【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】	2019年3月11日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　橋詰　廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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】

①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。
②三井住友トラスト・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。
③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】

2019年 3月12日から2019年 9月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：http://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞
「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。
販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

収益分配金の再投資をする場合を除き、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号ロ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。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、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。

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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	ＭＭＦ ＭＲＦ ＥＴＦ	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

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

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］
(1)株式
①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

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

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

［為替ヘッジによる属性区分］
(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行な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コクサイ・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。

●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

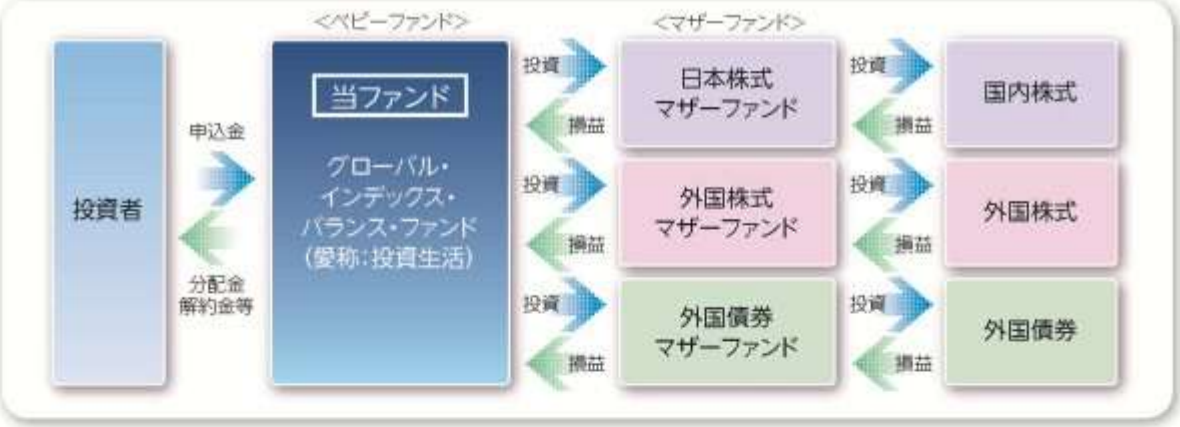
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
↓		
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

●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。

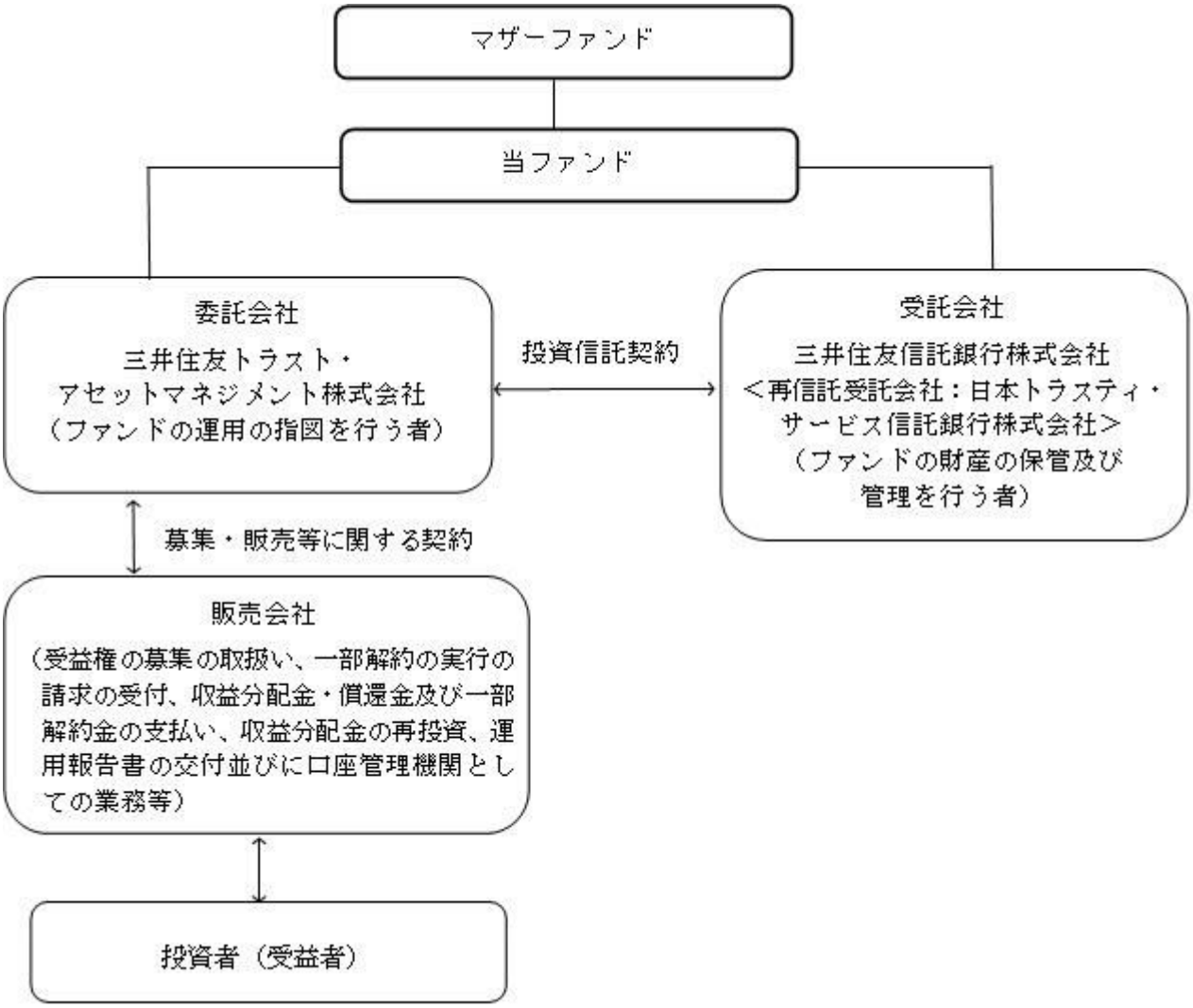
（２）【ファンドの沿革】

2008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
2010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
2012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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2018年12月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 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。

② 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】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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す。）

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

② 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書

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書

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書で、上記１．から11．までの証券又は証書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書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

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

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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す。）

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．の証券又は証書並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記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。

③　運用指図できる金融商品

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で上記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②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

①　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。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　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。

④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤　国内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。

⑥　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。

⑦　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

①　株式への投資割合には制限を設けません。

②　外貨建資産への投資は、行いません。

③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

⑤　同一銘柄の転換社債、並びに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。

⑥　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑦　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、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

①　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。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90％以上）とします。

③　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。

④　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。

⑤　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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

①　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

②　株式への投資割合には制限を設けません。

③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

⑤　同一銘柄の転換社債、並びに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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、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

①　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。

②　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。

③　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。

④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤　国内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。

⑥　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。

⑦　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

①　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ます。）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。

②　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。

③　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

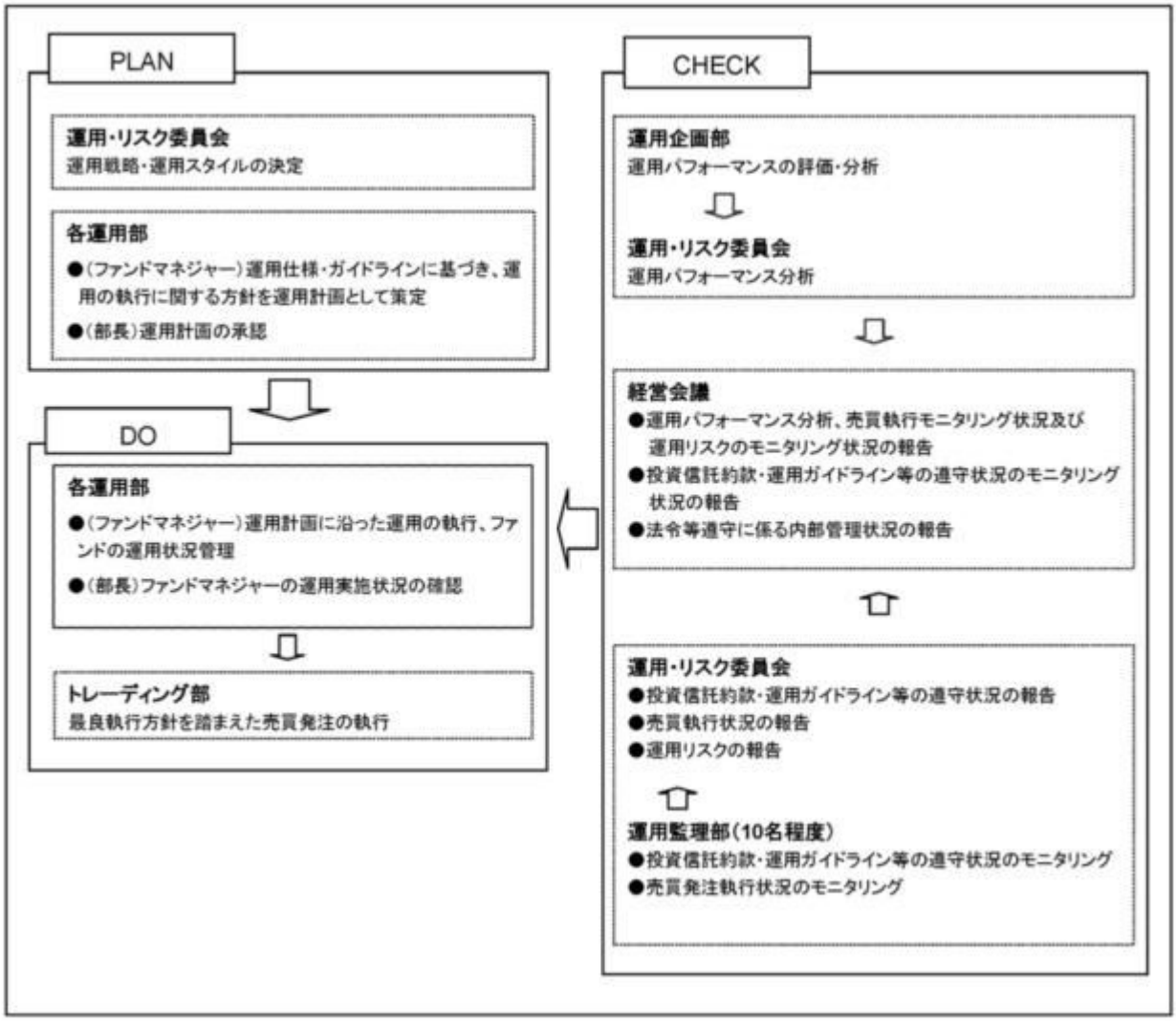
④　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　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。

⑥　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。



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号ロ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。）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ます。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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ます。

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ます。

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ます。

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ます（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。

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たときは、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たときは、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たときは、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たときは、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。

ニ．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。

ニ．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Ｏ．まで及びＱ．からＴ．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Ｏ．まで及びＱ．からＴ．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。

ニ．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。

W．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。

X．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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

② 為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③ 金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

④ 信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤ 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。

⑥ 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＞

① 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

② 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落すること

になります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2014年1月～2018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)※1
先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)※2
新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)※3
日本国債… NOMURA-BPI国債※4
先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)※5
新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)※6
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%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

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に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。

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、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。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（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）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）
ロ．一部解約金及び償還金に対する課税
一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。
ハ．損益通算について
一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。
ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合
NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
②法人の受益者に対する課税

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

	税　率　（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

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

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

※上記は、2018年12月28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、2018年12月28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	3,006,333,049	99.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	12,085,996	0.40

合計(純資産総額)	3,018,419,045	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	451,806,259	2.3041	1,041,006,802	2.3377	1,056,187,491	34.99
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	412,162,660	2.6536	1,093,714,835	2.3778	980,040,372	32.47
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	616,174,534	1.8557	1,143,435,083	1.5744	970,105,186	32.14

(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	99.60
合計	99.60

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第2期計算期間末 (2009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 (2010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 (2011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	(2012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	(2013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	(2014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	(2015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	(2016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	(2017年 6月12日)	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905	14,905
第11期計算期間末	(2018年 6月11日)	3,448,836,583	3,448,836,583	16,204	16,204
	2017年12月末日	3,563,533,424	—	16,586	—
	2018年 1月末日	3,527,344,494	—	16,568	—
	2月末日	3,385,217,170	—	15,964	—
	3月末日	3,309,621,959	—	15,654	—
	4月末日	3,416,767,518	—	16,129	—
	5月末日	3,369,682,028	—	15,924	—
	6月末日	3,393,302,351	—	15,992	—
	7月末日	3,469,693,267	—	16,310	—
	8月末日	3,485,418,468	—	16,364	—
	9月末日	3,575,819,863	—	16,885	—
	10月末日	3,279,263,746	—	15,748	—
	11月末日	3,288,999,203	—	15,976	—
	12月末日	3,018,419,045	—	14,835	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2008年 6月11日～2009年 6月10日	0
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	0
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	0
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	0
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	20
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	20
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	20
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	0
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	0
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第2期計算期間	2008年 6月11日～2009年 6月10日	△26.8
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	△4.0
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	3.4

第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	△5.2
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	45.5
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	16.2
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	23.6
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	△13.8
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	13.5
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	8.7
第12期中間計算期間	2018年 6月12日～2018年12月11日	△4.5

(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2期計算期間	2008年 6月11日～2009年 6月10日	1,395,056,723	201,040,178	1,686,114,589
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	816,801,713	364,200,118	2,138,716,184
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	487,758,083	267,858,897	2,673,563,819
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	366,034,410	642,194,197	2,025,611,326
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	217,108,019	285,901,685	2,128,429,347
第12期中間計算期間	2018年 6月12日～2018年12月11日	83,981,383	148,065,428	2,064,345,302

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

（参考）

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	207,544,360,180	98.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,193,711,941	1.05
合計(純資産総額)		209,738,072,121	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	2,270,120,000	1.08

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

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

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	1,094,800	7,601.87	8,322,537,530	6,406.00	7,013,288,800	3.34
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,748,000	857.24	5,784,695,872	537.90	3,629,749,200	1.73
日本	株式	ソニー	電気機器	658,800	5,574.29	3,672,343,125	5,326.00	3,508,768,800	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	659,400	5,199.32	3,428,435,439	4,482.00	2,955,430,800	1.41
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	402,900	9,186.36	3,701,185,891	7,305.00	2,943,184,500	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	48,200	70,376.94	3,392,168,890	55,680.00	2,683,776,000	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	682,900	5,170.26	3,530,772,135	3,645.00	2,489,170,500	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	828,700	3,915.59	3,244,853,078	2,894.50	2,398,672,150	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,166,400	212.24	2,794,469,537	170.30	2,242,237,920	1.07
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	849,600	2,750.87	2,337,145,095	2,624.00	2,229,350,400	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	679,000	3,160.31	2,145,856,815	3,020.00	2,050,580,000	0.98
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	88,000	20,925.24	1,841,421,969	23,165.00	2,038,520,000	0.97
日本	株式	花王	化学	238,500	7,716.65	1,840,422,403	8,154.00	1,944,729,000	0.93
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	405,600	4,592.22	1,862,605,596	4,783.00	1,939,984,800	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	351,200	5,319.70	1,868,281,280	5,236.00	1,838,883,200	0.88
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	672,500	2,800.85	1,883,574,100	2,662.50	1,790,531,250	0.85
日本	株式	任天堂	その他製品	60,500	47,294.60	2,861,323,689	29,285.00	1,771,742,500	0.84
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	692,200	2,711.74	1,877,071,621	2,472.50	1,711,464,500	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	174,700	11,300.11	1,974,130,505	9,711.00	1,696,511,700	0.81
日本	株式	キヤノン	電気機器	528,900	4,270.71	2,258,782,079	3,001.00	1,587,228,900	0.76
日本	株式	ダイキン工業	機械	134,100	13,767.86	1,846,270,791	11,695.00	1,568,299,500	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	93,400	30,912.78	2,887,253,867	16,670.00	1,556,978,000	0.74

日本	株式	村田製作所	電気機器	103,100	16,138.30	1,663,859,106	14,955.00	1,541,860,500	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	569,300	3,583.15	2,039,892,943	2,616.50	1,489,573,450	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	118,200	17,524.79	2,071,431,130	12,475.00	1,474,545,000	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	169,600	12,240.30	2,075,955,214	8,536.00	1,447,705,600	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	387,800	6,189.89	2,400,443,004	3,705.00	1,436,799,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	797,100	1,909.28	1,521,887,095	1,690.50	1,347,497,550	0.64
日本	株式	資生堂	化学	195,200	6,010.33	1,173,218,262	6,892.00	1,345,318,400	0.64
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	197,800	5,742.35	1,135,836,958	6,615.00	1,308,447,000	0.62

(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	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	3.07
		食料品	4.49
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.42
		医薬品	4.85
		石油・石炭製品	0.70
		ゴム製品	0.82
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	0.99
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.77
		電気機器	12.56
		輸送用機器	8.22
		精密機器	1.88
		その他製品	2.06
		電気・ガス業	2.01
		陸運業	4.89
		海運業	0.17
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.42
		卸売業	5.05
		小売業	5.21
		銀行業	6.44

		証券、商品先物取引業	0.87
		保険業	2.33
		その他金融業	1.16
		不動産業	2.39
		サービス業	4.75
		小計	98.95
合計			98.95

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	152	円	2,354,057,380	2,270,120,000	1.08

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

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

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	100,816,999,339	60.31
	イギリス	10,022,456,452	6.00
	フランス	6,009,797,080	3.60
	カナダ	5,916,487,905	3.54
	スイス	5,719,545,488	3.42
	ドイツ	5,337,794,322	3.19
	オーストラリア	3,801,369,747	2.27
	オランダ	2,805,189,265	1.68
	アイルランド	2,770,158,930	1.66
	スペイン	1,858,227,059	1.11
	香港	1,563,400,905	0.94

	スウェーデン	1,476,346,158	0.88
	イタリア	1,153,628,461	0.69
	デンマーク	1,068,569,798	0.64
	シンガポール	769,777,162	0.46
	フィンランド	761,940,169	0.46
	バミューダ	662,831,421	0.40
	ベルギー	581,407,344	0.35
	ジャージー	446,601,959	0.27
	ノルウェー	442,303,115	0.26
	ケイマン	435,759,709	0.26
	イスラエル	304,208,558	0.18
	キュラソー	250,898,141	0.15
	ルクセンブルク	207,715,346	0.12
	オーストリア	150,459,167	0.09
	ニュージーランド	144,613,588	0.09
	ポルトガル	101,486,233	0.06
	パナマ	97,857,290	0.06
	リベリア	73,355,043	0.04
	パプアニューギニア	29,278,699	0.02
	英ヴァージン諸島	28,462,372	0.02
	マン島	19,508,138	0.01
	モーリシャス	9,264,715	0.01
	小計	155,837,699,078	93.23
投資信託受益証券	オーストラリア	94,678,105	0.06
	香港	44,261,452	0.03
	小計	138,939,557	0.08
投資証券	アメリカ	3,259,326,492	1.95
	オーストラリア	312,930,831	0.19
	フランス	196,533,623	0.12
	イギリス	114,791,988	0.07
	香港	107,404,992	0.06
	シンガポール	78,725,277	0.05
	カナダ	37,691,030	0.02
	小計	4,107,404,233	2.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,069,607,662	4.23
合計(純資産総額)		167,153,650,530	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	5,150,970,540	3.08
	買建	カナダ	290,718,254	0.17
	買建	ドイツ	1,321,366,324	0.79
	買建	イギリス	586,965,484	0.35
	買建	オーストラリア	282,186,801	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	―	1,632,618,240	0.98

(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	215,659	18,130.48	3,910,001,468	17,332.64	3,737,941,966	2.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	325,404	10,176.77	3,311,564,320	11,230.98	3,654,605,816	2.19

アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	18,517	160,870.24	2,978,834,399	162,242.04	3,004,235,855	1.80
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	119,951	14,650.28	1,757,316,184	14,142.50	1,696,408,217	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,096	119,744.27	1,687,915,345	115,870.67	1,633,313,105	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	150,456	12,432.40	1,870,530,111	10,771.44	1,620,627,777	0.97
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	107,955	20,253.70	2,186,488,399	14,931.72	1,611,953,833	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,381	120,191.31	1,608,279,970	116,871.90	1,563,862,894	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	189,325	8,671.83	1,641,794,892	7,652.34	1,448,779,271	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,153	22,396.14	1,302,402,817	22,213.32	1,291,771,198	0.77
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	262,477	3,954.39	1,037,937,497	4,756.35	1,248,432,479	0.75
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	136,996	8,659.49	1,186,316,367	8,812.66	1,207,299,854	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	43,094	25,172.24	1,084,772,705	27,302.67	1,176,581,261	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	79,558	13,360.15	1,062,907,504	14,653.10	1,165,772,125	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	424,855	3,453.18	1,467,101,598	2,705.07	1,149,262,515	0.69
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	111,470	9,158.49	1,020,897,040	10,214.21	1,138,579,103	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	184,769	5,656.96	1,045,231,509	6,121.65	1,131,091,149	0.68
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	206,503	4,990.86	1,030,629,365	5,145.96	1,062,656,178	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	85,815	12,947.65	1,111,103,359	12,134.52	1,041,323,834	0.62
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	204,878	6,354.10	1,301,815,413	5,053.83	1,035,418,583	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	324,738	3,925.73	1,274,834,636	3,124.65	1,014,692,592	0.61
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	210,625	4,499.18	947,641,679	4,763.00	1,003,208,981	0.60
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	119,123	6,208.19	739,538,739	8,367.17	996,723,583	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	51,249	21,098.30	1,081,267,224	18,905.51	968,888,994	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	180,973	4,966.64	898,828,683	5,275.83	954,782,783	0.57
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	96,975	8,950.73	867,997,933	9,208.84	893,027,356	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	41,331	18,873.97	780,080,111	20,944.58	865,660,849	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	24,474	37,903.62	927,653,242	35,202.54	861,546,964	0.52
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	31,426	24,726.73	777,062,347	26,528.03	833,670,028	0.50

イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	887,685	1,020.76	906,115,996	896.13	795,485,420	0.48

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	6.14
		素材	4.31
		資本財	6.56
		商業・専門サービス	1.09
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.18
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.82
		メディア・娯楽	5.56
		小売	4.43
		食品・生活必需品小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	4.71
		家庭用品・パーソナル用品	2.05
		ヘルスケア機器・サービス	4.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.45
		銀行	8.00
		各種金融	4.13
		保険	3.64
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	8.12
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93
		電気通信サービス	2.51
		公益事業	3.42
		半導体・半導体製造装置	2.76
		小計	93.23
投資信託受益証券	—	—	0.08
投資証券	—	—	2.46
合計			95.77

(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	372	アメリカドル	46,933,936.5	5,209,666,952	46,405,140	5,150,970,540	3.08
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	21	カナダドル	3,597,508.5	293,268,893	3,566,220	290,718,254	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	36	スイスフラン	3,010,422	338,822,996	2,900,880	326,494,044	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	268	ユーロ	8,063,246	1,024,032,242	7,833,640	994,872,280	0.60
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	3,578,682	279,781,359	3,609,450	282,186,801	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	64	イギリスポンド	4,251,265	597,132,681	4,178,880	586,965,484	0.35

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	10,711,000.00	1,202,755,505	1,187,314,620	0.71
	カナダドル	買建	260,000.00	21,188,180	21,182,200	0.01
	ユーロ	買建	1,800,000.00	230,513,100	228,582,000	0.14
	イギリスポンド	買建	869,000.00	122,861,042	121,982,200	0.07
	スイスフラン	買建	220,000.00	24,773,540	24,763,200	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	550,000.00	6,784,635	6,776,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	250,000.00	4,254,000	4,252,500	0.00
	オーストラリアドル	買建	271,000.00	21,177,024	21,170,520	0.01
	香港ドル	買建	600,000.00	8,502,900	8,502,000	0.01
	シンガポールドル	買建	100,000.00	8,095,500	8,093,000	0.00

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

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

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	60,104,154,925	45.31

	フランス	13,186,534,821	9.94
	イタリア	11,861,381,703	8.94
	ドイツ	9,117,095,482	6.87
	イギリス	8,590,401,476	6.48
	スペイン	7,568,059,717	5.70
	ベルギー	3,194,127,176	2.41
	オランダ	2,752,519,166	2.07
	オーストラリア	2,699,518,803	2.03
	カナダ	2,570,723,747	1.94
	オーストリア	1,923,238,082	1.45
	メキシコ	1,060,389,514	0.80
	アイルランド	1,005,075,332	0.76
	フィンランド	830,451,521	0.63
	ポーランド	813,667,960	0.61
	南アフリカ	732,499,388	0.55
	デンマーク	717,627,913	0.54
	マレーシア	583,173,776	0.44
	シンガポール	522,886,472	0.39
	スウェーデン	480,190,974	0.36
	ノルウェー	304,380,832	0.23
	小計	130,618,098,780	98.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,045,789,183	1.54
合計(純資産総額)		132,663,887,963	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	272,503,268	0.21
	買建	ドイツ	321,607,180	0.24

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

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

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	—	714,412,800	0.54

(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	11,425.00	1,119,650,859	11,220.79	1,099,638,081	3.625	2020/2/15	0.83
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	8,500,000	10,690.59	908,700,927	10,787.28	916,918,888	1.250	2021/3/31	0.69
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	8,250,000	10,905.15	899,674,951	10,919.87	900,889,703	1.375	2020/4/30	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	8,100,000	10,834.04	877,557,564	10,898.32	882,764,072	2.250	2024/1/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	8,100,000	10,587.26	857,568,538	10,654.36	863,003,822	1.625	2023/4/30	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	10,020.48	831,700,276	10,163.37	843,559,830	1.500	2026/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	7,700,000	10,593.06	815,665,851	10,726.62	825,950,037	1.625	2022/8/31	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	7,250,000	11,162.77	809,301,247	11,161.69	809,223,058	2.750	2024/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,200,000	11,249.38	809,955,722	11,233.38	808,803,858	3.125	2044/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,050,000	11,489.31	809,997,026	11,343.21	799,696,954	3.625	2021/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	7,000,000	11,052.93	773,705,520	11,314.17	791,992,192	3.000	2025/9/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,649.70	772,103,626	10,733.29	778,164,077	2.125	2025/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 8.75% 08/15/20	6,340,000	12,515.68	793,494,308	12,184.92	772,524,525	8.750	2020/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	7,050,000	10,725.14	756,122,894	10,714.84	755,396,758	2.875	2045/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	7,500,000	9,927.79	744,584,794	9,927.78	744,583,812	2.500	2046/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	10,380.06	736,984,645	10,484.05	744,367,849	1.375	2023/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/22	6,800,000	10,887.15	740,326,498	10,899.15	741,142,580	2.125	2022/12/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,890.91	729,691,220	10,935.14	732,654,634	2.375	2024/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	6,800,000	10,530.14	716,050,146	10,640.24	723,536,403	2.250	2027/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	5,850,000	12,252.31	716,760,692	12,199.40	713,665,325	3.625	2044/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,812.28	702,798,625	10,837.43	704,432,967	2.000	2023/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	11,367.72	710,482,951	11,244.10	702,756,664	3.125	2021/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	10,706.44	695,918,647	10,783.04	700,898,000	2.250	2025/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	7,450,000	9,390.67	699,604,917	9,393.92	699,847,577	2.250	2046/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	6,330,000	10,590.67	670,389,877	10,659.38	674,738,905	2.250	2027/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 07/31/22	6,000,000	10,867.24	652,034,999	10,878.60	652,716,377	2.000	2022/7/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	10,839.93	650,396,366	10,860.34	651,620,594	1.375	2020/10/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,591.29	640,773,494	10,669.15	645,483,692	2.000	2025/2/15	0.49
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	4,000,000	15,504.84	620,193,769	15,379.44	615,177,840	4.250	2023/10/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 05/31/21	5,500,000	10,972.11	603,466,313	10,953.39	602,436,546	2.000	2021/5/31	0.45

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.46
合計	98.46

(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	10	アメリカドル	1,130,383.77	125,472,599	1,143,671.9	126,947,581	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	6	アメリカドル	715,524	79,423,163	729,187.5	80,939,812	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	4	アメリカドル	557,797.26	61,915,496	582,125	64,615,875	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	5	ユーロ	559,580	71,066,660	559,750	71,088,250	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	5	ユーロ	660,870	83,930,490	662,750	84,169,250	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	8	ユーロ	1,299,072	164,982,144	1,309,840	166,349,680	0.13

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,120,000.00	352,319,820	345,758,400	0.26
	カナダドル	買建	530,000.00	44,770,860	43,157,900	0.03
	ユーロ	買建	2,110,000.00	270,988,325	267,948,900	0.20
	イギリスポンド	買建	410,000.00	58,069,610	57,547,600	0.04

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

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

≪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：2018年12月28日

基準価額・純資産の推移

基準価額	14,835円
純資産総額	30.18億円

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間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	2014年6月	2015年6月	2016年6月	2017年6月	2018年6月
分配金	20円	20円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券マザーファンド	35.0%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.3%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.2%
		T 1.375% 04/30/20	アメリカ	国債	-	1.375%	2020/04/30	0.2%
		T 2.25% 01/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/01/31	0.2%
外国株式マザーファンド	32.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.6%
		JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	-	-	0.3%
日本株式マザーファンド	32.1%	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	-	-	0.6%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：http://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約単位＞
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付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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1万口当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＞

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。（2008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2008年3月3日から2008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）
①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したとき

は、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたこと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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるとき

は、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

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

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間(2017年6月13日から2018年6月11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10期 （2017年 6月12日現在）	第11期 （2018年 6月11日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	993,329	166,252
コール・ローン	9,303,477	10,277,131
親投資信託受益証券	3,264,776,909	3,438,358,570
未収入金	11,020,763	12,154,045
流動資産合計	3,286,094,478	3,460,955,998
資産合計	3,286,094,478	3,460,955,998
負債の部		
流動負債		
未払解約金	495,440	960,096
未払受託者報酬	872,230	922,254
未払委託者報酬	9,594,421	10,144,744
未払利息	22	27
その他未払費用	87,177	92,294
流動負債合計	11,049,290	12,119,415
負債合計	11,049,290	12,119,415
純資産の部		
元本等		
元本	2,197,223,013	2,128,429,347
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,077,822,175	1,320,407,236
（分配準備積立金）	1,068,376,873	1,092,511,120
元本等合計	3,275,045,188	3,448,836,583
純資産合計	3,275,045,188	3,448,836,583
負債純資産合計	3,286,094,478	3,460,955,998

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自　2016年 6月11日 至　2017年 6月12日	第11期 自　2017年 6月13日 至　2018年 6月11日
営業収益		
受取利息	16	6
有価証券売買等損益	417,916,725	306,156,059
営業収益合計	417,916,741	306,156,065
営業費用		
支払利息	8,107	7,009
受託者報酬	1,650,939	1,842,410
委託者報酬	18,160,118	20,266,455
その他費用	165,313	184,343
営業費用合計	19,984,477	22,300,217
営業利益又は営業損失（△）	397,932,264	283,855,848
経常利益又は経常損失（△）	397,932,264	283,855,848
当期純利益又は当期純損失（△）	397,932,264	283,855,848
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（△）	25,737,748	28,915,089
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	98,816,600	128,285,626
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	98,816,600	128,285,626
剰余金減少額又は欠損金増加額	79,239,423	140,641,324
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	79,239,423	140,641,324
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,077,822,175	1,320,407,236

（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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2017年 6月13日から2018年 6月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第10期 (2017年 6月12日現在)	第11期 (2018年 6月11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	2,128,429,347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 1.4905円 (1万口当たり純資産額) (14,905円)	1口当たり純資産額 1.6204円 (1万口当たり純資産額) (16,204円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第10期
自 2016年 6月11日
至 2017年 6月12日

分配金の計算過程

項目		
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
収益調整金額	C	660,430,911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	1,728,807,784円
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	7,868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

第11期
自 2017年 6月13日
至 2018年 6月11日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	68,592,421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	87,408,434円
収益調整金額	C	739,309,472円
分配準備積立金額	D	936,510,265円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,831,820,592円
当ファンドの期末残存口数	F	2,128,429,347口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,606円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 2017年 6月13日 至 2018年 6月11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11期 (2018年 6月11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10期 自 2016年 6月11日 至 2017年 6月12日	第11期 自 2017年 6月13日 至 2018年 6月11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	217,108,019円
期中一部解約元本額	253,825,441円	285,901,685円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第10期 (2017年 6月12日現在)	第11期 (2018年 6月11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	391,922,392	275,243,457
合計	391,922,392	275,243,457

（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	619,055,559	1,151,876,678	
	外国株式マザーファンド	443,271,447	1,175,954,821	
	外国債券マザーファンド	482,271,712	1,110,527,071	
合計		1,544,598,718	3,438,358,570	

(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

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	41,446,663
コール・ローン	2,562,085,073
株式	236,593,974,450
派生商品評価勘定	46,196,820
未収入金	3,478,900
未収配当金	1,610,948,383
差入委託証拠金	115,672,700
流動資産合計	240,973,802,989
資産合計	240,973,802,989
負債の部	
流動負債	
前受金	46,203,300
未払解約金	216,576,383
未払利息	6,789
その他未払費用	40,492
流動負債合計	262,826,964
負債合計	262,826,964
純資産の部	

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	129,367,405,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	111,343,570,475
元本等合計	240,710,976,025
純資産合計	240,710,976,025
負債純資産合計	240,973,802,989

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11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）

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	129,367,405,550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 1.8607円 (1万口当たり純資産額) (18,607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

	2018年 6月11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

	2018年 6月11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。

	2018年 6月11日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 6月13日
期首元本額	139,501,925,120円
期中追加設定元本額	10,139,593,634円
期中一部解約元本額	20,274,113,204円
期末元本額	129,367,405,550円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	805,215,124円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	354,257,194円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,118,821,339円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	1,195,645,593円
ＤＣバランスファンド３０	1,868,790,355円
ＤＣバランスファンド５０	2,863,049,423円
ＤＣバランスファンド７０	1,493,459,270円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	619,055,559円
日本株式インデックスｅ	1,894,468,953円
インデックスコレクション（国内株式）	10,639,449,398円

区分	2018年 6月11日現在
インデックスコレクション（バランス株式３０）	5,018,561,874円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,395,851,249円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,124,585,898円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,215,276,000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）	2,372,685,185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）	2,218,943,814円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	190,668,723円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,791,498,017円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	138,335,864円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	761,187,893円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	16,656,820円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	893,597,544円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,459,050,881円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	676,465,169円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	11,594,191,465円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	991,904,917円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	446,311,534円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,818,618,123円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	51,126,790円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	331,816,697円
ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	23,957,334円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,906,391,666円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	85,479,400円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	85,516,363円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	41,026,694円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	1,232,409,186円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,038,465,656円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	28,815,495円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	464,064,055円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	7,686,409,668円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	139,594,615円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	69,979,946円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	11,407,810円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	189,235,796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）	4,928,526円
世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	176,675円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	△13,660,598,088
合計	△13,660,598,088

(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

（2018年 6月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,721,208,180	－	3,767,405,000	46,196,820
合計		3,721,208,180	－	3,767,405,000	46,196,820

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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 単価(円)	評価額 金額(円)	備考
極洋	4,100	3,810.00	15,621,000	
日本水産	117,100	538.00	62,999,800	
マルハニチロ	19,700	4,085.00	80,474,500	
カネコ種苗	3,600	1,599.00	5,756,400	
サカタのタネ	15,300	4,295.00	65,713,500	
ホクト	10,600	2,012.00	21,327,200	
ホクリヨウ	1,500	901.00	1,351,500	
住石ホールディングス	35,100	159.00	5,580,900	
日鉄鉱業	3,100	5,870.00	18,197,000	
三井松島産業	6,100	1,597.00	9,741,700	
国際石油開発帝石	505,400	1,200.50	606,732,700	
石油資源開発	16,700	2,822.00	47,127,400	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,900	1,848.00	12,751,200	
ヒノキヤグループ	2,600	2,848.00	7,404,800	
ショーボンドホールディングス	9,800	7,740.00	75,852,000	
ミライト・ホールディングス	31,900	1,803.00	57,515,700	

タマホーム	7,800	1,094.00	8,533,200	
サンヨーホームズ	1,800	1,060.00	1,908,000	
日本アクア	3,000	387.00	1,161,000	
ファーストコーポレーション	3,500	1,160.00	4,060,000	
ベステラ	1,900	1,500.00	2,850,000	
ＴＡＴＥＲＵ	9,900	2,189.00	21,671,100	
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,177.00	2,824,800	
第一カッター興業	1,400	2,961.00	4,145,400	
安藤・間	81,000	992.00	80,352,000	
東急建設	40,100	1,076.00	43,147,600	
コムシスホールディングス	36,500	2,978.00	108,697,000	
ミサワホーム	8,800	991.00	8,720,800	
ビーアールホールディングス	10,400	450.00	4,680,000	
高松コンストラクショングループ	6,700	3,220.00	21,574,000	
東建コーポレーション	3,900	10,300.00	40,170,000	
ソネック	1,300	845.00	1,098,500	
ヤマウラ	5,000	897.00	4,485,000	
大成建設	103,300	6,150.00	635,295,000	
大林組	311,200	1,152.00	358,502,400	
清水建設	317,500	1,127.00	357,822,500	
飛島建設	95,400	199.00	18,984,600	
長谷工コーポレーション	120,800	1,601.00	193,400,800	
松井建設	11,600	940.00	10,904,000	
錢高組	1,500	5,790.00	8,685,000	
鹿島建設	456,000	906.00	413,136,000	
不動テトラ	79,600	193.00	15,362,800	
大末建設	3,400	1,345.00	4,573,000	
鉄建建設	6,300	3,050.00	19,215,000	
西松建設	24,000	3,160.00	75,840,000	
三井住友建設	74,400	770.00	57,288,000	
大豊建設	38,000	639.00	24,282,000	
前田建設工業	74,100	1,280.00	94,848,000	
佐田建設	6,900	482.00	3,325,800	
ナカノフドー建設	8,100	709.00	5,742,900	
奥村組	17,100	3,765.00	64,381,500	
東鉄工業	12,500	3,360.00	42,000,000	
イチケン	1,900	2,678.00	5,088,200	
淺沼組	37,000	384.00	14,208,000	
戸田建設	121,000	1,000.00	121,000,000	
熊谷組	16,300	3,785.00	61,695,500	
青木あすなろ建設	6,900	1,018.00	7,024,200	
北野建設	22,000	386.00	8,492,000	

植木組	1,300	2,678.00	3,481,400	
三井ホーム	13,000	716.00	9,308,000	
矢作建設工業	14,200	897.00	12,737,400	
ピーエス三菱	12,500	601.00	7,512,500	
日本ハウスホールディングス	20,000	549.00	10,980,000	
大東建託	37,000	17,970.00	664,890,000	
新日本建設	12,500	1,293.00	16,162,500	
ＮＩＰＰＯ	24,000	2,117.00	50,808,000	
東亜道路工業	2,100	3,910.00	8,211,000	
前田道路	32,500	2,253.00	73,222,500	
日本道路	2,800	6,050.00	16,940,000	
東亜建設工業	8,400	2,872.00	24,124,800	
若築建設	5,600	1,660.00	9,296,000	
東洋建設	32,400	515.00	16,686,000	
五洋建設	123,400	729.00	89,958,600	
世紀東急工業	14,100	770.00	10,857,000	
福田組	3,400	6,970.00	23,698,000	
住友林業	66,400	1,702.00	113,012,800	
日本基礎技術	11,600	381.00	4,419,600	
日成ビルド工業	15,300	1,201.00	18,375,300	
巴コーポレーション	13,100	503.00	6,589,300	
大和ハウス工業	306,500	4,032.00	1,235,808,000	
ライト工業	19,900	1,088.00	21,651,200	
積水ハウス	337,600	1,865.00	629,624,000	
日特建設	8,900	626.00	5,571,400	
北陸電気工事	5,800	1,204.00	6,983,200	
ユアテック	14,500	933.00	13,528,500	
西部電気工業	1,700	3,740.00	6,358,000	
四電工	1,600	2,729.00	4,366,400	
中電工	13,400	3,000.00	40,200,000	
関電工	41,400	1,221.00	50,549,400	
きんでん	69,000	1,843.00	127,167,000	
東京エネシス	11,700	1,281.00	14,987,700	
トーエネック	2,900	3,295.00	9,555,500	
住友電設	8,200	2,053.00	16,834,600	
日本電設工業	15,900	2,490.00	39,591,000	
協和エクシオ	37,300	2,937.00	109,550,100	
新日本空調	8,000	1,723.00	13,784,000	
ＮＤＳ	1,600	6,090.00	9,744,000	
九電工	20,400	5,420.00	110,568,000	
三機工業	22,000	1,117.00	24,574,000	
日揮	89,400	2,243.00	200,524,200	

中外炉工業	3,200	2,881.00	9,219,200	
ヤマト	8,700	732.00	6,368,400	
太平電業	7,000	2,959.00	20,713,000	
高砂熱学工業	28,600	2,047.00	58,544,200	
三晃金属工業	1,200	3,650.00	4,380,000	
朝日工業社	2,200	3,515.00	7,733,000	
明星工業	18,900	865.00	16,348,500	
大氣社	13,100	3,425.00	44,867,500	
ダイダン	7,000	2,427.00	16,989,000	
日比谷総合設備	11,600	2,286.00	26,517,600	
東芝プラントシステム	22,500	2,558.00	57,555,000	
ＯＳＪＢホールディングス	46,200	290.00	13,398,000	
東洋エンジニアリング	12,200	832.00	10,150,400	
千代田化工建設	67,600	916.00	61,921,600	
新興プランテック	19,800	993.00	19,661,400	
日本製粉	30,900	1,913.00	59,111,700	
日清製粉グループ本社	113,800	2,374.00	270,161,200	
日東富士製粉	700	5,290.00	3,703,000	
昭和産業	8,500	2,968.00	25,228,000	
鳥越製粉	8,300	989.00	8,208,700	
中部飼料	11,400	2,082.00	23,734,800	
フィード・ワン	62,000	245.00	15,190,000	
東洋精糖	1,600	1,230.00	1,968,000	
日本甜菜製糖	5,300	2,278.00	12,073,400	
三井製糖	7,300	3,560.00	25,988,000	
塩水港精糖	11,200	265.00	2,968,000	
日新製糖	4,400	2,163.00	9,517,200	
森永製菓	21,700	5,370.00	116,529,000	
中村屋	2,400	4,815.00	11,556,000	
江崎グリコ	26,000	5,500.00	143,000,000	
名糖産業	4,500	1,733.00	7,798,500	
井村屋グループ	3,700	3,375.00	12,487,500	
不二家	5,900	2,578.00	15,210,200	
山崎製パン	75,800	2,665.00	202,007,000	
第一屋製パン	1,600	1,183.00	1,892,800	
モロゾフ	1,600	6,690.00	10,704,000	
亀田製菓	5,800	6,090.00	35,322,000	
寿スピリッツ	8,900	5,900.00	52,510,000	
カルビー	42,200	3,880.00	163,736,000	
森永乳業	18,600	4,215.00	78,399,000	
六甲バター	6,200	2,418.00	14,991,600	
ヤクルト本社	54,100	7,280.00	393,848,000	

明治ホールディングス	61,500	9,310.00	572,565,000	
雪印メグミルク	22,400	2,964.00	66,393,600	
プリマハム	65,000	634.00	41,210,000	
日本ハム	40,200	4,445.00	178,689,000	
林兼産業	3,400	814.00	2,767,600	
丸大食品	50,000	505.00	25,250,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,500	4,505.00	29,282,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	60,000	976.00	58,560,000	
サッポロホールディングス	34,000	2,831.00	96,254,000	
アサヒグループホールディングス	194,700	5,585.00	1,087,399,500	
キリンホールディングス	446,800	2,956.00	1,320,740,800	
宝ホールディングス	69,600	1,425.00	99,180,000	
オエノンホールディングス	26,600	456.00	12,129,600	
養命酒製造	2,800	2,434.00	6,815,200	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	65,200	4,630.00	301,876,000	
サントリー食品インターナショナル	71,100	4,815.00	342,346,500	
ダイドーグループホールディングス	4,800	6,180.00	29,664,000	
伊藤園	30,800	5,010.00	154,308,000	
キーコーヒー	9,100	2,198.00	20,001,800	
ユニカフェ	2,800	1,160.00	3,248,000	
ジャパンフーズ	1,300	1,477.00	1,920,100	
日清オイリオグループ	11,000	3,300.00	36,300,000	
不二製油グループ本社	25,200	4,115.00	103,698,000	
かどや製油	1,000	6,200.00	6,200,000	
Ｊ－オイルミルズ	4,800	3,985.00	19,128,000	
キッコーマン	72,600	5,400.00	392,040,000	
味の素	213,800	2,144.00	458,387,200	
キユーピー	51,800	2,760.00	142,968,000	
ハウス食品グループ本社	35,500	4,060.00	144,130,000	
カゴメ	37,100	3,790.00	140,609,000	
焼津水産化学工業	4,500	1,221.00	5,494,500	
アリアケジャパン	8,500	9,660.00	82,110,000	
ピエトロ	1,200	1,647.00	1,976,400	
エバラ食品工業	2,000	2,419.00	4,838,000	
ニチレイ	44,300	2,850.00	126,255,000	
東洋水産	51,000	3,950.00	201,450,000	
イートアンド	2,600	2,124.00	5,522,400	
大冷	1,000	1,992.00	1,992,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,500	1,029.00	1,543,500	
日清食品ホールディングス	40,500	8,270.00	334,935,000	
永谷園ホールディングス	10,000	1,481.00	14,810,000	
一正蒲鉾	3,600	1,438.00	5,176,800	

フジッコ	10,100	2,721.00	27,482,100	
ロック・フィールド	10,000	1,962.00	19,620,000	
日本たばこ産業	575,100	3,021.00	1,737,377,100	
ケンコーマヨネーズ	6,200	4,405.00	27,311,000	
わらべや日洋ホールディングス	6,100	2,766.00	16,872,600	
なとり	5,200	1,883.00	9,791,600	
イフジ産業	1,600	791.00	1,265,600	
ピックルスコーポレーション	1,800	2,156.00	3,880,800	
北の達人コーポレーション	28,400	832.00	23,628,800	
ユーグレナ	37,000	890.00	32,930,000	
ミヨシ油脂	3,600	1,446.00	5,205,600	
理研ビタミン	3,500	4,420.00	15,470,000	
片倉工業	11,100	1,333.00	14,796,300	
グンゼ	7,300	7,420.00	54,166,000	
東洋紡	35,900	1,828.00	65,625,200	
ユニチカ	28,200	670.00	18,894,000	
富士紡ホールディングス	5,400	3,890.00	21,006,000	
倉敷紡績	98,000	379.00	37,142,000	
シキボウ	4,900	1,341.00	6,570,900	
日本毛織	27,500	1,085.00	29,837,500	
トーア紡コーポレーション	4,100	571.00	2,341,100	
ダイドーリミテッド	11,200	456.00	5,107,200	
帝国繊維	10,200	2,354.00	24,010,800	
帝人	79,500	2,165.00	172,117,500	
東レ	703,800	909.80	640,317,240	
サカイオーベックス	2,500	2,412.00	6,030,000	
住江織物	2,400	2,818.00	6,763,200	
日本フエルト	5,400	527.00	2,845,800	
イチカワ	7,000	364.00	2,548,000	
日東製網	1,000	1,786.00	1,786,000	
アツギ	6,700	1,235.00	8,274,500	
ダイニック	3,700	1,055.00	3,903,500	
セーレン	22,400	2,049.00	45,897,600	
ソトー	3,900	1,041.00	4,059,900	
東海染工	1,600	1,447.00	2,315,200	
小松精練	15,100	1,013.00	15,296,300	
ワコールホールディングス	26,700	3,445.00	91,981,500	
ホギメディカル	12,300	5,150.00	63,345,000	
レナウン	26,400	155.00	4,092,000	
クラウディアホールディングス	2,800	597.00	1,671,600	
ＴＳＩホールディングス	33,700	816.00	27,499,200	
マツオカコーポレーション	2,300	4,015.00	9,234,500	

三陽商会	5,200	2,504.00	13,020,800	
ナイガイ	3,700	568.00	2,101,600	
オンワードホールディングス	58,400	909.00	53,085,600	
ルックホールディングス	17,000	302.00	5,134,000	
ゴールドウイン	5,500	9,190.00	50,545,000	
デサント	22,300	2,107.00	46,986,100	
キング	5,200	523.00	2,719,600	
ヤマトインターナショナル	6,800	618.00	4,202,400	
特種東海製紙	5,300	4,495.00	23,823,500	
王子ホールディングス	408,000	760.00	310,080,000	
日本製紙	43,500	1,832.00	79,692,000	
三菱製紙	13,900	668.00	9,285,200	
北越紀州製紙	54,300	595.00	32,308,500	
中越パルプ工業	3,800	1,820.00	6,916,000	
巴川製紙所	15,000	263.00	3,945,000	
大王製紙	38,700	1,552.00	60,062,400	
阿波製紙	2,400	650.00	1,560,000	
レンゴー	93,600	1,035.00	96,876,000	
トーモク	5,600	2,222.00	12,443,200	
ザ・パック	6,900	3,900.00	26,910,000	
クラレ	163,300	1,683.00	274,833,900	
旭化成	604,900	1,516.00	917,028,400	
共和レザー	5,700	1,044.00	5,950,800	
昭和電工	64,600	5,060.00	326,876,000	
住友化学	714,000	654.00	466,956,000	
住友精化	4,000	6,010.00	24,040,000	
日産化学工業	56,300	5,160.00	290,508,000	
ラサ工業	3,400	3,425.00	11,645,000	
クレハ	8,400	7,420.00	62,328,000	
多木化学	1,300	5,210.00	6,773,000	
テイカ	7,400	2,651.00	19,617,400	
石原産業	17,400	1,211.00	21,071,400	
片倉コープアグリ	2,400	1,248.00	2,995,200	
日東エフシー	5,800	759.00	4,402,200	
日本曹達	67,000	617.00	41,339,000	
東ソー	140,200	1,855.00	260,071,000	
トクヤマ	28,200	3,810.00	107,442,000	
セントラル硝子	19,800	2,478.00	49,064,400	
東亜合成	57,100	1,319.00	75,314,900	
大阪ソーダ	9,400	3,145.00	29,563,000	
関東電化工業	23,200	1,137.00	26,378,400	
デンカ	35,500	4,095.00	145,372,500	

信越化学工業	161,500	11,105.00	1,793,457,500	
日本カーバイド工業	3,100	2,092.00	6,485,200	
堺化学工業	6,600	2,863.00	18,895,800	
エア・ウォーター	80,000	2,201.00	176,080,000	
大陽日酸	74,800	1,827.00	136,659,600	
日本化学工業	3,600	4,325.00	15,570,000	
東邦アセチレン	1,400	1,571.00	2,199,400	
日本パーカライジング	49,600	1,703.00	84,468,800	
高圧ガス工業	14,500	1,020.00	14,790,000	
チタン工業	1,000	2,783.00	2,783,000	
四国化成工業	14,000	1,562.00	21,868,000	
戸田工業	1,900	3,005.00	5,709,500	
ステラ　ケミファ	4,900	3,815.00	18,693,500	
保土谷化学工業	3,100	3,695.00	11,454,500	
日本触媒	15,300	8,580.00	131,274,000	
大日精化工業	7,500	3,730.00	27,975,000	
カネカ	131,000	1,137.00	148,947,000	
三菱瓦斯化学	80,000	2,823.00	225,840,000	
三井化学	88,200	3,150.00	277,830,000	
ＪＳＲ	97,500	2,032.00	198,120,000	
東京応化工業	16,900	4,210.00	71,149,000	
大阪有機化学工業	8,400	1,544.00	12,969,600	
三菱ケミカルホールディングス	649,700	1,000.50	650,024,850	
ＫＨネオケム	14,900	3,185.00	47,456,500	
ダイセル	130,400	1,250.00	163,000,000	
住友ベークライト	78,000	1,120.00	87,360,000	
積水化学工業	201,500	1,824.00	367,536,000	
日本ゼオン	81,900	1,417.00	116,052,300	
アイカ工業	27,200	4,160.00	113,152,000	
宇部興産	48,900	3,140.00	153,546,000	
積水樹脂	15,000	2,370.00	35,550,000	
タキロンシーアイ	19,600	689.00	13,504,400	
旭有機材	5,700	2,257.00	12,864,900	
日立化成	48,000	2,424.00	116,352,000	
ニチバン	4,800	2,974.00	14,275,200	
リケンテクノス	21,100	574.00	12,111,400	
大倉工業	23,000	541.00	12,443,000	
積水化成品工業	12,100	1,286.00	15,560,600	
群栄化学工業	2,300	3,675.00	8,452,500	
タイガースポリマー	4,900	815.00	3,993,500	
ミライアル	3,200	1,507.00	4,822,400	
ダイキアクシス	3,300	1,332.00	4,395,600	

ダイキョーニシカワ	19,200	1,751.00	33,619,200	
竹本容器	1,500	3,160.00	4,740,000	
森六ホールディングス	4,900	3,255.00	15,949,500	
日本化薬	63,100	1,199.00	75,656,900	
カーリットホールディングス	9,100	1,099.00	10,000,900	
日本精化	8,100	1,244.00	10,076,400	
扶桑化学工業	9,200	2,870.00	26,404,000	
トリケミカル研究所	2,300	4,760.00	10,948,000	
ＡＤＥＫＡ	41,800	1,982.00	82,847,600	
日油	37,500	3,500.00	131,250,000	
ハリマ化成グループ	7,600	913.00	6,938,800	
花王	227,700	8,506.00	1,936,816,200	
第一工業製薬	19,000	804.00	15,276,000	
石原ケミカル	2,300	2,210.00	5,083,000	
日華化学	3,100	1,215.00	3,766,500	
ニイタカ	1,400	1,796.00	2,514,400	
三洋化成工業	6,100	5,400.00	32,940,000	
有機合成薬品工業	6,600	289.00	1,907,400	
大日本塗料	11,100	1,563.00	17,349,300	
日本ペイントホールディングス	74,900	4,720.00	353,528,000	
関西ペイント	101,900	2,328.00	237,223,200	
神東塗料	7,500	230.00	1,725,000	
中国塗料	27,800	1,062.00	29,523,600	
日本特殊塗料	6,100	2,531.00	15,439,100	
藤倉化成	12,300	705.00	8,671,500	
太陽ホールディングス	7,500	4,770.00	35,775,000	
ＤＩＣ	38,300	3,670.00	140,561,000	
サカタインクス	19,800	1,537.00	30,432,600	
東洋インキＳＣホールディングス	96,000	633.00	60,768,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	6,600	1,262.00	8,329,200	
富士フイルムホールディングス	192,400	4,317.00	830,590,800	
資生堂	172,500	8,990.00	1,550,775,000	
ライオン	129,000	2,052.00	264,708,000	
高砂香料工業	5,800	3,540.00	20,532,000	
マンダム	18,100	3,620.00	65,522,000	
ミルボン	12,400	5,220.00	64,728,000	
ファンケル	22,500	5,680.00	127,800,000	
コーセー	15,700	24,830.00	389,831,000	
コタ	4,400	1,533.00	6,745,200	
シーズ・ホールディングス	11,200	6,220.00	69,664,000	
シーボン	1,100	3,095.00	3,404,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	39,400	5,010.00	197,394,000	

ノエビアホールディングス	5,900	8,030.00	47,377,000	
アジュバンコスメジャパン	2,100	1,251.00	2,627,100	
エステー	6,600	2,812.00	18,559,200	
アグロ　カネショウ	3,800	2,866.00	10,890,800	
コニシ	15,200	1,845.00	28,044,000	
長谷川香料	11,000	2,246.00	24,706,000	
星光ＰＭＣ	5,400	1,138.00	6,145,200	
小林製薬	26,000	9,470.00	246,220,000	
荒川化学工業	8,300	1,938.00	16,085,400	
メック	6,400	2,285.00	14,624,000	
日本高純度化学	2,600	2,492.00	6,479,200	
タカラバイオ	24,300	2,548.00	61,916,400	
ＪＣＵ	11,400	2,659.00	30,312,600	
新田ゼラチン	6,500	851.00	5,531,500	
ＯＡＴアグリオ	1,500	3,630.00	5,445,000	
デクセリアルズ	23,900	1,126.00	26,911,400	
アース製薬	7,000	5,720.00	40,040,000	
北興化学工業	9,600	685.00	6,576,000	
大成ラミック	2,800	3,190.00	8,932,000	
クミアイ化学工業	42,100	876.00	36,879,600	
日本農薬	22,100	693.00	15,315,300	
アキレス	7,100	2,355.00	16,720,500	
有沢製作所	15,600	1,229.00	19,172,400	
日東電工	69,900	8,762.00	612,463,800	
レック	5,500	4,770.00	26,235,000	
きもと	16,100	315.00	5,071,500	
藤森工業	7,800	3,865.00	30,147,000	
前澤化成工業	6,400	1,262.00	8,076,800	
ウェーブロックホールディングス	2,400	1,172.00	2,812,800	
ＪＳＰ	5,400	3,570.00	19,278,000	
エフピコ	7,600	6,590.00	50,084,000	
天馬	7,200	1,984.00	14,284,800	
信越ポリマー	19,000	1,161.00	22,059,000	
東リ	23,400	350.00	8,190,000	
ニフコ	34,000	3,935.00	133,790,000	
日本バルカー工業	7,500	3,495.00	26,212,500	
ユニ・チャーム	196,400	3,422.00	672,080,800	
協和発酵キリン	116,000	2,379.00	275,964,000	
武田薬品工業	341,200	4,291.00	1,464,089,200	
アステラス製薬	951,800	1,712.50	1,629,957,500	
大日本住友製薬	68,400	2,268.00	155,131,200	
塩野義製薬	130,500	5,710.00	745,155,000	

田辺三菱製薬	113,000	1,917.00	216,621,000	
わかもと製薬	11,000	285.00	3,135,000	
あすか製薬	10,500	1,303.00	13,681,500	
日本新薬	24,200	7,490.00	181,258,000	
ビオフェルミン製薬	1,600	2,911.00	4,657,600	
中外製薬	96,600	5,980.00	577,668,000	
科研製薬	16,700	5,770.00	96,359,000	
エーザイ	110,900	8,228.00	912,485,200	
ロート製薬	50,900	3,465.00	176,368,500	
小野薬品工業	218,700	2,552.00	558,122,400	
久光製薬	27,400	9,080.00	248,792,000	
持田製薬	6,400	8,010.00	51,264,000	
参天製薬	175,500	1,995.00	350,122,500	
扶桑薬品工業	3,300	2,942.00	9,708,600	
日本ケミファ	1,200	4,620.00	5,544,000	
ツムラ	33,100	3,785.00	125,283,500	
日医工	24,400	1,679.00	40,967,600	
キッセイ薬品工業	16,300	3,070.00	50,041,000	
生化学工業	17,900	1,556.00	27,852,400	
栄研化学	15,000	2,589.00	38,835,000	
日水製薬	3,900	1,438.00	5,608,200	
鳥居薬品	5,800	2,758.00	15,996,400	
ＪＣＲファーマ	6,500	6,930.00	45,045,000	
東和薬品	4,400	6,570.00	28,908,000	
富士製薬工業	3,100	4,150.00	12,865,000	
沢井製薬	18,600	4,860.00	90,396,000	
ゼリア新薬工業	19,900	2,274.00	45,252,600	
第一三共	265,000	3,813.00	1,010,445,000	
キョーリン製薬ホールディングス	25,900	2,287.00	59,233,300	
大幸薬品	4,900	2,087.00	10,226,300	
ダイト	5,400	3,640.00	19,656,000	
大塚ホールディングス	192,500	5,374.00	1,034,495,000	
大正製薬ホールディングス	20,700	12,150.00	251,505,000	
ペプチドリーム	42,200	4,790.00	202,138,000	
日本コークス工業	78,700	119.00	9,365,300	
昭和シェル石油	86,700	1,528.00	132,477,600	
ニチレキ	11,900	1,290.00	15,351,000	
ユシロ化学工業	5,200	1,741.00	9,053,200	
ビーピー・カストロール	4,000	1,659.00	6,636,000	
富士石油	22,700	382.00	8,671,400	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,300	1,928.00	6,362,400	
出光興産	77,700	3,760.00	292,152,000	

ＪＸＴＧホールディングス	1,478,000	727.30	1,074,949,400	
コスモエネルギーホールディングス	26,800	3,660.00	98,088,000	
横浜ゴム	53,700	2,483.00	133,337,100	
東洋ゴム工業	54,900	1,778.00	97,612,200	
ブリヂストン	306,600	4,464.00	1,368,662,400	
住友ゴム工業	95,100	1,894.00	180,119,400	
藤倉ゴム工業	8,200	705.00	5,781,000	
オカモト	32,000	1,228.00	39,296,000	
フコク	4,100	1,007.00	4,128,700	
ニッタ	9,600	4,345.00	41,712,000	
住友理工	18,000	1,145.00	20,610,000	
三ツ星ベルト	22,000	1,332.00	29,304,000	
バンドー化学	17,700	1,354.00	23,965,800	
日東紡績	13,800	2,729.00	37,660,200	
旭硝子	93,400	4,610.00	430,574,000	
日本板硝子	46,900	1,081.00	50,698,900	
石塚硝子	1,300	2,486.00	3,231,800	
日本山村硝子	39,000	180.00	7,020,000	
日本電気硝子	40,100	3,120.00	125,112,000	
オハラ	3,700	2,254.00	8,339,800	
住友大阪セメント	180,000	533.00	95,940,000	
太平洋セメント	58,500	4,090.00	239,265,000	
日本ヒューム	9,300	900.00	8,370,000	
日本コンクリート工業	20,000	380.00	7,600,000	
三谷セキサン	4,900	2,708.00	13,269,200	
アジアパイルホールディングス	12,200	722.00	8,808,400	
東海カーボン	84,100	2,191.00	184,263,100	
日本カーボン	4,800	6,840.00	32,832,000	
東洋炭素	6,000	3,475.00	20,850,000	
ノリタケカンパニーリミテド	5,100	5,360.00	27,336,000	
ＴＯＴＯ	71,200	5,720.00	407,264,000	
日本碍子	113,000	2,091.00	236,283,000	
日本特殊陶業	79,500	3,185.00	253,207,500	
ＭＡＲＵＷＡ	3,200	8,990.00	28,768,000	
品川リフラクトリーズ	2,500	3,805.00	9,512,500	
黒崎播磨	1,800	6,200.00	11,160,000	
ヨータイ	7,400	716.00	5,298,400	
イソライト工業	4,900	780.00	3,822,000	
東京窯業	12,200	399.00	4,867,800	
ニッカトー	4,200	1,132.00	4,754,400	
フジミインコーポレーテッド	8,300	2,858.00	23,721,400	
クニミネ工業	2,500	1,109.00	2,772,500	

エーアンドエーマテリアル	2,000	1,291.00	2,582,000	
ニチアス	51,000	1,446.00	73,746,000	
ニチハ	14,000	4,440.00	62,160,000	
新日鐵住金	409,900	2,299.00	942,360,100	
神戸製鋼所	167,600	1,126.00	188,717,600	
中山製鋼所	12,800	725.00	9,280,000	
合同製鐵	4,900	2,374.00	11,632,600	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	247,300	2,291.50	566,687,950	
日新製鋼	25,300	1,613.00	40,808,900	
東京製鐵	49,200	984.00	48,412,800	
共英製鋼	10,300	2,205.00	22,711,500	
大和工業	19,500	3,560.00	69,420,000	
東京鐵鋼	3,800	1,683.00	6,395,400	
大阪製鐵	6,100	2,253.00	13,743,300	
淀川製鋼所	13,400	2,941.00	39,409,400	
東洋鋼鈑	23,000	717.00	16,491,000	
丸一鋼管	32,300	3,700.00	119,510,000	
モリ工業	3,000	3,365.00	10,095,000	
大同特殊鋼	16,200	5,460.00	88,452,000	
日本高周波鋼業	3,400	838.00	2,849,200	
日本冶金工業	76,000	344.00	26,144,000	
山陽特殊製鋼	10,600	2,825.00	29,945,000	
愛知製鋼	5,100	4,480.00	22,848,000	
日立金属	98,700	1,219.00	120,315,300	
日本金属	2,300	2,075.00	4,772,500	
大平洋金属	5,600	4,045.00	22,652,000	
新日本電工	54,900	335.00	18,391,500	
栗本鐵工所	4,600	2,011.00	9,250,600	
虹技	1,400	2,004.00	2,805,600	
日本鋳鉄管	9,000	157.00	1,413,000	
三菱製鋼	6,800	2,335.00	15,878,000	
日亜鋼業	13,500	351.00	4,738,500	
日本精線	1,500	4,450.00	6,675,000	
シンニッタン	14,400	481.00	6,926,400	
新家工業	2,100	2,165.00	4,546,500	
大紀アルミニウム工業所	15,100	774.00	11,687,400	
日本軽金属ホールディングス	268,700	263.00	70,668,100	
三井金属鉱業	24,800	5,110.00	126,728,000	
東邦亜鉛	5,100	4,415.00	22,516,500	
三菱マテリアル	60,500	3,190.00	192,995,000	
住友金属鉱山	117,100	4,730.00	553,883,000	
ＤＯＷＡホールディングス	23,200	3,735.00	86,652,000	

古河機械金属	15,200	1,692.00	25,718,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,600	1,747.00	16,771,200	
東邦チタニウム	16,500	1,036.00	17,094,000	
ＵＡＣＪ	14,000	2,601.00	36,414,000	
ＣＫサンエツ	1,700	3,750.00	6,375,000	
古河電気工業	30,500	4,125.00	125,812,500	
住友電気工業	342,500	1,691.00	579,167,500	
フジクラ	110,900	773.00	85,725,700	
昭和電線ホールディングス	11,600	816.00	9,465,600	
東京特殊電線	1,200	2,820.00	3,384,000	
タツタ電線	18,200	630.00	11,466,000	
カナレ電気	1,600	2,468.00	3,948,800	
平河ヒューテック	4,700	1,503.00	7,064,100	
リョービ	11,300	3,705.00	41,866,500	
アーレスティ	11,500	1,047.00	12,040,500	
アサヒホールディングス	15,800	2,094.00	33,085,200	
稲葉製作所	5,200	1,445.00	7,514,000	
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,186.00	5,683,600	
トーカロ	25,500	1,344.00	34,272,000	
アルファＣｏ	3,200	1,701.00	5,443,200	
ＳＵＭＣＯ	84,100	2,584.00	217,314,400	
川田テクノロジーズ	1,900	6,980.00	13,262,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,400	6,170.00	8,638,000	
東洋製罐グループホールディングス	62,400	1,868.00	116,563,200	
ホッカンホールディングス	23,000	376.00	8,648,000	
コロナ	5,100	1,251.00	6,380,100	
横河ブリッジホールディングス	17,100	2,655.00	45,400,500	
駒井ハルテック	2,000	2,422.00	4,844,000	
高田機工	800	3,205.00	2,564,000	
三和ホールディングス	87,900	1,231.00	108,204,900	
文化シヤッター	27,000	1,043.00	28,161,000	
三協立山	12,700	1,555.00	19,748,500	
アルインコ	6,700	1,093.00	7,323,100	
東洋シヤッター	2,500	684.00	1,710,000	
ＬＩＸＩＬグループ	135,000	2,433.00	328,455,000	
日本フイルコン	7,100	619.00	4,394,900	
ノーリツ	20,500	1,929.00	39,544,500	
長府製作所	10,400	2,429.00	25,261,600	
リンナイ	16,300	10,420.00	169,846,000	
ダイニチ工業	5,000	810.00	4,050,000	
日東精工	12,800	755.00	9,664,000	
三洋工業	1,100	2,159.00	2,374,900	

岡部	18,700	1,041.00	19,466,700	
ジーテクト	10,100	2,016.00	20,361,600	
東プレ	17,100	3,080.00	52,668,000	
高周波熱錬	17,700	996.00	17,629,200	
東京製綱	6,500	1,937.00	12,590,500	
サンコール	5,200	721.00	3,749,200	
モリテック　スチール	7,200	666.00	4,795,200	
パイオラックス	13,600	2,795.00	38,012,000	
エイチワン	9,000	1,246.00	11,214,000	
日本発條	91,300	1,128.00	102,986,400	
中央発條	1,100	3,780.00	4,158,000	
アドバネクス	1,400	2,337.00	3,271,800	
立川ブラインド工業	4,000	1,416.00	5,664,000	
三益半導体工業	7,100	1,911.00	13,568,100	
日本ドライケミカル	1,200	2,317.00	2,780,400	
日本製鋼所	30,000	3,175.00	95,250,000	
三浦工業	39,700	2,779.00	110,326,300	
タクマ	31,400	1,317.00	41,353,800	
ツガミ	25,000	1,132.00	28,300,000	
オークマ	10,700	6,300.00	67,410,000	
東芝機械	52,000	595.00	30,940,000	
アマダホールディングス	141,200	1,171.00	165,345,200	
アイダエンジニアリング	23,600	1,268.00	29,924,800	
滝澤鉄工所	2,800	1,897.00	5,311,600	
ＦＵＪＩ	27,400	2,232.00	61,156,800	
牧野フライス製作所	47,000	948.00	44,556,000	
オーエスジー	42,400	2,424.00	102,777,600	
ダイジェット工業	1,300	1,812.00	2,355,600	
旭ダイヤモンド工業	27,500	886.00	24,365,000	
ＤＭＧ森精機	50,900	1,783.00	90,754,700	
ソディック	20,000	1,128.00	22,560,000	
ディスコ	12,400	20,370.00	252,588,000	
日東工器	5,600	2,810.00	15,736,000	
日進工具	2,400	2,841.00	6,818,400	
パンチ工業	7,600	1,285.00	9,766,000	
冨士ダイス	4,600	889.00	4,089,400	
豊和工業	5,300	1,096.00	5,808,800	
ＯＫＫ	3,800	1,286.00	4,886,800	
東洋機械金属	7,200	741.00	5,335,200	
島精機製作所	11,600	5,940.00	68,904,000	
オプトラン	8,900	4,200.00	37,380,000	
ＮＣホールディングス	3,000	775.00	2,325,000	

フリュー	6,600	1,030.00	6,798,000	
ヤマシンフィルタ	13,700	1,223.00	16,755,100	
日阪製作所	13,300	1,101.00	14,643,300	
やまびこ	17,800	1,467.00	26,112,600	
平田機工	3,400	7,690.00	26,146,000	
ペガサスミシン製造	8,600	999.00	8,591,400	
ナブテスコ	50,500	3,580.00	180,790,000	
三井海洋開発	9,700	2,891.00	28,042,700	
レオン自動機	8,200	2,307.00	18,917,400	
ＳＭＣ	29,100	41,870.00	1,218,417,000	
新川	7,500	994.00	7,455,000	
ホソカワミクロン	3,200	7,400.00	23,680,000	
ユニオンツール	4,200	3,945.00	16,569,000	
オイレス工業	11,800	2,345.00	27,671,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,600	5,450.00	14,170,000	
サトーホールディングス	12,100	3,150.00	38,115,000	
技研製作所	6,300	2,648.00	16,682,400	
日本エアーテック	3,200	888.00	2,841,600	
カワタ	1,900	1,801.00	3,421,900	
日精樹脂工業	7,900	1,316.00	10,396,400	
オカダアイヨン	3,100	1,718.00	5,325,800	
ワイエイシイホールディングス	3,100	961.00	2,979,100	
小松製作所	447,200	3,528.00	1,577,721,600	
住友重機械工業	53,100	3,910.00	207,621,000	
日立建機	43,400	3,860.00	167,524,000	
日工	2,700	2,627.00	7,092,900	
巴工業	3,900	2,265.00	8,833,500	
井関農機	9,400	2,058.00	19,345,200	
ＴＯＷＡ	7,200	1,313.00	9,453,600	
丸山製作所	2,200	1,851.00	4,072,200	
北川鉄工所	4,600	2,820.00	12,972,000	
ローツェ	4,600	2,496.00	11,481,600	
タカキタ	3,200	782.00	2,502,400	
クボタ	496,900	1,871.50	929,948,350	
荏原実業	2,800	2,403.00	6,728,400	
三菱化工機	3,300	2,158.00	7,121,400	
月島機械	18,600	1,742.00	32,401,200	
帝国電機製作所	6,500	1,447.00	9,405,500	
新東工業	22,200	1,078.00	23,931,600	
澁谷工業	8,200	3,675.00	30,135,000	
アイチ　コーポレーション	16,600	738.00	12,250,800	
小森コーポレーション	23,500	1,430.00	33,605,000	

鶴見製作所	8,000	1,904.00	15,232,000	
住友精密工業	15,000	378.00	5,670,000	
酒井重工業	1,800	4,260.00	7,668,000	
荏原製作所	38,000	3,700.00	140,600,000	
石井鐵工所	1,600	2,088.00	3,340,800	
西島製作所	9,800	1,084.00	10,623,200	
北越工業	10,300	1,176.00	12,112,800	
ダイキン工業	126,400	13,335.00	1,685,544,000	
オルガノ	3,400	3,110.00	10,574,000	
トーヨーカネツ	4,000	4,010.00	16,040,000	
栗田工業	50,200	3,155.00	158,381,000	
椿本チエイン	55,000	896.00	49,280,000	
大同工業	3,700	1,546.00	5,720,200	
木村化工機	8,400	452.00	3,796,800	
アネスト岩田	15,500	1,119.00	17,344,500	
ダイフク	47,200	5,620.00	265,264,000	
サムコ	2,600	1,278.00	3,322,800	
加藤製作所	4,500	2,969.00	13,360,500	
油研工業	1,900	2,818.00	5,354,200	
タダノ	44,900	1,511.00	67,843,900	
フジテック	29,700	1,442.00	42,827,400	
ＣＫＤ	25,800	2,212.00	57,069,600	
キトー	7,000	2,492.00	17,444,000	
平和	28,700	2,523.00	72,410,100	
理想科学工業	9,200	2,339.00	21,518,800	
ＳＡＮＫＹＯ	23,200	4,375.00	101,500,000	
日本金銭機械	8,600	1,251.00	10,758,600	
マースエンジニアリング	5,900	2,708.00	15,977,200	
福島工業	5,700	4,765.00	27,160,500	
オーイズミ	3,900	587.00	2,289,300	
ダイコク電機	4,300	1,884.00	8,101,200	
竹内製作所	15,500	2,532.00	39,246,000	
アマノ	28,700	2,780.00	79,786,000	
ＪＵＫＩ	13,700	1,217.00	16,672,900	
サンデンホールディングス	11,200	1,534.00	17,180,800	
蛇の目ミシン工業	8,500	730.00	6,205,000	
マックス	14,200	1,449.00	20,575,800	
グローリー	27,600	3,215.00	88,734,000	
新晃工業	9,400	2,012.00	18,912,800	
大和冷機工業	14,800	1,332.00	19,713,600	
セガサミーホールディングス	91,900	1,874.00	172,220,600	
日本ピストンリング	3,400	2,340.00	7,956,000	

リケン	4,300	5,710.00	24,553,000	
ＴＰＲ	10,400	2,877.00	29,920,800	
ツバキ・ナカシマ	9,300	2,732.00	25,407,600	
ホシザキ	29,200	11,450.00	334,340,000	
大豊工業	7,500	1,398.00	10,485,000	
日本精工	190,200	1,232.00	234,326,400	
ＮＴＮ	214,500	472.00	101,244,000	
ジェイテクト	98,400	1,613.00	158,719,200	
不二越	8,600	5,250.00	45,150,000	
日本トムソン	29,600	944.00	27,942,400	
ＴＨＫ	57,600	3,780.00	217,728,000	
ユーシン精機	8,200	1,442.00	11,824,400	
前澤給装工業	3,600	1,968.00	7,084,800	
イーグル工業	11,400	1,860.00	21,204,000	
前澤工業	6,800	469.00	3,189,200	
日本ピラー工業	9,400	1,634.00	15,359,600	
キッツ	37,400	998.00	37,325,200	
マキタ	120,800	4,955.00	598,564,000	
日立造船	74,000	552.00	40,848,000	
三菱重工業	155,300	4,133.00	641,854,900	
ＩＨＩ	71,200	4,020.00	286,224,000	
スター精密	14,800	1,853.00	27,424,400	
日清紡ホールディングス	56,600	1,312.00	74,259,200	
イビデン	57,000	1,824.00	103,968,000	
コニカミノルタ	217,200	1,036.00	225,019,200	
ブラザー工業	113,300	2,290.00	259,457,000	
ミネベアミツミ	172,100	2,008.00	345,576,800	
日立製作所	2,224,000	824.80	1,834,355,200	
三菱電機	926,100	1,562.50	1,447,031,250	
富士電機	279,000	825.00	230,175,000	
東洋電機製造	3,600	1,896.00	6,825,600	
安川電機	107,400	4,335.00	465,579,000	
シンフォニアテクノロジー	60,000	425.00	25,500,000	
明電舎	79,000	421.00	33,259,000	
オリジン電気	2,700	2,439.00	6,585,300	
山洋電気	4,500	8,890.00	40,005,000	
デンヨー	8,500	1,978.00	16,813,000	
東芝テック	66,000	655.00	43,230,000	
芝浦メカトロニクス	14,000	394.00	5,516,000	
マブチモーター	25,900	5,190.00	134,421,000	
日本電産	111,500	16,940.00	1,888,810,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,500	2,706.00	9,471,000	

トレックス・セミコンダクター	2,900	1,528.00	4,431,200	
東光高岳	4,900	1,975.00	9,677,500	
ダブル・スコープ	13,700	1,781.00	24,399,700	
ダイヘン	51,000	762.00	38,862,000	
ヤーマン	13,600	2,534.00	34,462,400	
ＪＶＣケンウッド	69,100	322.00	22,250,200	
ミマキエンジニアリング	8,800	900.00	7,920,000	
第一精工	4,500	2,190.00	9,855,000	
日新電機	21,700	1,161.00	25,193,700	
大崎電気工業	19,700	859.00	16,922,300	
オムロン	98,400	5,800.00	570,720,000	
日東工業	14,800	2,070.00	30,636,000	
ＩＤＥＣ	11,500	2,970.00	34,155,000	
不二電機工業	1,300	1,433.00	1,862,900	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	167,000	517.00	86,339,000	
サクサホールディングス	2,300	2,330.00	5,359,000	
メルコホールディングス	4,600	4,225.00	19,435,000	
テクノメディカ	2,100	2,008.00	4,216,800	
日本電気	119,800	3,040.00	364,192,000	
富士通	952,000	682.40	649,644,800	
沖電気工業	37,700	1,256.00	47,351,200	
岩崎通信機	4,100	837.00	3,431,700	
電気興業	5,300	3,205.00	16,986,500	
サンケン電気	54,000	648.00	34,992,000	
ナカヨ	1,800	1,857.00	3,342,600	
アイホン	5,200	1,827.00	9,500,400	
ルネサスエレクトロニクス	48,400	1,140.00	55,176,000	
セイコーエプソン	137,900	1,958.00	270,008,200	
ワコム	72,700	651.00	47,327,700	
アルバック	21,300	4,830.00	102,879,000	
アクセル	4,300	926.00	3,981,800	
ＥＩＺＯ	8,500	4,725.00	40,162,500	
日本信号	25,500	1,071.00	27,310,500	
京三製作所	21,700	831.00	18,032,700	
能美防災	12,400	2,582.00	32,016,800	
ホーチキ	6,900	2,205.00	15,214,500	
星和電機	3,800	594.00	2,257,200	
エレコム	8,200	2,757.00	22,607,400	
パナソニック	1,058,000	1,575.50	1,666,879,000	
シャープ	86,000	2,898.00	249,228,000	
アンリツ	67,300	1,533.00	103,170,900	
富士通ゼネラル	28,300	1,725.00	48,817,500	

ソニー	619,900	5,509.00	3,415,029,100	
ＴＤＫ	48,500	11,070.00	536,895,000	
帝国通信工業	4,500	1,323.00	5,953,500	
タムラ製作所	35,700	773.00	27,596,100	
アルプス電気	79,700	2,765.00	220,370,500	
池上通信機	29,000	154.00	4,466,000	
パイオニア	154,300	159.00	24,533,700	
日本電波工業	8,400	631.00	5,300,400	
鈴木	4,400	1,035.00	4,554,000	
日本トリム	2,100	4,700.00	9,870,000	
ローランド　ディー．ジー．	4,900	2,537.00	12,431,300	
フォスター電機	10,800	1,685.00	18,198,000	
クラリオン	49,000	285.00	13,965,000	
ＳＭＫ	24,000	427.00	10,248,000	
ヨコオ	6,200	2,146.00	13,305,200	
ホシデン	23,800	1,066.00	25,370,800	
ヒロセ電機	15,700	14,570.00	228,749,000	
日本航空電子工業	24,000	1,852.00	44,448,000	
ＴＯＡ	10,000	1,188.00	11,880,000	
マクセルホールディングス	18,600	1,844.00	34,298,400	
古野電気	11,500	958.00	11,017,000	
ユニデンホールディングス	25,000	343.00	8,575,000	
アルパイン	22,100	2,102.00	46,454,200	
スミダコーポレーション	9,800	1,253.00	12,279,400	
アイコム	5,100	2,715.00	13,846,500	
リオン	4,100	2,419.00	9,917,900	
本多通信工業	7,700	993.00	7,646,100	
横河電機	92,700	2,075.00	192,352,500	
新電元工業	3,300	6,150.00	20,295,000	
アズビル	27,800	5,320.00	147,896,000	
東亜ディーケーケー	4,900	1,219.00	5,973,100	
日本光電工業	38,700	3,070.00	118,809,000	
チノー	3,200	1,766.00	5,651,200	
共和電業	10,600	447.00	4,738,200	
日本電子材料	3,700	854.00	3,159,800	
堀場製作所	18,300	9,160.00	167,628,000	
アドバンテスト	51,700	2,502.00	129,353,400	
小野測器	4,500	873.00	3,928,500	
エスペック	8,400	2,349.00	19,731,600	
キーエンス	45,500	67,150.00	3,055,325,000	
日置電機	4,900	4,340.00	21,266,000	
シスメックス	72,100	10,220.00	736,862,000	

日本マイクロニクス	15,300	1,067.00	16,325,100	
メガチップス	7,400	3,140.00	23,236,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,500	6,530.00	35,915,000	
澤藤電機	1,200	2,298.00	2,757,600	
コーセル	13,200	1,388.00	18,321,600	
イリソ電子工業	7,800	7,110.00	55,458,000	
新日本無線	5,700	847.00	4,827,900	
オプテックスグループ	15,200	3,045.00	46,284,000	
千代田インテグレ	4,500	2,354.00	10,593,000	
アイ・オー・データ機器	4,200	1,280.00	5,376,000	
レーザーテック	19,100	3,595.00	68,664,500	
スタンレー電気	71,000	3,960.00	281,160,000	
岩崎電気	3,900	1,699.00	6,626,100	
ウシオ電機	56,500	1,449.00	81,868,500	
岡谷電機産業	7,300	553.00	4,036,900	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	8,300	752.00	6,241,600	
日本セラミック	9,600	2,969.00	28,502,400	
遠藤照明	5,100	971.00	4,952,100	
古河電池	7,200	950.00	6,840,000	
双信電機	4,900	593.00	2,905,700	
山一電機	7,000	1,796.00	12,572,000	
図研	6,300	1,816.00	11,440,800	
日本電子	34,000	1,154.00	39,236,000	
カシオ計算機	74,500	1,704.00	126,948,000	
ファナック	88,000	22,790.00	2,005,520,000	
日本シイエムケイ	17,000	756.00	12,852,000	
エンプラス	4,300	3,335.00	14,340,500	
大真空	3,800	1,443.00	5,483,400	
ローム	41,600	10,830.00	450,528,000	
浜松ホトニクス	66,500	4,655.00	309,557,500	
三井ハイテック	12,500	1,388.00	17,350,000	
新光電気工業	35,600	993.00	35,350,800	
京セラ	152,100	6,514.00	990,779,400	
太陽誘電	41,800	2,551.00	106,631,800	
村田製作所	97,200	16,660.00	1,619,352,000	
ユーシン	13,900	712.00	9,896,800	
双葉電子工業	15,300	2,051.00	31,380,300	
北陸電気工業	4,000	1,335.00	5,340,000	
ニチコン	29,500	1,437.00	42,391,500	
日本ケミコン	7,500	4,330.00	32,475,000	
ＫＯＡ	13,000	2,476.00	32,188,000	
市光工業	14,200	1,492.00	21,186,400	

小糸製作所	55,500	7,910.00	439,005,000	
ミツバ	17,300	1,075.00	18,597,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	17,500	9,090.00	159,075,000	
キヤノン電子	8,700	2,412.00	20,984,400	
キヤノン	498,600	3,746.00	1,867,755,600	
リコー	278,400	1,007.00	280,348,800	
象印マホービン	17,600	1,736.00	30,553,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	2,423.00	3,392,200	
東京エレクトロン	61,800	20,545.00	1,269,681,000	
トヨタ紡織	27,000	2,137.00	57,699,000	
芦森工業	1,900	2,691.00	5,112,900	
ユニプレス	17,900	2,371.00	42,440,900	
豊田自動織機	75,000	6,560.00	492,000,000	
モリタホールディングス	14,800	2,224.00	32,915,200	
三櫻工業	11,800	781.00	9,215,800	
デンソー	205,500	5,581.00	1,146,895,500	
東海理化電機製作所	24,400	2,150.00	52,460,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	33,400	1,506.00	50,300,400	
川崎重工業	72,100	3,460.00	249,466,000	
名村造船所	27,600	510.00	14,076,000	
日本車輌製造	34,000	285.00	9,690,000	
三菱ロジスネクスト	11,000	1,196.00	13,156,000	
近畿車輛	1,400	2,557.00	3,579,800	
日産自動車	1,092,200	1,099.50	1,200,873,900	
いすゞ自動車	268,300	1,562.50	419,218,750	
トヨタ自動車	1,125,900	7,492.00	8,435,242,800	
日野自動車	131,800	1,230.00	162,114,000	
三菱自動車工業	342,800	877.00	300,635,600	
エフテック	6,000	1,532.00	9,192,000	
レシップホールディングス	3,300	880.00	2,904,000	
ＧＭＢ	1,500	1,556.00	2,334,000	
ファルテック	1,600	1,262.00	2,019,200	
武蔵精密工業	9,900	4,075.00	40,342,500	
日産車体	36,100	1,043.00	37,652,300	
新明和工業	40,100	1,289.00	51,688,900	
極東開発工業	17,200	1,752.00	30,134,400	
日信工業	18,800	2,079.00	39,085,200	
トピー工業	7,600	3,300.00	25,080,000	
ティラド	3,400	3,680.00	12,512,000	
曙ブレーキ工業	43,400	230.00	9,982,000	
タチエス	15,700	2,012.00	31,588,400	
ＮＯＫ	49,800	2,117.00	105,426,600	

フタバ産業	28,300	792.00	22,413,600	
ＫＹＢ	9,600	5,280.00	50,688,000	
大同メタル工業	11,700	1,201.00	14,051,700	
プレス工業	49,200	647.00	31,832,400	
ミクニ	11,800	622.00	7,339,600	
太平洋工業	19,300	1,756.00	33,890,800	
ケーヒン	21,300	2,310.00	49,203,000	
河西工業	11,400	1,525.00	17,385,000	
アイシン精機	76,300	5,600.00	427,280,000	
マツダ	290,700	1,409.50	409,741,650	
今仙電機製作所	8,500	1,304.00	11,084,000	
本田技研工業	833,400	3,575.00	2,979,405,000	
スズキ	183,500	6,439.00	1,181,556,500	
ＳＵＢＡＲＵ	287,500	3,403.00	978,362,500	
安永	4,500	2,082.00	9,369,000	
ヤマハ発動機	130,800	3,070.00	401,556,000	
ショーワ	24,000	2,078.00	49,872,000	
ＴＢＫ	11,100	554.00	6,149,400	
エクセディ	11,200	3,605.00	40,376,000	
豊田合成	33,500	2,957.00	99,059,500	
愛三工業	16,200	1,074.00	17,398,800	
盟和産業	1,400	1,307.00	1,829,800	
日本プラスト	5,000	1,031.00	5,155,000	
ヨロズ	9,300	1,795.00	16,693,500	
エフ・シー・シー	15,100	3,150.00	47,565,000	
シマノ	37,300	16,260.00	606,498,000	
テイ・エス　テック	21,500	5,040.00	108,360,000	
ジャムコ	4,600	2,387.00	10,980,200	
テルモ	142,000	6,380.00	905,960,000	
クリエートメディック	3,100	1,442.00	4,470,200	
日機装	32,200	1,237.00	39,831,400	
島津製作所	110,700	3,000.00	332,100,000	
ＪＭＳ	8,700	666.00	5,794,200	
長野計器	7,200	1,392.00	10,022,400	
ブイ・テクノロジー	2,200	23,380.00	51,436,000	
東京計器	6,000	1,292.00	7,752,000	
愛知時計電機	1,200	4,115.00	4,938,000	
インターアクション	4,900	1,469.00	7,198,100	
オーバル	9,200	334.00	3,072,800	
東京精密	16,800	4,190.00	70,392,000	
マニー	11,300	5,390.00	60,907,000	
ニコン	161,400	1,823.00	294,232,200	

トプコン	49,800	1,966.00	97,906,800	
オリンパス	138,000	4,100.00	565,800,000	
理研計器	8,900	2,687.00	23,914,300	
タムロン	7,500	2,152.00	16,140,000	
ＨＯＹＡ	186,500	6,563.00	1,223,999,500	
シード	1,300	6,950.00	9,035,000	
ノーリツ鋼機	9,400	2,012.00	18,912,800	
エー・アンド・デイ	8,600	1,174.00	10,096,400	
シチズン時計	110,600	749.00	82,839,400	
リズム時計工業	3,500	2,424.00	8,484,000	
大研医器	8,400	767.00	6,442,800	
メニコン	12,700	2,937.00	37,299,900	
シンシア	800	653.00	522,400	
松風	4,600	1,432.00	6,587,200	
セイコーホールディングス	14,300	2,557.00	36,565,100	
ニプロ	64,200	1,299.00	83,395,800	
中本パックス	2,400	1,783.00	4,279,200	
スノーピーク	2,900	1,524.00	4,419,600	
パラマウントベッドホールディングス	9,800	5,140.00	50,372,000	
トランザクション	5,000	1,016.00	5,080,000	
ＳＨＯ－ＢＩ	3,100	444.00	1,376,400	
ニホンフラッシュ	4,300	3,275.00	14,082,500	
前田工繊	10,200	1,979.00	20,185,800	
永大産業	12,000	556.00	6,672,000	
アートネイチャー	10,000	721.00	7,210,000	
バンダイナムコホールディングス	95,700	4,740.00	453,618,000	
アイフィスジャパン	2,100	711.00	1,493,100	
共立印刷	15,500	384.00	5,952,000	
ＳＨＯＥＩ	4,500	4,055.00	18,247,500	
フランスベッドホールディングス	11,100	984.00	10,922,400	
パイロットコーポレーション	16,200	6,240.00	101,088,000	
萩原工業	5,100	1,923.00	9,807,300	
トッパン・フォームズ	19,800	1,183.00	23,423,400	
フジシールインターナショナル	20,800	4,375.00	91,000,000	
タカラトミー	38,900	981.00	38,160,900	
廣済堂	8,700	541.00	4,706,700	
Ａｓ－ｍｅエステール	2,700	794.00	2,143,800	
アーク	47,100	129.00	6,075,900	
タカノ	4,100	970.00	3,977,000	
プロネクサス	8,700	1,342.00	11,675,400	
ホクシン	6,600	175.00	1,155,000	
ウッドワン	3,100	1,484.00	4,600,400	

大建工業	7,200	2,718.00	19,569,600	
凸版印刷	261,000	937.00	244,557,000	
大日本印刷	121,200	2,496.00	302,515,200	
図書印刷	6,300	1,072.00	6,753,600	
共同印刷	2,900	3,065.00	8,888,500	
ＮＩＳＳＨＡ	19,000	2,311.00	43,909,000	
光村印刷	800	2,326.00	1,860,800	
宝印刷	4,800	1,920.00	9,216,000	
アシックス	91,700	1,751.00	160,566,700	
ツツミ	2,900	1,884.00	5,463,600	
小松ウオール工業	3,100	2,233.00	6,922,300	
ヤマハ	62,400	6,030.00	376,272,000	
河合楽器製作所	3,100	5,860.00	18,166,000	
クリナップ	8,700	882.00	7,673,400	
ピジョン	56,000	5,210.00	291,760,000	
兼松サステック	700	2,015.00	1,410,500	
キングジム	7,800	1,113.00	8,681,400	
リンテック	22,000	3,295.00	72,490,000	
イトーキ	19,700	656.00	12,923,200	
任天堂	57,000	41,640.00	2,373,480,000	
三菱鉛筆	15,300	2,291.00	35,052,300	
タカラスタンダード	19,100	1,858.00	35,487,800	
コクヨ	44,400	2,098.00	93,151,200	
ナカバヤシ	9,200	725.00	6,670,000	
グローブライド	4,100	3,905.00	16,010,500	
オカムラ	32,300	1,684.00	54,393,200	
美津濃	9,200	4,115.00	37,858,000	
東京電力ホールディングス	739,300	514.00	380,000,200	
中部電力	283,300	1,683.00	476,793,900	
関西電力	377,900	1,584.00	598,593,600	
中国電力	128,000	1,441.00	184,448,000	
北陸電力	90,800	1,138.00	103,330,400	
東北電力	216,900	1,362.00	295,417,800	
四国電力	83,400	1,520.00	126,768,000	
九州電力	204,500	1,256.00	256,852,000	
北海道電力	93,100	769.00	71,593,900	
沖縄電力	18,750	2,380.00	44,625,000	
電源開発	73,700	2,907.00	214,245,900	
エフオン	4,600	1,798.00	8,270,800	
イーレックス	14,700	1,160.00	17,052,000	
レノバ	4,800	1,505.00	7,224,000	
東京瓦斯	197,600	3,018.00	596,356,800	

大阪瓦斯	179,700	2,330.00	418,701,000	
東邦瓦斯	45,900	3,610.00	165,699,000	
北海道瓦斯	25,000	310.00	7,750,000	
広島ガス	19,200	388.00	7,449,600	
西部瓦斯	11,200	3,020.00	33,824,000	
静岡ガス	26,300	1,080.00	28,404,000	
メタウォーター	5,200	3,145.00	16,354,000	
ＳＢＳホールディングス	9,200	1,302.00	11,978,400	
東武鉄道	97,700	3,490.00	340,973,000	
相鉄ホールディングス	29,600	3,420.00	101,232,000	
東京急行電鉄	251,500	1,975.00	496,712,500	
京浜急行電鉄	126,900	1,931.00	245,043,900	
小田急電鉄	137,700	2,418.00	332,958,600	
京王電鉄	51,600	5,360.00	276,576,000	
京成電鉄	64,300	3,830.00	246,269,000	
富士急行	12,600	3,375.00	42,525,000	
新京成電鉄	2,400	2,206.00	5,294,400	
東日本旅客鉄道	166,300	10,735.00	1,785,230,500	
西日本旅客鉄道	83,600	7,918.00	661,944,800	
東海旅客鉄道	82,900	23,210.00	1,924,109,000	
西武ホールディングス	117,700	1,912.00	225,042,400	
鴻池運輸	13,100	1,717.00	22,492,700	
西日本鉄道	25,700	3,070.00	78,899,000	
ハマキョウレックス	6,600	3,685.00	24,321,000	
サカイ引越センター	4,900	5,960.00	29,204,000	
近鉄グループホールディングス	87,700	4,685.00	410,874,500	
阪急阪神ホールディングス	117,000	4,600.00	538,200,000	
南海電気鉄道	41,600	3,160.00	131,456,000	
京阪ホールディングス	39,100	3,955.00	154,640,500	
神戸電鉄	2,100	4,035.00	8,473,500	
名古屋鉄道	69,800	2,950.00	205,910,000	
山陽電気鉄道	6,700	2,772.00	18,572,400	
日本通運	34,400	8,530.00	293,432,000	
ヤマトホールディングス	153,800	3,293.00	506,463,400	
山九	22,500	6,170.00	138,825,000	
丸運	5,000	360.00	1,800,000	
丸全昭和運輸	31,000	541.00	16,771,000	
センコーグループホールディングス	52,900	919.00	48,615,100	
トナミホールディングス	2,100	7,360.00	15,456,000	
ニッコンホールディングス	33,400	3,070.00	102,538,000	
日本石油輸送	1,100	3,275.00	3,602,500	
福山通運	12,800	5,820.00	74,496,000	

セイノーホールディングス	65,700	2,072.00	136,130,400	
エスライン	2,400	1,144.00	2,745,600	
神奈川中央交通	2,200	3,785.00	8,327,000	
日立物流	19,300	3,035.00	58,575,500	
丸和運輸機関	4,600	4,005.00	18,423,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	9,500	1,408.00	13,376,000	
九州旅客鉄道	73,600	3,535.00	260,176,000	
ＳＧホールディングス	82,900	2,332.00	193,322,800	
日本郵船	73,400	2,264.00	166,177,600	
商船三井	55,700	2,887.00	160,805,900	
川崎汽船	40,800	2,210.00	90,168,000	
ＮＳユナイテッド海運	4,400	2,191.00	9,640,400	
飯野海運	45,900	514.00	23,592,600	
共栄タンカー	1,000	2,003.00	2,003,000	
乾汽船	6,800	1,051.00	7,146,800	
日本航空	162,700	4,277.00	695,867,900	
ＡＮＡホールディングス	170,300	4,427.00	753,918,100	
パスコ	8,000	328.00	2,624,000	
トランコム	2,400	8,110.00	19,464,000	
日新	7,600	2,493.00	18,946,800	
三菱倉庫	30,400	2,379.00	72,321,600	
三井倉庫ホールディングス	50,000	362.00	18,100,000	
住友倉庫	61,000	711.00	43,371,000	
澁澤倉庫	4,800	1,863.00	8,942,400	
東陽倉庫	16,000	372.00	5,952,000	
日本トランスシティ	21,000	539.00	11,319,000	
ケイヒン	1,700	1,679.00	2,854,300	
中央倉庫	5,400	1,252.00	6,760,800	
川西倉庫	1,800	2,117.00	3,810,600	
安田倉庫	7,900	942.00	7,441,800	
東洋埠頭	2,700	1,738.00	4,692,600	
宇徳	7,600	521.00	3,959,600	
上組	54,100	2,479.00	134,113,900	
サンリツ	2,300	839.00	1,929,700	
キムラユニティー	2,400	1,174.00	2,817,600	
キユーソー流通システム	2,600	2,781.00	7,230,600	
近鉄エクスプレス	16,500	2,377.00	39,220,500	
東海運	5,000	386.00	1,930,000	
エーアイテイー	6,300	1,190.00	7,497,000	
内外トランスライン	3,100	1,615.00	5,006,500	
日本コンセプト	1,700	1,479.00	2,514,300	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,100	2,602.00	26,280,200	

システナ	29,200	1,234.00	36,032,800	
デジタルアーツ	4,500	5,800.00	26,100,000	
新日鉄住金ソリューションズ	13,700	3,050.00	41,785,000	
キューブシステム	5,500	969.00	5,329,500	
エイジア	1,900	1,660.00	3,154,000	
コア	4,000	1,464.00	5,856,000	
ソリトンシステムズ	4,100	1,201.00	4,924,100	
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	1,713.00	7,708,500	
ＴＩＳ	30,300	5,280.00	159,984,000	
ネオス	3,000	422.00	1,266,000	
電算システム	3,200	2,179.00	6,972,800	
グリー	48,900	631.00	30,855,900	
コーエーテクモホールディングス	15,600	2,250.00	35,100,000	
三菱総合研究所	3,600	4,930.00	17,748,000	
電算	1,100	2,251.00	2,476,100	
ＡＧＳ	5,300	876.00	4,642,800	
ファインデックス	7,800	851.00	6,637,800	
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	2,164.00	4,544,400	
ブレインパッド	2,000	3,035.00	6,070,000	
ＫＬａｂ	17,200	1,616.00	27,795,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,700	2,315.00	15,510,500	
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,267.00	2,027,200	
ネクソン	204,700	1,761.00	360,476,700	
アイスタイル	22,900	1,335.00	30,571,500	
エムアップ	3,100	1,410.00	4,371,000	
エイチーム	5,700	2,592.00	14,774,400	
テクノスジャパン	8,400	1,053.00	8,845,200	
コロプラ	26,000	762.00	19,812,000	
モバイルクリエイト	7,800	338.00	2,636,400	
ブロードリーフ	45,400	610.00	27,694,000	
クロス・マーケティンググループ	2,800	713.00	1,996,400	
ハーツユナイテッドグループ	4,900	1,668.00	8,173,200	
メディアドゥホールディングス	3,000	2,324.00	6,972,000	
サイバーリンクス	1,500	1,181.00	1,771,500	
フィックスターズ	8,800	1,623.00	14,282,400	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	4,700	1,242.00	5,837,400	
オプティム	1,600	2,663.00	4,260,800	
セレス	2,800	1,995.00	5,586,000	
ベリサーブ	1,300	3,340.00	4,342,000	
ティーガイア	9,200	3,060.00	28,152,000	
セック	1,200	2,930.00	3,516,000	
日本アジアグループ	9,600	518.00	4,972,800	

豆蔵ホールディングス	6,900	1,083.00	7,472,700	
テクマトリックス	5,100	2,378.00	12,127,800	
プロシップ	1,400	2,746.00	3,844,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	247,000	303.00	74,841,000	
GMOペイメントゲートウェイ	7,500	11,100.00	83,250,000	
ザッパラス	4,700	375.00	1,762,500	
システムリサーチ	1,300	2,888.00	3,754,400	
インターネットイニシアティブ	14,900	2,383.00	35,506,700	
さくらインターネット	11,100	879.00	9,756,900	
ヴィンクス	2,700	1,247.00	3,366,900	
GMOクラウド	2,100	3,215.00	6,751,500	
ＳＲＡホールディングス	4,900	3,105.00	15,214,500	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	1,900	1,625.00	3,087,500	
朝日ネット	8,600	540.00	4,644,000	
ｅＢＡＳＥ	2,500	1,563.00	3,907,500	
アバント	2,600	959.00	2,493,400	
アドソル日進	3,600	1,858.00	6,688,800	
フリービット	6,200	1,391.00	8,624,200	
コムチュア	4,700	3,130.00	14,711,000	
サイバーコム	1,700	2,131.00	3,622,700	
インフォテリア	4,600	1,242.00	5,713,200	
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,579.00	11,053,000	
ｇｕｍｉ	10,700	836.00	8,945,200	
ショーケース・ティービー	1,800	1,363.00	2,453,400	
モバイルファクトリー	2,300	1,731.00	3,981,300	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,100	1,289.00	5,284,900	
ＰＣＩホールディングス	1,600	3,455.00	5,528,000	
パイプドＨＤ	1,500	1,049.00	1,573,500	
アイビーシー	1,600	1,685.00	2,696,000	
ネオジャパン	2,200	1,624.00	3,572,800	
オープンドア	3,700	1,986.00	7,348,200	
マイネット	2,600	1,196.00	3,109,600	
アカツキ	2,400	4,555.00	10,932,000	
ベネフィットジャパン	600	1,322.00	793,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,100	1,075.00	1,182,500	
ＬＩＮＥ	27,500	4,100.00	112,750,000	
シンクロ・フード	3,300	886.00	2,923,800	
オークネット	4,000	1,449.00	5,796,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,500	1,377.00	10,327,500	
マクロミル	11,400	2,414.00	27,519,600	
ビーグリー	2,100	1,601.00	3,362,100	
オロ	900	3,695.00	3,325,500	

ソルクシーズ	3,700	1,548.00	5,727,600	
フェイス	3,300	1,371.00	4,524,300	
ハイマックス	1,300	1,865.00	2,424,500	
野村総合研究所	57,800	5,690.00	328,882,000	
サイバネットシステム	7,700	927.00	7,137,900	
ＣＥホールディングス	2,800	827.00	2,315,600	
日本システム技術	1,200	1,368.00	1,641,600	
インテージホールディングス	10,600	1,150.00	12,190,000	
東邦システムサイエンス	3,200	869.00	2,780,800	
ソースネクスト	13,000	795.00	10,335,000	
フォーカスシステムズ	5,400	855.00	4,617,000	
クレスコ	2,100	3,415.00	7,171,500	
フジ・メディア・ホールディングス	95,000	1,850.00	175,750,000	
オービック	28,700	9,650.00	276,955,000	
ジャストシステム	14,800	2,469.00	36,541,200	
ＴＤＣソフト	4,100	1,711.00	7,015,100	
ヤフー	655,700	385.00	252,444,500	
トレンドマイクロ	44,400	6,400.00	284,160,000	
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	1,478.00	4,434,000	
日本オラクル	14,700	8,600.00	126,420,000	
アルファシステムズ	3,100	2,289.00	7,095,900	
フューチャー	12,400	1,469.00	18,215,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,000	1,100.00	7,700,000	
ソフトバンク・テクノロジー	3,900	1,736.00	6,770,400	
トーセ	2,500	1,203.00	3,007,500	
オービックビジネスコンサルタント	4,700	8,330.00	39,151,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	41,500	2,000.00	83,000,000	
アイティフォー	11,300	1,320.00	14,916,000	
東計電算	1,700	3,200.00	5,440,000	
エックスネット	1,600	923.00	1,476,800	
大塚商会	54,700	4,590.00	251,073,000	
サイボウズ	12,500	553.00	6,912,500	
ソフトブレーン	7,600	586.00	4,453,600	
電通国際情報サービス	5,700	3,550.00	20,235,000	
デジタルガレージ	16,400	4,585.00	75,194,000	
ＥＭシステムズ	6,400	1,094.00	7,001,600	
ウェザーニューズ	3,100	3,440.00	10,664,000	
ＣＩＪ	7,300	714.00	5,212,200	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,955.00	1,955,000	
日本エンタープライズ	10,000	225.00	2,250,000	
WOWOW	4,400	3,390.00	14,916,000	
スカラ	7,500	892.00	6,690,000	

イマジカ・ロボット　ホールディングス	7,700	1,046.00	8,054,200	
ネットワンシステムズ	37,200	1,853.00	68,931,600	
システムソフト	22,800	146.00	3,328,800	
アルゴグラフィックス	4,200	3,760.00	15,792,000	
マーベラス	15,700	934.00	14,663,800	
エイベックス	16,900	1,525.00	25,772,500	
日本ユニシス	25,300	2,709.00	68,537,700	
兼松エレクトロニクス	5,800	3,670.00	21,286,000	
東京放送ホールディングス	50,300	2,389.00	120,166,700	
日本テレビホールディングス	83,300	1,842.00	153,438,600	
朝日放送グループホールディングス	9,300	860.00	7,998,000	
テレビ朝日ホールディングス	25,000	2,472.00	61,800,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	69,900	513.00	35,858,700	
テレビ東京ホールディングス	7,500	3,200.00	24,000,000	
日本ＢＳ放送	3,200	1,453.00	4,649,600	
ビジョン	2,400	3,550.00	8,520,000	
ワイヤレスゲート	4,400	1,557.00	6,850,800	
コネクシオ	6,500	2,074.00	13,481,000	
クロップス	2,100	906.00	1,902,600	
日本電信電話	652,200	5,174.00	3,374,482,800	
ＫＤＤＩ	818,400	3,011.00	2,464,202,400	
光通信	11,000	20,010.00	220,110,000	
ＮＴＴドコモ	652,600	2,848.00	1,858,604,800	
エムティーアイ	10,700	661.00	7,072,700	
GMOインターネット	33,200	2,816.00	93,491,200	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	782.00	1,329,400	
カドカワ	26,700	1,225.00	32,707,500	
学研ホールディングス	3,100	5,560.00	17,236,000	
ゼンリン	16,600	2,599.00	43,143,400	
昭文社	4,400	822.00	3,616,800	
インプレスホールディングス	7,600	187.00	1,421,200	
アイネット	5,200	1,815.00	9,438,000	
松竹	6,000	15,930.00	95,580,000	
東宝	59,800	3,630.00	217,074,000	
東映	3,400	11,660.00	39,644,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	282,400	1,278.00	360,907,200	
ピー・シー・エー	1,400	1,808.00	2,531,200	
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	2,338.00	3,740,800	
ＤＴＳ	9,500	4,510.00	42,845,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	42,300	5,290.00	223,767,000	
シーイーシー	5,500	4,535.00	24,942,500	
カプコン	39,000	2,525.00	98,475,000	

アイ・エス・ビー	1,900	1,932.00	3,670,800	
ジャステック	5,400	1,187.00	6,409,800	
ＳＣＳＫ	21,000	5,360.00	112,560,000	
日本システムウエア	3,100	2,441.00	7,567,100	
アイネス	11,700	1,152.00	13,478,400	
ＴＫＣ	7,700	4,425.00	34,072,500	
富士ソフト	12,600	4,695.00	59,157,000	
ＮＳＤ	15,000	2,476.00	37,140,000	
コナミホールディングス	37,100	5,360.00	198,856,000	
福井コンピュータホールディングス	2,700	1,960.00	5,292,000	
ＪＢＣＣホールディングス	7,400	1,207.00	8,931,800	
ミロク情報サービス	8,100	3,050.00	24,705,000	
ソフトバンクグループ	411,400	8,143.00	3,350,030,200	
ホウスイ	700	1,179.00	825,300	
高千穂交易	3,600	1,212.00	4,363,200	
伊藤忠食品	2,300	6,180.00	14,214,000	
エレマテック	4,300	2,643.00	11,364,900	
ＪＡＬＵＸ	2,600	3,095.00	8,047,000	
あらた	4,500	7,150.00	32,175,000	
トーメンデバイス	1,400	2,892.00	4,048,800	
東京エレクトロン　デバイス	3,300	2,066.00	6,817,800	
フィールズ	7,100	937.00	6,652,700	
双日	539,800	399.00	215,380,200	
アルフレッサ　ホールディングス	101,400	2,735.00	277,329,000	
横浜冷凍	22,800	1,049.00	23,917,200	
神栄	1,300	1,450.00	1,885,000	
ラサ商事	4,100	966.00	3,960,600	
ラクーン	5,300	628.00	3,328,400	
アルコニックス	9,700	1,840.00	17,848,000	
神戸物産	5,900	5,470.00	32,273,000	
ペッパーフードサービス	6,600	5,160.00	34,056,000	
あい　ホールディングス	14,700	2,612.00	38,396,400	
ディーブイエックス	3,300	1,388.00	4,580,400	
ダイワボウホールディングス	7,800	6,510.00	50,778,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	17,500	1,919.00	33,582,500	
ラクト・ジャパン	1,700	5,420.00	9,214,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,300	1,135.00	19,635,500	
八洲電機	7,100	952.00	6,759,200	
メディアスホールディングス	5,100	1,118.00	5,701,800	
ＵＫＣホールディングス	5,900	2,261.00	13,339,900	
ジューテックホールディングス	2,100	1,170.00	2,457,000	
大光	2,100	794.00	1,667,400	

ＯＣＨＩホールディングス	2,700	1,503.00	4,058,100	
ＴＯＫＡＩホールディングス	48,300	1,147.00	55,400,100	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,400	938.00	1,313,200	
三洋貿易	4,600	2,229.00	10,253,400	
ビューティガレージ	1,200	2,372.00	2,846,400	
ウイン・パートナーズ	6,700	1,447.00	9,694,900	
ミタチ産業	2,100	1,012.00	2,125,200	
シップヘルスケアホールディングス	19,000	4,220.00	80,180,000	
明治電機工業	3,100	2,097.00	6,500,700	
デリカフーズホールディングス	1,800	1,600.00	2,880,000	
スターティアホールディングス	2,100	746.00	1,566,600	
コメダホールディングス	16,900	2,165.00	36,588,500	
富士興産	3,600	629.00	2,264,400	
協栄産業	1,100	2,103.00	2,313,300	
小野建	8,000	2,016.00	16,128,000	
佐鳥電機	6,800	1,067.00	7,255,600	
エコートレーディング	2,100	723.00	1,518,300	
伯東	5,600	1,779.00	9,962,400	
コンドーテック	7,300	1,049.00	7,657,700	
中山福	5,300	739.00	3,916,700	
ナガイレーベン	13,200	2,995.00	39,534,000	
三菱食品	10,000	3,000.00	30,000,000	
松田産業	6,700	1,701.00	11,396,700	
第一興商	13,600	5,140.00	69,904,000	
メディパルホールディングス	91,400	2,462.00	225,026,800	
ＳＰＫ	2,000	2,822.00	5,644,000	
萩原電気ホールディングス	3,200	3,190.00	10,208,000	
アズワン	7,100	8,260.00	58,646,000	
スズデン	3,200	1,654.00	5,292,800	
尾家産業	2,700	1,401.00	3,782,700	
シモジマ	5,600	1,148.00	6,428,800	
ドウシシャ	9,700	2,518.00	24,424,600	
小津産業	2,000	2,167.00	4,334,000	
高速	5,500	1,347.00	7,408,500	
たけびし	3,200	1,748.00	5,593,600	
リックス	2,100	2,062.00	4,330,200	
丸文	8,200	919.00	7,535,800	
ハピネット	6,200	1,454.00	9,014,800	
橋本総業ホールディングス	1,900	1,853.00	3,520,700	
日本ライフライン	26,000	2,720.00	70,720,000	
エクセル	3,600	2,522.00	9,079,200	
マルカキカイ	2,900	2,007.00	5,820,300	

ＩＤＯＭ	27,500	727.00	19,992,500	
日本エム・ディ・エム	6,200	1,118.00	6,931,600	
進和	5,400	2,596.00	14,018,400	
エスケイジャパン	2,300	500.00	1,150,000	
ダイトロン	4,200	2,623.00	11,016,600	
シークス	11,600	2,163.00	25,090,800	
田中商事	2,800	725.00	2,030,000	
オーハシテクニカ	5,200	1,857.00	9,656,400	
白銅	3,300	2,289.00	7,553,700	
伊藤忠商事	669,400	2,161.00	1,446,573,400	
丸紅	749,600	880.40	659,947,840	
高島	1,600	2,195.00	3,512,000	
長瀬産業	55,000	1,877.00	103,235,000	
蝶理	5,800	2,017.00	11,698,600	
豊田通商	101,800	3,985.00	405,673,000	
三共生興	15,700	483.00	7,583,100	
兼松	38,900	1,669.00	64,924,100	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,263.00	2,147,100	
三井物産	751,500	1,971.00	1,481,206,500	
日本紙パルプ商事	4,800	5,260.00	25,248,000	
日立ハイテクノロジーズ	31,700	4,955.00	157,073,500	
カメイ	11,900	1,803.00	21,455,700	
東都水産	1,400	1,882.00	2,634,800	
ＯＵＧホールディングス	1,400	2,719.00	3,806,600	
スターゼン	3,600	6,600.00	23,760,000	
山善	35,700	1,171.00	41,804,700	
椿本興業	2,100	4,360.00	9,156,000	
住友商事	575,300	1,911.50	1,099,685,950	
内田洋行	4,200	3,320.00	13,944,000	
三菱商事	640,100	3,186.00	2,039,358,600	
第一実業	4,200	3,515.00	14,763,000	
キヤノンマーケティングジャパン	26,100	2,382.00	62,170,200	
西華産業	5,500	2,749.00	15,119,500	
佐藤商事	8,200	1,308.00	10,725,600	
菱洋エレクトロ	8,500	1,860.00	15,810,000	
東京産業	9,200	622.00	5,722,400	
ユアサ商事	8,700	3,815.00	33,190,500	
神鋼商事	2,000	3,095.00	6,190,000	
小林産業	6,200	354.00	2,194,800	
阪和興業	17,100	4,545.00	77,719,500	
正栄食品工業	5,000	4,445.00	22,225,000	
カナデン	8,800	1,474.00	12,971,200	

菱電商事	6,600	1,862.00	12,289,200	
フルサト工業	5,000	1,834.00	9,170,000	
岩谷産業	20,300	3,940.00	79,982,000	
すてきナイスグループ	3,900	1,366.00	5,327,400	
昭光通商	32,000	111.00	3,552,000	
ニチモウ	1,400	1,718.00	2,405,200	
極東貿易	13,000	471.00	6,123,000	
イワキ	13,000	448.00	5,824,000	
三愛石油	24,500	1,577.00	38,636,500	
稲畑産業	21,900	1,667.00	36,507,300	
ＧＳＩクレオス	2,400	1,632.00	3,916,800	
明和産業	8,500	510.00	4,335,000	
ワキタ	19,500	1,232.00	24,024,000	
東邦ホールディングス	27,000	2,769.00	74,763,000	
サンゲツ	30,400	2,317.00	70,436,800	
ミツウロコグループホールディングス	13,400	922.00	12,354,800	
シナネンホールディングス	3,800	2,744.00	10,427,200	
伊藤忠エネクス	20,200	1,124.00	22,704,800	
サンリオ	25,600	2,102.00	53,811,200	
サンワテクノス	5,900	1,629.00	9,611,100	
リョーサン	11,500	3,975.00	45,712,500	
新光商事	10,000	1,769.00	17,690,000	
トーホー	4,100	2,681.00	10,992,100	
三信電気	8,400	2,152.00	18,076,800	
東陽テクニカ	10,600	924.00	9,794,400	
モスフードサービス	12,000	3,370.00	40,440,000	
加賀電子	8,300	2,785.00	23,115,500	
ソーダニッカ	9,500	719.00	6,830,500	
立花エレテック	6,200	2,189.00	13,571,800	
フォーバル	4,100	902.00	3,698,200	
ＰＡＬＴＡＣ	12,800	6,380.00	81,664,000	
三谷産業	10,000	363.00	3,630,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,500	5,370.00	13,425,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,508.00	1,206,400	
ヤマタネ	4,600	2,209.00	10,161,400	
丸紅建材リース	9,000	245.00	2,205,000	
日鉄住金物産	7,100	5,810.00	41,251,000	
泉州電業	3,000	3,395.00	10,185,000	
トラスコ中山	19,000	2,863.00	54,397,000	
オートバックスセブン	36,300	2,000.00	72,600,000	
モリト	7,400	1,024.00	7,577,600	
加藤産業	14,300	3,930.00	56,199,000	

イノテック	7,900	1,417.00	11,194,300	
イエローハット	8,600	3,405.00	29,283,000	
ＪＫホールディングス	9,300	899.00	8,360,700	
日伝	7,600	2,168.00	16,476,800	
北沢産業	7,700	274.00	2,109,800	
杉本商事	4,900	2,025.00	9,922,500	
因幡電機産業	12,100	4,940.00	59,774,000	
バイテックホールディングス	4,100	2,537.00	10,401,700	
東テク	3,000	2,779.00	8,337,000	
ミスミグループ本社	106,000	3,260.00	345,560,000	
アルテック	7,900	338.00	2,670,200	
タキヒヨー	3,000	2,395.00	7,185,000	
蔵王産業	1,500	1,743.00	2,614,500	
スズケン	41,600	4,865.00	202,384,000	
ジェコス	6,400	1,091.00	6,982,400	
ルネサスイーストン	8,500	603.00	5,125,500	
ローソン	23,100	6,940.00	160,314,000	
サンエー	6,900	5,710.00	39,399,000	
カワチ薬品	7,100	2,453.00	17,416,300	
エービーシー・マート	16,600	6,350.00	105,410,000	
ハードオフコーポレーション	4,100	1,088.00	4,460,800	
アスクル	8,000	3,305.00	26,440,000	
ゲオホールディングス	16,700	1,521.00	25,400,700	
アダストリア	14,100	1,452.00	20,473,200	
ジーフット	5,700	792.00	4,514,400	
くらコーポレーション	5,400	7,850.00	42,390,000	
キャンドゥ	4,400	1,820.00	8,008,000	
パルグループホールディングス	4,700	2,832.00	13,310,400	
エディオン	35,700	1,143.00	40,805,100	
サーラコーポレーション	16,000	704.00	11,264,000	
ワッツ	3,200	1,118.00	3,577,600	
ハローズ	3,500	2,709.00	9,481,500	
あみやき亭	2,000	5,160.00	10,320,000	
ひらまつ	12,900	517.00	6,669,300	
大黒天物産	2,200	5,550.00	12,210,000	
ハニーズホールディングス	9,000	1,022.00	9,198,000	
ファーマライズホールディングス	2,300	685.00	1,575,500	
アルペン	7,100	2,461.00	17,473,100	
ハブ	2,400	1,175.00	2,820,000	
クオール	10,200	2,363.00	24,102,600	
ジンズ	6,200	6,120.00	37,944,000	
ビックカメラ	48,700	1,713.00	83,423,100	

ＤＣＭホールディングス	49,500	1,073.00	53,113,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	32,500	4,470.00	145,275,000	
東京一番フーズ	2,500	672.00	1,680,000	
ＤＤホールディングス	2,000	2,877.00	5,754,000	
きちり	2,600	920.00	2,392,000	
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,522.00	19,419,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	108,700	1,774.00	192,833,800	
ドトール・日レスホールディングス	16,100	2,240.00	36,064,000	
マツモトキヨシホールディングス	37,600	5,220.00	196,272,000	
ブロンコビリー	4,800	4,710.00	22,608,000	
スタートトゥデイ	89,700	4,255.00	381,673,500	
トレジャー・ファクトリー	2,800	751.00	2,102,800	
物語コーポレーション	2,600	11,530.00	29,978,000	
ココカラファイン	9,500	7,630.00	72,485,000	
三越伊勢丹ホールディングス	170,700	1,406.00	240,004,200	
Ｈａｍｅｅ	2,400	1,733.00	4,159,200	
ウエルシアホールディングス	24,100	5,880.00	141,708,000	
クリエイトＳＤホールディングス	13,500	3,300.00	44,550,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	10,700	364.00	3,894,800	
ティーライフ	1,300	1,377.00	1,790,100	
エー・ピーカンパニー	1,900	708.00	1,345,200	
チムニー	2,900	2,950.00	8,555,000	
シュッピン	5,600	1,530.00	8,568,000	
ネクステージ	9,900	1,252.00	12,394,800	
ジョイフル本田	13,400	3,765.00	50,451,000	
鳥貴族	3,100	2,772.00	8,593,200	
キリン堂ホールディングス	3,300	2,905.00	9,586,500	
ホットランド	5,400	1,396.00	7,538,400	
すかいらーく	56,800	1,688.00	95,878,400	
綿半ホールディングス	3,500	3,450.00	12,075,000	
ヨシックス	1,500	4,055.00	6,082,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,400	1,454.00	44,201,600	
ブックオフコーポレーション	5,200	822.00	4,274,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	1,293.00	5,042,700	
ＢＥＥＮＯＳ	2,200	1,743.00	3,834,600	
あさひ	7,000	1,423.00	9,961,000	
日本調剤	3,300	2,966.00	9,787,800	
コスモス薬品	4,600	22,820.00	104,972,000	
トーエル	4,600	1,016.00	4,673,600	
一六堂	2,300	413.00	949,900	
オンリー	1,500	971.00	1,456,500	
セブン＆アイ・ホールディングス	382,300	5,053.00	1,931,761,900	

薬王堂	4,000	3,830.00	15,320,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	24,600	1,544.00	37,982,400	
ツルハホールディングス	19,800	15,920.00	315,216,000	
サンマルクホールディングス	6,600	2,849.00	18,803,400	
フェリシモ	2,400	1,387.00	3,328,800	
トリドールホールディングス	11,300	2,978.00	33,651,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	8,300	978.00	8,117,400	
ウイルプラスホールディングス	1,000	1,202.00	1,202,000	
サツドラホールディングス	1,600	2,321.00	3,713,600	
ダイユー・リックホールディングス	4,400	1,177.00	5,178,800	
バロックジャパンリミテッド	7,500	1,068.00	8,010,000	
クスリのアオキホールディングス	7,300	7,810.00	57,013,000	
力の源ホールディングス	2,100	1,681.00	3,530,100	
スシローグローバルホールディングス	10,000	6,810.00	68,100,000	
ＬＩＸＩＬビバ	11,700	1,904.00	22,276,800	
メディカルシステムネットワーク	10,600	517.00	5,480,200	
総合メディカル	8,000	2,531.00	20,248,000	
はるやまホールディングス	4,400	1,024.00	4,505,600	
ノジマ	16,100	2,669.00	42,970,900	
カッパ・クリエイト	11,300	1,459.00	16,486,700	
ライトオン	7,900	1,015.00	8,018,500	
良品計画	12,100	39,200.00	474,320,000	
三城ホールディングス	11,700	503.00	5,885,100	
アドヴァン	9,500	988.00	9,386,000	
アルビス	3,000	3,360.00	10,080,000	
コナカ	12,000	541.00	6,492,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,200	1,795.00	2,154,000	
Ｇ－７ホールディングス	2,800	3,025.00	8,470,000	
イオン北海道	9,400	809.00	7,604,600	
コジマ	13,800	537.00	7,410,600	
ヒマラヤ	2,600	1,157.00	3,008,200	
コーナン商事	13,000	2,710.00	35,230,000	
エコス	3,800	1,726.00	6,558,800	
ワタミ	10,900	1,449.00	15,794,100	
マルシェ	2,600	818.00	2,126,800	
ドンキホーテホールディングス	59,100	5,850.00	345,735,000	
西松屋チェーン	20,100	1,210.00	24,321,000	
ゼンショーホールディングス	47,400	2,776.00	131,582,400	
幸楽苑ホールディングス	5,900	1,762.00	10,395,800	
ハークスレイ	2,400	1,089.00	2,613,600	
サイゼリヤ	15,100	2,546.00	38,444,600	
ＶＴホールディングス	31,400	556.00	17,458,400	

魚力	2,700	1,435.00	3,874,500	
ポプラ	2,400	891.00	2,138,400	
フジ・コーポレーション	1,700	2,705.00	4,598,500	
ユナイテッドアローズ	11,300	4,040.00	45,652,000	
ハイデイ日高	12,000	2,684.00	32,208,000	
京都きもの友禅	6,000	662.00	3,972,000	
コロワイド	30,400	3,060.00	93,024,000	
ピーシーデポコーポレーション	13,900	594.00	8,256,600	
壱番屋	6,500	5,040.00	32,760,000	
トップカルチャー	3,600	406.00	1,461,600	
ＰＬＡＮＴ	2,200	1,338.00	2,943,600	
スギホールディングス	20,100	6,560.00	131,856,000	
ヴィア・ホールディングス	10,900	715.00	7,793,500	
スクロール	14,400	625.00	9,000,000	
ヨンドシーホールディングス	9,400	2,803.00	26,348,200	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	29,200	12,180.00	355,656,000	
木曽路	11,300	2,870.00	32,431,000	
ＳＲＳホールディングス	11,000	1,003.00	11,033,000	
タカキュー	7,700	219.00	1,686,300	
ケーヨー	17,200	562.00	9,666,400	
上新電機	10,800	3,910.00	42,228,000	
日本瓦斯	16,800	6,100.00	102,480,000	
ロイヤルホールディングス	16,300	2,951.00	48,101,300	
いなげや	10,200	1,817.00	18,533,400	
島忠	20,700	3,410.00	70,587,000	
チヨダ	10,900	2,633.00	28,699,700	
ライフコーポレーション	7,000	2,829.00	19,803,000	
リンガーハット	11,300	2,659.00	30,046,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	11,700	699.00	8,178,300	
テンアライド	8,500	467.00	3,969,500	
ＡＯＫＩホールディングス	18,300	1,703.00	31,164,900	
オークワ	13,000	1,153.00	14,989,000	
コメリ	14,200	2,847.00	40,427,400	
青山商事	17,600	3,910.00	68,816,000	
しまむら	10,600	11,250.00	119,250,000	
はせがわ	5,200	493.00	2,563,600	
高島屋	143,000	915.00	130,845,000	
松屋	18,500	1,622.00	30,007,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	43,300	1,848.00	80,018,400	
近鉄百貨店	3,500	4,095.00	14,332,500	
パルコ	8,900	1,380.00	12,282,000	
丸井グループ	87,400	2,352.00	205,564,800	

アクシアル　リテイリング	7,600	4,185.00	31,806,000	
イオン	351,000	2,403.00	843,453,000	
イズミ	16,500	6,940.00	114,510,000	
東武ストア	1,100	3,080.00	3,388,000	
平和堂	18,600	2,674.00	49,736,400	
フジ	10,900	2,318.00	25,266,200	
ヤオコー	10,400	6,010.00	62,504,000	
ゼビオホールディングス	12,400	1,871.00	23,200,400	
ケーズホールディングス	80,200	1,216.00	97,523,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,700	619.00	3,528,300	
日産東京販売ホールディングス	13,900	375.00	5,212,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,600	4,610.00	16,596,000	
アインホールディングス	12,200	7,750.00	94,550,000	
元気寿司	2,400	3,515.00	8,436,000	
ヤマダ電機	305,100	552.00	168,415,200	
アークランドサカモト	15,500	1,675.00	25,962,500	
ニトリホールディングス	36,200	18,940.00	685,628,000	
グルメ杵屋	7,000	1,210.00	8,470,000	
愛眼	7,300	471.00	3,438,300	
ケーユーホールディングス	4,900	979.00	4,797,100	
吉野家ホールディングス	30,000	2,195.00	65,850,000	
松屋フーズ	4,400	3,750.00	16,500,000	
サガミチェーン	12,400	1,415.00	17,546,000	
関西スーパーマーケット	7,100	1,222.00	8,676,200	
王将フードサービス	6,700	6,170.00	41,339,000	
プレナス	10,300	1,864.00	19,199,200	
ミニストップ	6,800	2,307.00	15,687,600	
アークス	17,200	2,987.00	51,376,400	
バローホールディングス	21,300	2,638.00	56,189,400	
藤久	800	1,571.00	1,256,800	
ベルク	4,100	5,850.00	23,985,000	
大庄	5,000	1,773.00	8,865,000	
ファーストリテイリング	12,200	50,270.00	613,294,000	
サンドラッグ	38,700	4,920.00	190,404,000	
サックスバー　ホールディングス	8,800	1,024.00	9,011,200	
ヤマザワ	2,000	1,835.00	3,670,000	
やまや	1,900	3,315.00	6,298,500	
ベルーナ	22,500	1,484.00	33,390,000	
島根銀行	1,900	1,234.00	2,344,600	
じもとホールディングス	62,100	182.00	11,302,200	
めぶきフィナンシャルグループ	474,600	396.00	187,941,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12,300	2,542.00	31,266,600	

九州フィナンシャルグループ	150,000	542.00	81,300,000	
ゆうちょ銀行	258,800	1,352.00	349,897,600	
富山第一銀行	23,400	499.00	11,676,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	545,400	631.00	344,147,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	58,300	1,322.00	77,072,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	40,000	912.00	36,480,000	
三十三フィナンシャルグループ	7,700	2,276.00	17,525,200	
新生銀行	79,100	1,746.00	138,108,600	
あおぞら銀行	54,300	4,360.00	236,748,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,394,800	676.70	4,327,361,160	
りそなホールディングス	1,002,400	634.20	635,722,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	179,600	4,608.00	827,596,800	
三井住友フィナンシャルグループ	691,400	4,542.00	3,140,338,800	
第四銀行	11,200	4,785.00	53,592,000	
北越銀行	9,200	2,393.00	22,015,600	
千葉銀行	323,500	849.00	274,651,500	
群馬銀行	185,600	632.00	117,299,200	
武蔵野銀行	14,600	3,620.00	52,852,000	
千葉興業銀行	25,300	516.00	13,054,800	
筑波銀行	38,200	299.00	11,421,800	
七十七銀行	28,700	2,495.00	71,606,500	
青森銀行	7,100	3,395.00	24,104,500	
秋田銀行	5,900	3,115.00	18,378,500	
山形銀行	10,300	2,480.00	25,544,000	
岩手銀行	6,400	4,470.00	28,608,000	
東邦銀行	81,700	430.00	35,131,000	
東北銀行	4,700	1,399.00	6,575,300	
みちのく銀行	5,900	1,767.00	10,425,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	371,000	602.00	223,342,000	
静岡銀行	241,100	1,091.00	263,040,100	
十六銀行	12,300	3,025.00	37,207,500	
スルガ銀行	93,500	1,055.00	98,642,500	
八十二銀行	165,400	516.00	85,346,400	
山梨中央銀行	57,000	463.00	26,391,000	
大垣共立銀行	14,400	2,924.00	42,105,600	
福井銀行	7,800	2,415.00	18,837,000	
北國銀行	10,400	4,755.00	49,452,000	
清水銀行	3,100	2,180.00	6,758,000	
富山銀行	1,800	4,365.00	7,857,000	
滋賀銀行	86,000	592.00	50,912,000	
南都銀行	10,700	2,851.00	30,505,700	
百五銀行	87,900	477.00	41,928,300	

京都銀行	34,900	5,740.00	200,326,000	
紀陽銀行	34,400	1,923.00	66,151,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	60,800	1,583.00	96,246,400	
広島銀行	134,900	799.00	107,785,100	
山陰合同銀行	54,300	1,024.00	55,603,200	
中国銀行	63,300	1,254.00	79,378,200	
鳥取銀行	2,900	1,721.00	4,990,900	
伊予銀行	130,400	787.00	102,624,800	
百十四銀行	97,000	378.00	36,666,000	
四国銀行	13,900	1,454.00	20,210,600	
阿波銀行	73,000	741.00	54,093,000	
大分銀行	5,300	3,955.00	20,961,500	
宮崎銀行	6,100	3,640.00	22,204,000	
佐賀銀行	5,500	2,478.00	13,629,000	
十八銀行	56,000	304.00	17,024,000	
沖縄銀行	8,900	4,405.00	39,204,500	
琉球銀行	17,700	1,733.00	30,674,100	
セブン銀行	342,800	355.00	121,694,000	
みずほフィナンシャルグループ	12,410,600	193.50	2,401,451,100	
高知銀行	3,300	1,277.00	4,214,100	
山口フィナンシャルグループ	114,000	1,350.00	153,900,000	
長野銀行	3,000	1,825.00	5,475,000	
名古屋銀行	7,400	3,980.00	29,452,000	
北洋銀行	138,100	388.00	53,582,800	
愛知銀行	3,100	5,240.00	16,244,000	
中京銀行	3,800	2,339.00	8,888,200	
大光銀行	3,100	2,283.00	7,077,300	
愛媛銀行	12,700	1,275.00	16,192,500	
トマト銀行	3,500	1,560.00	5,460,000	
京葉銀行	81,000	499.00	40,419,000	
栃木銀行	47,300	418.00	19,771,400	
北日本銀行	2,800	2,772.00	7,761,600	
東和銀行	16,000	1,218.00	19,488,000	
福島銀行	8,700	697.00	6,063,900	
大東銀行	4,400	1,295.00	5,698,000	
トモニホールディングス	75,500	516.00	38,958,000	
フィデアホールディングス	88,100	178.00	15,681,800	
池田泉州ホールディングス	97,200	397.00	38,588,400	
ＦＰＧ	29,300	1,519.00	44,506,700	
マーキュリアインベストメント	2,700	1,134.00	3,061,800	
ＳＢＩホールディングス	103,400	2,876.00	297,378,400	
ジャフコ	13,100	4,660.00	61,046,000	

大和証券グループ本社	782,100	648.90	507,504,690	
野村ホールディングス	1,571,800	573.00	900,641,400	
岡三証券グループ	78,000	570.00	44,460,000	
丸三証券	29,300	1,022.00	29,944,600	
東洋証券	33,000	272.00	8,976,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	101,400	762.00	77,266,800	
光世証券	2,300	1,400.00	3,220,000	
水戸証券	26,900	404.00	10,867,600	
いちよし証券	19,300	1,300.00	25,090,000	
松井証券	45,000	1,043.00	46,935,000	
だいこう証券ビジネス	4,700	611.00	2,871,700	
マネックスグループ	93,100	588.00	54,742,800	
カブドットコム証券	59,000	390.00	23,010,000	
極東証券	12,300	1,510.00	18,573,000	
岩井コスモホールディングス	9,400	1,487.00	13,977,800	
藍澤證券	17,200	793.00	13,639,600	
マネーパートナーズグループ	12,200	451.00	5,502,200	
かんぽ生命保険	34,500	2,476.00	85,422,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	179,100	4,620.00	827,442,000	
アニコム　ホールディングス	6,200	4,220.00	26,164,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	238,800	3,553.00	848,456,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	75,100	2,143.00	160,939,300	
第一生命ホールディングス	516,700	2,117.00	1,093,853,900	
東京海上ホールディングス	344,100	5,473.00	1,883,259,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,000	1,149.00	3,447,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	282,500	1,810.50	511,466,250	
アドバンスクリエイト	2,100	2,196.00	4,611,600	
全国保証	25,800	5,080.00	131,064,000	
ジェイリース	1,700	689.00	1,171,300	
イントラスト	1,400	811.00	1,135,400	
アルヒ	10,400	2,188.00	22,755,200	
クレディセゾン	69,100	1,812.00	125,209,200	
アクリーティブ	5,000	299.00	1,495,000	
芙蓉総合リース	10,500	7,860.00	82,530,000	
興銀リース	17,200	3,055.00	52,546,000	
東京センチュリー	18,400	6,390.00	117,576,000	
日本証券金融	37,400	638.00	23,861,200	
アイフル	153,700	352.00	54,102,400	
リコーリース	7,200	3,730.00	26,856,000	
イオンフィナンシャルサービス	64,600	2,563.00	165,569,800	
アコム	183,700	452.00	83,032,400	
ジャックス	11,100	2,457.00	27,272,700	

オリエントコーポレーション	198,200	154.00	30,522,800	
日立キャピタル	25,100	2,898.00	72,739,800	
アプラスフィナンシャル	44,200	114.00	5,038,800	
オリックス	609,300	1,869.00	1,138,781,700	
三菱ＵＦＪリース	231,100	672.00	155,299,200	
九州リースサービス	3,900	767.00	2,991,300	
日本取引所グループ	262,200	2,119.00	555,601,800	
イー・ギャランティ	4,800	2,224.00	10,675,200	
アサックス	1,300	1,931.00	2,510,300	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,700	2,035.00	7,529,500	
いちご	131,000	539.00	70,609,000	
日本駐車場開発	109,800	179.00	19,654,200	
ヒューリック	190,700	1,163.00	221,784,100	
三栄建築設計	3,700	1,930.00	7,141,000	
スター・マイカ	4,400	2,398.00	10,551,200	
野村不動産ホールディングス	60,800	2,506.00	152,364,800	
三重交通グループホールディングス	18,800	492.00	9,249,600	
サムティ	7,800	2,273.00	17,729,400	
ディア・ライフ	9,300	527.00	4,901,100	
コーセーアールイー	1,600	859.00	1,374,400	
エー・ディー・ワークス	123,300	41.00	5,055,300	
日本商業開発	5,200	1,947.00	10,124,400	
プレサンスコーポレーション	12,600	1,773.00	22,339,800	
ユニゾホールディングス	12,500	2,193.00	27,412,500	
ＴＨＥグローバル社	4,400	867.00	3,814,800	
日本管理センター	6,100	1,406.00	8,576,600	
サンセイランディック	2,700	1,242.00	3,353,400	
エストラスト	1,300	931.00	1,210,300	
フージャースホールディングス	22,100	841.00	18,586,100	
オープンハウス	14,900	6,550.00	97,595,000	
東急不動産ホールディングス	220,500	809.00	178,384,500	
飯田グループホールディングス	76,000	2,123.00	161,348,000	
イーグランド	1,100	1,204.00	1,324,400	
ムゲンエステート	5,700	1,174.00	6,691,800	
ビーロット	1,400	1,762.00	2,466,800	
ファーストブラザーズ	2,600	1,503.00	3,907,800	
ハウスドゥ	1,500	5,240.00	7,860,000	
シーアールイー	1,500	1,925.00	2,887,500	
ケイアイスター不動産	3,300	2,696.00	8,896,800	
グッドコムアセット	1,100	1,807.00	1,987,700	
パーク２４	53,300	2,893.00	154,196,900	
パラカ	2,400	2,494.00	5,985,600	

三井不動産	456,100	2,717.50	1,239,451,750	
三菱地所	679,900	1,972.50	1,341,102,750	
平和不動産	16,200	2,245.00	36,369,000	
東京建物	99,500	1,515.00	150,742,500	
ダイビル	23,600	1,193.00	28,154,800	
京阪神ビルディング	15,300	1,012.00	15,483,600	
住友不動産	219,000	4,187.00	916,953,000	
大京	14,600	2,546.00	37,171,600	
テーオーシー	31,500	885.00	27,877,500	
東京楽天地	1,500	5,790.00	8,685,000	
レオパレス２１	109,100	682.00	74,406,200	
スターツコーポレーション	12,400	2,814.00	34,893,600	
フジ住宅	11,800	984.00	11,611,200	
空港施設	9,200	649.00	5,970,800	
明和地所	5,100	698.00	3,559,800	
ゴールドクレスト	7,200	1,940.00	13,968,000	
日本エスリード	3,600	2,023.00	7,282,800	
日神不動産	12,300	725.00	8,917,500	
日本エスコン	16,300	699.00	11,393,700	
タカラレーベン	42,600	425.00	18,105,000	
サンヨーハウジング名古屋	4,800	1,237.00	5,937,600	
イオンモール	58,900	2,078.00	122,394,200	
ファースト住建	3,400	1,524.00	5,181,600	
カチタス	12,500	4,550.00	56,875,000	
トーセイ	11,200	1,384.00	15,500,800	
穴吹興産	1,000	3,445.00	3,445,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	57,000	1,175.00	66,975,000	
サンフロンティア不動産	11,100	1,379.00	15,306,900	
エフ・ジェー・ネクスト	7,100	1,060.00	7,526,000	
インテリックス	2,600	1,022.00	2,657,200	
ランドビジネス	5,400	336.00	1,814,400	
グランディハウス	8,100	494.00	4,001,400	
日本空港ビルデング	26,700	5,590.00	149,253,000	
日本工営	6,000	3,290.00	19,740,000	
ＬＩＦＵＬＬ	30,900	749.00	23,144,100	
ジェイエイシーリクルートメント	7,200	2,212.00	15,926,400	
日本Ｍ＆Ａセンター	61,300	3,480.00	213,324,000	
メンバーズ	3,000	1,245.00	3,735,000	
中広	1,100	793.00	872,300	
タケエイ	9,200	1,213.00	11,159,600	
トラスト・テック	4,100	3,615.00	14,821,500	
コシダカホールディングス	23,600	1,706.00	40,261,600	

パソナグループ	8,500	1,714.00	14,569,000	
ＣＤＳ	2,500	1,463.00	3,657,500	
リンクアンドモチベーション	16,500	1,413.00	23,314,500	
ＧＣＡ	10,200	939.00	9,577,800	
エス・エム・エス	17,500	4,090.00	71,575,000	
パーソルホールディングス	81,500	2,322.00	189,243,000	
リニカル	5,800	2,211.00	12,823,800	
クックパッド	27,800	577.00	16,040,600	
エスクリ	3,200	839.00	2,684,800	
アイ・ケイ・ケイ	5,400	845.00	4,563,000	
学情	4,100	1,510.00	6,191,000	
スタジオアリス	4,500	2,642.00	11,889,000	
シミックホールディングス	5,000	2,318.00	11,590,000	
ＮＪＳ	2,200	1,840.00	4,048,000	
綜合警備保障	35,100	5,270.00	184,977,000	
カカクコム	66,700	2,490.00	166,083,000	
アイロムグループ	3,000	2,115.00	6,345,000	
セントケア・ホールディング	3,900	711.00	2,772,900	
サイネックス	1,500	840.00	1,260,000	
ルネサンス	4,400	2,307.00	10,150,800	
ディップ	12,500	2,732.00	34,150,000	
オプトホールディング	6,200	2,087.00	12,939,400	
ツクイ	20,800	912.00	18,969,600	
キャリアデザインセンター	2,100	2,205.00	4,630,500	
エムスリー	93,200	4,590.00	427,788,000	
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	654.00	4,774,200	
ブラス	600	809.00	485,400	
アウトソーシング	26,400	2,101.00	55,466,400	
ウェルネット	9,100	1,270.00	11,557,000	
ワールドホールディングス	3,000	3,605.00	10,815,000	
ディー・エヌ・エー	47,800	2,103.00	100,523,400	
博報堂ＤＹホールディングス	122,700	1,718.00	210,798,600	
ぐるなび	14,000	920.00	12,880,000	
エスアールジータカミヤ	10,700	683.00	7,308,100	
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	887.00	6,209,000	
ファンコミュニケーションズ	24,800	759.00	18,823,200	
ライク	3,500	2,011.00	7,038,500	
ビジネス・ブレークスルー	4,400	455.00	2,002,000	
ＷＤＢホールディングス	4,100	3,085.00	12,648,500	
ティア	4,200	1,094.00	4,594,800	
ＣＤＧ	900	1,692.00	1,522,800	
バリューコマース	8,000	1,503.00	12,024,000	

インフォマート	45,000	1,449.00	65,205,000	
ＪＰホールディングス	28,400	408.00	11,587,200	
エコナックホールディングス	18,100	135.00	2,443,500	
ＥＰＳホールディングス	13,400	2,353.00	31,530,200	
レッグス	2,300	1,056.00	2,428,800	
プレステージ・インターナショナル	18,400	1,590.00	29,256,000	
アミューズ	5,900	3,045.00	17,965,500	
ドリームインキュベータ	3,000	2,349.00	7,047,000	
クイック	5,600	1,821.00	10,197,600	
ＴＡＣ	5,800	349.00	2,024,200	
ケネディクス	117,700	680.00	80,036,000	
電通	107,800	5,280.00	569,184,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,670.00	7,181,000	
ぴあ	2,900	6,320.00	18,328,000	
イオンファンタジー	2,900	7,110.00	20,619,000	
シーティーエス	8,900	1,009.00	8,980,100	
ネクシィーズグループ	2,800	1,719.00	4,813,200	
みらかホールディングス	26,400	3,400.00	89,760,000	
アルプス技研	7,800	2,401.00	18,727,800	
ダイオーズ	1,800	1,324.00	2,383,200	
日本空調サービス	9,500	814.00	7,733,000	
オリエンタルランド	104,600	11,275.00	1,179,365,000	
ダスキン	23,900	2,701.00	64,553,900	
明光ネットワークジャパン	11,200	1,310.00	14,672,000	
ファルコホールディングス	4,600	1,879.00	8,643,400	
ラウンドワン	27,500	1,900.00	52,250,000	
リゾートトラスト	37,500	2,074.00	77,775,000	
ビー・エム・エル	11,400	2,853.00	32,524,200	
ワタベウェディング	1,600	537.00	859,200	
りらいあコミュニケーションズ	14,000	1,584.00	22,176,000	
リソー教育	15,100	847.00	12,789,700	
早稲田アカデミー	1,300	2,312.00	3,005,600	
ユー・エス・エス	108,100	2,140.00	231,334,000	
東京個別指導学院	3,300	951.00	3,138,300	
サイバーエージェント	54,500	5,970.00	325,365,000	
楽天	453,900	709.60	322,087,440	
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,163.00	5,466,100	
テー・オー・ダブリュー	8,600	893.00	7,679,800	
セントラルスポーツ	3,300	4,170.00	13,761,000	
フルキャストホールディングス	7,800	2,799.00	21,832,200	
リソルホールディングス	1,000	4,435.00	4,435,000	
テクノプロ・ホールディングス	16,700	7,090.00	118,403,000	

アトラ	1,700	767.00	1,303,900	
インターワークス	2,100	1,005.00	2,110,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,000	1,354.00	4,062,000	
ファーストロジック	1,400	762.00	1,066,800	
三機サービス	1,100	1,862.00	2,048,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	5,400	1,522.00	8,218,800	
デザインワン・ジャパン	1,800	1,241.00	2,233,800	
イー・ガーディアン	4,200	3,155.00	13,251,000	
リブセンス	6,000	561.00	3,366,000	
ジャパンマテリアル	24,300	1,833.00	44,541,900	
ベクトル	10,700	2,200.00	23,540,000	
ウチヤマホールディングス	4,600	572.00	2,631,200	
ライクキッズネクスト	2,000	1,172.00	2,344,000	
キャリアリンク	3,100	562.00	1,742,200	
ＩＢＪ	7,100	672.00	4,771,200	
アサンテ	3,300	2,199.00	7,256,700	
Ｎ・フィールド	5,000	1,673.00	8,365,000	
バリューＨＲ	2,100	2,092.00	4,393,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2,300	10,170.00	23,391,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,345.00	5,111,000	
ＥＲＩホールディングス	2,600	1,054.00	2,740,400	
アビスト	1,300	4,865.00	6,324,500	
シグマクシス	4,800	1,316.00	6,316,800	
ウィルグループ	3,900	1,115.00	4,348,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,400	508.00	6,299,200	
日本ビューホテル	2,900	1,449.00	4,202,100	
リクルートホールディングス	682,700	3,056.00	2,086,331,200	
エラン	2,200	2,679.00	5,893,800	
土木管理総合試験所	2,800	575.00	1,610,000	
日本郵政	502,300	1,250.00	627,875,000	
ベルシステム２４ホールディングス	14,800	1,853.00	27,424,400	
鎌倉新書	1,600	3,330.00	5,328,000	
一蔵	1,200	822.00	986,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,100	1,780.00	3,738,000	
グローバルグループ	1,000	1,659.00	1,659,000	
エボラブルアジア	2,600	2,306.00	5,995,600	
ストライク	2,300	3,860.00	8,878,000	
ソラスト	5,400	3,375.00	18,225,000	
セラク	1,600	945.00	1,512,000	
インソース	3,000	2,410.00	7,230,000	
キャリアインデックス	1,200	3,085.00	3,702,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	900	7,480.00	6,732,000	

船場	1,400	1,190.00	1,666,000	
フルテック	1,000	1,132.00	1,132,000	
グリーンズ	2,000	1,627.00	3,254,000	
日総工産	1,500	5,760.00	8,640,000	
キュービーネットホールディングス	4,500	1,808.00	8,136,000	
リログループ	48,300	2,825.00	136,447,500	
東祥	5,500	4,245.00	23,347,500	
エイチ・アイ・エス	13,800	3,780.00	52,164,000	
ラックランド	1,700	2,689.00	4,571,300	
共立メンテナンス	15,800	5,980.00	94,484,000	
イチネンホールディングス	9,900	1,462.00	14,473,800	
建設技術研究所	6,300	1,418.00	8,933,400	
スペース	5,800	1,519.00	8,810,200	
長大	3,700	946.00	3,500,200	
燦ホールディングス	2,100	2,741.00	5,756,100	
スバル興業	600	6,850.00	4,110,000	
東京テアトル	3,800	1,448.00	5,502,400	
タナベ経営	1,800	2,036.00	3,664,800	
ナガワ	1,800	4,740.00	8,532,000	
よみうりランド	1,900	4,805.00	9,129,500	
東京都競馬	6,700	4,835.00	32,394,500	
カナモト	13,500	3,720.00	50,220,000	
東京ドーム	36,100	1,010.00	36,461,000	
西尾レントオール	9,000	3,695.00	33,255,000	
トランス・コスモス	9,900	2,671.00	26,442,900	
乃村工藝社	20,800	2,392.00	49,753,600	
藤田観光	3,600	3,520.00	12,672,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,500	1,653.00	9,091,500	
日本管財	9,500	2,298.00	21,831,000	
トーカイ	8,600	2,450.00	21,070,000	
白洋舎	1,000	3,450.00	3,450,000	
セコム	93,900	8,262.00	775,801,800	
セントラル警備保障	4,300	4,635.00	19,930,500	
丹青社	18,300	1,529.00	27,980,700	
メイテック	10,400	5,100.00	53,040,000	
応用地質	9,600	1,473.00	14,140,800	
船井総研ホールディングス	18,400	2,820.00	51,888,000	
進学会ホールディングス	4,300	648.00	2,786,400	
オオバ	7,100	641.00	4,551,100	
いであ	1,900	1,140.00	2,166,000	
学究社	3,300	1,827.00	6,029,100	
ベネッセホールディングス	32,300	4,070.00	131,461,000	

イオンディライト	10,900	4,045.00	44,090,500	
ナック	6,100	913.00	5,569,300	
ニチイ学館	17,000	1,238.00	21,046,000	
ダイセキ	14,900	3,455.00	51,479,500	
ステップ	3,300	1,765.00	5,824,500	
合　計	111,805,250		236,593,974,450	

(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

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,477,157,845
金銭信託	17,475,267
コール・ローン	1,080,258,765
株式	222,085,183,609
投資信託受益証券	166,732,204
投資証券	5,066,197,878
派生商品評価勘定	292,697,863
未収入金	21,891,183
未収配当金	452,027,828
差入委託証拠金	2,317,448,655
流動資産合計	240,977,071,097
資産合計	240,977,071,097
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,780,546
前受金	263,413,147
未払解約金	195,899,650
未払利息	2,862
その他未払費用	15,216
流動負債合計	490,111,421
負債合計	490,111,421
純資産の部	
元本等	

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
元本	90,650,594,351
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	149,836,365,325
元本等合計	240,486,959,676
純資産合計	240,486,959,676
負債純資産合計	240,977,071,097

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2018年 6月11日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 6月11日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		90,650,594,351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	2.6529円
	(1万口当たり純資産額)	(26,529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

	2018年 6月11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。

	2018年 6月11日現在
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

	2018年 6月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 6月13日
期首元本額	87,969,112,695円
期中追加設定元本額	18,307,177,597円
期中一部解約元本額	15,625,695,941円
期末元本額	90,650,594,351円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,931,276,888円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,432,615,815円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	19,447,279,722円
ＤＣバランスファンド３０	678,812,752円
ＤＣバランスファンド５０	1,372,488,581円
ＤＣバランスファンド７０	796,782,045円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	443,271,447円
外国株式インデックスｅ	6,050,004,938円
インデックスコレクション（外国株式）	4,886,748,595円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	1,874,707,775円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	665,649,284円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	600,729,813円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	24,914,932,941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）	1,433,989,717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）	1,073,732,112円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	138,042,523円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,273,021,466円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	97,324,911円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	535,583,714円

区分	2018年 6月11日現在
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	5,959,966円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	3,143,875,854円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	711,468,448円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	424,466,285円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,209,574,901円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	799,680,169円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	942,016,929円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,279,592,077円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	35,972,057円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	230,864,349円
ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	16,757,698円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	180,442,351円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	541,589,719円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	29,569,048円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	867,106,105円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	19,748,204円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	150,236,661円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	399,407,400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）	15,271,091円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,325,301,206
投資信託受益証券	14,940,775
投資証券	234,049,939
合計	7,574,291,920

(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

（2018年 6月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	12,849,171,224	－	13,112,584,371	263,413,147
合計		12,849,171,224	－	13,112,584,371	263,413,147

(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はありません。

通貨関連

（2018年 6月11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	1,027,296,105	－	1,025,455,080	△1,841,025
	アメリカドル	746,471,152	－	747,215,840	744,688
	ユーロ	186,873,084	－	185,072,040	△1,801,044
	イギリスポンド	93,951,869	－	93,167,200	△784,669
	売建	158,322,695	－	157,977,500	345,195
	アメリカドル	128,339,250	－	127,994,000	345,250
	ユーロ	16,777,475	－	16,777,800	△325
	イギリスポンド	13,205,970	－	13,205,700	270
合計		1,185,618,800	－	1,183,432,580	△1,495,830

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	29,500	71.40	2,106,300.00	
	ANDEAVOR	7,990	144.68	1,155,993.20	
	ANTERO RESOURCES CORP	12,192	19.62	239,207.04	
	APACHE CORP	20,175	42.24	852,192.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	21,381	34.70	741,920.70	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,594	23.54	578,942.76	

CHENIERE ENERGY INC	10,538	65.39	689,079.82	
CHEVRON CORP	106,188	126.44	13,426,410.72	
CIMAREX ENERGY CO	5,025	85.59	430,089.75	
CONCHO RESOURCES INC	8,513	128.28	1,092,047.64	
CONOCOPHILLIPS	65,211	69.43	4,527,599.73	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,386	65.84	354,614.24	
DEVON ENERGY CORPORATION	29,200	42.16	1,231,072.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,750	113.96	541,310.00	
EOG RESOURCES INC	32,262	117.67	3,796,269.54	
EQT CORPORATION	14,856	53.12	789,150.72	
EXXON MOBIL	235,598	83.60	19,695,992.80	
HALLIBURTON CO	48,932	48.10	2,353,629.20	
HELMERICH & PAYNE	6,339	65.38	414,443.82	
HESS CORP	15,109	61.84	934,340.56	
HOLLYFRONTIER CORP	9,262	77.19	714,933.78	
KINDER MORGAN INC	113,702	16.85	1,915,878.70	
MARATHON OIL CORP	44,903	20.99	942,513.97	
MARATHON PETROLEUM CORP	26,376	78.99	2,083,440.24	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	20,041	42.58	853,345.78	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,321	29.15	388,307.15	
NOBLE ENERGY INC	27,338	34.06	931,132.28	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,916	85.47	3,668,030.52	
ONEOK INC	21,967	68.45	1,503,641.15	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	12,200	27.20	331,840.00	
PHILLIPS 66	24,428	116.84	2,854,167.52	
PIONEER NATURAL RESOURCES	9,720	193.24	1,878,292.80	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	10,331	24.76	255,795.56	
SCHLUMBERGER	77,493	69.43	5,380,338.99	
TARGA RESOURCES CORP	13,301	49.31	655,872.31	
TECHNIPFMC PLC	23,499	32.60	766,067.40	
VALERO ENERGY CORP	24,027	119.72	2,876,512.44	
WILLIAMS COS	47,151	26.12	1,231,584.12	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,318	168.51	2,075,706.18	
ALBEMARLE CORP	5,954	95.37	567,832.98	
AVERY DENNISON CORP	5,286	108.03	571,046.58	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	31.85	345,381.40	
BALL CORP	17,586	37.60	661,233.60	
CELANESE CORP-SERIES A	7,497	117.11	877,973.67	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,239	43.18	528,480.02	
CHEMOURS CO/THE	11,442	51.28	586,745.76	
CROWN HOLDINGS INC	7,348	44.58	327,573.84	
DOWDUPONT INC	130,103	69.49	9,040,857.47	

EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,768	109.07	847,255.76	
ECOLAB INC	14,734	146.19	2,153,963.46	
FMC CORP	8,186	88.64	725,607.04	
FREEPORT-MCMORAN INC	79,109	18.03	1,426,335.27	
INT'L PAPER CO	22,531	58.81	1,325,048.11	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,198	126.41	530,669.18	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,002	118.09	2,243,946.18	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,686	229.56	846,158.16	
MOSAIC CO/THE	17,569	29.46	517,582.74	
NEWMONT MINING CORP	30,871	38.38	1,184,828.98	
NUCOR CORP	18,456	66.85	1,233,783.60	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,966	122.64	609,030.24	
PPG INDUSTRIES INC	14,635	104.15	1,524,235.25	
PRAXAIR INC	16,096	159.83	2,572,623.68	
SEALED AIR CORP	9,792	43.80	428,889.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,765	398.05	1,896,708.25	
STEEL DYNAMICS INC	14,374	50.74	729,336.76	
VULCAN MATERIALS CO	7,023	130.04	913,270.92	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,000	117.67	235,340.00	
WESTROCK CO	14,893	60.96	907,877.28	
3 M COMPANY	33,270	206.59	6,873,249.30	
ACUITY BRANDS INC	2,326	121.84	283,399.84	
AERCAP HOLDINGS NV	7,756	54.83	425,261.48	
AGCO CORP	3,843	63.68	244,722.24	
ALLEGION PLC	4,805	81.12	389,781.60	
AMETEK INC	12,258	75.75	928,543.50	
ARCONIC INC	27,936	17.94	501,171.84	
BOEING CO	31,075	369.50	11,482,212.50	
CATERPILLAR	32,959	155.32	5,119,191.88	
CUMMINS INC	9,149	143.68	1,314,528.32	
DEERE&CO	16,895	157.12	2,654,542.40	
DOVER CORP	8,227	78.92	649,274.84	
EATON CORP	25,118	80.35	2,018,231.30	
EMERSON ELECTRIC CO	35,953	73.15	2,629,961.95	
FASTENAL CO	15,334	52.82	809,941.88	
FLOWSERVE CORP	8,571	42.17	361,439.07	
FLUOR CORP	7,798	50.34	392,551.32	
FORTIVE CORP	16,839	78.20	1,316,809.80	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8,144	58.52	476,586.88	
GENERAL DYNAMICS CORP	14,252	202.58	2,887,170.16	
GENERAL ELECTRIC CO	481,860	13.93	6,712,309.80	
GRAINGER (WW) INC	2,626	314.59	826,113.34	

HARRIS CORP	6,483	154.65	1,002,595.95	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10,197	42.89	437,349.33	
HONEYWELL INTL INC	41,631	151.86	6,322,083.66	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,490	226.35	563,611.50	
IDEX CORP	4,460	144.13	642,819.80	
ILLINOIS TOOL WORKS	17,383	147.76	2,568,512.08	
INGERSOLL-RAND PLC	13,665	90.69	1,239,278.85	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,708	66.60	446,752.80	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	62.41	792,607.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	12,000	36.71	440,520.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,689	35.14	1,851,491.46	
L3 TECHNOLOGIES INC	4,589	204.22	937,165.58	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,937	213.76	414,053.12	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,450	322.31	4,657,379.50	
MASCO CORP	18,777	38.86	729,674.22	
MIDDLEBY CORP	3,030	104.19	315,695.70	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,256	338.63	3,134,359.28	
OWENS CORNING	6,694	65.55	438,791.70	
PACCAR INC	18,914	65.26	1,234,327.64	
PARKER HANNIFIN CORP	7,165	174.71	1,251,797.15	
PENTAIR PLC	9,130	45.00	410,850.00	
RAYTHEON COMPANY	16,220	214.56	3,480,163.20	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,909	178.01	1,229,871.09	
ROCKWELL COLLIN	8,761	139.18	1,219,355.98	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,803	285.58	1,657,220.74	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,985	53.85	483,842.25	
SMITH (A.O.) CORP	9,112	64.84	590,822.08	
SNAP-ON INC	2,943	156.94	461,874.42	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	6,272	89.49	561,281.28	
STANLEY BLACK&DECKER	8,836	145.37	1,284,489.32	
TEXTRON	14,314	69.32	992,246.48	
TRANSDIGM GROUP INC	2,589	346.00	895,794.00	
UNITED RENTALS INC	4,452	166.80	742,593.60	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,296	127.61	5,397,392.56	
WABCO HOLDINGS INC	2,741	124.28	340,651.48	
WABTEC CORP	4,324	102.69	444,031.56	
XYLEM INC	9,461	73.27	693,207.47	
CINTAS CORP	5,229	191.48	1,001,248.92	
COPART INC	11,300	57.63	651,219.00	
COSTAR GROUP INC	1,956	401.85	786,018.60	
EQUIFAX INC	6,359	127.82	812,807.38	
IHS MARKIT LTD	21,616	51.14	1,105,442.24	

MANPOWER GROUP	4,170	92.30	384,891.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,961	31.24	592,341.64	
REPUBLIC SERVICES INC	12,626	68.24	861,598.24	
ROBERT HALF INTL INC	6,347	68.91	437,371.77	
ROLLINS INC	4,760	52.81	251,375.60	
STERICYCLE INC	4,468	64.60	288,632.80	
TRANSUNION	9,544	70.93	676,955.92	
VERISK ANALYTICS INC	8,428	109.06	919,157.68	
WASTE CONNECTIONS INC	13,965	76.73	1,071,534.45	
WASTE MANAGEMENT INC	24,839	83.59	2,076,292.01	
AMERCO	376	346.68	130,351.68	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,277	43.11	270,601.47	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,489	88.32	661,428.48	
CSX CORP	46,759	67.07	3,136,126.13	
DELTA AIR LINES INC	9,273	54.09	501,576.57	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,765	76.52	823,737.80	
FEDEX CORP	14,243	260.15	3,705,316.45	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,727	128.68	608,270.36	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,677	109.25	620,212.25	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	40.51	283,570.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,181	154.23	2,495,595.63	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,844	160.64	617,500.16	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,809	50.48	394,198.32	
UNION PACIFIC CORP	43,730	144.52	6,319,859.60	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	4,613	69.99	322,863.87	
UNITED PARCEL SERVICE B	38,338	116.60	4,470,210.80	
XPO LOGISTICS INC	6,500	111.28	723,320.00	
APTIV PLC	15,395	100.81	1,551,969.95	
AUTOLIV INC	4,653	158.85	739,129.05	
BORGWARNER INC	11,963	50.02	598,389.26	
FORD MOTOR COMPANY	208,290	12.10	2,520,309.00	
GENERAL MOTORS CO	70,028	44.25	3,098,739.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	13,776	25.31	348,670.56	
HARLEY-DAVIDSON	9,347	42.65	398,649.55	
LEAR CORP	3,716	205.34	763,043.44	
TESLA INC	7,019	317.66	2,229,655.54	
DR HORTON INC	18,752	44.19	828,650.88	
GARMIN LTD	6,761	61.85	418,167.85	
HANESBRANDS INC	19,888	20.09	399,549.92	
HASBRO INC	5,941	90.33	536,650.53	
LEGGETT & PLATT INC	7,015	43.64	306,134.60	
LENNAR CORP-CL A	16,521	54.00	892,134.00	

LULULEMON ATHLETICA INC	5,051	122.02	616,323.02	
MATTEL INC	18,030	17.03	307,050.90	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	8,077	64.65	522,178.05	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,344	210.44	703,711.36	
NEWELL BRANDS INC	28,256	24.68	697,358.08	
NIKE B	73,190	74.90	5,481,931.00	
NVR INC	207	3,196.45	661,665.15	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	126.01	370,721.42	
PULTE GROUP INC	16,982	32.56	552,933.92	
PVH CORP	4,007	168.16	673,817.12	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,528	142.23	501,787.44	
TAPESTRY INC	14,838	46.24	686,109.12	
TOLL BROTHERS INC	8,145	40.52	330,035.40	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,148	24.31	271,007.88	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11,227	22.40	251,484.80	
VF CORP	19,053	83.67	1,594,164.51	
WHIRLPOOL CORP	3,979	148.86	592,313.94	
ARAMARK	14,734	39.03	575,068.02	
BLOCK H & R INC	10,235	29.15	298,350.25	
CARNIVAL CORPORATION	23,249	60.94	1,416,794.06	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,327	453.38	601,635.26	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,416	91.45	678,193.20	
DOMINO'S PIZZA INC	2,536	270.04	684,821.44	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,526	84.14	1,306,357.64	
LAS VEGAS SANDS CORP	22,582	78.00	1,761,396.00	
MARRIOTT INTL A	16,842	138.38	2,330,595.96	
MCDONALD'S CORP	44,143	168.91	7,456,194.13	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	15,711	29.65	465,831.15	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,994	30.78	892,435.32	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,274	51.75	583,429.50	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,765	103.48	1,010,482.20	
STARBUCKS CORP	78,045	56.60	4,417,347.00	
VAIL RESORTS INC	2,021	275.25	556,280.25	
WYNN RESORTS LTD	5,255	178.12	936,020.60	
YUM BRANDS INC	17,606	83.18	1,464,467.08	
CBS CORP-CL B	18,735	51.13	957,920.55	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,257	277.26	2,566,595.82	
COMCAST CORP-CL A	257,563	32.08	8,262,621.04	
DISCOVERY INC - A	7,886	23.02	181,535.72	
DISCOVERY INC-C	17,984	21.80	392,051.20	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,018	32.08	385,537.44	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	19,962	23.12	461,521.44	

LIBERTY BROADBAND-C	5,651	72.90	411,957.90	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	10,471	29.37	307,533.27	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	32,662	28.35	925,967.70	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	12,570	32.01	402,365.70	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	8,852	46.17	408,696.84	
LIBERTY SIRIUSXM-A	4,837	46.03	222,647.11	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	9,043	45.86	414,711.98	
NEWS CORP-CLASS A	22,501	15.82	355,965.82	
OMNICOM GROUP	12,506	73.90	924,193.40	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	83,565	7.24	605,010.60	
THE WALT DISNEY CO	83,560	103.98	8,688,568.80	
TIME WARNER INC	43,281	95.34	4,126,410.54	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	58,816	39.99	2,352,051.84	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	23,286	39.55	920,961.30	
VIACOM INC-CLASS B	18,443	27.91	514,744.13	
ADVANCE AUTO PARTS	3,895	131.71	513,010.45	
AMAZON.COM	22,871	1,683.99	38,514,535.29	
AUTOZONE INC	1,514	674.39	1,021,026.46	
BEST BUY COMPANY INC	14,835	72.31	1,072,718.85	
BOOKING HOLDINGS INC	2,683	2,136.54	5,732,336.82	
CARMAX INC	10,070	73.79	743,065.30	
DOLLAR GENERAL CORP	15,532	94.90	1,473,986.80	
DOLLAR TREE INC	12,740	82.63	1,052,706.20	
EXPEDIA GROUP INC	6,557	120.89	792,675.73	
GAP	13,143	31.74	417,158.82	
GENUINE PARTS CO	7,885	94.62	746,078.70	
HOME DEPOT	64,911	198.33	12,873,798.63	
KOHLS CORP	9,438	77.76	733,898.88	
L BRANDS INC	12,863	36.99	475,802.37	
LKQ CORP	17,868	32.59	582,318.12	
LOWES COMPANIES	46,666	100.22	4,676,866.52	
MACY'S INC	17,317	39.88	690,601.96	
NETFLIX INC	24,086	360.57	8,684,689.02	
NORDSTROM INC	6,807	52.47	357,163.29	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,625	283.13	1,309,476.25	
QURATE RETAIL INC	27,323	21.46	586,351.58	
ROSS STORES INC	21,936	85.84	1,882,986.24	
TARGET (DAYTON HUDSON)	28,999	78.02	2,262,501.98	
TIFFANY & CO	6,588	132.19	870,867.72	
TJX COMPANIES INC	35,725	94.94	3,391,731.50	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,923	76.58	530,163.34	
TRIPADVISOR INC	5,778	55.84	322,643.52	

ULTA BEAUTY INC	3,147	253.06	796,379.82	
COSTCO WHOLESALE CORP	24,419	203.76	4,975,615.44	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	8.90	151,300.00	
KROGER CO	48,244	25.36	1,223,467.84	
SYSCO CORP	28,665	66.15	1,896,189.75	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,712	63.40	2,961,540.80	
WALMART INC	83,155	84.36	7,014,955.80	
ALTRIA GROUP INC	107,012	57.71	6,175,662.52	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,488	44.85	1,457,086.80	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,947	52.97	738,772.59	
BUNGE LIMITED	7,376	69.17	510,197.92	
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,126	34.05	344,790.30	
COCA-COLA CO	225,830	43.95	9,925,228.50	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,354	38.42	436,220.68	
CONAGRA BRANDS INC	22,086	37.74	833,525.64	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,617	227.28	2,185,751.76	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,762	120.52	1,176,516.24	
GENERAL MILLS INC	32,777	42.91	1,406,461.07	
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,645	91.77	701,581.65	
HORMEL FOODS CORP	14,782	36.21	535,256.22	
INGREDION INC	3,629	111.96	406,302.84	
JM SMUCKER CO	6,179	102.52	633,471.08	
KELLOGG CO	14,044	63.71	894,743.24	
KRAFT HEINZ CO/THE	34,291	58.47	2,004,994.77	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,935	103.48	717,633.80	
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,015	63.56	636,553.40	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	84,151	39.78	3,347,526.78	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,986	55.48	1,275,263.28	
PEPSICO INC	79,361	102.49	8,133,708.89	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	86,464	79.42	6,866,970.88	
TYSON FOODS INC	15,608	70.75	1,104,266.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	13,701	48.19	660,251.19	
CLOROX COMPANY	6,840	126.75	866,970.00	
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,796	63.34	2,964,058.64	
COTY INC-CL A	25,578	13.89	355,278.42	
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,616	153.05	1,930,878.80	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,839	103.27	2,048,773.53	
PROCTER & GAMBLE CO	140,118	77.18	10,814,307.24	
ABBOTT LABORATORIES	96,865	63.27	6,128,648.55	
ABIOMED INC	2,300	409.77	942,471.00	
AETNA INC	18,554	180.81	3,354,748.74	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,386	346.67	1,520,494.62	

AMERISOURCEBERGEN CORP	8,757	86.09	753,890.13	
ANTHEM INC	14,190	228.30	3,239,577.00	
BAXTER INTERNATIONAL	27,853	74.78	2,082,847.34	
BECTON DICKINSON & CO	14,795	231.84	3,430,072.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	77,460	31.95	2,474,847.00	
CARDINAL HEALTH	18,400	53.35	981,640.00	
CENTENE CORP	11,064	119.81	1,325,577.84	
CERNER CORP	17,188	60.69	1,043,139.72	
CIGNA CORP	13,464	177.81	2,394,033.84	
CVS HEALTH CORP	56,585	66.03	3,736,307.55	
DANAHER CORP	34,947	103.00	3,599,541.00	
DAVITA INC	7,925	71.05	563,071.25	
DENTSPLY SIRONA INC	12,246	42.96	526,088.16	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,988	142.82	1,712,126.16	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	31,287	78.39	2,452,587.93	
HCA HEALTHCARE INC	15,493	105.39	1,632,807.27	
HENRY SCHEIN INC	8,146	72.12	587,489.52	
HOLOGIC INC	16,710	38.34	640,661.40	
HUMANA INC	7,632	297.89	2,273,496.48	
IDEXX LABORATORIES INC	5,094	219.72	1,119,253.68	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,291	484.60	3,048,618.60	
LABORATORY CRP OF AMER	5,465	186.96	1,021,736.40	
MCKESSON CORP	11,848	145.37	1,722,343.76	
MEDTRONIC PLC	75,632	87.18	6,593,597.76	
QUEST DIAGNOSTICS	7,350	109.72	806,442.00	
RESMED INC	7,447	106.79	795,265.13	
STRYKER CORP	18,879	178.95	3,378,397.05	
TELEFLEX INC	2,665	283.28	754,941.20	
THE COOPER COS INC	2,574	232.21	597,708.54	
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,792	250.68	13,484,578.56	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,744	115.30	546,983.20	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,742	121.67	576,959.14	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	79.53	425,565.03	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,419	114.50	1,307,475.50	
ABBVIE INC	84,802	100.43	8,516,664.86	
AGILENT TECHNOLOGIES	17,329	65.73	1,139,035.17	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,808	118.33	1,515,570.64	
ALKERMES PLC	8,974	48.61	436,226.14	
ALLERGAN PLC	18,738	170.35	3,192,018.30	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,278	100.24	529,066.72	
AMGEN	37,436	184.30	6,899,454.80	
BIOGEN INC	11,821	303.29	3,585,191.09	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,134	90.64	918,545.76	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	91,295	53.16	4,853,242.20	
CELGENE CORP	41,736	79.06	3,299,648.16	
GILEAD SCIENCES INC	72,767	71.91	5,232,674.97	
ILLUMINA INC	8,286	282.03	2,336,900.58	
INCYTE CORP	10,238	70.01	716,762.38	
IQVIA HOLDINGS INC	8,351	104.60	873,514.60	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,158	176.79	558,302.82	
JOHNSON & JOHNSON	149,165	124.06	18,505,409.90	
LILLY (ELI) & CO	55,395	86.08	4,768,401.60	
MERCK & CO	149,834	62.58	9,376,611.72	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,471	594.86	875,039.06	
MYLAN NV	27,869	41.36	1,152,661.84	
NEKTAR THERAPEUTICS	8,800	54.14	476,432.00	
PERRIGO CO PLC	7,708	73.26	564,688.08	
PFIZER	330,890	36.67	12,133,736.30	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,502	308.10	1,387,066.20	
SEATTLE GENETICS INC	6,901	65.01	448,634.01	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	48,940	23.11	1,131,003.40	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,274	217.02	4,833,903.48	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,483	111.89	277,822.87	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,161	150.55	2,131,938.55	
WATERS CORP	4,630	205.32	950,631.60	
ZOETIS INC	27,561	86.78	2,391,743.58	
BANK OF AMERICA CORP	541,027	30.01	16,236,220.27	
BB&T CORP	43,145	54.60	2,355,717.00	
CIT GROUP INC	7,240	52.08	377,059.20	
CITIGROUP	142,837	68.47	9,780,049.39	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	26,986	41.98	1,132,872.28	
COMERICA INC	10,048	96.47	969,330.56	
EAST WEST BANCORP INC	8,210	72.66	596,538.60	
FIFTH THIRD BANCORP	39,666	31.81	1,261,775.46	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,201	103.38	951,199.38	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	57,546	15.69	902,896.74	
JPMORGAN CHASE & CO	190,733	111.11	21,192,343.63	
KEY CORP	62,427	20.54	1,282,250.58	
M & T BANK CORP	7,775	177.11	1,377,030.25	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,490	11.99	341,595.10	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,390	19.19	372,094.10	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,681	148.85	3,971,466.85	
REGIONS FINL CORP	64,404	19.11	1,230,760.44	
SIGNATURE BANK	2,827	130.64	369,319.28	

SUNTRUST BANKS	25,932	70.53	1,828,983.96	
SVB FINANCIAL GROUP	2,911	325.72	948,170.92	
US BANCORP	87,131	52.05	4,535,168.55	
WELLS FARGO & CO	260,060	55.68	14,480,140.80	
ZIONS BANCORPORATION	12,093	57.19	691,598.67	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,891	165.05	477,159.55	
ALLY FINANCIAL INC	26,496	26.63	705,588.48	
AMERICAN EXPRESS	40,594	101.00	4,099,994.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,072	142.63	1,151,309.36	
BANK NEW YORK CO	56,025	57.56	3,224,799.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,996	196.01	13,915,925.96	
BLACKROCK INC	6,740	549.41	3,703,023.40	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,179	96.97	2,635,547.63	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,914	103.95	614,760.30	
CME GROUP INC	19,049	170.97	3,256,807.53	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,627	75.38	1,479,483.26	
E*TRADE FINANCIAL CORP	14,690	65.41	960,872.90	
EATON VANCE CORP	6,907	56.45	389,900.15	
FRANKLIN RESOURCES INC	17,434	34.41	599,903.94	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,040	233.39	4,677,135.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	33,024	75.66	2,498,595.84	
INVESCO LTD	23,841	27.93	665,879.13	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	17,074	23.07	393,897.18	
MOODY'S CORP	9,859	179.21	1,766,831.39	
MORGAN STANLEY	74,600	51.91	3,872,486.00	
MSCI INC	5,300	166.29	881,337.00	
NASDAQ INC	6,910	95.13	657,348.30	
NORTHERN TRUST CORP	12,439	106.92	1,329,977.88	
PRICE T ROWE GROUP INC	12,925	125.98	1,628,291.50	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,691	100.60	773,714.60	
S&P GLOBAL INC	14,437	206.47	2,980,807.39	
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,354	57.73	3,888,346.42	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,077	66.75	539,139.75	
STATE STREET CORP	20,900	100.46	2,099,614.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	39,946	35.45	1,416,085.70	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,646	62.31	974,902.26	
VOYA FINANCIAL INC	9,470	53.59	507,497.30	
AFLAC	44,680	45.89	2,050,365.20	
ALLEGHANY CORP	782	591.69	462,701.58	
ALLSTATE CORP	20,475	93.71	1,918,712.25	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,742	111.63	417,719.46	
AMERICAN INT'L GROUP	50,665	55.12	2,792,654.80	

AON PLC	13,637	142.97	1,949,681.89	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,851	84.29	661,760.79	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,410	67.78	637,809.80	
ASSURANT INC	3,380	98.29	332,220.20	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	7,977	45.81	365,426.37	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,145	57.94	298,101.30	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,534	46.70	211,737.80	
CHUBB LTD	25,945	133.52	3,464,176.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,280	71.28	590,198.40	
EVEREST RE GROUP LTD	2,083	230.32	479,756.56	
FNF GROUP	15,560	37.87	589,257.20	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	19,674	53.26	1,047,837.24	
LINCOLN NATIONAL CORP	12,006	69.25	831,415.50	
LOEWS CORP	15,181	50.42	765,426.02	
MARKEL CORP	742	1,117.59	829,251.78	
MARSH & MCLENNAN COS	28,758	82.90	2,384,038.20	
METLIFE INC	50,700	47.41	2,403,687.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,287	56.80	868,301.60	
PROGRESSIVE CORP	33,027	62.84	2,075,416.68	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,014	100.55	2,414,607.70	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,350	151.68	508,128.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,393	127.64	305,442.52	
TORCHMARK CORP	5,657	86.24	487,859.68	
TRAVELERS COS INC/THE	15,423	131.32	2,025,348.36	
UNUM GROUP	12,274	39.35	482,981.90	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,908	158.13	1,092,362.04	
WR BERKLEY CORP	5,098	78.31	399,224.38	
XL GROUP LTD	14,226	56.30	800,923.80	
CBRE GROUP INC-A	17,345	48.59	842,793.55	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	61,800	7.32	452,376.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,230	170.77	380,817.10	
WEYERHAEUSER CO	40,479	38.11	1,542,654.69	
ACCENTURE PLC-CL A	34,459	162.17	5,588,216.03	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,039	74.29	2,974,497.31	
ADOBE SYSTEMS INC	27,482	251.21	6,903,753.22	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	9,160	78.48	718,876.80	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,578	222.38	573,295.64	
ALPHABET INC-CL A	16,596	1,132.71	18,798,455.16	
ALPHABET INC-CL C	17,506	1,120.87	19,621,950.22	
ANSYS INC	4,986	172.23	858,738.78	
AUTODESK INC	12,046	135.13	1,627,775.98	
AUTOMATIC DATA PROCESS	24,923	135.35	3,373,328.05	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,994	119.40	715,683.60	
CA INC	18,870	36.28	684,603.60	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,121	44.07	666,382.47	
CDK GLOBAL INC	6,693	64.99	434,978.07	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,045	99.10	698,159.50	
CITRIX SYSTEMS INC	8,265	107.94	892,124.10	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,194	77.11	2,559,589.34	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	11,892	88.33	1,050,420.36	
DXC TECHNOLOGY CO	16,278	85.54	1,392,420.12	
EBAY	53,269	40.29	2,146,208.01	
ELECTRONIC ARTS INC	17,398	137.87	2,398,662.26	
FACEBOOK INC-A	133,119	189.10	25,172,802.90	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	18,880	106.14	2,003,923.20	
FIRST DATA CORP- CLASS A	28,193	20.05	565,269.65	
FISERV INC	24,008	75.47	1,811,883.76	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,920	202.50	996,300.00	
FORTINET INC	8,520	62.53	532,755.60	
GARTNER INC	5,564	137.73	766,329.72	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,140	117.08	953,031.20	
GODADDY INC - CLASS A	8,000	72.64	581,120.00	
IAC/INTERACTIVECORP	4,525	157.17	711,194.25	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,028	146.14	7,457,231.92	
INTUIT INC	13,662	206.26	2,817,924.12	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,919	129.65	508,098.35	
LEIDOS HOLDINGS	8,457	61.29	518,329.53	
MASTERCARD INC-CLASS A	51,884	200.04	10,378,875.36	
MERCADOLIBRE INC	2,285	288.80	659,908.00	
MICROSOFT CORP	406,540	101.63	41,316,660.20	
ORACLE CORP	172,522	48.18	8,312,109.96	
PAYCHEX INC	17,458	68.17	1,190,111.86	
PAYPAL HOLDINGS INC	63,716	84.34	5,373,807.44	
RED HAT INC	9,562	171.06	1,635,675.72	
SABRE CORP	10,169	25.53	259,614.57	
SALESFORCE.COM INC	38,012	133.53	5,075,742.36	
SERVICENOW INC	9,765	178.19	1,740,025.35	
SPLUNK INC	8,153	116.75	951,862.75	
SQUARE INC - A	15,395	61.78	951,103.10	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,735	51.68	554,784.80	
SYMANTEC CORP	35,613	21.32	759,269.16	
SYNOPSYS INC	8,003	90.51	724,351.53	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	6,294	113.42	713,865.48	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	8,723	87.14	760,122.22	

TWITTER INC	36,777	41.21	1,515,580.17	
VERISIGN INC	4,957	137.87	683,421.59	
VISA INC-CLASS A SHARES	100,206	134.74	13,501,756.44	
VMWARE INC-CLASS A	4,340	149.64	649,437.60	
WESTERN UNION CO	25,608	20.81	532,902.48	
WORKDAY INC-CLASS A	7,773	123.90	963,074.70	
WORLDPAY INC-CLASS A	16,772	82.07	1,376,478.04	
ZILLOW GROUP INC-C	6,531	62.43	407,730.33	
AMPHENOL CORPORATION	17,336	90.91	1,576,015.76	
APPLE INC	282,074	191.70	54,073,585.80	
ARISTA NETWORKS INC	2,795	273.75	765,131.25	
ARROW ELECTRONICS INC	4,954	77.74	385,123.96	
AVNET INC	6,677	39.58	264,275.66	
CDW CORP/DE	8,508	84.71	720,712.68	
CISCO SYSTEMS	267,778	43.48	11,642,987.44	
COGNEX CORP	10,630	47.52	505,137.60	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	9,775	29.80	291,295.00	
CORNING	47,398	28.75	1,362,692.50	
F5 NETWORKS INC	3,273	176.80	578,666.40	
FLEX LTD	27,142	14.07	381,887.94	
FLIR SYSTEMS INC	6,707	55.06	369,287.42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	87,362	16.01	1,398,665.62	
HP INC	90,714	23.71	2,150,828.94	
IPG PHOTONICS CORP	2,326	248.95	579,057.70	
JUNIPER NETWORKS INC	20,221	27.92	564,570.32	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	10,000	60.99	609,900.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,762	112.30	983,972.60	
NETAPP INC	15,904	74.35	1,182,462.40	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,071	199.33	1,010,802.43	
SEAGATE TECHNOLOGY	15,615	55.98	874,127.70	
TE CONNECTIVITY LTD	19,966	97.25	1,941,693.50	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,193	34.52	455,422.36	
WESTERN DIGITAL CORP	16,996	82.62	1,404,209.52	
XEROX CORP	11,291	27.91	315,131.81	
AT&T INC	341,905	33.83	11,566,646.15	
CENTURYLINK INC	52,180	17.65	920,977.00	
SPRINT CORP	39,898	5.17	206,272.66	
T-MOBILE US INC	18,524	57.80	1,070,687.20	
VERIZON COMMUNICATIONS	229,073	49.18	11,265,810.14	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	36.29	361,085.50	
AES CORP	33,217	12.77	424,181.09	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	11,999	39.23	470,720.77	

AMEREN CORPORATION	12,859	56.69	728,976.71	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,922	64.11	1,790,079.42	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,437	79.28	748,165.36	
ATMOS ENERGY CORP	5,476	85.31	467,157.56	
CENTERPOINT ENERGY INC	21,644	25.35	548,675.40	
CMS ENERGY CORP	14,825	43.35	642,663.75	
CONSOLIDATED EDISON INC	17,825	72.75	1,296,768.75	
DOMINION ENERGY INC	36,096	62.60	2,259,609.60	
DTE ENERGY COMPANY	9,536	96.97	924,705.92	
DUKE ENERGY CORP	39,255	73.12	2,870,325.60	
EDISON INTL	17,612	59.61	1,049,851.32	
ENTERGY CORP	9,495	76.89	730,070.55	
EVERGY INC	9,017	51.32	462,752.44	
EVERSOURCE ENERGY	18,271	53.56	978,594.76	
EXELON CORP	54,237	40.00	2,169,480.00	
FIRSTENERGY CORP	26,542	33.32	884,379.44	
NEXTERA ENERGY INC	26,118	156.80	4,095,302.40	
NISOURCE INC	16,007	23.52	376,484.64	
OGE ENERGY CORP	11,648	33.75	393,120.00	
PG&E CORP	29,434	41.45	1,220,039.30	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,873	74.40	436,951.20	
PPL CORPORATION	37,024	25.79	954,848.96	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	27,232	50.89	1,385,836.48	
SCANA CORP	6,890	36.15	249,073.50	
SEMPRA ENERGY	12,833	101.43	1,301,651.19	
SOUTHERN CO	56,238	43.28	2,433,980.64	
UGI CORP	8,757	48.81	427,429.17	
VISTRA ENERGY CORP	18,076	24.56	443,946.56	
WEC ENERGY GROUP INC	18,160	59.46	1,079,793.60	
XCEL ENERGY INC	27,390	42.69	1,169,279.10	
ADVANCED MICRO DEVICES	49,000	15.25	747,250.00	
ANALOG DEVICES	20,718	101.06	2,093,761.08	
APPLIED MATERIALS	59,670	51.15	3,052,120.50	
BROADCOM INC	22,671	257.97	5,848,437.87	
INTEL CORP	260,170	55.05	14,322,358.50	
KLA-TENCOR CORP	8,294	114.20	947,174.80	
LAM RESEARCH CORP	9,282	188.03	1,745,294.46	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,854	21.75	540,574.50	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,006	60.75	911,614.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,396	102.15	1,368,401.40	
MICRON TECHNOLOGY	64,187	61.39	3,940,439.93	
NVIDIA CORP	31,990	262.28	8,390,337.20	

	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,549	120.17	2,349,203.33	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	23,000	25.20	579,600.00	
	QORVO INC	6,735	80.16	539,877.60	
	QUALCOMM	82,284	60.26	4,958,433.84	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,942	99.81	992,311.02	
	TEXAS INSTRUMENTS	55,198	115.74	6,388,616.52	
	XILINX INC	14,418	69.54	1,002,627.72	
アメリカドル 小計		17,031,884		1,351,986,448.32 (147,920,837,310)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,078	25.01	202,030.78	
	ARC RESOURCES LTD	20,535	12.80	262,848.00	
	CAMECO CORP	19,186	15.13	290,284.18	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	66,035	43.66	2,883,088.10	
	CENOVUS ENERGY INC	52,049	13.00	676,637.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,742	9.96	266,350.32	
	ENBRIDGE	92,746	40.55	3,760,850.30	
	ENCANA CORP	56,719	16.07	911,474.33	
	HUSKY ENERGY INC	18,846	19.42	365,989.32	
	IMPERIAL OIL	15,145	42.47	643,208.15	
	INTER PIPELINE LTD	20,287	24.81	503,320.47	
	KEYERA CORP	11,025	36.46	401,971.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	29,200	44.81	1,308,452.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	26.51	257,226.53	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	15,297	15.00	229,455.00	
	SUNCOR ENERGY	93,488	52.73	4,929,622.24	
	TOURMALINE OIL CORP	12,981	24.45	317,385.45	
	TRANSCANADA CORP	50,840	54.11	2,750,952.40	
	VERMILION ENERGY INC	6,153	45.70	281,192.10	
	AGNICO EAGLE MINES	14,064	57.54	809,242.56	
	BARRICK GOLD CORP	61,196	16.87	1,032,376.52	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,850	64.46	506,011.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,925	21.83	893,392.75	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,847	91.47	992,175.09	
	GOLDCORP INC	52,063	18.33	954,314.79	
	KINROSS GOLD CORP	60,197	4.64	279,314.08	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	8.75	264,013.75	
	METHANEX CORP	4,891	91.88	449,385.08	
	NUTRIEN LTD	35,312	68.09	2,404,394.08	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	27,209	38.20	1,039,383.80	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	3.66	177,667.38	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,615	96.00	443,040.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22,516	28.69	645,984.04	

BOMBARDIER B	104,404	4.88	509,491.52	
CAE INC	14,339	27.61	395,899.79	
FINNING INTERNATIONAL INC	11,028	34.25	377,709.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	58.50	513,337.50	
WSP GLOBAL INC	5,400	73.28	395,712.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	41,001	107.88	4,423,187.88	
CP RAILWAY LIMITED	8,056	248.83	2,004,574.48	
LINAMAR CORP	2,700	65.09	175,743.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,255	85.47	1,731,194.85	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14,500	37.43	542,735.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,328	76.55	1,020,258.40	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	28,809	26.98	777,266.82	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,390	166.28	563,689.20	
DOLLARAMA INC	5,699	151.19	861,631.81	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	24,116	53.89	1,299,611.24	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	24.18	177,239.40	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,468	65.37	749,663.16	
METRO INC	11,606	42.71	495,692.26	
WESTON (GEORGE) LTD	2,481	103.51	256,808.31	
SAPUTO INC	10,742	41.80	449,015.60	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	20,744	33.38	692,434.72	
BANK MONTREAL	36,697	102.17	3,749,332.49	
BANK NOVA SCOTIA	67,514	76.36	5,155,369.04	
CANADIAN IMPERIAL BANK	24,823	115.25	2,860,850.75	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,768	63.08	1,246,965.44	
ROYAL BANK OF CANADA	80,105	99.89	8,001,688.45	
TORONTO-DOMINION BANK	103,491	75.20	7,782,523.20	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	45,887	53.40	2,450,365.80	
CI FINANCIAL CORP	16,457	25.11	413,235.27	
IGM FINANCIAL INC	3,890	39.48	153,577.20	
ONEX CORP	4,702	94.19	442,881.38	
THOMSON REUTERS CORP	14,949	52.74	788,410.26	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,602	742.14	1,188,908.28	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,947	33.45	499,977.15	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	7,229	53.31	385,377.99	
INTACT FINANCIAL CORP	8,533	95.41	814,133.53	
MANULIFE FINANCIAL CORP	109,402	24.74	2,706,605.48	
POWER CORP OF CANADA	17,809	30.48	542,818.32	
POWER FINANCIAL CORP	12,518	32.61	408,211.98	
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,859	55.03	1,863,260.77	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	21.12	147,840.00	
BLACKBERRY LIMITED	25,075	15.66	392,674.50	

	CGI GROUP INC - CL A	13,915	80.60	1,121,549.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,159	1,034.33	1,198,788.47	
	OPEN TEXT CORP	14,330	46.16	661,472.80	
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,902	210.68	1,032,753.36	
	BCE INC	7,663	54.78	419,779.14	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,189	61.51	1,303,335.39	
	TELUS CORP	11,560	45.75	528,870.00	
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	39.01	170,551.72	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	31.32	187,230.96	
	EMERA INC	1,710	40.15	68,656.50	
	FORTIS INC	24,474	40.76	997,560.24	
	HYDRO ONE LTD	14,740	19.57	288,461.80	
カナダドル 小計		2,197,876		100,519,945.69 (8,486,899,014)	
ユーロ	ENAGAS	11,653	23.85	277,924.05	
	ENI	143,570	15.22	2,185,709.68	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,347	16.08	488,131.49	
	NESTE OIL OYJ	7,752	70.88	549,461.76	
	OMV AG	8,029	50.76	407,552.04	
	REPSOL SA	69,000	17.03	1,175,415.00	
	SNAM SPA	117,058	3.45	404,552.44	
	TENARIS SA	24,795	15.56	385,810.20	
	TOTAL SA	134,629	53.10	7,148,799.90	
	VOPAK	3,661	42.06	153,981.66	
	AIR LIQUIDE	23,736	109.50	2,599,092.00	
	AKZO NOBEL	13,655	75.98	1,037,506.90	
	ARCELORMITTAL	36,249	28.04	1,016,603.20	
	ARKEMA	3,446	103.30	355,971.80	
	BASF SE	51,415	85.88	4,415,520.20	
	COVESTRO AG	10,086	78.12	787,918.32	
	CRH PLC	43,853	32.11	1,408,119.83	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,342	30.42	314,603.64	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	45.16	146,589.36	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,668	78.52	680,611.36	
	IMERYS SA	2,111	72.35	152,730.85	
	K+S AG	11,391	22.71	258,689.61	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,475	88.60	928,085.00	
	LANXESS	5,764	69.18	398,753.52	
	LINDE AG - TENDER	10,484	196.85	2,063,775.40	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,350	33.70	348,795.00	
	SOLVAY SA	4,422	114.10	504,550.20	
	STORA ENSO OYJ R	28,950	18.07	523,271.25	

SYMRISE AG	6,301	70.70	445,480.70	
THYSSEN KRUPP	24,540	23.36	573,254.40	
UMICORE	12,401	49.65	615,709.65	
UPM KYMMENE OYJ	29,434	32.08	944,242.72	
VOESTALPINE AG	5,948	45.81	272,477.88	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,861	36.70	545,398.70	
AIRBUS SE	33,261	100.90	3,356,034.90	
ALSTOM	8,179	41.00	335,339.00	
ANDRITZ AG	3,617	42.52	153,794.84	
BOUYGUES ORD	11,310	39.18	443,125.80	
BRENNTAG AG	7,892	50.12	395,547.04	
CNH INDUSTRIAL NV	53,801	9.71	522,407.71	
DASSAULT AVIATION SA	121	1,687.00	204,127.00	
EIFFAGE	3,707	96.16	356,465.12	
FERROVIAL SA	25,885	18.30	473,824.92	
GEA GROUP AG	11,373	32.04	364,390.92	
HOCHTIEF AG	1,172	156.80	183,769.60	
KION GROUP AG	3,430	70.54	241,952.20	
KONE OYJ-B	20,649	44.24	913,511.76	
LEGRAND SA	14,055	63.84	897,271.20	
LEONARDO SPA	22,011	8.63	190,131.01	
MAN SE	1,966	94.25	185,295.50	
METSO OYJ	6,409	30.22	193,679.98	
MTU AERO ENGINES AG	3,209	161.70	518,895.30	
OSRAM LICHT AG	5,768	51.70	298,205.60	
PRYSMIAN SPA	11,275	24.16	272,404.00	
REXEL SA	17,749	12.68	225,057.32	
SAFRAN SA	18,753	102.55	1,923,120.15	
SAINT-GOBAIN	28,009	42.50	1,190,382.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,416	73.60	2,312,217.60	
SIEMENS	42,953	113.80	4,888,051.40	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	12.97	159,816.34	
THALES SA	5,447	110.35	601,076.45	
VINCI S.A.	27,970	84.32	2,358,430.40	
WARTSILA OYJ	23,400	18.19	425,763.00	
BUREAU VERITAS SA	13,374	21.67	289,814.58	
EDENRED	12,153	25.89	314,641.17	
RANDSTAD NV	6,192	52.16	322,974.72	
RELX NV	52,492	18.87	990,524.04	
SOCIETE BIC SA	1,751	80.50	140,955.50	
TELEPERFORMANCE	3,445	137.30	472,998.50	
WOLTERS KLUWER	15,914	47.94	762,917.16	

ADP	1,532	176.00	269,632.00	
AENA SME SA	4,235	159.00	673,365.00	
ATLANTIA SPA	26,561	23.58	626,308.38	
BOLLORE	52,200	4.15	216,734.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,445	22.99	332,090.55	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,775	31.17	1,707,336.75	
FRAPORT AG	1,934	79.56	153,869.04	
GETLINK	26,998	11.71	316,146.58	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	32,810	7.87	258,214.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,877	85.64	1,616,626.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	74.60	234,318.60	
CONTINENTAL AG	5,971	221.90	1,324,964.90	
DAIMLER AG	50,071	61.96	3,102,399.16	
FAURECIA	3,558	72.62	258,381.96	
FERRARI NV	6,958	115.30	802,257.40	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,425	17.96	1,067,273.00	
MICHELIN	9,513	116.45	1,107,788.85	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	35.15	216,418.55	
PEUGEOT SA	32,780	20.60	675,268.00	
PIRELLI & C SPA	20,549	7.27	149,514.52	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,108	61.88	563,603.04	
RENAULT SA	10,529	83.50	879,171.50	
SCHAEFFLER AG	8,942	13.25	118,481.50	
VALEO SA	12,585	54.02	679,841.70	
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,498	159.40	1,673,381.20	
VOLKSWAGEN STAMM	1,924	160.80	309,379.20	
ADIDAS AG	10,627	199.35	2,118,492.45	
HERMES INTERNATIONAL	1,744	563.20	982,220.80	
HUGO BOSS AG	3,285	78.36	257,412.60	
KERING	4,194	505.40	2,119,647.60	
LUXOTTICA GROUP SPA	8,719	53.50	466,466.50	
LVMH	15,481	300.35	4,649,718.35	
MONCLER SPA	9,633	39.75	382,911.75	
PUMA AG	349	494.50	172,580.50	
SEB SA	1,716	155.70	267,181.20	
ACCOR	9,765	43.40	423,801.00	
PADDY POWER PLC	4,606	98.35	453,000.10	
SODEXO	4,814	81.32	391,474.48	
AXEL SPRINGER SE	3,235	61.00	197,335.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	17.33	150,381.12	
JC DECAUX SA	3,750	26.66	99,975.00	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	11,988	24.85	297,901.80	

PUBLICIS GROUPE	11,404	56.74	647,062.96	
RTL GROUP	2,176	65.05	141,548.80	
SES	18,856	15.60	294,153.60	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	41.82	118,392.42	
VIVENDI	57,385	21.48	1,232,629.80	
INDITEX	64,111	28.29	1,813,700.19	
ZALANDO SE	7,250	46.03	333,717.50	
CARREFOUR	32,231	14.96	482,336.91	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	32.82	108,240.36	
COLRUYT SA	3,653	45.48	166,138.44	
JERONIMO MARTINS	13,062	13.33	174,181.77	
KONINKLIJKE AHOLD NV	67,761	19.92	1,349,934.64	
METRO AG	8,880	11.32	100,521.60	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	42,767	80.10	3,425,636.70	
DANONE (GROUPE)	33,451	64.31	2,151,233.81	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	6.44	171,746.36	
HEINEKEN HOLDING NV	6,086	83.00	505,138.00	
HEINEKEN NV	14,057	85.42	1,200,748.94	
KERRY GROUP PLC-A	8,164	90.25	736,801.00	
PERNOD-RICARD	11,752	141.10	1,658,207.20	
REMY COINTREAU	1,020	122.90	125,358.00	
BEIERSDORF AG	6,452	98.00	632,296.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,864	96.40	565,289.60	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,760	107.30	1,047,248.00	
LOREAL	14,004	206.10	2,886,224.40	
UNILEVER NV-CVA	85,215	47.42	4,040,895.30	
BIOMERIEUX	1,835	76.80	140,928.00	
ESSILOR INTERNATIONAL	11,526	117.25	1,351,423.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,428	86.68	1,077,259.04	
FRESENIUS SE&CO KGAA	22,538	67.76	1,527,174.88	
KONINKLIJKE PHILIPS	53,240	36.00	1,916,906.20	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,900	122.20	232,180.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,600	35.20	302,720.00	
BAYER	46,456	98.44	4,573,128.64	
BAYER AG-RTS	46,456	1.49	69,591.08	
EUROFINS SCIENTIFIC	774	422.60	327,092.40	
GRIFOLS SA	15,514	26.91	417,481.74	
IPSEN	1,866	133.45	249,017.70	
MERCK KGAA	8,141	84.52	688,077.32	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	26.35	142,105.55	
QIAGEN N.V.	11,006	31.02	341,406.12	
RECORDATI SPA	5,195	32.55	169,097.25	

SANOFI	63,060	66.43	4,189,075.80	
UCB (GROUPE)	6,519	66.16	431,297.04	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	25,191	23.04	580,400.64	
AIB GROUP PLC	37,786	4.89	184,773.54	
BANCO BILBAO VIZCAYA	375,267	6.07	2,280,872.82	
BANCO DE SABADELL SA	278,761	1.46	406,991.06	
BANCO SANTANDER SA	906,473	4.69	4,257,250.44	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	7.22	337,823.80	
BANKIA SA	88,049	3.35	295,228.29	
BANKINTER SA	34,589	8.43	291,723.62	
BNP PARIBAS	62,270	53.70	3,343,899.00	
CAIXABANK	199,348	3.84	766,493.06	
COMMERZBANK AG	62,846	9.32	585,976.10	
CREDIT AGRICOLE SA	63,198	11.89	751,424.22	
ERSTE GROUP BANK AG	17,861	36.10	644,782.10	
ING GROEP NV-CVA	219,085	12.66	2,774,054.27	
INTESA SANPAOLO	758,865	2.42	1,840,247.62	
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.51	111,751.34	
KBC GROEP NV	13,885	66.48	923,074.80	
MEDIOBANCA	29,447	7.82	230,511.11	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	27.43	215,764.38	
SOCIETE GENERALE	42,844	37.23	1,595,082.12	
UNICREDIT SPA	113,027	13.60	1,537,167.20	
AMUNDI SA	2,812	64.22	180,586.64	
DEUTSCHE BANK NAMEN	112,037	9.55	1,070,401.49	
DEUTSCHE BOERSE	11,116	117.45	1,305,574.20	
EURAZEO SA	2,229	65.45	145,888.05	
EXOR NV	6,186	58.90	364,355.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,009	91.36	457,622.24	
NATIXIS	50,808	6.28	319,074.24	
WENDEL	1,767	116.20	205,325.40	
AEGON	93,189	5.37	500,611.30	
AGEAS	9,709	43.63	423,603.67	
ALLIANZ SE-REG	24,306	178.58	4,340,565.48	
ASSICURAZIONI GENERALI	72,240	14.17	1,023,640.80	
AXA	107,552	21.80	2,344,633.60	
CNP ASSURANCES	8,406	19.61	164,841.66	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	109.40	334,545.20	
MAPFRE SA	56,454	2.60	146,949.76	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	8,877	178.85	1,587,651.45	
NN GROUP NV	18,100	36.51	660,831.00	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	7.08	182,604.26	

SAMPO OYJ-A SHS	24,654	41.88	1,032,509.52	
SCOR SE	9,111	31.79	289,638.69	
DEUTSCHE WOHNEN SE	20,887	40.50	845,923.50	
VONOVIA SE	28,177	40.65	1,145,395.05	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	23,879	70.32	1,679,171.28	
ATOS SE	5,204	118.10	614,592.40	
CAPGEMINI SA	8,567	113.20	969,784.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,192	119.25	857,646.00	
DELIVERY HERO AG	4,800	41.12	197,376.00	
SAP SE	55,054	100.44	5,529,623.76	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,479	95.62	332,661.98	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,625	55.06	419,832.50	
WIRECARD AG	6,970	142.00	989,740.00	
INGENICO GROUP	3,351	70.98	237,853.98	
NOKIA OYJ	319,120	4.93	1,573,580.72	
1&1 DRILLISCH AG	2,406	60.05	144,480.30	
DEUTSCHE TELEKOM	187,505	13.33	2,500,379.17	
ELISA A	7,434	38.97	289,702.98	
ILIAD SA	1,337	147.70	197,474.90	
KPN (KON.)	179,463	2.38	428,737.10	
ORANGE	110,387	14.67	1,619,929.22	
PROXIMUS	7,531	22.47	169,221.57	
TELECOM ITALIA ORD	601,141	0.67	404,086.98	
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.59	204,844.05	
TELEFONICA	256,569	7.58	1,945,306.15	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	3.62	148,268.13	
E.ON SE	127,680	8.86	1,132,266.24	
ELECTRICITE DE FRANCE	31,965	11.12	355,450.80	
ENDESA	16,465	19.01	313,081.97	
ENEL	457,804	4.59	2,103,151.57	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	125,070	3.37	422,236.32	
ENGIE	98,950	13.50	1,335,825.00	
FORTUM OYJ	23,370	20.20	472,074.00	
GAS NATURAL SDG SA	18,170	21.01	381,751.70	
IBERDROLA SA	328,582	6.35	2,087,810.02	
INNOGY SE	6,865	36.40	249,886.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	22,517	17.51	394,272.67	
RWE STAMM	31,894	18.90	602,796.60	
SUEZ	17,194	11.43	196,613.39	
TERNA SPA	88,647	4.44	393,769.97	
UNIPER SE	12,950	25.60	331,520.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	19.09	474,405.59	

	ASML HOLDING NV	22,455	175.65	3,944,220.75	
	INFINEON TECHNOLOGIES	61,890	24.73	1,530,539.70	
	STMICROELECTRONICS	40,389	21.04	849,784.56	
ユーロ 小計		10,837,495		221,466,430.06 (28,582,457,463)	
イギリスポンド	BP PLC	1,100,464	5.83	6,424,508.83	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	254,858	26.06	6,642,873.77	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	208,707	27.00	5,635,089.00	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	33,000	6.44	212,586.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	63,378	18.49	1,172,112.73	
	ANTOFAGASTA PLC	21,571	10.98	236,957.43	
	BHP BILLTTON PLC	118,824	17.63	2,095,580.06	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,806	48.30	377,029.80	
	FRESNILLO PLC	10,869	12.16	132,167.04	
	GLENCORE PLC	664,526	3.83	2,550,783.05	
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,810	37.88	371,602.80	
	MONDI PLC	18,808	20.97	394,403.76	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	6,478	58.30	377,667.40	
	RIO TINTO PLC REG	69,186	44.20	3,058,021.20	
	ASHTEAD GROUP PLC	28,731	23.75	682,361.25	
	BAE SYSTEMS PLC	178,641	6.48	1,157,950.96	
	BUNZL PLC	17,241	22.72	391,715.52	
	DCC PLC	4,508	72.05	324,801.40	
	FERGUSON PLC	13,930	58.94	821,034.20	
	MEGGITT PLC	43,669	4.98	217,602.62	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	234,090	2.37	554,793.30	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	93,200	8.35	778,592.80	
	SMITHS GROUP PLC	20,046	17.84	357,720.87	
	TRAVIS PERKINS PLC	15,153	14.14	214,339.18	
	WEIR GROUP PLC/THE	12,587	22.00	276,914.00	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	8.54	126,498.47	
	EXPERIAN PLC	51,031	18.83	960,913.73	
	G4S PLC	77,964	2.75	214,946.74	
	INTERTEK GROUP PLC	9,425	57.14	538,544.50	
	RELX PLC	59,947	16.73	1,003,213.04	
	EASYJET PLC	9,909	17.13	169,790.71	
	ROYAL MAIL PLC	44,164	4.82	213,002.97	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.86	298,731.08	
	BURBERRY GROUP PLC	22,630	21.14	478,398.20	
	PERSIMMON PLC	15,742	28.80	453,369.60	
	TAYLOR WIMPAY PLC	166,048	1.91	317,234.70	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	43.21	283,025.50	

CARNIVAL PLC	9,818	45.20	443,773.60	
COMPASS GROUP PLC	89,514	15.79	1,413,426.06	
GVC HOLDINGS PLC	30,400	10.55	320,720.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,227	49.15	502,657.05	
MERLIN ENTERTAINME	43,424	3.82	166,270.49	
TUI AG-DI	25,058	17.34	434,505.72	
WHITBREAD PLC	9,381	41.45	388,842.45	
ITV PLC	185,979	1.69	314,583.47	
PEARSON	41,558	8.82	366,874.02	
SKY PLC	59,062	13.40	791,430.80	
WPP PLC	69,453	12.16	844,548.48	
KINGFISHER PLC	114,680	3.01	345,645.52	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	2.90	238,870.10	
NEXT PLC	8,359	60.54	506,053.86	
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.46	275,428.86	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	3.04	249,990.86	
TESCO	507,149	2.47	1,257,222.37	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,423	27.40	504,790.20	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	127,757	36.56	4,670,795.92	
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,565	26.00	248,690.00	
DIAGEO	140,464	27.24	3,826,239.36	
IMPERIAL BRANDS PLC	53,653	25.84	1,386,661.78	
RECKITT BENCKISER PLC	37,394	58.74	2,196,523.56	
UNILEVER PLC	70,451	41.15	2,899,410.90	
CONVATEC GROUP PLC	57,895	2.26	131,016.38	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	21,500	5.50	118,422.00	
NMC HEALTH PLC	4,750	34.34	163,115.00	
SMITH & NEPHEW PLC	50,322	13.60	684,379.20	
ASTRAZENECA	70,596	53.53	3,779,003.88	
GLAXOSMITHKLINE	275,161	15.28	4,204,460.08	
SHIRE PLC	52,700	39.98	2,106,946.00	
BARCLAYS	957,989	1.99	1,906,398.11	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,118,989	7.29	8,167,500.71	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,032,760	0.62	2,536,606.04	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.67	550,619.11	
STANDARD CHARTERED PLC	167,157	7.26	1,214,562.76	
3I GROUP PLC	56,101	9.67	542,721.07	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,303	19.62	300,244.86	
INVESTEC PLC	32,355	5.52	178,664.31	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,870	45.04	804,864.80	
SCHRODERS PLC	7,525	32.53	244,788.25	
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.93	318,865.04	

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	142,821	3.51	501,301.71	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	19.02	187,814.80	
	AVIVA PIC	218,859	5.06	1,108,739.69	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.47	239,484.64	
	LEGAL & GENERAL GROUP	337,768	2.70	912,649.13	
	OLD MUTUAL PLC	281,685	2.22	626,467.44	
	PRUDENTIAL	144,262	18.36	2,648,650.32	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	6.43	332,592.76	
	AUTO TRADER GROUP PLC	60,396	4.17	251,851.32	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	23,405	13.36	312,690.80	
	SAGE GROUP PLC	55,165	6.71	370,157.15	
	BT GROUP PLC	457,520	2.04	937,687.24	
	VODAFONE GROUP PLC	1,493,552	1.87	2,800,111.28	
	CENTRICA PLC	286,017	1.45	416,154.73	
	NATIONAL GRID PLC	191,332	8.28	1,585,185.62	
	SEVERN TRENT PLC	11,927	19.37	231,025.99	
	SSE PLC	58,154	13.42	780,717.45	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	7.79	270,507.07	
イギリスポンド 小計		16,816,770		107,577,800.38 (15,785,966,427)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	14,239	24.70	351,703.30	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	644.50	262,956.00	
	GIVAUDAN-REG	507	2,203.00	1,116,921.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	24,798	51.86	1,286,024.28	
	SIKA AG-BR	125	8,240.00	1,030,000.00	
	ABB LTD	103,904	22.66	2,354,464.64	
	GEBERIT AG-REG	2,149	439.00	943,411.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,159	214.00	248,026.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,118	220.00	465,960.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	8,484	59.74	506,834.16	
	SGS SA	286	2,611.00	746,746.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,765	152.35	421,247.75	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	29,560	92.26	2,727,205.60	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,792	492.50	882,560.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	89.40	268,557.60	
	DUFRY AG-REG	1,811	136.85	247,835.35	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,764.00	227,556.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	75,400.00	377,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	6,270.00	351,120.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	173,575	73.46	12,750,819.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	173.55	463,725.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	637	691.50	440,485.50	

	LONZA GROUP AG-REG	4,326	268.00	1,159,368.00	
	NOVARTIS	124,263	73.86	9,178,065.18	
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,272	207.70	8,156,794.40	
	VIFOR PHARMA AG	3,035	157.50	478,012.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	136,960	15.18	2,079,737.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,064	59.18	773,127.52	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	88.60	202,805.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,038	730.50	758,259.00	
	UBS GROUP AG	206,375	15.19	3,135,868.12	
	BALOISE HOLDING AG	2,548	147.00	374,556.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,081	342.30	712,326.30	
	SWISS RE LTD	17,876	87.06	1,556,284.56	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,534	294.70	2,514,969.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	91.65	331,956.30	
	TEMENOS AG	3,200	146.00	467,200.00	
	SWISSCOM	1,539	442.30	680,699.70	
スイスフラン 小計		944,205		61,031,189.66 (6,779,954,859)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	278.80	2,578,900.00	
	BOLIDEN AB	16,893	314.05	5,305,246.65	
	ALFA LAVAL AB	18,213	224.10	4,081,533.30	
	ASSA ABLOY AB-B	55,667	189.00	10,521,063.00	
	ATLAS COPCO A	36,849	353.60	13,029,806.40	
	ATLAS COPCO B	23,119	319.45	7,385,364.55	
	SANDVIK AB	64,789	154.85	10,032,576.65	
	SKANSKA B	17,528	159.55	2,796,592.40	
	SKF AB-B	23,501	171.20	4,023,371.20	
	VOLVO B	85,429	148.90	12,720,378.10	
	SECURITAS B	20,175	142.65	2,877,963.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	14,772	215.80	3,187,797.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	88.02	1,922,444.82	
	HENNES & MAURITZ B	55,058	134.60	7,410,806.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,386	270.70	1,457,990.20	
	SWEDISH MATCH AB	11,216	425.30	4,770,164.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	37,299	217.00	8,093,883.00	
	NORDEA BANK AB	165,566	84.54	13,996,949.64	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	87,747	80.26	7,042,574.22	
	SVENSKA HANDELSBK A	84,950	97.30	8,265,635.00	
	SWEDBANK AB-A	50,209	186.95	9,386,572.55	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	184.15	1,589,398.65	
	INVESTOR AB-B SHS	25,351	366.10	9,281,001.10	
	KINNEVIK AB - B	14,484	304.60	4,411,826.40	

	LUNDBERGS AB-B SHS	5,520	285.20	1,574,304.00	
	ERICSSON (LM) B	178,077	63.42	11,293,643.34	
	HEXAGON AB-B SHS	15,175	525.60	7,975,980.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,878	554.00	2,148,412.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,919	110.80	2,096,225.20	
	TELIA CO AB	165,559	42.33	7,008,112.47	
スウェーデンクローナ 小計		1,341,051		188,266,517.79 (2,366,510,128)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,500	296.60	1,631,300.00	
	EQUINOR ASA	66,270	216.70	14,360,709.00	
	NORSK HYDRO	80,998	53.72	4,351,212.56	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,904	358.00	3,903,632.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	240.50	1,131,793.00	
	MARINE HARVEST	25,848	168.65	4,359,265.20	
	ORKLA	48,425	74.30	3,597,977.50	
	DNB ASA	56,830	154.30	8,768,869.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	127.20	1,418,661.60	
	TELENOR ASA	44,068	171.60	7,562,068.80	
ノルウェークローネ 小計		354,702		51,085,488.66 (693,230,081)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,228	640.00	3,345,920.00	
	NOVOZYMES A/S	12,241	326.00	3,990,566.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	12,552	407.60	5,116,195.20	
	ISS A/S	8,803	222.40	1,957,787.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	8,990.00	1,789,010.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	348	9,588.00	3,336,624.00	
	DSV A/S	10,005	531.00	5,312,655.00	
	PANDORA A/S	6,365	502.40	3,197,776.00	
	CARLSBERG AS-B	6,298	720.20	4,535,819.60	
	COLOPLAST-B	6,257	630.00	3,941,910.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	8,166	241.80	1,974,538.80	
	GENMAB A/S	3,049	952.00	2,902,648.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	450.90	1,644,432.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	98,046	285.55	27,997,035.30	
	DANSKE BANK A/S	41,094	213.40	8,769,459.60	
	TRYG A/S	5,192	148.40	770,492.80	
	ORSTED A/S	11,238	371.90	4,179,412.20	
デンマーククローネ 小計		238,728		84,762,282.00 (1,468,082,724)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	29.35	376,296.35	
	OIL SEARCH LTD	68,668	8.38	575,437.84	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	92,410	9.94	918,555.40	

SANTOS	118,020	5.89	695,137.80	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,345	33.48	1,618,590.60	
ALUMINA LIMITED	135,453	2.73	369,786.69	
AMCOR	68,120	13.91	947,549.20	
BHP BILLITON LTD	180,279	34.07	6,142,105.53	
BLUESCOPE STEEL LTD	30,171	18.45	556,654.95	
BORAL LIMITED	72,218	6.38	460,750.84	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,834	4.71	366,598.14	
INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.54	287,596.68	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,221	22.77	528,742.17	
NEWCREST MINING LIMITED	45,574	20.84	949,762.16	
ORICA LTD	19,570	17.53	343,062.10	
RIO TINTO LTD	23,382	86.60	2,024,881.20	
SOUTH32 LTD	272,725	3.85	1,049,991.25	
CIMIC GROUP LIMITED	6,260	41.51	259,852.60	
BRAMBLES LTD	93,746	9.06	849,338.76	
SEEK LTD	17,113	20.89	357,490.57	
AURIZON HOLDINGS LTD	129,671	4.14	536,837.94	
TRANSURBAN GROUP	123,903	11.67	1,445,948.01	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	33,436	30.01	1,003,414.36	
CROWN RESORTS LTD	22,372	13.36	298,889.92	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	52.91	157,354.34	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	61.53	183,851.64	
TABCORP HOLDINGS LTD	102,705	4.58	470,388.90	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	3.49	129,203.29	
WESFARMERS LTD	61,841	46.36	2,866,948.76	
WOOLWORTHS GROUP LTD	71,230	28.87	2,056,410.10	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	39,341	9.16	360,363.56	
TREASURY WINE ESTATES LTD	44,748	16.99	760,268.52	
COCHLEAR LIMITED	3,025	198.63	600,855.75	
HEALTHSCOPE LTD	92,574	2.28	211,068.72	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,451	56.66	422,173.66	
SONIC HEALTHCARE LTD	27,479	24.25	666,365.75	
CSL LIMITED	25,555	189.19	4,834,750.45	
AUST AND NZ BANKING GROUP	165,855	26.66	4,421,694.30	
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	10.09	192,698.82	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	10.30	245,953.70	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	96,683	69.37	6,706,899.71	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	151,721	26.38	4,002,399.98	
WESTPAC BANKING	190,315	27.61	5,254,597.15	
AMP LTD	169,110	3.63	613,869.30	
ASX LTD	10,197	61.89	631,092.33	

	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	12.60	384,690.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	17,830	113.07	2,016,038.10	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	124,658	8.01	998,510.58	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	172,264	2.87	494,397.68	
	QBE INSURANCE GROUP	70,777	9.33	660,349.41	
	SUNCORP GROUP LIMITED	76,853	14.03	1,078,247.59	
	COMPUTERSHARE LIMITED	29,131	17.66	514,453.46	
	REA GROUP LTD	3,000	88.74	266,220.00	
	TELSTRA CORP	216,367	2.77	599,336.59	
	TPG TELECOM LTD	22,697	5.42	123,017.74	
	AGL ENERGY LTD	34,713	21.19	735,568.47	
	AUSNET SERVICES	117,666	1.54	181,205.64	
オーストラリアドル 小計		4,058,831		66,804,515.65 (5,560,807,882)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	49,092	6.88	337,752.96	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	6.85	336,430.90	
	A2 MILK CO LTD	39,000	11.50	448,500.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	14.48	383,980.64	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	12.23	269,060.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	105,967	3.70	392,077.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	3.14	201,066.76	
ニュージーランドドル 小計		355,725		2,368,869.16 (182,497,680)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	147,448	90.05	13,277,692.40	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	14.70	1,080,450.00	
	MTR CORP	77,500	44.50	3,448,750.00	
	MINTH GROUP LTD	34,000	38.00	1,292,000.00	
	LI & FUNG	377,400	3.09	1,166,166.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,000	46.20	3,880,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	23.00	1,081,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	135,000	64.40	8,694,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	20.80	1,256,320.00	
	SANDS CHINA LTD	127,800	44.75	5,719,050.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	16.62	1,628,760.00	
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	10.24	1,433,600.00	
	WYNN MACAU LTD	103,200	27.45	2,832,840.00	
	WH GROUP LTD	534,000	7.88	4,207,920.00	
	BANK EAST ASIA	67,964	32.65	2,219,024.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	39.95	7,830,200.00	
	HANG SENG BANK	44,600	200.20	8,928,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	66,600	260.00	17,316,000.00	
	AIA GROUP LTD	676,600	71.95	48,681,370.00	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	143,448	66.30	9,510,602.40	
	HANG LUNG GROUP LTD	65,000	24.40	1,586,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	117,000	17.98	2,103,660.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	69,601	45.95	3,198,165.95	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	45.80	1,419,800.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	41.35	1,529,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	12.10	3,690,500.00	
	SINO LAND CO	208,600	14.14	2,949,604.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	126.90	10,152,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	28,500	83.25	2,372,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	30.95	2,073,650.00	
	WHARF HOLDINGS	61,000	25.80	1,573,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	60.40	3,684,400.00	
	WHEELOCK & CO LTD	40,000	59.20	2,368,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.56	966,720.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	59.40	1,900,800.00	
	CLP HOLDINGS	93,000	81.95	7,621,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	488,870	15.48	7,567,707.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	55.45	4,075,575.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	106.50	1,246,050.00	
香港ドル 小計		5,316,231		207,565,822.95 (2,893,467,571)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	77,300	7.58	585,934.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	2.94	182,280.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.49	261,052.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	158,500	1.01	160,085.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.40	273,360.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,500	11.43	371,475.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	52,600	5.13	269,838.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	1.25	399,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.70	228,285.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	34.52	158,792.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.30	148,449.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.24	248,832.00	
	DBS GROUP	99,800	28.50	2,844,300.00	
	OCBC BANK	172,650	12.58	2,171,937.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	73,600	28.02	2,062,272.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	7.25	308,125.00	
	CAPITALAND LTD	159,400	3.50	557,900.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	11.84	260,480.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,300	8.13	262,599.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	21.13	302,159.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	454,180	3.23	1,467,001.40	
シンガポールドル 小計		2,614,700		13,524,781.00 (1,109,437,785)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,831	352.60	998,210.60	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	16.78	477,961.52	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,706	452.00	771,112.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,756	24.61	1,642,865.16	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	89,987	22.02	1,981,513.74	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	69.55	436,217.60	
	AZRIELI GROUP	1,471	185.40	272,723.40	
	NICE LTD	3,244	380.00	1,232,720.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	4.28	502,120.58	
イスラエルシェケル 小計		317,932		8,315,444.60 (255,034,685)	
合　計		62,426,130		222,085,183,609 (222,085,183,609)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	58,685	490,606.60	
		LENDLEASE GROUP	27,483	524,650.47	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	384,413.95	
	オーストラリアドル 小計		140,083	1,399,671.02 (116,508,615)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	977,600.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	262,000	2,625,240.00	
	香港ドル 小計		392,000	3,602,840.00 (50,223,589)	
投資信託受益証券合計			532,083	166,732,204 (166,732,204)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	23,936	454,305.28	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,427	690,260.13	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	23,998	3,325,642.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	68,132	718,111.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,446	1,249,587.72	
		BOSTON PROPERTIES	8,178	1,003,031.70	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	469,592.89	
		CROWN CASTLE INTL CORP	22,854	2,354,876.16	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,064	1,212,282.48	
		DUKE REALTY CORP	18,713	537,437.36	
		EQUINIX INC	4,393	1,771,916.55	

	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,826	1,280,759.60	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,477	837,922.23	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,639	650,754.78	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,790	458,059.40	
	GGP INC	36,240	749,080.80	
	HCP INC	24,801	603,656.34	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	39,222	866,413.98	
	INVITATION HOMES INC	19,958	442,269.28	
	IRON MOUNTAIN INC	15,087	522,161.07	
	KIMCO REALTY CORP	22,428	367,370.64	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,682	345,305.90	
	MACERICH CO/THE	5,933	338,181.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,265	603,256.85	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	306,308.00	
	PROLOGIS INC	30,197	1,991,492.15	
	PUBLIC STORAGE	8,956	1,939,421.80	
	REALTY INCOME CORP	16,079	856,528.33	
	REGENCY CENTERS CORP	8,074	480,160.78	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	6,502	1,022,894.64	
	SIMON PROPERTY GROUP	17,462	2,887,865.56	
	SL GREEN REALTY CORP	5,123	504,871.65	
	UDR INC	14,110	528,701.70	
	VENTAS INC	18,846	1,033,514.64	
	VEREIT INC	51,309	368,398.62	
	VORNADO REALTY TRUST	9,035	646,906.00	
	WELLTOWER INC	20,937	1,214,136.63	
アメリカドル 小計		624,572	35,633,436.76 (3,898,654,315)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,959	202,366.88	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	215,932.30	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	88,966.08	
カナダドル 小計		21,846	507,265.26 (42,828,405)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	—	
	COVIVIO	1,902	168,327.00	
	GECINA SA	2,385	354,649.50	
	ICADE	1,843	148,177.20	
	KLEPIERRE	11,404	379,753.20	
	UNIBAIL GROUP STAPLED	5,546	1,065,386.60	
ユーロ 小計		1,628,664	2,116,293.50 (273,128,839)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,566	339,031.44	

		HAMMERSON PLC	46,892	250,121.92	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	38,147	358,314.77	
		SEGRO PLC	57,118	383,718.72	
	イギリスポンド 小計		191,723	1,331,186.85 (195,338,358)	
	オーストラリアドル	DEXUS	62,695	613,157.10	
		GOODMAN GROUP	94,201	887,373.42	
		GPT GROUP	115,255	578,580.10	
		MIRVAC GROUP	195,169	427,420.11	
		ONEMARKET LTD	5,789	7,757.26	
		SCENTRE GROUP	312,116	1,301,523.72	
		STOCKLAND	121,481	502,931.34	
		UNIBAIL-RODAMCO-WTFIELD-CDI	42,700	631,106.00	
		VICINITY CENTERS	163,023	427,120.26	
	オーストラリアドル 小計		1,112,429	5,376,969.31 (447,578,925)	
	香港ドル	LINK REIT	123,500	9,052,550.00	
	香港ドル 小計		123,500	9,052,550.00 (126,192,547)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	318,795.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	187,000.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	144,600	300,768.00	
		SUNTEC REIT	113,000	198,880.00	
	シンガポールドル 小計		487,900	1,005,443.00 (82,476,489)	
投資証券合計			4,190,634	5,066,197,878 (5,066,197,878)	
合計				5,232,930,082 (5,232,930,082)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　601銘柄	97.4%	—	—	65.1%
	投資証券　37銘柄	—	—	2.6%	1.7%
カナダドル	株式　87銘柄	99.5%	—	—	3.7%

	投資証券　3銘柄	—	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　241銘柄	99.1%	—	—	12.6%
	投資証券　6銘柄	—	—	0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式　97銘柄	98.8%	—	—	6.9%
	投資証券　4銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　38銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　30銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.6%
オーストラリアドル	株式　57銘柄	90.8%	—	—	2.4%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	1.9%	—	0.1%
	投資証券　9銘柄	—	—	7.3%	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　39銘柄	94.3%	—	—	1.3%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式　21銘柄	93.1%	—	—	0.5%
	投資証券　4銘柄	—	—	6.9%	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

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	93,208,749
金銭信託	41,058,739
コール・ローン	2,538,105,010
国債証券	134,390,976,772
派生商品評価勘定	25,338,465

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
未収入金	4,159,578
未収利息	1,043,667,719
前払金	11,478,398
前払費用	37,014,996
差入委託証拠金	97,914,197
流動資産合計	138,282,922,623
資産合計	138,282,922,623
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,724,229
未払金	2,412,790
未払解約金	206,697,806
未払利息	6,725
その他未払費用	29,716
流動負債合計	223,871,266
負債合計	223,871,266
純資産の部	
元本等	
元本	59,954,266,750
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	78,104,784,607
元本等合計	138,059,051,357
純資産合計	138,059,051,357
負債純資産合計	138,282,922,623

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2018年 6月11日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 6月11日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		59,954,266,750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	2.3027円
	(1万口当たり純資産額)	(23,027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

	2018年 6月11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。

	2018年 6月11日現在
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

	2018年 6月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 6月13日
期首元本額	68,417,295,002円
期中追加設定元本額	4,763,125,257円
期中一部解約元本額	13,226,153,509円
期末元本額	59,954,266,750円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,400,399,267円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,949,190,958円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	11,432,047,322円
ＤＣバランスファンド３０	695,714,358円
ＤＣバランスファンド５０	693,644,550円
ＤＣバランスファンド７０	129,790,942円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	482,271,712円
外国債券インデックスｅ	1,464,693,979円
インデックスコレクション（外国債券）	3,150,445,014円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	1,850,489,743円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	334,064,058円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	92,451,776円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,527,944,390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）	2,464,555,794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）	953,595,218円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	343,344,799円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,364,285,983円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	530,693,913円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	973,270,017円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	3,494,258円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	1,785,204,820円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	2,581,044,237円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	839,239,856円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,754,494,542円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	425,037,432円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	1,248,877,999円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	2,179,982,583円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	163,429,958円

区分	2018年 6月11日現在
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	378,018,008円
ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	38,179,755円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	136,613,965円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	68,336,875円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	124,583,496円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	3,939,544,230円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	14,298,285円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	345,672,385円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	104,472,215円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,966,034,542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）	24,723,131円
世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	90,385円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,307,281,201
合計	△1,307,281,201

(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

（2018年 6月11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	1,762,199,128	－	1,750,720,730	△11,478,398
合計		1,762,199,128	－	1,750,720,730	△11,478,398

(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はありません。

通貨関連

（2018年 6月11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	2,402,962,180	－	2,425,054,000	22,091,820
	アメリカドル	1,142,610,030	－	1,148,385,000	5,774,970
	カナダドル	111,178,452	－	111,421,200	242,748
	ユーロ	980,817,244	－	995,052,600	14,235,356
	イギリスポンド	168,356,454	－	170,195,200	1,838,746
	売建	39,815,999	－	39,815,185	814
	イギリスポンド	39,815,999	－	39,815,185	814
合計		2,442,778,179	－	2,464,869,185	22,092,634

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	2,759,056.58	
		T 0.875% 07/31/19	2,000,000.00	1,966,417.68	
		T 0.875% 09/15/19	7,100,000.00	6,965,599.20	
		T 1.125% 02/28/21	4,550,000.00	4,373,936.74	
		T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,952,308.94	
		T 1.125% 05/31/19	2,850,000.00	2,817,208.52	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,822,320.08	
		T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,096,174.09	
		T 1.25% 01/31/20	4,000,000.00	3,923,130.32	
		T 1.25% 03/31/21	8,500,000.00	8,188,134.15	
		T 1.25% 06/30/19	1,500,000.00	1,482,853.24	
		T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,550,307.18	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,907,934.45	

		T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,081,179.59	
		T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,896,320.84	
		T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,891,019.05	
		T 1.375% 08/31/20	1,750,000.00	1,706,079.42	
		T 1.375% 09/30/20	2,950,000.00	2,872,836.76	
		T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	6,600,147.22	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,835,129.30	
		T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,874,875.67	
		T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	3,964,589.53	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,771,368.80	
		T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,339,319.48	
		T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	7,441,119.56	
		T 1.5% 10/31/19	3,200,000.00	3,159,751.61	
		T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,932,383.10	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,241,086.24	
		T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	7,673,069.57	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	4,906,880.10	
		T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,116,540.76	
		T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	3,969,583.08	
		T 1.625% 07/31/19	3,500,000.00	3,470,614.31	
		T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,177,455.84	
		T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,338,317.23	
		T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,811,920.76	
		T 1.625% 11/30/20	5,000,000.00	4,886,565.25	
		T 1.625% 12/31/19	2,250,000.00	2,222,151.81	
		T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,533,105.39	
		T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,525,716.73	
		T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,412,483.77	
		T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,927,948.68	
		T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,432,555.40	
		T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,667,181.70	
		T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,405,601.20	
		T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,924,256.04	
		T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	2,938,301.43	
		T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,712,074.73	
		T 1.875% 05/31/22	5,850,000.00	5,662,083.49	
		T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,159,145.05	
		T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,509,629.59	
		T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,446,981.52	
		T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	1,927,494.66	
		T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,405,806.91	
		T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,183,188.82	

		T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,753,080.45	
		T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,910,265.05	
		T 1% 11/30/19	2,600,000.00	2,546,594.96	
		T 2.125% 03/31/24	4,200,000.00	4,039,355.67	
		T 2.125% 05/15/25	5,250,000.00	4,997,386.27	
		T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	2,954,800.56	
		T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,074,343.41	
		T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,438,090.32	
		T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,852,206.98	
		T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	990,906.42	
		T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,965,046.26	
		T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,105,905.45	
		T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,338,029.64	
		T 2.125% 12/31/22	6,800,000.00	6,614,401.81	
		T 2.25% 01/31/24	8,100,000.00	7,855,549.20	
		T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,695,521.63	
		T 2.25% 03/31/21	900,000.00	891,247.76	
		T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,651,392.41	
		T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,444,889.58	
		T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	5,978,489.40	
		T 2.25% 08/15/46	7,450,000.00	6,284,032.68	
		T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,817,345.65	
		T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,214,855.07	
		T 2.25% 11/15/27	4,000,000.00	3,771,634.68	
		T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,396,549.48	
		T 2.25% 12/31/24	2,300,000.00	2,213,946.88	
		T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,442,057.38	
		T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,515,887.88	
		T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,277,584.87	
		T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,909,479.44	
		T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	4,785,140.63	
		T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	6,687,713.85	
		T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,629,879.96	
		T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,400,501.64	
		T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,459,470.02	
		T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,404,561.39	
		T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,352,707.01	
		T 2.75% 02/15/24	7,250,000.00	7,219,582.62	
		T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,593,017.14	
		T 2.75% 08/15/42	2,100,000.00	1,985,812.66	
		T 2.75% 08/15/47	4,700,000.00	4,396,792.51	
		T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,436,433.28	
		T 2.75% 11/15/42	1,900,000.00	1,795,539.36	

		T 2.75% 11/15/47	3,900,000.00	3,646,598.78	
		T 2.875% 05/15/43	1,250,000.00	1,206,480.07	
		T 2.875% 08/15/45	7,050,000.00	6,782,701.29	
		T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,023,425.78	
		T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,282,280.42	
		T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,725,603.65	
		T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,100,300.08	
		T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,400,744.80	
		T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,429,998.73	
		T 2% 06/30/24	1,000,000.00	952,499.85	
		T 2% 07/31/20	4,000,000.00	3,955,945.80	
		T 2% 07/31/22	6,000,000.00	5,826,599.82	
		T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,532,077.30	
		T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,113,113.50	
		T 2% 09/30/20	4,000,000.00	3,950,665.32	
		T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,106,623.33	
		T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,203,652.65	
		T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,512,385.23	
		T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,761,345.38	
		T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,326,421.70	
		T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,299,628.12	
		T 3.125% 02/15/42	1,800,000.00	1,818,923.56	
		T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,119,094.20	
		T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,337,706.25	
		T 3.125% 08/15/44	7,200,000.00	7,261,867.94	
		T 3.125% 11/15/41	1,970,000.00	1,990,637.79	
		T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,579,487.85	
		T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	5,977,847.72	
		T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,181,515.64	
		T 3.5% 05/15/20	300,000.00	305,577.73	
		T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	9,984,844.56	
		T 3.625% 02/15/21	7,050,000.00	7,236,042.45	
		T 3.625% 02/15/44	5,850,000.00	6,417,553.48	
		T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	5,578,512.44	
		T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,753,229.48	
		T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,226,099.68	
		T 3.75% 11/15/43	1,400,000.00	1,565,511.45	
		T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,756,768.68	
		T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,088,231.88	
		T 3% 05/15/45	200,000.00	197,148.18	
		T 3% 05/15/47	2,000,000.00	1,967,405.26	
		T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,021,406.49	

		T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,011,399.74	
		T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,075,243.78	
		T 4.375% 02/15/38	700,000.00	842,188.09	
		T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	1,941,023.82	
		T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,643,320.83	
		T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,271,757.87	
		T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,208,622.28	
		T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,537,347.16	
		T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,877,244.04	
		T 4.75% 02/15/41	350,000.00	447,164.19	
		T 5.0% 05/15/37	650,000.00	838,493.22	
		T 5.25% 02/15/29	500,000.00	604,848.48	
		T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,085,381.64	
		T 5.375% 02/15/31	750,000.00	940,370.31	
		T 5.5% 08/15/28	250,000.00	305,901.03	
		T 6.0% 02/15/26	600,000.00	727,843.03	
		T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,324,667.82	
		T 6.25% 05/15/30	1,200,000.00	1,595,038.98	
		T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,574,910.36	
		T 6.5% 11/15/26	450,000.00	570,486.96	
		T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,051,319.67	
		T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,036,122.25	
	アメリカドル 小計		552,100,000.00	541,862,470.33 (59,285,172,878)	
	カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	801,826.25	
		CAN 0.75% 03/01/21	300,000.00	290,139.00	
		CAN 0.75% 09/01/20	1,550,000.00	1,509,932.50	
		CAN 0.75% 09/01/21	1,500,000.00	1,439,782.50	
		CAN 1.25% 11/01/19	1,000,000.00	992,140.00	
		CAN 1.5% 03/01/20	3,580,000.00	3,556,425.70	
		CAN 1.5% 06/01/23	1,500,000.00	1,453,215.00	
		CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,367,864.75	
		CAN 1.75% 09/01/19	750,000.00	749,655.00	
		CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	948,546.30	
		CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,098,054.50	
		CAN 2.25% 06/01/25	530,000.00	529,764.15	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,050,000.00	1,066,863.00	
		CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,126,966.50	
		CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	944,332.80	
		CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	471,141.30	
		CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,449,378.00	
		CAN 3.5% 06/01/20	2,550,000.00	2,627,239.50	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,500,000.00	1,841,235.00	

		CAN 3.75% 06/01/19	2,790,000.00	2,844,488.70	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,230,000.00	1,582,745.55	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,110,000.00	1,475,922.60	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,050,000.00	1,499,788.50	
		CAN 5% 06/01/37	900,000.00	1,261,935.00	
		CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	701,049.60	
	カナダドル 小計		31,670,000.00	33,630,431.70 (2,839,417,348)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,690,496.00	
		MBONO 10% 12/05/24	23,650,000.00	26,301,401.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	7,500,000.00	6,609,075.00	
		MBONO 5% 12/11/19	18,550,000.00	17,836,845.25	
		MBONO 6.5% 06/09/22	15,850,000.00	15,136,987.75	
		MBONO 6.5% 06/10/21	25,200,000.00	24,352,272.00	
		MBONO 7.25% 12/09/21	1,550,000.00	1,523,371.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	8,100,000.00	7,932,006.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	11,850,000.00	11,736,654.75	
		MBONO 7.75% 11/13/42	15,500,000.00	15,180,312.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	7,550,397.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	8,000,000.00	8,383,560.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	8,669,368.00	
		MBONO 8% 06/11/20	22,400,000.00	22,527,120.00	
		MBONO 8% 11/07/47	3,850,000.00	3,871,213.50	
		MBONO 8% 12/07/23	7,550,000.00	7,607,984.00	
	メキシコペソ 小計		191,800,000.00	192,909,064.25 (1,039,779,856)	
	ユーロ	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	353,591.00	
		BGB 0.8% 06/22/25	1,430,000.00	1,465,442.55	
		BGB 0.8% 06/22/27	450,000.00	451,404.00	
		BGB 0.8% 06/22/28	500,000.00	495,687.50	
		BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	396,982.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	550,000.00	529,138.50	
		BGB 1.9% 06/22/38	330,000.00	349,897.35	
		BGB 1% 06/22/26	1,200,000.00	1,236,294.00	
		BGB 1% 06/22/31	1,360,000.00	1,335,771.60	
		BGB 2.15% 06/22/66	240,000.00	248,685.60	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,350,000.00	1,503,663.75	
		BGB 2.25% 06/22/57	290,000.00	313,304.40	
		BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,369,278.00	
		BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	1,153,672.00	
		BGB 3.75% 09/28/20	1,480,000.00	1,625,735.60	
		BGB 3% 06/22/34	500,000.00	619,740.00	

		BGB 3% 09/28/19	770,000.00	805,520.10	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,400,000.00	2,117,556.00	
		BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,441,562.50	
		BGB 4.25% 09/28/22	1,450,000.00	1,727,965.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,239,769.00	
		BGB 4% 03/28/22	790,000.00	918,947.75	
		BGB 4% 03/28/32	450,000.00	614,097.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	1,350,000.00	1,955,475.00	
		BGB 5% 03/28/35	1,430,000.00	2,214,741.10	
		BTPS 0.2% 10/15/20	1,350,000.00	1,299,942.00	
		BTPS 0.35% 06/15/20	900,000.00	877,099.50	
		BTPS 0.35% 11/01/21	3,300,000.00	3,117,625.50	
		BTPS 0.65% 10/15/23	2,150,000.00	1,949,931.75	
		BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,167,330.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,800,000.00	1,579,824.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	300,000.00	289,936.50	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,491,937.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	554,607.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,374,577.50	
		BTPS 1.5% 08/01/19	1,300,000.00	1,303,724.50	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,222,695.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	373,275.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,350,000.00	2,159,156.50	
		BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,702,227.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,060,000.00	1,928,046.70	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,320,000.00	1,132,170.60	
		BTPS 2.45% 09/01/33	500,000.00	449,745.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,773,432.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	1,800,000.00	1,565,100.00	
		BTPS 2.8% 03/01/67	520,000.00	440,164.40	
		BTPS 2.95% 09/01/38	550,000.00	509,363.25	
		BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	988,107.75	
		BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	431,968.50	
		BTPS 3.45% 03/01/48	810,000.00	792,499.95	
		BTPS 3.5% 03/01/30	1,850,000.00	1,880,099.50	
		BTPS 3.75% 03/01/21	1,550,000.00	1,622,199.00	
		BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,623,725.75	
		BTPS 3.75% 08/01/21	2,400,000.00	2,518,248.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	1,900,000.00	2,004,462.00	
		BTPS 4.25% 03/01/20	2,750,000.00	2,871,453.75	
		BTPS 4.25% 09/01/19	2,850,000.00	2,949,108.75	
		BTPS 4.5% 02/01/20	2,250,000.00	2,352,825.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,640,000.00	2,890,615.20	

		BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,489,208.75	
		BTPS 4.5% 05/01/23	1,300,000.00	1,416,681.50	
		BTPS 4.75% 08/01/23	1,500,000.00	1,655,040.00	
		BTPS 4.75% 09/01/21	3,990,000.00	4,317,359.55	
		BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	1,864,137.00	
		BTPS 4.75% 09/01/44	1,450,000.00	1,720,794.75	
		BTPS 4% 02/01/37	1,850,000.00	2,001,061.75	
		BTPS 4% 09/01/20	1,020,000.00	1,068,439.80	
		BTPS 5.0% 08/01/39	1,740,000.00	2,095,081.80	
		BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	2,721,751.00	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,905,700.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,472,745.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	1,500,000.00	1,902,900.00	
		BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,590,548.50	
		BTPS 5% 03/01/25	1,300,000.00	1,472,289.00	
		BTPS 5% 08/01/34	2,100,000.00	2,517,984.00	
		BTPS 5% 09/01/40	1,750,000.00	2,109,450.00	
		BTPS 6.5% 11/01/27	1,250,000.00	1,589,206.25	
		BTPS 6% 05/01/31	2,800,000.00	3,560,102.00	
		BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	459,142.25	
		BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,371,698.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	2,930,000.00	2,913,899.65	
		DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	720,664.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,070,245.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	640,000.00	643,164.80	
		DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	909,468.00	
		DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	2,007,021.75	
		DBR 1.25% 08/15/48	620,000.00	638,550.40	
		DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,111,684.25	
		DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,475,389.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,582,899.75	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,050,000.00	2,210,597.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	2,100,000.00	2,318,694.00	
		DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,793,772.75	
		DBR 1% 08/15/24	1,950,000.00	2,071,260.75	
		DBR 1% 08/15/25	1,500,000.00	1,594,447.50	
		DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	2,023,775.50	
		DBR 2.25% 09/04/21	2,600,000.00	2,832,401.00	
		DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,301,667.35	
		DBR 2.5% 07/04/44	1,720,000.00	2,285,226.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,820,000.00	2,445,288.30	
		DBR 2% 01/04/22	1,870,000.00	2,034,232.75	

		DBR 2% 08/15/23	850,000.00	945,786.50	
		DBR 3.25% 01/04/20	1,750,000.00	1,859,830.00	
		DBR 3.25% 07/04/21	900,000.00	1,005,367.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	1,100,000.00	1,629,287.00	
		DBR 3.5% 07/04/19	3,700,000.00	3,866,648.00	
		DBR 3% 07/04/20	1,150,000.00	1,237,204.50	
		DBR 4.0% 01/04/37	1,700,000.00	2,611,888.50	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,100,000.00	1,797,499.00	
		DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	998,007.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	1,430,000.00	2,286,462.75	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	1,845,695.25	
		DBR 5.5% 01/04/31	1,150,000.00	1,832,272.00	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,239,260.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	720,000.00	975,474.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	800,000.00	1,314,744.00	
		DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	310,455.00	
		FRTR 0.25% 11/25/20	2,050,000.00	2,085,916.00	
		FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	1,993,471.25	
		FRTR 0.5% 05/25/25	3,600,000.00	3,636,450.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,248,413.75	
		FRTR 0.5% 11/25/19	250,000.00	253,918.75	
		FRTR 0.75% 05/25/28	3,000,000.00	2,982,015.00	
		FRTR 0% 02/25/20	2,200,000.00	2,220,174.00	
		FRTR 0% 03/25/23	900,000.00	900,454.50	
		FRTR 0% 05/25/20	2,050,000.00	2,070,899.75	
		FRTR 0% 05/25/21	1,000,000.00	1,011,190.00	
		FRTR 1.25% 05/25/34	350,000.00	350,724.50	
		FRTR 1.25% 05/25/36	1,450,000.00	1,427,981.75	
		FRTR 1.5% 05/25/31	2,550,000.00	2,683,798.50	
		FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,826,603.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	450,000.00	433,377.00	
		FRTR 1.75% 06/25/39	700,000.00	738,076.50	
		FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,285,435.00	
		FRTR 1% 05/25/27	1,100,000.00	1,131,410.50	
		FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,335,121.60	
		FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,682,775.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	2,550,000.00	2,816,067.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	2,030,000.00	2,379,596.45	
		FRTR 2.5% 10/25/20	3,450,000.00	3,694,277.25	
		FRTR 2.75% 10/25/27	2,800,000.00	3,322,480.00	
		FRTR 2% 05/25/48	600,000.00	641,037.00	
		FRTR 3.25% 05/25/45	2,710,000.00	3,682,320.90	
		FRTR 3.25% 10/25/21	4,350,000.00	4,875,893.25	

		FRTR 3.5% 04/25/20	1,950,000.00	2,097,322.50	
		FRTR 3.5% 04/25/26	3,960,000.00	4,898,777.40	
		FRTR 3.75% 04/25/21	3,700,000.00	4,143,759.50	
		FRTR 3.75% 10/25/19	3,200,000.00	3,389,744.00	
		FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,222,968.75	
		FRTR 4.25% 10/25/23	1,750,000.00	2,145,412.50	
		FRTR 4.5% 04/25/41	2,300,000.00	3,656,091.50	
		FRTR 4.75% 04/25/35	2,250,000.00	3,466,755.00	
		FRTR 4% 04/25/55	1,150,000.00	1,841,512.25	
		FRTR 4% 04/25/60	1,070,000.00	1,754,564.60	
		FRTR 4% 10/25/38	2,250,000.00	3,302,381.25	
		FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,709,837.50	
		FRTR 5.75% 10/25/32	2,410,000.00	3,908,682.60	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	2,048,016.25	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,558,903.50	
		FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,518,878.25	
		IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	465,419.25	
		IRISH 0.9% 05/15/28	280,000.00	276,474.80	
		IRISH 1.7% 05/15/37	640,000.00	645,065.60	
		IRISH 1% 05/15/26	700,000.00	712,687.50	
		IRISH 2.4% 05/15/30	820,000.00	925,468.40	
		IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	641,557.40	
		IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	494,499.60	
		IRISH 3.9% 03/20/23	470,000.00	555,528.25	
		IRISH 4.4% 06/18/19	550,000.00	577,456.00	
		IRISH 4.5% 04/18/20	980,000.00	1,071,747.60	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,050,000.00	1,387,191.75	
		IRISH 5.9% 10/18/19	450,000.00	489,069.00	
		IRISH 5% 10/18/20	620,000.00	700,420.20	
		NETHER 0.25% 01/15/20	1,500,000.00	1,521,982.50	
		NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	629,259.75	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,450,000.00	1,462,085.75	
		NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	917,797.50	
		NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,113,590.50	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,550,000.00	1,695,095.50	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,300,000.00	1,435,765.50	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,070,000.00	1,308,117.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,050,000.00	1,461,132.75	
		NETHER 2% 07/15/24	1,430,000.00	1,594,385.65	
		NETHER 3.25% 07/15/21	1,300,000.00	1,451,417.50	
		NETHER 3.5% 07/15/20	640,000.00	695,692.80	
		NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	354,760.50	

		NETHER 3.75% 01/15/42	1,160,000.00	1,817,575.00	
		NETHER 4% 01/15/37	1,190,000.00	1,808,984.45	
		NETHER 4% 07/15/19	1,220,000.00	1,282,628.70	
		NETHER 5.5% 01/15/28	850,000.00	1,246,695.00	
		NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	949,284.00	
		OBL 0.25% 10/11/19	1,900,000.00	1,924,453.00	
		OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,837,287.00	
		OBL 0% 04/08/22	1,600,000.00	1,624,768.00	
		OBL 0% 04/14/23	600,000.00	605,901.00	
		OBL 0% 04/17/20	2,050,000.00	2,076,117.00	
		RAGB 0.25% 10/18/19	100,000.00	101,060.00	
		RAGB 0.75% 10/20/26	1,800,000.00	1,827,693.00	
		RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	649,626.25	
		RAGB 0% 09/20/22	270,000.00	271,873.80	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,020,000.00	1,078,869.30	
		RAGB 1.5% 02/20/47	70,000.00	70,095.55	
		RAGB 1.5% 11/02/86	190,000.00	168,217.45	
		RAGB 1.65% 10/21/24	650,000.00	708,591.00	
		RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	764,659.00	
		RAGB 1.95% 06/18/19	650,000.00	666,464.50	
		RAGB 2.1% 09/20/17	270,000.00	292,630.05	
		RAGB 2.4% 05/23/34	560,000.00	665,646.80	
		RAGB 3.15% 06/20/44	800,000.00	1,107,152.00	
		RAGB 3.4% 11/22/22	800,000.00	926,464.00	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,230,000.00	1,386,597.45	
		RAGB 3.65% 04/20/22	570,000.00	655,140.90	
		RAGB 3.8% 01/26/62	240,000.00	403,095.60	
		RAGB 3.9% 07/15/20	1,220,000.00	1,333,527.10	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,000,000.00	1,496,810.00	
		RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,275,318.00	
		RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	556,113.70	
		RFGB 0.5% 04/15/26	490,000.00	491,398.95	
		RFGB 0.5% 09/15/27	180,000.00	177,556.50	
		RFGB 0.75% 04/15/31	350,000.00	342,459.25	
		RFGB 0.875% 09/15/25	190,000.00	196,746.90	
		RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	251,977.50	
		RFGB 1.125% 04/15/34	200,000.00	201,490.00	
		RFGB 1.5% 04/15/23	770,000.00	827,761.55	
		RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	409,155.50	
		RFGB 2.625% 07/04/42	410,000.00	534,531.35	
		RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	455,665.60	
		RFGB 2% 04/15/24	200,000.00	221,602.00	
		RFGB 3.375% 04/15/20	770,000.00	826,210.00	

		RFGB 3.5% 04/15/21	960,000.00	1,067,587.20	
		RFGB 4.375% 07/04/19	250,000.00	263,407.50	
		RFGB 4% 07/04/25	360,000.00	452,052.00	
		SPGB 0.05% 01/31/21	500,000.00	500,445.00	
		SPGB 0.4% 04/30/22	1,470,000.00	1,480,069.50	
		SPGB 0.75% 07/30/21	1,000,000.00	1,022,005.00	
		SPGB 1.15% 07/30/20	950,000.00	975,849.50	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,050,000.00	1,057,245.00	
		SPGB 1.4% 01/31/20	1,850,000.00	1,900,199.75	
		SPGB 1.4% 04/30/28	1,150,000.00	1,144,382.25	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,250,000.00	2,262,015.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,200,000.00	1,217,970.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,309,806.25	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,760,000.00	1,866,224.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,450,000.00	1,489,382.00	
		SPGB 2.15% 10/31/25	950,000.00	1,024,798.25	
		SPGB 2.35% 07/30/33	650,000.00	681,973.50	
		SPGB 2.7% 10/31/48	650,000.00	667,771.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,900,000.00	2,133,985.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,000,000.00	1,079,065.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	600,000.00	697,338.00	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,300,000.00	1,532,193.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,640,000.00	2,173,369.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	650,000.00	692,032.25	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,850,000.00	2,223,801.75	
		SPGB 4.6% 07/30/19	1,430,000.00	1,510,752.10	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,850,000.00	2,322,573.25	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	1,984,489.10	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,050,000.00	1,291,788.75	
		SPGB 4.85% 10/31/20	1,000,000.00	1,116,885.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,320,000.00	1,918,547.40	
		SPGB 4% 04/30/20	2,650,000.00	2,858,396.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,010,527.50	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,040,000.00	1,586,494.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,720,000.00	3,343,696.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,472,920.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	1,550,000.00	2,316,653.25	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,000,000.00	2,411,410.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,526,665.25	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,376,715.00	
	ユーロ 小計		368,030,000.00	419,149,226.35 (54,095,399,152)	

	イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	950,000.00	932,301.50	
		UKT 1.25% 07/22/27	940,000.00	924,734.40	
		UKT 1.5% 01/22/21	2,570,000.00	2,617,609.25	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,400,000.00	2,431,296.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	1,150,000.00	1,059,063.75	
		UKT 1.625% 10/22/28	500,000.00	504,345.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	350,000.00	344,753.50	
		UKT 1.75% 07/22/19	1,700,000.00	1,720,986.50	
		UKT 1.75% 07/22/57	500,000.00	502,505.00	
		UKT 1.75% 09/07/22	2,000,000.00	2,065,290.00	
		UKT 1.75% 09/07/37	550,000.00	541,532.75	
		UKT 2.25% 09/07/23	1,420,000.00	1,504,426.10	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,350,000.00	1,708,627.50	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,420,000.00	1,555,496.40	
		UKT 2% 07/22/20	1,950,000.00	2,001,372.75	
		UKT 2% 09/07/25	1,450,000.00	1,528,379.75	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,080,000.00	2,659,394.40	
		UKT 3.5% 01/22/45	1,150,000.00	1,541,172.50	
		UKT 3.5% 07/22/68	1,500,000.00	2,419,380.00	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,663,656.90	
		UKT 3.75% 09/07/19	700,000.00	726,981.50	
		UKT 3.75% 09/07/20	890,000.00	950,048.30	
		UKT 3.75% 09/07/21	1,050,000.00	1,147,980.75	
		UKT 4.25% 03/07/36	1,740,000.00	2,388,889.50	
		UKT 4.25% 06/07/32	1,250,000.00	1,648,987.50	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,550,000.00	2,205,743.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	940,601.25	
		UKT 4.25% 12/07/40	1,220,000.00	1,758,935.00	
		UKT 4.25% 12/07/46	1,600,000.00	2,442,568.00	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,170,000.00	1,847,541.15	
		UKT 4.25% 12/07/55	1,450,000.00	2,443,264.50	
		UKT 4.5% 09/07/34	1,350,000.00	1,870,776.00	
		UKT 4.5% 12/07/42	1,340,000.00	2,033,785.00	
		UKT 4.75% 03/07/20	2,100,000.00	2,248,543.50	
		UKT 4.75% 12/07/30	1,150,000.00	1,558,681.25	
		UKT 4.75% 12/07/38	620,000.00	930,728.50	
		UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	1,679,710.00	
		UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,286,467.50	
		UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,994,272.00	
		UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	647,500.50	
		UKT 8% 06/07/21	400,000.00	485,272.00	
	イギリスポンド 小計		52,470,000.00	64,463,600.65 (9,459,388,759)	

スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	570,000.00	606,189.30	
	SWISS 2% 04/28/21	200,000.00	215,639.00	
	SWISS 4% 02/11/23	100,000.00	121,205.50	
	SWISS 4% 04/08/28	480,000.00	668,779.20	
スイスフラン 小計		1,350,000.00	1,611,813.00 (179,056,306)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	3,200,000.00	3,244,912.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	5,530,000.00	5,979,450.75	
	SGB 1% 11/12/26	5,560,000.00	5,825,656.80	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,800,491.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,500,000.00	4,937,590.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	7,450,000.00	8,565,935.50	
	SGB 5% 12/01/20	7,500,000.00	8,540,887.50	
スウェーデンクローナ 小計		36,890,000.00	41,894,924.30 (526,619,198)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,150,000.00	3,111,192.00	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,600,000.00	2,600,247.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	2,990,000.00	3,020,931.55	
	NGB 2% 05/24/23	4,550,000.00	4,687,933.25	
	NGB 3.75% 05/25/21	6,300,000.00	6,786,675.00	
	NGB 3% 03/14/24	3,550,000.00	3,846,123.25	
ノルウェークローネ 小計		23,140,000.00	24,053,102.05 (326,400,594)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	450,000.00	458,930.25	
	DGB 0.5% 11/15/27	2,000,000.00	2,011,070.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	4,450,000.00	4,829,963.25	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,300,000.00	7,030,012.50	
	DGB 3% 11/15/21	6,200,000.00	6,930,887.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,150,000.00	17,264,135.00	
	DGB 4% 11/15/19	8,020,000.00	8,557,500.40	
デンマーククローネ 小計		37,570,000.00	47,082,498.40 (815,468,872)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	1,750,000.00	1,747,856.25	
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,035,619.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	1,999,500.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	500,000.00	500,320.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	2,998,075.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,850,000.00	1,741,016.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	700,000.00	670,715.50	
	POLGB 2% 04/25/21	2,860,000.00	2,868,294.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	1,300,000.00	1,327,332.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,000,000.00	2,025,570.00	

		POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,064,499.90	
		POLGB 5.25% 10/25/20	2,300,000.00	2,491,233.50	
		POLGB 5.5% 10/25/19	1,900,000.00	2,005,165.00	
		POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,105,195.50	
		POLGB 5.75% 09/23/22	850,000.00	967,542.25	
		POLGB 5.75% 10/25/21	1,250,000.00	1,400,868.75	
	ポーランドズロチ 小計		28,230,000.00	28,948,804.40 (873,674,916)	
	オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,734,495.00	
		ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,382,256.00	
		ACGB 2.75% 04/21/24	2,050,000.00	2,075,358.50	
		ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	553,815.90	
		ACGB 2.75% 10/21/19	1,060,000.00	1,070,441.00	
		ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	1,894,974.50	
		ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	1,742,256.25	
		ACGB 2.75% 11/21/29	600,000.00	595,245.00	
		ACGB 2% 12/21/21	1,950,000.00	1,933,064.25	
		ACGB 3.25% 04/21/25	2,050,000.00	2,129,591.25	
		ACGB 3.25% 04/21/29	1,530,000.00	1,593,349.65	
		ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	553,649.25	
		ACGB 3.75% 04/21/37	820,000.00	890,930.00	
		ACGB 3% 03/21/47	900,000.00	847,300.50	
		ACGB 4.25% 04/21/26	2,450,000.00	2,718,299.50	
		ACGB 4.5% 04/15/20	2,400,000.00	2,505,432.00	
		ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,442,143.70	
		ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,775,708.00	
		ACGB 5.5% 04/21/23	1,820,000.00	2,076,965.80	
		ACGB 5.75% 05/15/21	2,000,000.00	2,201,260.00	
		ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,267,780.00	
	オーストラリアドル 小計		33,230,000.00	34,984,316.05 (2,912,094,468)	
	シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	140,000.00	136,185.70	
		SIGB 1.625% 10/01/19	250,000.00	249,375.00	
		SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	195,119.00	
		SIGB 2.25% 06/01/21	720,000.00	723,780.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	150,000.00	136,345.50	
		SIGB 2.375% 06/01/25	100,000.00	99,606.00	
		SIGB 2.5% 06/01/19	990,000.00	996,865.65	
		SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	70,272.65	
		SIGB 2.75% 03/01/46	380,000.00	363,515.60	
		SIGB 2.75% 04/01/42	380,000.00	365,216.10	
		SIGB 2.75% 07/01/23	350,000.00	357,542.50	
		SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	102,438.50	

		SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	376,160.50	
		SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,353.60	
		SIGB 3.125% 09/01/22	250,000.00	259,992.50	
		SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	616,629.00	
		SIGB 3.375% 09/01/33	380,000.00	404,487.20	
		SIGB 3.5% 03/01/27	650,000.00	699,536.50	
		SIGB 3% 09/01/24	470,000.00	486,522.85	
	シンガポールドル 小計		6,870,000.00	6,959,944.35 (570,924,235)	
	マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,158,530.00	
		MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,274,962.00	
		MGS 3.492% 03/31/20	1,200,000.00	1,198,824.00	
		MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	627,056.35	
		MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	947,777.00	
		MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	779,805.00	
		MGS 3.889% 07/31/20	1,350,000.00	1,357,985.25	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,159,602.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	50,000.00	49,183.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	1,080,000.00	1,013,736.60	
		MGS 4.16% 07/15/21	2,230,000.00	2,255,143.25	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,650,000.00	1,654,735.50	
		MGS 4.254% 05/31/35	1,050,000.00	975,129.75	
		MGS 4.378% 11/29/19	2,330,000.00	2,360,231.75	
		MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,661,855.25	
		MGS 4.498% 04/15/30	1,900,000.00	1,877,485.00	
		MGS 4.762% 04/07/37	560,000.00	551,012.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,300,000.00	1,309,802.00	
		MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,010,515.00	
	マレーシアリンギット 小計		24,480,000.00	24,223,370.70 (665,415,993)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	17,509,988.25	
		SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,352,706.50	
		SAGB 6.5% 02/28/41	7,550,000.00	5,297,457.50	
		SAGB 6.75% 03/31/21	4,400,000.00	4,278,890.00	
		SAGB 7.25% 01/15/20	3,680,000.00	3,663,808.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	4,000,000.00	3,924,980.00	
		SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,257,684.20	
		SAGB 8.25% 03/31/32	5,300,000.00	4,781,686.50	
		SAGB 8.5% 01/31/37	8,400,000.00	7,540,764.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	10,900,000.00	9,796,375.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	11,300,000.00	10,122,709.50	
		SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,620,926.00	
		SAGB 8% 01/31/30	7,200,000.00	6,516,468.00	

		SAGB 9% 01/31/40	5,450,000.00	5,059,207.75	
	南アフリカランド 小計		106,170,000.00	95,723,651.20 (802,164,197)	
合計				134,390,976,772 (134,390,976,772)	

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　162銘柄	100.0%	44.1%
カナダドル	国債証券　25銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　269銘柄	100.0%	40.3%
イギリスポンド	国債証券　41銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券　4銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券　6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.6%
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　21銘柄	100.0%	2.2%
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%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　14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12期中間計算期間(2018年6月12日から2018年12月11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11期 （2018年 6月11日現在）	第12期中間計算期間 （2018年12月11日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	166,252	-
コール・ローン	10,277,131	18,227,938
親投資信託受益証券	3,438,358,570	3,179,225,910
未収入金	12,154,045	8,466,977
流動資産合計	3,460,955,998	3,205,920,825
資産合計	3,460,955,998	3,205,920,825
負債の部		
流動負債		
未払解約金	960,096	464,571
未払受託者報酬	922,254	924,916
未払委託者報酬	10,144,744	10,174,005
未払利息	27	51
その他未払費用	92,294	92,733
流動負債合計	12,119,415	11,656,276
負債合計	12,119,415	11,656,276
純資産の部		
元本等		
元本	2,128,429,347	2,064,345,302
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,320,407,236	1,129,919,247
（分配準備積立金）	1,092,511,120	1,018,696,152
元本等合計	3,448,836,583	3,194,264,549
純資産合計	3,448,836,583	3,194,264,549
負債純資産合計	3,460,955,998	3,205,920,825

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自　2017年 6月13日 至　2017年12月12日	第12期中間計算期間 自　2018年 6月12日 至　2018年12月11日
営業収益		
受取利息	5	-
有価証券売買等損益	365,718,889	△140,599,927
営業収益合計	365,718,894	△140,599,927
営業費用		
支払利息	3,269	7,196
受託者報酬	920,156	924,916
委託者報酬	10,121,711	10,174,005
その他費用	91,960	92,812
営業費用合計	11,137,096	11,198,929
営業利益又は営業損失（△）	354,581,798	△151,798,856
経常利益又は経常損失（△）	354,581,798	△151,798,856
中間純利益又は中間純損失（△）	354,581,798	△151,798,856
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（△）	12,649,973	△435,144
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,077,822,175	1,320,407,236
剰余金増加額又は欠損金減少額	69,564,883	52,316,575
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	69,564,883	52,316,575
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,881,910	91,440,852
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,881,910	91,440,852
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,410,436,973	1,129,919,247

（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12期中間計算期間は2018年 6月12日から2018年12月11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11期 (2018年 6月11日現在)	第12期中間計算期間 (2018年12月11日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	2,128,429,347口	2,064,345,302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 1.6204円 (1万口当たり純資産額) (16,204円)	1口当たり純資産額 1.5473円 (1万口当たり純資産額) (15,473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12期中間計算期間 (2018年12月11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12期中間計算期間 (2018年12月11日現在)
	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第11期 自 2017年 6月13日 至 2018年 6月11日	第12期中間計算期間 自 2018年 6月12日 至 2018年12月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,197,223,013円	2,128,429,347円
期中追加設定元本額	217,108,019円	83,981,383円
期中一部解約元本額	285,901,685円	148,065,428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

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,398,373,532
株式	211,845,722,950
未収配当金	112,924,955
前払金	67,395,000
差入委託証拠金	58,875,000
流動資産合計	214,483,291,437
資産合計	214,483,291,437
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	67,396,620
未払解約金	178,945,127
未払利息	6,724
その他未払費用	41,600
流動負債合計	246,390,071
負債合計	246,390,071
純資産の部	
元本等	
元本	129,275,553,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	84,961,348,233
元本等合計	214,236,901,366
純資産合計	214,236,901,366
負債純資産合計	214,483,291,437

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11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。

	2018年12月11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）

		2018年12月11日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		129,275,553,133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	1.6572円
	(1万口当たり純資産額)	(16,572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

	2018年12月11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	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	129,367,405,550円
期中追加設定元本額	5,868,962,761円
期中一部解約元本額	5,960,815,178円
期末元本額	129,275,553,133円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	783,425,060円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	344,612,603円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	54,177,722,554円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	1,180,549,146円
ＤＣバランスファンド３０	2,041,382,662円
ＤＣバランスファンド５０	3,040,494,224円
ＤＣバランスファンド７０	1,604,198,564円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	617,755,584円
日本株式インデックスｅ	1,879,550,399円
インデックスコレクション（国内株式）	11,078,008,554円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	5,531,620,351円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,513,259,152円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,232,913,364円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,242,063,656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）	2,323,332,712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）	1,880,078,414円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	160,041,316円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,484,243,405円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	136,520,689円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	771,786,800円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	10,965,342円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	863,946,912円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,347,467,804円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	635,545,561円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	10,864,857,162円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	921,851,172円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	177,521,259円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,793,634,788円

区分	2018年12月11日現在
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	46,835,751円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	213,951,831円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,789,637,661円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	85,439,171円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	84,898,622円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	38,798,135円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	1,244,288,093円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	973,149,943円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	27,486,202円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	434,166,923円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	7,295,140,373円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	133,300,302円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	65,409,621円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	11,336,216円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	187,485,872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）	4,879,208円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年12月11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	2,467,965,000	－	2,400,570,000	△67,395,000
合計		2,467,965,000	－	2,400,570,000	△67,395,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,351,610,139
コール・ローン	1,119,990,031

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
株式	166,909,763,753
投資信託受益証券	144,954,417
投資証券	4,474,459,097
派生商品評価勘定	1,792,749
未収入金	764,236
未収配当金	315,176,235
前払金	273,609,174
差入委託証拠金	1,301,143,348
流動資産合計	178,893,263,179
資産合計	178,893,263,179
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	279,200,275
未払解約金	134,113,498
未払利息	3,140
その他未払費用	19,213
流動負債合計	413,336,126
負債合計	413,336,126
純資産の部	
元本等	
元本	70,284,094,924
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	108,195,832,129
元本等合計	178,479,927,053
純資産合計	178,479,927,053
負債純資産合計	178,893,263,179

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券

	2018年12月11日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年12月11日現在
1.　計算期間の末日における受益権の総数	70,284,094,924口

	2018年12月11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　2.5394円 (1万口当たり純資産額)　(25,394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

	2018年12月11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	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2018年 6月12日

区分	2018年12月11日現在
期首元本額	90,650,594,351円
期中追加設定元本額	4,401,961,346円
期中一部解約元本額	24,768,460,773円
期末元本額	70,284,094,924円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,855,923,845円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,502,889,432円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	20,260,307,872円
ＤＣバランスファンド３０	699,729,595円
ＤＣバランスファンド５０	1,359,159,660円
ＤＣバランスファンド７０	801,249,975円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	413,954,240円
外国株式インデックスｅ	5,961,564,775円
インデックスコレクション（外国株式）	5,082,740,008円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	1,990,967,163円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	673,241,597円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	614,232,387円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,205,085,847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）	1,385,701,710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）	1,012,245,963円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	106,511,660円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	999,463,971円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	90,854,115円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	513,534,871円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	3,620,446円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	2,874,942,843円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	634,425,506円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	380,370,800円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	7,354,525,300円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	706,451,628円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	354,396,053円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,193,533,318円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	31,169,185円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	144,323,150円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	170,590,072円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	508,525,902円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	26,477,481円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	828,006,021円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	18,869,473円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	135,816,928円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	374,304,270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）	14,387,862円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年12月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,160,723,814	－	6,887,114,640	△273,609,174
合計		7,160,723,814	－	6,887,114,640	△273,609,174

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2018年12月11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	994,894,784	－	991,156,400	△3,738,384
	アメリカドル	749,094,186	－	746,827,350	△2,266,836
	ユーロ	153,072,120	－	154,140,000	1,067,880
	イギリスポンド	92,728,478	－	90,189,050	△2,539,428
	売建	73,045,162	－	73,105,130	△59,968
	アメリカドル	62,925,442	－	62,986,730	△61,288
	カナダドル	10,119,720	－	10,118,400	1,320
合計		1,067,939,946	－	1,064,261,530	△3,798,352

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	86,085,929
コール・ローン	1,986,981,588
国債証券	132,255,278,751
派生商品評価勘定	13,995,382
未収入金	5,186,312
未収利息	1,022,829,401
前払費用	33,630,739
差入委託証拠金	156,242,533
流動資産合計	135,560,230,635
資産合計	135,560,230,635
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,319,743
前受金	10,858,121
未払金	2,870,134
未払解約金	202,147,184
未払利息	5,571
その他未払費用	32,827
流動負債合計	224,233,580
負債合計	224,233,580
純資産の部	
元本等	
元本	57,242,884,603
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	78,093,112,452
元本等合計	135,335,997,055
純資産合計	135,335,997,055
負債純資産合計	135,560,230,635

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2018年12月11日現在
	(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年12月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		57,242,884,603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	2.3642円
	(1万口当たり純資産額)	(23,642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

	2018年12月11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。

	2018年12月11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	(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。 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	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	59,954,266,750円
期中追加設定元本額	2,011,769,114円
期中一部解約元本額	4,723,151,261円
期末元本額	57,242,884,603円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,331,664,362円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,959,025,648円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	11,792,184,136円
ＤＣバランスファンド３０	731,579,733円
ＤＣバランスファンド５０	718,160,783円
ＤＣバランスファンド７０	136,816,169円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	467,086,524円
外国債券インデックスｅ	1,431,602,632円
インデックスコレクション（外国債券）	3,291,322,151円

区分	2018年12月11日現在
インデックスコレクション（バランス株式３０）	2,043,489,990円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	352,063,266円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	101,035,149円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,580,182,877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）	2,172,861,153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）	829,487,934円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	288,901,513円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,124,614,583円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	485,552,324円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	915,009,086円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	2,109,493円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	1,600,563,865円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	2,383,210,507円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	789,675,118円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,220,549,108円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	395,483,378円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	460,408,522円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,993,710,543円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	138,823,763円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	244,603,880円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	126,626,870円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	62,912,457円
バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	117,684,630円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	3,688,099,059円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	13,534,568円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	322,778,363円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	100,261,182円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,806,137,901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）	23,071,383円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2018年12月11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	1,289,457,756	－	1,300,315,877	10,858,121
合計		1,289,457,756	－	1,300,315,877	10,858,121

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2018年12月11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	1,770,270,764	―	1,765,085,500	△5,185,264
	アメリカドル	863,317,721	―	860,462,700	△2,855,021
	カナダドル	87,370,284	―	86,006,400	△1,363,884
	ユーロ	691,307,699	―	693,630,000	2,322,301
	イギリスポンド	128,275,060	―	124,986,400	△3,288,660
	売建	35,913,348	―	35,910,566	2,782
	イギリスポンド	35,913,348	―	35,910,566	2,782
合計		1,806,184,112	―	1,800,996,066	△5,182,482

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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】

（2018年12月28日現在）

Ⅰ　資産総額	3,021,544,572円
Ⅱ　負債総額	3,125,527円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,018,419,045円
Ⅳ　発行済口数	2,034,643,502口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4835円
（1万口当たり純資産額）	（14,835円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2018年12月28日現在）

Ⅰ　資産総額	216,104,851,048円
Ⅱ　負債総額	6,366,778,927円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	209,738,072,121円
Ⅳ　発行済口数	133,216,650,786口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5744円
（1万口当たり純資産額）	（15,744円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2018年12月28日現在）

Ⅰ　資産総額	167,325,408,748円
Ⅱ　負債総額	171,758,218円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	167,153,650,530円
Ⅳ　発行済口数	70,297,691,626口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3778円
（1万口当たり純資産額）	（23,778円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（2018年12月28日現在）

Ⅰ　資産総額	132,708,008,619円
Ⅱ　負債総額	44,120,656円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	132,663,887,963円
Ⅳ　発行済口数	56,750,631,006口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3377円
（1万口当たり純資産額）	（23,377円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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（2018年12月28日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

おいて、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

［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執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN－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。

委託会社の機構は2019年 3月11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。

2018年12月28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	528	11,339,014
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	306,406
単位型公社債投資信託	0	0
合計	607	11,645,420

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭

和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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29年3月31日現在）		当事業年度 （平成30年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		20,260,630		23,973,152
前払費用		143,622		157,614
未収委託者報酬		5,252,944		5,373,307
繰延税金資産		61,677		94,211
その他		5,474		9,842
流動資産合計		25,724,348		29,608,128
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	47,993	※1	36,782
器具備品	※1	73,765	※1	79,655
その他	※1	2,830	※1	1,912
有形固定資産合計		124,589		118,350
無形固定資産				
ソフトウェア		221,499		210,679
その他		6,656		4,377
無形固定資産合計		228,156		215,056
投資その他の資産				
投資有価証券		71,153		42,802
長期前払費用		9,828		7,810
長期貸付金		19,838		17,088
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		137,359		154,422
その他		145		70
貸倒引当金		△19,838		△17,088
投資その他の資産合計		243,485		230,105
固定資産合計		596,231		563,512
資産合計		26,320,580		30,171,641

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）	当事業年度 （平成30年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
固定負債		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	71,500	74,500
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	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△1,134	182
評価・換算差額等合計	△1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178
広告宣伝費	95,688	175,296
公告費	3,094	－
調査費	6,239,223	6,008,380
調査費	360,520	396,842
委託調査費	5,876,937	5,609,496
図書費	1,766	2,041
営業雑経費	1,460,885	1,474,361
通信費	24,920	33,158
印刷費	370,785	368,414
協会費	30,665	36,616
諸会費	105	105
情報機器関連費	943,725	942,093
その他営業雑経費	90,684	93,973
営業費用合計	20,679,217	20,202,216
一般管理費		
給料	1,874,710	2,006,157
役員報酬	89,520	84,130
給料・手当	1,526,244	1,649,268
賞与	258,946	272,758
退職給付費用	76,106	84,944
福利費	221,018	239,702
交際費	5,612	5,831
旅費交通費	61,961	73,807
租税公課	106,691	102,158
不動産賃借料	113,697	124,629
減価償却費	134,710	119,300
業務委託費	※1　486,690	※1　484,841
諸経費	223,685	246,326
一般管理費合計	3,304,885	3,487,699
営業利益	6,261,346	5,516,262

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136

収益分配金		129		116
投資有価証券売却益		307		499
貸倒引当金戻入		3,000		2,750
その他		1,591		4,351
営業外収益合計		9,697		9,854
営業外費用				
長期前払費用償却	※1	4,644	※1	―
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		―		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		―		51,569
特別損失合計		―		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		△50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成28年4月1日　至　平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	―	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

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

当事業年度（自　平成29年4月1日　至　平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	―	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等	

	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	△1,134	△1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

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。

未適用の会計基準等

・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　平成30年2月16日）
・「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30年2月16日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類１）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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29年3月31日）		当事業年度 （平成30年3月31日）	
建　　物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	〃	325,834	〃
そ の 他	1,759	〃	2,677	〃
計	362,567	〃	392,342	〃

（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28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	〃	―	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30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

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項
（1）金融商品に対する取組方針
当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク
未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。
未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制
①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理
売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理
有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理
当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成30年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	23,973,152	23,973,152	―
（2）未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	―
（3）投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	―
（4）未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	―
（5）未払法人税等	(838,596)	(838,596)	―

（*）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29年3月31日	平成30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、「(3)投資有価証券 その他有価証券」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

当事業年度（平成30年3月31日）　（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	―	―	―
未収委託者報酬	5,373,307	―	―	―
投資有価証券 投資信託	―	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成30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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	23,576	25,037	△1,461
小計	23,576	25,037	△1,461
合計	42,799	42,536	262

（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

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30年3月31日）　（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付債務	437,197	496,696
（2）退職給付引当金	437,197	496,696

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付費用	76,106	84,944

（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14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

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29年3月31日）		当事業年度 （平成30年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	〃	5,232	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	〃	32,511	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	〃	152,088	〃
その他	6,972	〃	23,674	〃
繰延税金資産 合計	205,870	〃	255,547	〃
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	〃
その他	-	〃	△80	〃
繰延税金負債 合計	△6,833	〃	△6,913	〃
繰延税金資産の純額	199,037	〃	248,633	〃

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おります。

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社
重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成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㈱	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
① 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30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㈱	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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
(1) 親会社情報

前事業年度（平成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）

当事業年度（平成30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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
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33期中間会計期間末 （2018年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	35,878
器具備品	※1	94,797
その他有形固定資産	※1	1,967
有形固定資産合計		132,642
無形固定資産		476,662
投資その他の資産		
投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590
その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284
固定資産合計		920,589
資産合計		32,413,396
負債の部		
流動負債		
未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	※2	107,652
流動負債合計		4,638,109
固定負債		

退職給付引当金	530,260
資産除去債務	13,489
その他固定負債	578
固定負債合計	544,327
負債合計	5,182,436

（単位：千円）

	第33期中間会計期間末 （2018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	75,000
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	24,405,169
利益剰余金合計	26,580,169
株主資本合計	27,230,169
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	789
評価・換算差額等合計	789
純資産合計	27,230,959
負債・純資産合計	32,413,396

中間損益計算書

（単位：千円）

		第33期中間会計期間 （自　2018年4月1日 至　2018年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	※1	2,088,498
営業利益		2,433,271
営業外収益	※2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774

法人税等合計	730,051
中間純利益	1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日　至 2018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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		△30,500	△30,000	△30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
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	500	―	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	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	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			△30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	607	607	607
当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

重要な会計方針

第33期中間会計期間 （自　2018年4月1日

至　2018年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法
有価証券
その他有価証券
時価のあるもの
中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。
（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
時価のないもの
移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法
（1）有形固定資産
定額法によっております。
（2）無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準
（1）貸倒引当金
一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
（2）賞与引当金
従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
（3）退職給付引当金
従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項
消費税等の会計処理
消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

第33期中間会計期間
（自　2018年4月1日
至　2018年9月30日）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法へ変更しております。
この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。
なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に及ぼす

影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間 （自　2018年4月1日 至　2018年9月30日）
「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号　平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末 （2018年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額 建　　物　66,454千円 器具備品　342,351千円 その他有形固定資産　3,136千円 計　411,942千円 ※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33期中間会計期間 （自　2018年4月1日 至　2018年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　19,715千円 無形固定資産　44,989千円 ※2　営業外収益の主要項目 受取利息　819千円 貸倒引当金戻入　17,088千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日　至 2018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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

2018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	23,034,588	23,034,588	－
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	－
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	－
(4)投資有価証券 その他有価証券	37,331	37,331	－
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	－
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	－

(*)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、(2)預け金、並びに(3)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。

(4)投資有価証券

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

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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、「（4）投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

その他有価証券

（単位:千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	21,579	19,493	2,085
小計	21,579	19,493	2,085
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	15,752	16,700	△947
小計	15,752	16,700	△947
合計	37,331	36,193	1,137

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

（デリバティブ取引関係）
第33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018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33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018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33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018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
外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（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33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018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33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018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33期中間会計期間（自　2018年4月1日　至　2018年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自　2018年4月1日 至　2018年9月30日）
1株当たり純資産額　9,076,986円44銭 1株当たり中間純利益　556,045円23銭 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
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）

（共通支配下の取引等）
１．取引の概要
(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容
事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業
事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供
(2) 企業結合日
2018年10月1日
(3) 企業結合の法的形式
三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割
(4) 結合後企業の名称
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社　（当社）
(5) その他取引の概要に関する事項
三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。
２．実施する会計処理の概要
「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定であります。

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）
当社は、2018年9月28日開催の臨時株主総会において、その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加について決議しており、2018年10月1日付で実行しております。

１．その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的
資本規模の充実を図るため、会社法第450条第１項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。

２．その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領

(1) 減少すべきその他資本剰余金の額
その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。

(2) その他資本剰余金の額の減少方法
減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。
資本金の額は2,000,000千円になります。

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
当社は2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項
2019年 3月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2018年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円）（2018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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2018年3月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年６月１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30年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

２０１８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２０１７年6月１３日から２０１８年6月１１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２０１８年6月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月３日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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2018年４月１日から2019年３月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2018年４月１日から2018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2018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（2018年４月１日から2018年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

２０１９年2月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　中島紀子　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの２０１８年6月１２日から２０１８年１２月１１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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの２０１８年１２月１１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（２０１８年6月１２日から２０１８年１２月１１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

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