB 0.5% 11/15/27	1,650,000.00	1,647,706.50
	DGB 1.5% 11/15/23	5,450,000.00	5,995,381.50
	DGB 1.75% 11/15/25	6,300,000.00	7,110,873.00
	DGB 3% 11/15/21	9,000,000.00	10,335,195.00
	DGB 4.5% 11/15/39	11,450,000.00	19,338,534.75
	DGB 4% 11/15/19	8,670,000.00	9,636,098.10
デンマーククローネ 小計		45,830,000.00	57,414,369.45 (953,652,676)
ポーランドズロチ	POLGB 0% 10/25/18	700,000.00	683,648.00
	POLGB 1.5% 04/25/20	1,850,000.00	1,818,448.25
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	1,992,784.50
	POLGB 2.25% 04/25/22	950,000.00	934,809.50
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,450,000.00	3,481,964.25
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	3,009,147.75
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,300,000.00	1,227,167.50
	POLGB 2% 04/25/21	2,860,000.00	2,817,171.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,150,000.00	3,234,813.75

	POLGB 3.25% 07/25/25	2,650,000.00	2,700,800.50
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,073,956.55
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,600,000.00	2,850,523.00
	POLGB 5.5% 10/25/19	1,900,000.00	2,053,330.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,150,000.00	1,450,167.25
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,800,000.00	2,073,969.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,250,000.00	1,418,393.75
	ポーランドズロチ 小計	33,680,000.00	34,821,095.05 (1,027,222,303)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,746,088.75
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,400,000.00	1,363,712.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,350,000.00	2,430,311.25
	ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	561,370.40
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,460,000.00	1,496,215.30
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,750,000.00	1,792,726.25
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,200,000.00	1,223,838.00
	ACGB 2% 12/21/21	1,400,000.00	1,404,431.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,480,000.00	2,648,131.60
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,230,000.00	1,313,824.50
	ACGB 3.25% 06/21/39	400,000.00	405,814.00
	ACGB 3.25% 10/21/18	1,050,000.00	1,073,215.50
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,000,000.00	1,102,595.00
	ACGB 3% 03/21/47	700,000.00	650,800.50
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,800,000.00	3,217,746.00
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,750,000.00	2,961,048.75
	ACGB 4.5% 04/21/33	950,000.00	1,154,430.50
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,886,972.00
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,010,000.00	3,197,884.20
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,000,000.00	2,375,380.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,000,000.00	2,293,340.00
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,363,220.00
	オーストラリアドル 小計	36,660,000.00	39,663,095.50 (3,292,433,557)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	140,000.00	138,651.80
	SIGB 1.625% 10/01/19	310,000.00	312,407.15
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	201,814.00
	SIGB 2.25% 06/01/21	720,000.00	739,425.60
	SIGB 2.25% 08/01/36	200,000.00	198,411.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	150,000.00	154,413.75
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	922,216.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	220,000.00	236,341.60
	SIGB 2.75% 04/01/42	400,000.00	429,252.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	600,000.00	632,718.00

	SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	107,274.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	396,749.15
	SIGB 2% 07/01/20	100,000.00	101,955.50
	SIGB 3.125% 09/01/22	250,000.00	268,017.50
	SIGB 3.25% 09/01/20	620,000.00	656,502.50
	SIGB 3.375% 09/01/33	230,000.00	262,886.55
	SIGB 3.5% 03/01/27	650,000.00	729,719.25
	SIGB 3% 09/01/24	590,000.00	633,432.85
	SIGB 4% 09/01/18	450,000.00	465,700.50
	シンガポールドル 小計	7,200,000.00	7,587,889.70 (604,375,414)
マレーシアリングgit	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,925,712.75
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,575,280.00
	MGS 3.492% 03/31/20	1,200,000.00	1,200,186.00
	MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	637,628.95
	MGS 3.58% 09/28/18	1,680,000.00	1,687,593.60
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	950,565.25
	MGS 3.759% 03/15/19	200,000.00	201,704.00
	MGS 3.844% 04/15/33	630,000.00	598,386.60
	MGS 3.889% 07/31/20	1,350,000.00	1,363,533.75
	MGS 3.892% 03/15/27	640,000.00	631,616.00
	MGS 4.127% 04/15/32	1,080,000.00	1,050,829.20
	MGS 4.16% 07/15/21	2,000,000.00	2,040,700.00
	MGS 4.181% 07/15/24	2,200,000.00	2,249,632.00
	MGS 4.254% 05/31/35	200,000.00	195,778.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,864,974.00
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,697,198.25
	MGS 4.498% 04/15/30	2,350,000.00	2,387,893.75
	MGS 4.935% 09/30/43	1,450,000.00	1,486,431.25
	MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,038,563.75
	マレーシアリングgit 小計	25,550,000.00	25,784,207.10 (666,521,753)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	18,142,117.50
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,488,615.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,150,000.00	5,850,844.25
	SAGB 6.75% 03/31/21	5,550,000.00	5,415,495.75
	SAGB 7.25% 01/15/20	6,100,000.00	6,083,164.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	3,700,000.00	3,680,760.00
	SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,425,069.60
	SAGB 8.25% 03/31/32	5,300,000.00	4,912,252.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	8,400,000.00	7,651,266.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	7,150,000.00	6,535,636.25
	SAGB 8.75% 02/28/48	12,800,000.00	11,707,712.00

	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,670,850.00	
	SAGB 8% 01/31/30	6,300,000.00	5,835,564.00	
	SAGB 8% 12/21/18	4,150,000.00	4,188,574.25	
	SAGB 9% 01/31/40	3,950,000.00	3,741,163.50	
	南アフリカランド 小計	109,540,000.00	101,329,084.10 (866,363,669)	
	合計		153,605,404,392 (153,605,404,392)	

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 171銘柄	100.0%	44.0%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 266銘柄	100.0%	40.1%
イギリスポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	7.2%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7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 16銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期中間計算期間(平成29年 6月13日から平成29年12月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (平成29年 6月12日現在)	第11期中間計算期間 (平成29年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	993,329	-
コール・ローン	9,303,477	10,166,073
親投資信託受益証券	3,264,776,909	3,556,551,999
未収入金	11,020,763	13,243,040
流動資産合計	3,286,094,478	3,579,961,112
資産合計	3,286,094,478	3,579,961,112
負債の部		
流動負債		
未払解約金	495,440	91,074
未払受託者報酬	872,230	920,156
未払委託者報酬	9,594,421	10,121,711
未払利息	22	15
その他未払費用	87,177	91,958
流動負債合計	11,049,290	11,224,914
負債合計	11,049,290	11,224,914
純資産の部		
元本等		
元本	2,197,223,013	2,158,299,225
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	1,077,822,175	1,410,436,973
(分配準備積立金)	1,068,376,873	992,507,485
元本等合計	3,275,045,188	3,568,736,198
純資産合計	3,275,045,188	3,568,736,198
負債純資産合計	3,286,094,478	3,579,961,112

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 平成28年 6月11日 至 平成28年12月10日	第11期中間計算期間 自 平成29年 6月13日 至 平成29年12月12日
営業収益		
受取利息	11	5
有価証券売買等損益	273,254,249	365,718,889
営業収益合計	273,254,260	365,718,894
営業費用		
支払利息	4,574	3,269
受託者報酬	778,709	920,156
委託者報酬	8,565,697	10,121,711
その他費用	78,103	91,960
営業費用合計	9,427,083	11,137,096
営業利益又は営業損失（ ）	263,827,177	354,581,798
経常利益又は経常損失（ ）	263,827,177	354,581,798
中間純利益又は中間純損失（ ）	263,827,177	354,581,798
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,944,975	12,649,973
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	686,050,482	1,077,822,175
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,363,657	69,564,883
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	32,363,657	69,564,883
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,939,839	78,881,910
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,939,839	78,881,910
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	953,356,502	1,410,436,973

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期中間計算期間は平成29年 6月13日から平成29年12月12日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第10期 (平成29年 6月12日現在)	第11期中間計算期間 (平成29年12月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,197,223,013口	2,158,299,225口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4905円 (14,905円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6535円 (16,535円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第11期中間計算期間 (平成29年12月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第11期中間計算期間 (平成29年12月12日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第10期 自 平成28年 6月11日 至 平成29年 6月12日	第11期中間計算期間 自 平成29年 6月13日 至 平成29年12月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,191,360,846円	2,197,223,013円
期中追加設定元本額	259,687,608円	122,317,797円
期中一部解約元本額	253,825,441円	161,241,585円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	平成29年12月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,349,769,340
株式	241,932,251,520
派生商品評価勘定	56,441,700
未収入金	63,932,600
未収配当金	43,925,946
差入委託証拠金	63,655,000
流動資産合計	244,509,976,106
資産合計	244,509,976,106
負債の部	
流動負債	
前受金	56,460,600
未払金	8,009,050
未払解約金	122,198,176
未払利息	3,501
その他未払費用	105
流動負債合計	186,671,432
負債合計	186,671,432
純資産の部	
元本等	
元本	130,787,642,542
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	113,535,662,132
元本等合計	244,323,304,674
純資産合計	244,323,304,674
負債純資産合計	244,509,976,106

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	平成29年12月12日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,787,642,542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 1.8681円 (1万口当たり純資産額) (18,681円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 6月13日
期首元本額	139,501,925,120円
期中追加設定元本額	4,365,787,267円
期中一部解約元本額	13,080,069,845円
期末元本額	130,787,642,542円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	815,005,915円
D C日本株式インデックスファンド	344,215,396円
D C日本株式インデックスファンドL	51,209,395,772円
D C日本株式インデックスファンドA	1,183,000,262円
D Cバランスファンド30	1,827,653,689円
D Cバランスファンド50	2,800,828,535円
D Cバランスファンド70	1,436,520,871円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	646,791,658円
日本株式インデックスe	1,902,401,412円
インデックスコレクション（国内株式）	10,113,054,624円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,749,086,665円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,281,223,841円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,017,937,775円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,286,782,060円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,374,773,877円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,569,418,300円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	252,241,299円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	2,287,790,938円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	159,874,855円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	817,938,674円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	35,466,342円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	946,508,201円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,635,597,394円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	757,466,814円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,710,138,601円

区分	平成29年12月12日現在
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,069,014,702円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	1,209,895,423円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,920,595,467円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	53,452,679円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	564,362,524円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	106,085,284円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,069,426,604円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	91,629,857円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	89,174,183円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	45,329,220円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,288,000,229円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,090,904,526円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	31,591,948円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	504,439,047円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	8,046,535,502円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	152,377,659円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	74,712,985円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	13,470,087円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	199,168,182円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,172,901円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	189,763円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成29年12月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,229,828,300	-	2,286,270,000	56,441,700
	合計	2,229,828,300	-	2,286,270,000	56,441,700

(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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	平成29年12月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,318,079,703
コール・ローン	1,080,241,752
株式	203,128,984,871
投資信託受益証券	166,978,186
投資証券	5,109,246,676
派生商品評価勘定	250,913,251
未収入金	25,982,244
未収配当金	359,744,317
差入委託証拠金	2,194,110,030
流動資産合計	219,634,281,030
資産合計	219,634,281,030
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,102,109
前受金	236,584,359
未払解約金	141,825,791
未払利息	1,609
その他未払費用	67
流動負債合計	389,513,935
負債合計	389,513,935
純資産の部	
元本等	
元本	82,939,477,202
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	136,305,289,893
元本等合計	219,244,767,095
純資産合計	219,244,767,095
負債純資産合計	219,634,281,030

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

平成29年12月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	82,939,477,202口

		平成29年12月12日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6434円 (26,434円)	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		平成29年12月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。		

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	平成29年 6月13日

区分	平成29年12月12日現在
期首元本額	87,969,112,695円
期中追加設定元本額	4,120,581,067円
期中一部解約元本額	9,150,216,560円
期末元本額	82,939,477,202円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,006,708,148円
DC外国株式インデックスファンド	4,398,985,472円
DC外国株式インデックスファンドL	18,459,571,949円
DCバランスファンド30	658,132,383円
DCバランスファンド50	1,335,028,311円
DCバランスファンド70	756,922,129円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	451,743,879円
外国株式インデックスe	6,121,143,153円
インデックスコレクション（外国株式）	4,653,391,149円
インデックスコレクション（バランス株式30）	1,754,875,742円
インデックスコレクション（バランス株式50）	607,299,448円
インデックスコレクション（バランス株式70）	539,394,281円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,715,769,580円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,292,110,787円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,228,197,882円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	182,945,302円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,635,225,031円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	114,474,130円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	585,688,606円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	12,455,559円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	3,388,713,680円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	805,405,570円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	473,145,816円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,044,937,359円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	865,035,410円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	2,599,568,527円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,375,207,719円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	38,272,934円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	407,162,701円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	70,769,695円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	196,833,483円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	574,640,221円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	31,394,813円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	922,245,858円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	21,710,876円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	165,779,044円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	427,820,972円

区分	平成29年12月12日現在
私募外国株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	20,769,603円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成29年12月12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	10,401,622,510	-	10,638,206,869	236,584,359
合計		10,401,622,510	-	10,638,206,869	236,584,359

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成29年12月12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	999,407,214	-	1,002,575,250	3,168,036
	アメリカドル	751,064,454	-	751,133,250	68,796
	ユーロ	158,897,640	-	160,476,000	1,578,360
	イギリスポンド	89,445,120	-	90,966,000	1,520,880
	売建	250,977,047	-	250,918,300	58,747
	アメリカドル	201,053,537	-	201,005,900	47,637
	イギリスポンド	18,195,000	-	18,194,400	600
	スイスフラン	17,178,810	-	17,178,000	810
	香港ドル	14,549,700	-	14,540,000	9,700
合計		1,250,384,261	-	1,253,493,550	3,226,783

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	平成29年12月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	101,911,636
コール・ローン	2,042,678,260
国債証券	148,608,870,053
派生商品評価勘定	13,180,641
未収入金	5,171,907
未収利息	1,173,427,240
前払費用	22,301,648
差入委託証拠金	134,802,490
流動資産合計	152,102,343,875
資産合計	152,102,343,875
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,409,456
前受金	3,116,559
未払金	8,506,929
未払解約金	137,103,541
未払利息	3,043
その他未払費用	88
流動負債合計	151,139,616
負債合計	151,139,616
純資産の部	
元本等	
元本	62,557,762,934
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,393,441,325
元本等合計	151,951,204,259
純資産合計	151,951,204,259
負債純資産合計	152,102,343,875

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1)先物取引</p>

平成29年12月12日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	62,557,762,934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 2.4290円 (1万口当たり純資産額) (24,290円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	平成29年12月12日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 6月13日
期首元本額	68,417,295,002円
期中追加設定元本額	1,970,428,066円
期中一部解約元本額	7,829,960,134円
期末元本額	62,557,762,934円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,440,976,037円
DC外国債券インデックスファンド	1,807,587,285円
DC外国債券インデックスファンドL	11,057,398,951円
DCバランスファンド30	620,551,338円
DCバランスファンド50	630,567,614円

区分	平成29年12月12日現在
DCバランスファンド70	122,397,509円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	475,150,570円
外国債券インデックスe	1,497,554,363円
インデックスコレクション（外国債券）	3,004,673,148円
インデックスコレクション（バランス株式30）	1,680,413,406円
インデックスコレクション（バランス株式50）	289,810,486円
インデックスコレクション（バランス株式70）	79,351,148円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,441,990,270円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,473,125,354円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,151,749,946円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	424,322,003円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,654,953,279円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	587,288,740円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,001,725,900円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	6,309,724円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,811,188,264円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,707,282,886円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	876,303,401円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,147,165,524円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	434,159,474円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	3,240,501,017円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,205,057,678円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	163,652,784円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	611,082,248円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	145,876,095円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	140,275,108円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	68,253,701円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	127,520,027円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,943,398,329円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	15,926,796円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	350,050,066円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	107,951,172円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,981,800,451円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	32,329,715円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	91,127円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成29年12月12日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,334,771,797	-	1,337,888,356	3,116,559
	合計	1,334,771,797	-	1,337,888,356	3,116,559

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成29年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,788,774,010	-	1,796,227,900	7,453,890
	アメリカドル	805,870,219	-	814,153,500	8,283,281
	カナダドル	91,743,269	-	92,725,500	982,231
	ユーロ	754,359,059	-	752,899,900	1,459,159
	イギリスポンド 売建	136,801,463	-	136,449,000	352,463
	イギリスポンド 売建	45,982,395	-	45,781,659	200,736
	イギリスポンド 売建	45,982,395	-	45,781,659	200,736
	合計	1,834,756,405	-	1,842,009,559	7,654,626

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

【純資産額計算書】

(平成29年12月29日現在)

資産総額	3,566,007,562円
負債総額	2,474,138円
純資産総額(-)	3,563,533,424円
発行済口数	2,148,542,096口
1口当たり純資産額(/)	1.6586円
(1万口当たり純資産額)	(16,586円)

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(平成29年12月29日現在)

資産総額	245,179,551,303円
負債総額	870,725,259円
純資産総額(-)	244,308,826,044円
発行済口数	130,439,957,509口
1口当たり純資産額(/)	1.8730円
(1万口当たり純資産額)	(18,730円)

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(平成29年12月29日現在)

資産総額	219,169,259,456円
負債総額	210,343,154円
純資産総額(-)	218,958,916,302円
発行済口数	82,065,199,710口
1口当たり純資産額(/)	2.6681円
(1万口当たり純資産額)	(26,681円)

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(平成29年12月29日現在)

資産総額	151,800,361,625円
負債総額	1,469,716,933円
純資産総額(-)	150,330,644,692円
発行済口数	62,012,857,487口
1口当たり純資産額(/)	2.4242円
(1万口当たり純資産額)	(24,242円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成29年12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年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成30年 3月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年12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	491	9,487,686
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	237,473
単位型公社債投資信託	0	0
合計	559	9,725,159

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。

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

また、第32期事業年度の中間会計期間（自平成29年4月1日 至 平成29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28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	68,500	71,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日
至 平成28年3月31日）（自 平成28年4月 1日
至 平成29年3月31日）

営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

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

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

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
	建 物	54,302	千円	62,231
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
-------	---------	---------	---------	--------

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額（単位：千円）

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
-----	---------	---------

12,699	307	604
--------	-----	-----

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円

普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株
--------------	--------	--------

中間貸借対照表

(単位：千円)

		第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559
無形固定資産		
投資その他の資産		220,928
投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747
固定資産合計		586,236
資産合計		28,454,709
負債の部		
流動負債		
未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123
固定負債		
退職給付引当金		464,737
資産除去債務		13,260
その他固定負債		1,569
固定負債合計		479,568
負債合計		4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末
（平成29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	74,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	20,972,132
利益剰余金合計	23,146,632
株主資本合計	23,796,632
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	384
評価・換算差額等合計	384
純資産合計	23,797,016
負債・純資産合計	28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

		第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
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			1,978,187	1,978,187	1,978,187
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	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,978,187
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	1,519	1,519	1,519
当中間期変動額合計	1,519	1,519	1,949,707
当中間期末残高	384	384	23,797,016

重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 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。）</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p>

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
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32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目	
受取利息	1,314千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29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	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(*)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。

(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 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	20,229	18,356	1,872
小計	20,229	18,356	1,872
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	52,590	53,909	1,318
小計	52,590	53,909	1,318
合計	72,820	72,266	554

（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「其他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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）	1,564,703千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97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いません。	

（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32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
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30年 3月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成29年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成28年6月11日から平成29年6月12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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成29年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年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 業務執行社員	公認会計士	藤澤 孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知 明 印

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年2月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成29年6月13日から平成29年12月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成29年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年6月13日から平成29年12月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。