

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年4月20日提出
【計算期間】	第4期(自 平成28年1月21日至 平成29年1月20日)
【ファンド名】	世界経済インデックスファンド（債券シフト型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0522
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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



## DR(預託証券)とは

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

##### (2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

#### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[ 投資形態による属性区分 ]

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

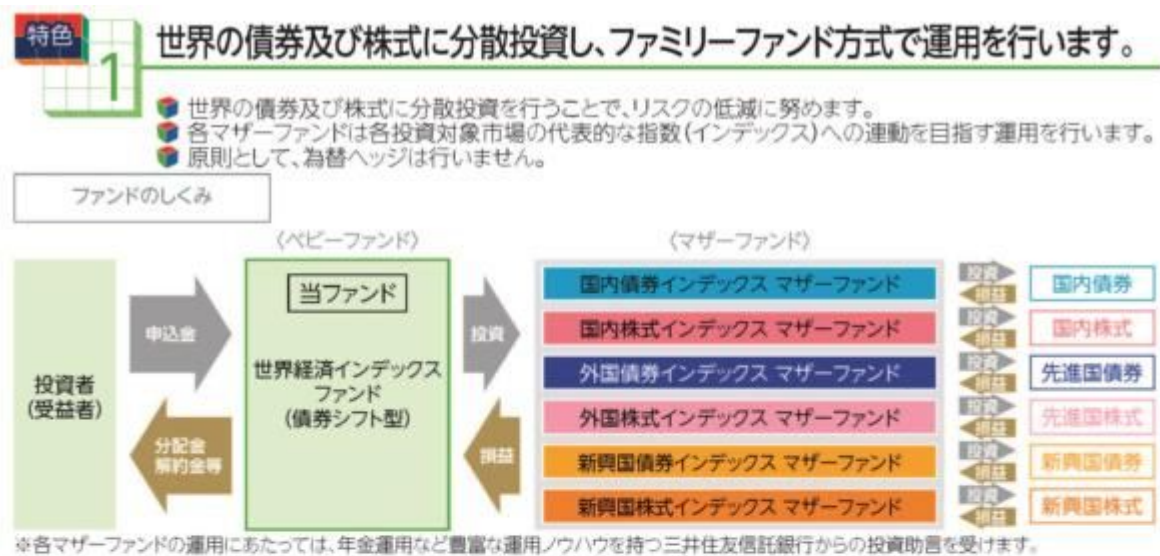
[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

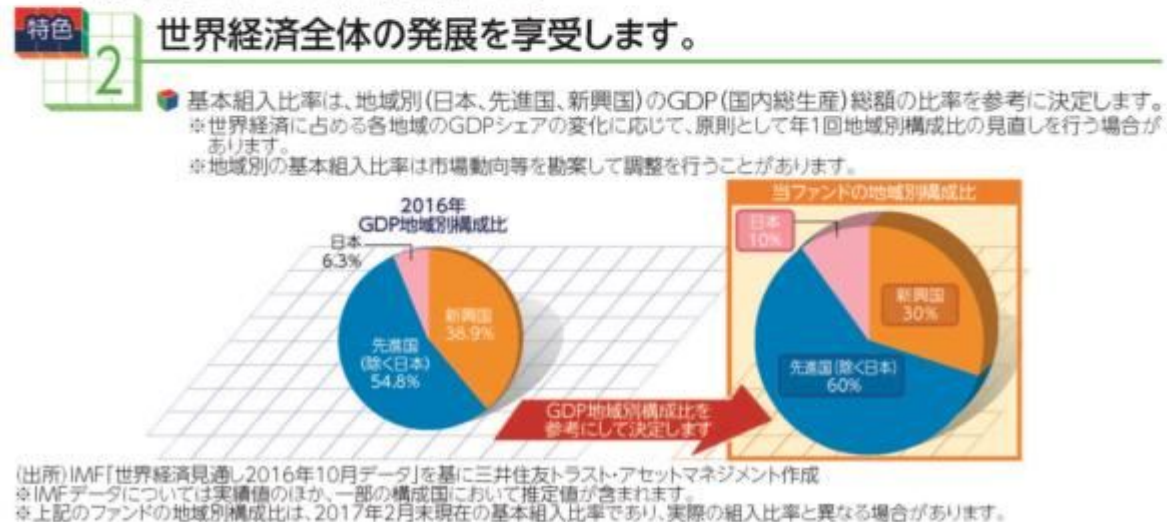
## [ 特殊型 ]

- (1) プル・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。

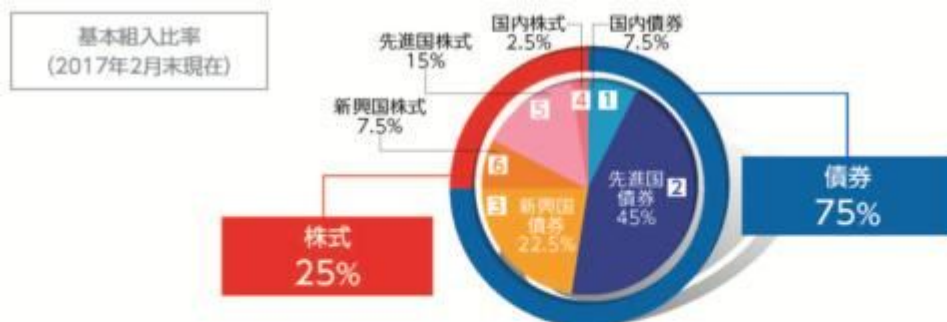
## &lt; ファンドの特色 &gt;



**?** 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。







- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

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

\* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

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

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

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



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

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

6「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 分配方針

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

## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

## 〈ご参考情報〉

## 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects(The 2015 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2017年1月改訂のデータ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

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

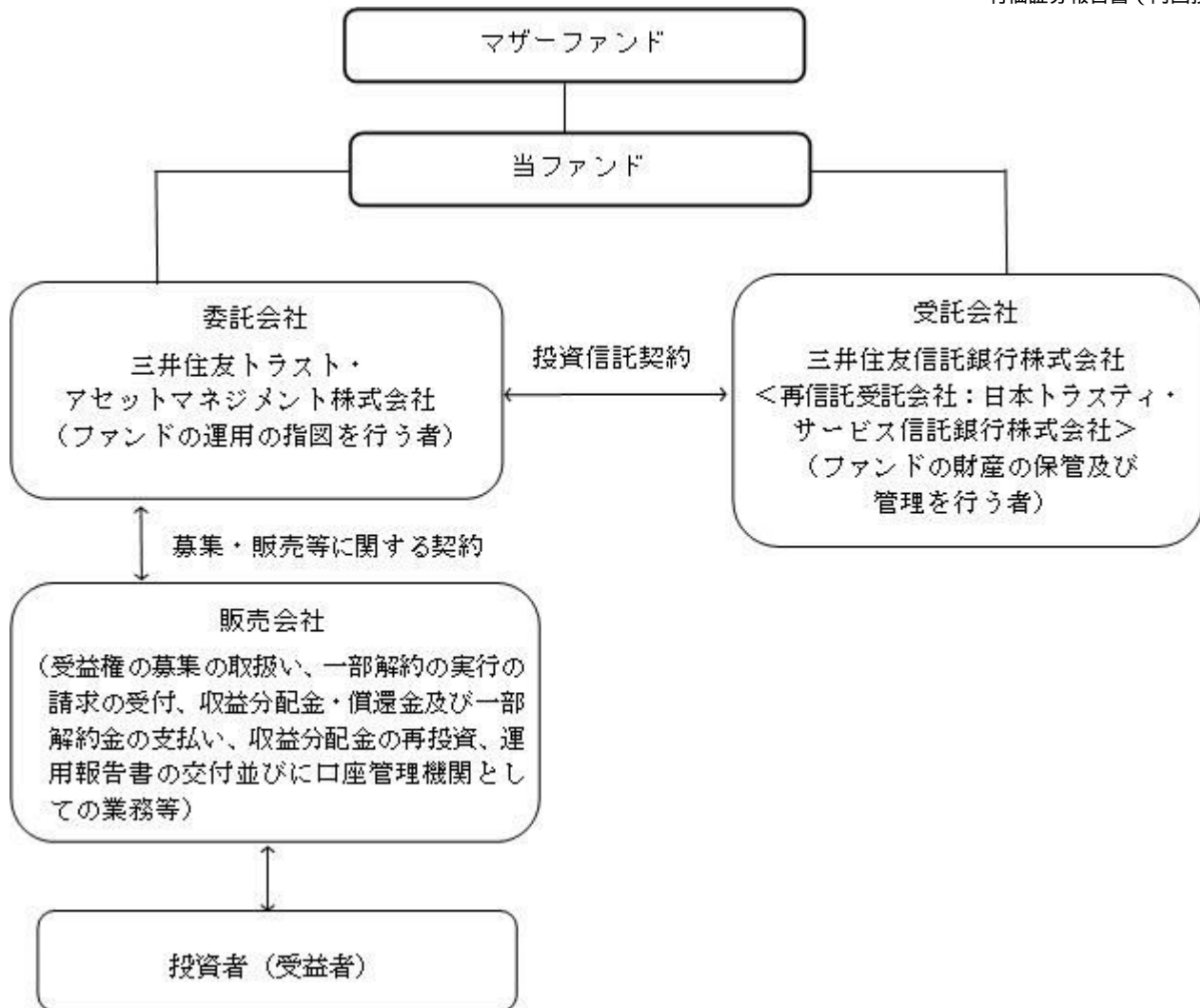
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成25年11月8日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成29年 2月28日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年2月20日：	投資顧問業の登録
昭和62年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
平成2年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
平成19年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
平成24年4月1日：	中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券））を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券））を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ロ．株式（DR（預託証券））を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式25%、債券75%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。
- ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ト．ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

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

□. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1. から6. までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7. から28. までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券又は新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7. から17. の証券又は証書の性質を有するもの
19. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
23. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  25. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  26. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  28. 外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

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

###### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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

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

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

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。

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

### 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。



同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

原則として、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

原則としてMSCI コクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

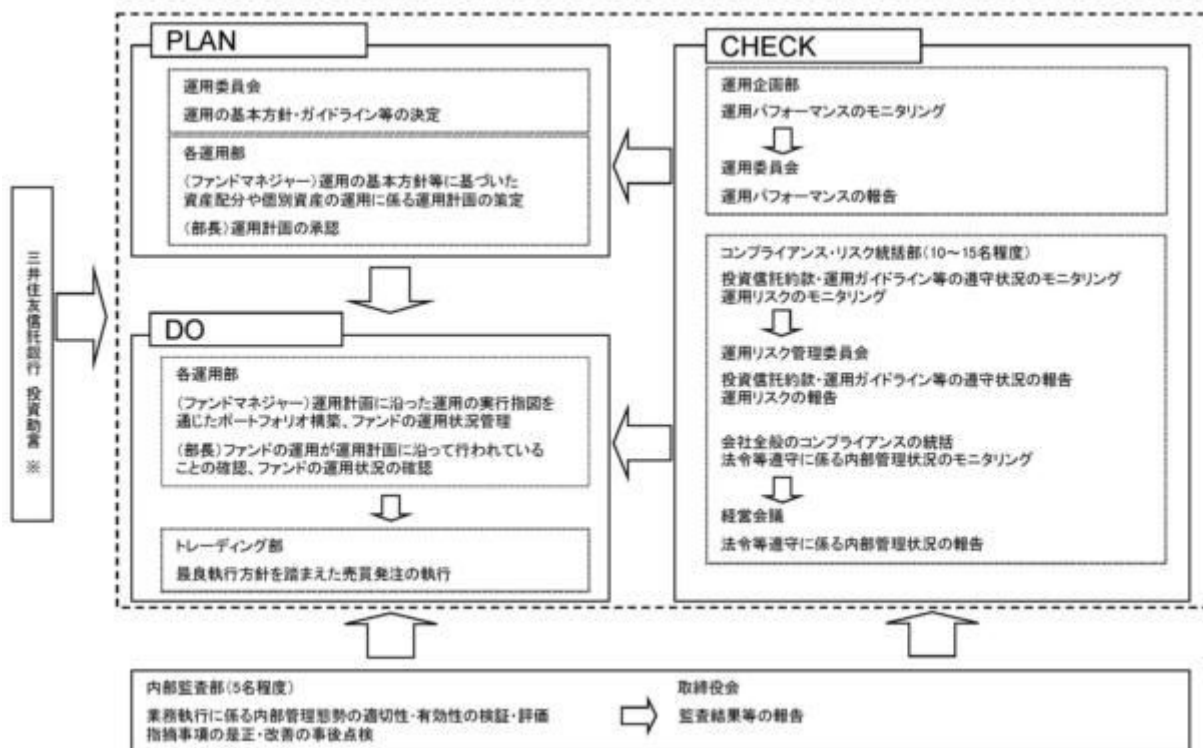
投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

### （４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### ＜約款に定める投資制限＞

- イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - 1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - 2. 株式分割により取得する株券
  - 3. 有償増資により取得する株券
  - 4. 売出しにより取得する株券
  - 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  - 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

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



の投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- ワ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- コ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

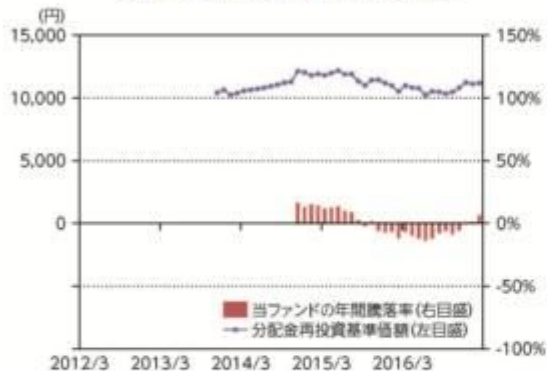
運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

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

監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



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

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

### 当ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2014年11月～2017年2月の2年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2012年3月～2017年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、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。

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

\*各資産クラスの指数  
 日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>  
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※2</sup>  
 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※3</sup>  
 日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>  
 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>※5</sup>  
 新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)<sup>※6</sup>  
 (注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

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

じ。 )。

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

2: 収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」( 税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース)と「分配金再投資コース」( 税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

## ( 2 ) 【換金( 解約 ) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額( )として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.486%( 税抜 0.45% )を乗じて得た額とします( 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 )。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1944% ( 税抜 0.18% )	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 0.2376% ( 税抜 0.22% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% ( 税抜 0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離

課税を選択したものに限り、)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。

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成29年 2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、平成29年 2月28日現在の状況について記載してあります。

## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	666,418,957	98.79
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,194,365	1.21
合計（純資産総額）		674,613,322	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	112,454,337	2.6467	297,632,894	2.6014	292,538,712	43.36
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	95,248,908	1.5720	149,731,284	1.5988	152,283,954	22.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	47,612,596	2.1111	100,514,952	2.1422	101,995,703	15.12
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	21,764,521	2.3802	51,803,913	2.4460	53,236,018	7.89
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	35,919,539	1.3786	49,518,677	1.3806	49,590,515	7.35
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	12,541,350	1.3348	16,740,194	1.3375	16,774,055	2.49

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.79
合計	98.79

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】



該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 （平成26年 1月20日）	83,358,017	83,358,017	10,486	10,486
第2期計算期間末 （平成27年 1月20日）	377,394,493	377,394,493	11,741	11,741
第3期計算期間末 （平成28年 1月20日）	537,488,921	537,488,921	10,576	10,576
第4期計算期間末 （平成29年 1月20日）	675,724,816	675,724,816	11,185	11,185
平成28年 2月末日	548,099,792		10,515	
3月末日	582,547,560		10,993	
4月末日	575,554,038		10,823	
5月末日	580,911,344		10,766	
6月末日	561,441,916		10,259	
7月末日	595,866,783		10,522	
8月末日	609,223,276		10,485	
9月末日	609,916,177		10,345	
10月末日	628,834,529		10,482	
11月末日	660,964,705		10,812	
12月末日	678,093,868		11,234	
平成29年 1月末日	671,455,762		11,118	
2月末日	674,613,322		11,185	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成25年11月 8日～平成26年 1月20日	0
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	0
第3期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	0
第4期計算期間	平成28年 1月21日～平成29年 1月20日	0

#### 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成25年11月 8日～平成26年 1月20日	4.9
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	12.0

第3期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	9.9
第4期計算期間	平成28年 1月21日～平成29年 1月20日	5.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	平成25年11月 8日～平成26年 1月20日	82,565,042	3,071,810	79,493,232
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	351,798,094	109,869,385	321,421,941
第3期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	400,244,016	213,448,471	508,217,486
第4期計算期間	平成28年 1月21日～平成29年 1月20日	182,370,280	86,474,117	604,113,649

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	245,707,024,100	82.04
	ポーランド	200,508,000	0.07
	小計	245,907,532,100	82.10
地方債証券	日本	17,012,195,392	5.68
特殊債券	日本	22,525,291,534	7.52
社債券	日本	11,269,593,840	3.76
	フランス	498,379,000	0.17
	オーストラリア	401,582,000	0.13
	オランダ	200,102,000	0.07
	スウェーデン	199,661,000	0.07
	アメリカ	100,298,000	0.03
	イギリス	99,622,000	0.03
	小計	12,769,237,840	4.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,300,078,780	0.43
合計(純資産総額)		299,514,335,646	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	101.12	4,439,343,600	100.77	4,423,803,000	0.300	2018/6/20	1.48
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,090,000,000	101.23	4,140,359,200	101.05	4,133,313,100	0.100	2021/3/20	1.38
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	101.14	3,812,978,000	100.87	3,803,100,600	0.200	2018/12/20	1.27
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,700,000,000	101.06	3,739,333,600	101.14	3,742,402,000	0.100	2021/9/20	1.25
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	101.43	3,661,767,400	100.96	3,644,836,500	0.100	2020/9/20	1.22
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	101.25	3,564,140,800	100.92	3,552,595,200	0.200	2019/3/20	1.19
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	101.20	3,562,240,000	100.84	3,549,744,000	0.100	2019/12/20	1.19
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	101.35	3,557,455,200	100.99	3,544,889,400	0.200	2019/6/20	1.18
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	101.26	3,179,721,000	100.88	3,167,914,600	0.100	2020/3/20	1.06
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	101.51	3,004,696,000	101.01	2,990,014,400	0.100	2020/12/20	1.00
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,840,000,000	105.14	2,985,976,000	103.37	2,935,906,800	0.400	2025/9/20	0.98
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,920,000,000	101.09	2,951,944,300	100.52	2,935,271,600	0.100	2026/9/20	0.98
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,770,000,000	102.45	2,838,002,600	100.60	2,786,675,400	0.100	2026/6/20	0.93
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,710,000,000	104.15	2,822,588,300	102.50	2,777,885,500	0.300	2025/12/20	0.93
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,680,000,000	105.09	2,816,412,000	103.36	2,770,128,400	0.400	2025/6/20	0.92
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	102.17	2,656,420,000	100.67	2,617,602,000	0.100	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	101.45	2,597,278,000	101.06	2,587,264,000	0.200	2019/9/20	0.86
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,390,000,000	106.66	2,549,174,000	104.72	2,502,903,600	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	101.03	2,475,259,500	100.75	2,468,522,000	0.200	2018/9/20	0.82
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,310,000,000	106.37	2,457,147,000	104.61	2,416,606,500	0.600	2023/12/20	0.81
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	106.65	2,442,422,400	105.08	2,406,423,600	0.800	2022/9/20	0.80
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,290,000,000	105.82	2,423,278,000	104.05	2,382,767,900	0.500	2024/9/20	0.80
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	107.03	2,408,287,300	105.67	2,377,642,500	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,200,000,000	104.99	2,309,921,000	103.34	2,273,568,000	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	104.03	2,184,651,000	102.78	2,158,485,000	1.500	2018/9/20	0.72
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,010,000,000	105.48	2,120,148,000	104.22	2,094,962,700	1.300	2019/12/20	0.70
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	2,010,000,000	100.98	2,029,737,100	101.18	2,033,798,400	0.100	2021/12/20	0.68

日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	1,950,000,000	101.30	1,975,455,500	100.92	1,968,115,500	0.100	2020/6/20	0.66
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	1,810,000,000	106.38	1,925,586,600	104.88	1,898,328,000	0.800	2022/6/20	0.63
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	1,720,000,000	105.80	1,819,863,200	104.26	1,793,272,000	0.600	2023/3/20	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.10
地方債証券	5.68
特殊債券	7.52
社債券	4.26
合計	99.57

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	154,964,592,410	98.83
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,833,176,416	1.17
合計（純資産総額）		156,797,768,826	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	1,794,780,000	1.14

(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	842,000	5,664.68	4,769,660,560	6,365.00	5,359,330,000	3.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,179,700	542.64	2,810,712,408	738.40	3,824,690,480	2.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	548,700	4,829.93	2,650,182,591	4,751.00	2,606,873,700	1.66
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	307,700	6,156.07	1,894,222,739	8,362.00	2,572,987,400	1.64
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	547,300	3,506.59	1,919,156,707	4,377.00	2,395,532,100	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	623,300	3,100.29	1,932,410,757	3,489.00	2,174,693,700	1.39
日本	株式	KDDI	情報・通信業	676,200	3,186.96	2,155,022,352	2,939.00	1,987,351,800	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,280,500	171.20	1,588,821,600	209.70	1,946,120,850	1.24
日本	株式	ソニー	電気機器	489,000	3,079.00	1,505,631,000	3,478.00	1,700,742,000	1.08
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	430,100	4,366.83	1,878,173,583	3,757.00	1,615,885,700	1.03
日本	株式	ファナック	電気機器	70,200	16,741.32	1,175,240,664	22,125.00	1,553,175,000	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	272,000	4,799.63	1,305,499,360	5,222.00	1,420,384,000	0.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	31,400	34,716.19	1,090,088,366	43,460.00	1,364,644,000	0.87
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	510,800	2,742.33	1,400,782,164	2,667.00	1,362,303,600	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	276,900	3,822.08	1,058,333,952	4,919.00	1,362,071,100	0.87
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	134,000	9,991.50	1,338,861,000	10,155.00	1,360,770,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	512,900	1,934.55	992,230,695	2,534.50	1,299,945,050	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	286,100	4,681.86	1,339,480,146	4,400.00	1,258,840,000	0.80
日本	株式	信越化学工業	化学	130,100	6,356.16	826,936,416	9,503.00	1,236,340,300	0.79
日本	株式	キャノン	電気機器	372,900	3,147.59	1,173,736,311	3,281.00	1,223,484,900	0.78
日本	株式	三菱電機	電気機器	738,800	1,310.22	967,990,536	1,647.50	1,217,173,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	72,700	12,694.99	922,925,773	16,150.00	1,174,105,000	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	741,100	1,498.30	1,110,390,130	1,512.00	1,120,543,200	0.71
日本	株式	三菱地所	不動産業	508,000	2,113.04	1,073,424,320	2,195.00	1,115,060,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	244,800	3,719.60	910,558,080	4,481.00	1,096,948,800	0.70
日本	株式	花王	化学	184,300	6,068.92	1,118,501,956	5,801.00	1,069,124,300	0.68
日本	株式	三井物産	卸売業	618,100	1,314.13	812,263,753	1,719.00	1,062,513,900	0.68
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	57,600	19,243.94	1,108,450,944	18,380.00	1,058,688,000	0.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,663,000	497.92	828,040,960	618.80	1,029,064,400	0.66
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,397,500	474.70	663,393,250	729.30	1,019,196,750	0.65

(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。

#### □.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.34
		建設業	2.88
		食料品	4.38
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.67
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.34
		非鉄金属	0.97
		金属製品	0.70
		機械	5.04
		電気機器	12.40
		輸送用機器	9.17
		精密機器	1.52
		その他製品	1.72
		電気・ガス業	1.76
		陸運業	4.14
		海運業	0.25
		空運業	0.57
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	7.71
		卸売業	4.52
		小売業	4.57
		銀行業	8.41
		証券、商品先物取引業	1.23
		保険業	2.71
		その他金融業	1.24
		不動産業	2.47
サービス業	3.67		
	小計	98.83	
合計		98.83	

(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	117円		1,798,330,840	1,794,780,000	1.14

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	94,367,882,184	43.96
	フランス	20,552,281,804	9.58
	イタリア	19,554,750,805	9.11
	イギリス	15,502,920,985	7.22
	ドイツ	15,347,457,560	7.15
	スペイン	11,487,568,779	5.35
	ベルギー	5,344,341,858	2.49
	オランダ	4,758,863,596	2.22
	カナダ	4,634,295,798	2.16
	オーストラリア	4,470,126,844	2.08
	オーストリア	3,044,045,404	1.42
	メキシコ	1,745,026,690	0.81
	アイルランド	1,652,561,644	0.77
	ポーランド	1,318,645,030	0.61
	フィンランド	1,261,304,011	0.59
	デンマーク	1,254,970,366	0.58
	南アフリカ	1,182,407,509	0.55
	スウェーデン	977,990,160	0.46
	マレーシア	940,960,233	0.44
	シンガポール	834,833,232	0.39
ノルウェー	589,256,836	0.27	
スイス	410,908,121	0.19	



	小計	211,233,399,449	98.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,409,981,915	1.59
合計(純資産総額)		214,643,381,364	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	423,545,687	0.20
	買建	ドイツ	541,617,186	0.25

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,315,382,700	0.61

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	19,000,000	10,683.67	2,029,898,949	10,153.27	1,929,121,716	2.500	2046/2/15	0.90
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	14,150,000	11,627.88	1,645,345,062	11,018.58	1,559,129,166	2.875	2043/5/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,425.97	1,376,229,023	10,422.01	1,375,705,971	1.500	2026/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	11,411.42	1,403,605,827	10,968.64	1,349,143,350	2.000	2025/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,649.06	1,281,397,073	11,648.34	1,281,317,589	2.625	2020/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,580.21	1,175,391,395	11,247.15	1,141,586,328	2.250	2024/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.875% 07/15/18	10,000,000	11,250.37	1,125,037,200	11,232.52	1,123,252,201	0.875	2018/7/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,197.30	1,119,730,176	11,211.18	1,121,118,626	0.625	2018/4/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	10,000,000	11,182.13	1,118,213,250	11,034.55	1,103,455,936	1.250	2021/3/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,900,000	11,756.21	1,163,865,776	10,984.08	1,087,424,001	2.875	2045/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	11,328.48	1,110,191,886	10,941.58	1,072,275,652	1.125	2021/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,208.12	1,070,376,319	11,168.64	1,066,606,059	1.750	2022/3/31	0.50

アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	11,059.35	1,050,638,979	11,079.93	1,052,593,856	1.375	2021/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	8,750,000	11,847.84	1,036,686,042	11,853.56	1,037,187,050	3.375	2019/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,233.57	1,011,021,832	11,177.85	1,006,006,757	1.000	2019/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/23	9,000,000	10,770.75	969,367,845	10,892.70	980,343,607	1.625	2023/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,778.78	1,001,197,015	11,367.69	966,253,805	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	8,700,000	11,352.78	987,692,388	11,102.03	965,877,468	2.125	2025/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,893.98	999,094,873	11,479.80	964,303,824	2.500	2024/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	11,433.19	960,388,303	11,021.75	925,827,164	2.000	2025/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 12/31/20	8,200,000	11,265.56	923,776,543	11,279.72	924,937,103	1.750	2020/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/18	8,000,000	11,582.46	926,597,441	11,435.18	914,814,687	2.625	2018/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	11,403.07	912,246,041	11,311.29	904,903,824	1.500	2019/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	8,270,000	11,395.24	942,386,797	10,564.22	873,661,112	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 12/15/19	7,650,000	11,231.23	859,189,615	11,242.04	860,016,306	1.375	2019/12/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	8,100,000	11,116.08	900,403,094	10,587.21	857,564,668	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.125% 06/30/21	7,500,000	11,732.65	879,948,968	11,412.58	855,943,548	2.125	2021/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	11,443.52	858,264,507	11,332.70	849,952,598	1.625	2019/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1% 08/31/19	7,500,000	11,284.92	846,369,594	11,160.17	837,012,827	1.000	2019/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/23	7,550,000	11,331.40	855,521,185	11,063.42	835,288,820	1.750	2023/1/31	0.39

(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	98.41
合計	98.41

(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	16	アメリカドル	1,884,509.36	212,120,373	1,884,624.96	212,133,385	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	9	アメリカドル	1,120,504.79	126,124,018	1,121,343.75	126,218,452	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	5	アメリカドル	753,801.25	84,847,869	756,875	85,193,850	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	9	ユーロ	1,013,451	120,580,400	1,014,120	120,659,998	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	9	ユーロ	1,209,576	143,915,352	1,212,930	144,314,411	0.07

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	14	ユーロ	2,305,036	274,253,183	2,325,120	276,642,777	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	5,490,000.00	620,084,640	617,570,100	0.29
	カナダドル	買建	690,000.00	59,409,850	58,822,500	0.03
	ユーロ	買建	4,560,000.00	545,189,930	542,548,800	0.25
	イギリスポンド	買建	690,000.00	97,659,140	96,441,300	0.04

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	179,775,695,652	59.81
	イギリス	19,930,119,797	6.63
	カナダ	11,769,636,833	3.92
	スイス	11,037,714,478	3.67
	ドイツ	10,715,218,591	3.56
	フランス	10,222,043,513	3.40
	オーストラリア	7,834,545,141	2.61
	オランダ	5,332,677,825	1.77
	アイルランド	4,774,697,310	1.59
	スペイン	3,499,714,615	1.16
	スウェーデン	3,306,869,672	1.10
	香港	2,705,475,278	0.90
	シンガポール	2,188,063,911	0.73
	イタリア	1,989,804,089	0.66
	デンマーク	1,871,736,175	0.62
	ジャージー	1,643,375,497	0.55
	バミューダ	1,391,536,170	0.46
	ベルギー	1,343,574,742	0.45
フィンランド	1,126,352,748	0.37	

	キュラソー	1,027,055,847	0.34
	ノルウェー	773,059,544	0.26
	ケイマン	738,083,871	0.25
	イスラエル	723,800,313	0.24
	ルクセンブルク	417,022,247	0.14
	オーストリア	246,211,155	0.08
	ニュージーランド	227,062,751	0.08
	パナマ	184,569,444	0.06
	ポルトガル	168,526,773	0.06
	リベリア	157,113,144	0.05
	パプアニューギニア	72,224,169	0.02
	英ヴァージン諸島	58,913,004	0.02
	マン島	33,681,037	0.01
	モーリシャス	12,913,266	0.00
	小計	287,299,088,602	95.58
投資信託受益証券	オーストラリア	212,470,058	0.07
	香港	49,985,415	0.02
	シンガポール	20,759,553	0.01
	小計	283,215,026	0.09
投資証券	アメリカ	5,884,215,482	1.96
	オーストラリア	707,595,559	0.24
	フランス	387,001,691	0.13
	イギリス	288,299,525	0.10
	香港	141,199,187	0.05
	シンガポール	112,082,367	0.04
	カナダ	69,971,787	0.02
	小計	7,590,365,598	2.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,398,953,580	1.80
合計(純資産総額)		300,571,622,806	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	3,505,472,401	1.17
	買建	カナダ	265,194,288	0.09
	買建	ドイツ	833,395,562	0.28
	買建	イギリス	496,366,743	0.17
	買建	オーストラリア	184,389,153	0.06

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建		217,287,200	0.07

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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	437,579	11,476.61	5,021,926,852	15,412.84	6,744,335,464	2.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	600,912	5,993.82	3,601,758,364	7,229.72	4,344,430,793	1.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	32,650	81,302.08	2,654,513,173	95,522.91	3,118,823,286	1.04
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	337,083	10,106.76	3,406,817,790	9,178.14	3,093,795,775	1.03
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	222,076	12,741.79	2,829,646,200	13,777.34	3,059,617,446	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	292,703	7,481.86	2,189,963,805	10,178.80	2,979,365,531	0.99
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	188,389	13,511.70	2,545,456,103	15,354.30	2,892,583,031	0.96
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	388,304	5,711.29	2,217,718,461	6,535.23	2,537,657,348	0.84
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	725,922	3,386.93	2,458,647,290	3,370.04	2,446,390,823	0.81
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	498,318	4,392.09	2,188,658,103	4,707.25	2,345,711,990	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,065	83,195.34	2,085,291,377	93,343.75	2,339,661,264	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,897	84,968.16	2,030,484,292	95,638.85	2,285,481,723	0.76
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	826,304	1,719.91	1,421,174,131	2,765.59	2,285,225,681	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	207,101	9,209.65	1,907,329,630	10,230.57	2,118,763,017	0.70
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	252,090	8,256.58	2,081,401,983	8,282.22	2,087,865,092	0.69
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	153,139	11,549.78	1,768,722,005	12,578.58	1,926,271,163	0.64

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	491,631	3,869.81	1,902,519,937	3,858.55	1,896,986,138	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	98,600	16,219.89	1,599,281,746	19,206.11	1,893,722,722	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	329,898	5,695.53	1,878,945,935	5,621.24	1,854,437,945	0.62
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	224,017	6,404.66	1,434,753,615	7,412.07	1,660,431,029	0.55
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	388,444	3,561.96	1,383,622,457	4,224.37	1,640,933,822	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	99,859	15,008.75	1,498,758,807	16,354.96	1,633,190,750	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	234,929	5,325.21	1,251,047,106	6,755.85	1,587,145,367	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	382,242	3,601.92	1,376,805,105	4,109.56	1,570,848,574	0.52
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	406,930	3,272.11	1,331,523,466	3,856.30	1,569,246,438	0.52
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	180,574	8,798.32	1,588,749,118	8,677.93	1,567,010,247	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	331,799	5,007.79	1,661,581,174	4,690.37	1,556,261,801	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	56,816	28,968.82	1,645,892,682	27,154.09	1,542,786,891	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	125,467	11,106.29	1,393,473,540	12,235.27	1,535,122,872	0.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	123,388	11,257.12	1,388,994,213	12,407.48	1,530,935,228	0.51

(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	6.98
		素材	4.84
		資本財	7.29
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.47
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.65
		小売	3.83
		食品・生活必需品小売り	1.92
		食品・飲料・タバコ	5.76

	家庭用品・パーソナル用品	2.15
	ヘルスケア機器・サービス	3.91
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.62
	銀行	9.48
	各種金融	4.31
	保険	4.12
	不動産	0.63
	ソフトウェア・サービス	9.06
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
	電気通信サービス	2.85
	公益事業	3.15
	半導体・半導体製造装置	2.43
	小計	95.58
投資信託受益証券		0.09
投資証券		2.53
合計		98.20

(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	263	アメリカドル	29,940,751	3,370,130,932	31,143,145	3,505,472,401	1.17
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	17	カナダドル	3,084,984.5	263,149,178	3,108,960	265,194,288	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	22	スイスフラン	1,807,134	201,441,226	1,857,240	207,026,542	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	159	ユーロ	5,176,795.5	615,935,128	5,264,490	626,369,020	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	15	オーストラリアドル	2,096,105	181,040,588	2,134,875	184,389,153	0.06
	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	49	イギリスポンド	3,469,203.75	485,029,375	3,550,295	496,366,743	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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	980,000.00	110,071,000	110,299,000	0.04
	ユーロ	売建	90,000.00	10,666,620	10,708,200	0.00
	イギリスポンド	売建	600,000.00	83,548,200	83,880,000	0.03
	スウェーデンクローナ	売建	1,000,000.00	12,412,000	12,400,000	0.00

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	2,446,904,090	10.39
	ブラジル	2,382,978,110	10.12
	南アフリカ	2,364,080,789	10.04
	インドネシア	2,297,696,166	9.76
	ポーランド	2,271,633,147	9.65
	トルコ	2,043,236,749	8.68
	マレーシア	1,948,647,597	8.27
	タイ	1,824,786,460	7.75
	コロンビア	1,758,488,255	7.47
	ロシア	1,507,669,462	6.40
	ハンガリー	1,179,536,877	5.01
	ペルー	518,157,613	2.20
	フィリピン	94,915,072	0.40
	チリ	27,499,090	0.12
	小計	22,666,229,477	96.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		885,518,739	3.76
合計(純資産総額)		23,551,748,216	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ.評価額上位銘柄明細



国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	16,500,000,000	4.08	673,623,678	4.08	673,935,339	7.750	2021/4/14	2.86
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	13,250,000,000	4.64	614,822,452	4.76	631,607,837	9.850	2027/6/28	2.68
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	13,200,000	3,463.43	457,173,179	3,615.86	477,293,962	10.000	2021/1/1	2.03
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000	3.43	444,325,378	3.49	452,945,079	4.375	2023/3/21	1.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	42,000,000	959.73	403,087,104	962.82	404,384,400	10.500	2026/12/21	1.72
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	97,700,000	341.26	333,411,806	339.49	331,682,477	3.875	2019/6/13	1.41
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	59,300,000	565.26	335,203,886	554.03	328,543,452	6.500	2021/6/10	1.39
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000	349.70	318,234,677	346.38	315,207,592	3.650	2021/12/17	1.34
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	8,450,000	3,394.70	286,852,217	3,591.02	303,441,616	10.000	2023/1/1	1.29
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/18	9,100,000	3,016.50	274,501,804	3,190.14	290,302,746	0.000	2018/7/1	1.23
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000	0.89	287,780,080	0.89	285,390,560	8.375	2024/3/15	1.21
メキシコ	国債証券	MBONO 5% 12/11/19	52,300,000	542.78	283,877,619	537.95	281,352,609	5.000	2019/12/11	1.19
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 10/01/18	8,450,000	3,034.69	256,432,097	3,116.87	263,376,352	0.000	2018/10/1	1.12
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000	354.04	263,764,366	347.98	259,251,727	3.625	2023/6/16	1.10
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000	3,526.60	238,045,513	3,632.65	245,204,039	10.000	2019/1/1	1.04
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	63,000,000	407.70	256,852,002	385.73	243,015,898	4.875	2029/6/22	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	36,650,000	687.38	251,926,474	657.02	240,798,398	10.000	2024/12/5	1.02
トルコ	国債証券	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,700,000	3,133.96	241,315,614	3,117.06	240,013,974	10.700	2021/2/17	1.02
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000	2,661.75	223,587,760	2,623.67	220,388,368	1.750	2021/7/25	0.94
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	7,900,000	2,617.45	206,779,098	2,765.29	218,458,687	0.000	2020/1/1	0.93
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	24,100,000,000	0.91	219,643,421	0.90	217,670,537	8.375	2026/9/15	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	60,400,000	368.08	222,322,941	355.44	214,688,991	3.850	2025/12/12	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	8,500,000	2,612.04	222,023,559	2,499.22	212,434,240	2.500	2026/7/25	0.90
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 07/15/21	23,400,000,000	0.89	208,834,061	0.88	206,009,681	8.250	2021/7/15	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 4.75% 06/14/18	37,000,000	555.08	205,382,217	551.35	204,000,397	4.750	2018/6/14	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/19	7,200,000	2,850.50	205,236,161	2,819.20	202,982,499	3.250	2019/7/25	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/18	7,100,000	2,792.11	198,240,041	2,782.74	197,574,625	2.500	2018/7/25	0.84
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	5,500,000	3,356.09	184,585,446	3,584.75	197,161,321	10.000	2025/1/1	0.84
インドネシア	国債証券	INDOGB 9% 03/15/29	21,500,000,000	0.93	200,430,785	0.91	196,903,073	9.000	2029/3/15	0.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	24,700,000	797.00	196,861,411	792.92	195,851,991	8.750	2048/2/28	0.83

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	96.24
合計	96.24

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 新興国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	韓国	4,587,962,649	14.28
	台湾	3,825,690,374	11.91
	ケイマン	3,715,249,969	11.57
	中国	3,284,270,051	10.22
	インド	2,667,270,930	8.30
	ブラジル	2,514,314,425	7.83
	南アフリカ	1,906,381,146	5.94
	ロシア	1,214,611,933	3.78
	香港	1,204,090,478	3.75
	メキシコ	1,069,885,452	3.33
	インドネシア	781,262,401	2.43
	マレーシア	752,914,278	2.34
	タイ	689,472,452	2.15
	ポーランド	387,567,008	1.21
	チリ	371,611,667	1.16
	フィリピン	359,362,161	1.12
	トルコ	320,992,780	1.00
	カタール	284,331,649	0.89
	バミューダ	274,333,527	0.85
	アラブ首長国連邦	268,466,606	0.84
コロンビア	127,164,435	0.40	
オランダ	114,924,771	0.36	
ギリシャ	110,822,831	0.35	
アメリカ	98,782,728	0.31	

	ハンガリー	94,126,658	0.29
	チェコ	61,350,638	0.19
	エジプト	30,757,465	0.10
	マン島	25,383,426	0.08
	ペルー	23,229,761	0.07
	マルタ共和国	13,091,285	0.04
	小計	31,179,675,934	97.07
投資信託受益証券	ブラジル	60,368,597	0.19
投資証券	南アフリカ	113,179,607	0.35
	メキシコ	30,823,772	0.10
	トルコ	13,236,592	0.04
	小計	157,239,971	0.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		723,111,506	2.25
合計(純資産総額)		32,120,396,008	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	776,684,260	2.42

(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		69,459,373	0.22
	売建		10,930,239	0.03

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

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

#### 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 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,463	159,584.43	1,031,394,198	189,348.49	1,223,759,355	3.81
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	369,300	2,933.04	1,083,174,950	3,047.90	1,125,589,470	3.50
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,593,389	666.29	1,061,669,358	691.74	1,102,210,907	3.43
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	72,965	10,881.41	793,962,370	11,661.21	850,860,625	2.65
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	28,435	18,756.96	533,354,182	18,429.29	524,036,941	1.63
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	5,444,620	80.17	436,544,854	92.21	502,102,856	1.56
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	399,500	1,257.41	502,338,731	1,254.97	501,362,512	1.56
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,795,515	66.46	318,744,938	73.66	353,237,635	1.10
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	17,688	19,021.45	336,451,571	19,469.50	344,376,573	1.07
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,017,311	294.68	299,785,525	327.56	333,240,564	1.04
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	212,821	1,334.10	283,924,829	1,447.48	308,055,163	0.96
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,198,200	49.36	256,586,946	56.98	296,219,427	0.92
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	182,125	1,099.42	200,232,858	1,275.86	232,367,386	0.72
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	99,064	2,272.41	225,114,935	2,324.93	230,317,163	0.72
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	411,180	513.17	211,007,894	517.94	212,968,559	0.66
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	176,228	1,151.69	202,961,083	1,208.46	212,965,758	0.66
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	347,000	581.98	201,948,396	606.10	210,316,700	0.65
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	121,050	1,620.91	196,211,398	1,710.95	207,111,224	0.64
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	299,300	648.34	194,050,796	645.09	193,076,754	0.60
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	85,812	1,707.05	146,485,998	2,093.74	179,668,103	0.56
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	28,801	5,389.37	155,219,326	6,083.86	175,221,482	0.55
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	ソフトウェア・サービス	4,995	28,349.36	141,605,061	33,966.10	169,660,697	0.53
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	36,626	3,945.17	144,495,980	4,577.00	167,637,202	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,111	125,369.99	139,286,069	148,155.49	164,600,760	0.51
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	470,000	276.37	129,893,900	348.72	163,900,750	0.51
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,181,000	138.35	163,400,363	134.12	158,401,625	0.49
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,085,540	67.68	141,163,946	72.60	151,415,418	0.47
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	10,030	13,332.99	133,729,989	14,775.74	148,200,772	0.46
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	42,534	2,828.63	120,313,068	3,466.84	147,458,913	0.46
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	265,640	599.18	159,167,307	548.90	145,812,134	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.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.29
		素材	7.37
		資本財	3.96
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.58
		自動車・自動車部品	3.31
		耐久消費財・アパレル	1.37
		消費者サービス	1.12
		メディア	2.28
		小売	2.09
		食品・生活必需品小売り	1.81
		食品・飲料・タバコ	3.80
		家庭用品・パーソナル用品	1.21
		ヘルスケア機器・サービス	0.63
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.81
		銀行	17.47
		各種金融	2.86
		保険	3.40
		不動産	2.09
		ソフトウェア・サービス	10.31
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.05
電気通信サービス	5.47		
公益事業	2.77		
半導体・半導体製造装置	4.89		
	小計	97.07	
投資信託受益証券			0.19
投資証券			0.49
合計			97.75

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	147	アメリカドル	6,573,294	739,889,972	6,900,180	776,684,260	2.42

(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	617,142.38	69,492,460	69,459,373	0.22
	アメリカドル	売建	80,000.00	8,973,600	9,004,000	0.03
	ブラジルリアル	売建	53,269.90	1,962,460	1,926,239	0.01

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

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

#### 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：2013年11月8日  
作成基準日：2017年2月28日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額	11,185円
純資産総額	6.75億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**分配の推移(1万口当たり、税引前)**

設定来分配金合計額:0円

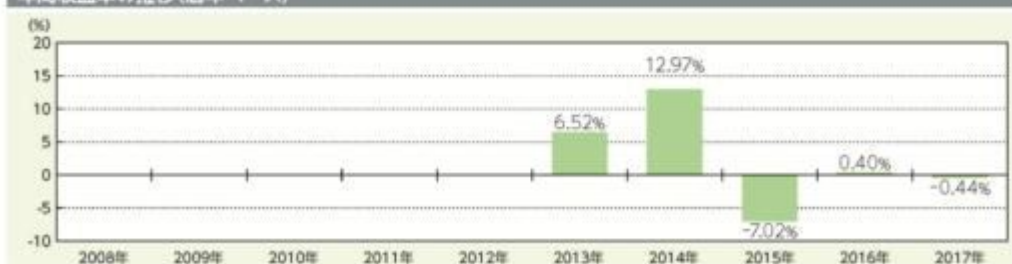
決算期	2014年1月	2015年1月	2016年1月	2017年1月	-
分配金	0円	0円	0円	0円	-

※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	種別	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	43.4%	T 2.5% 02/15/46 T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.4%
新興国債券 インデックス マザーファンド	22.6%	COLOM 7.75% 04/14/21 COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	7.750%	2021/04/14	0.7%
外国株式 インデックス マザーファンド	15.1%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
新興国株式 インデックス マザーファンド	7.9%	SAMSUNG ELECTRONICS CO.LTD TENCENT HOLDINGS LTD	韓国 ケイマン島	株式	テクノロジー/ソフトウェア ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	7.4%	第113回利付国債(5年) 第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	2.5%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 銀行業	-	-	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2017年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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

**< 申込コース >**

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

ります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替



機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

## ロンドンの銀行休業日

### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

### <一部解約の制限>

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

### <その他>

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

### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### <基準価額の算出方法>

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

#### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

#### イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

#### ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

##### （イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

##### （ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（平成25年11月 8日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は平成25年11月8日から平成26年1月20日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

## < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金(解約)請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金(解約)手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(平成28年 1月21日から平成29年 1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （平成28年 1月20日現在）	第4期 （平成29年 1月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	51,176
コール・ローン	11,601,531	10,986,534
親投資信託受益証券	528,507,954	667,509,028
未収利息	17	-
流動資産合計	540,109,502	678,546,738
資産合計	540,109,502	678,546,738
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,250,170	1,261,981
未払受託者報酬	150,608	171,431
未払委託者報酬	1,204,806	1,371,403
未払利息	-	23
その他未払費用	14,997	17,084
流動負債合計	2,620,581	2,821,922
負債合計	2,620,581	2,821,922
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	508,217,486	604,113,649
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,271,435	71,611,167
（分配準備積立金）	24,877,673	39,472,641
元本等合計	537,488,921	675,724,816
純資産合計	537,488,921	675,724,816
負債純資産合計	540,109,502	678,546,738

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日	自	平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日
営業収益				
受取利息		5,660		400
有価証券売買等損益		58,239,697		41,456,156
営業収益合計		58,234,037		41,456,556
営業費用				
支払利息		-		5,652
受託者報酬		272,791		323,336
委託者報酬		2,182,208		2,586,591
その他費用		27,149		32,867
営業費用合計		2,482,148		2,948,446
営業利益又は営業損失（ ）		60,716,185		38,508,110
経常利益又は経常損失（ ）		60,716,185		38,508,110
当期純利益又は当期純損失（ ）		60,716,185		38,508,110
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（ ）		1,555,959		2,273,664
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		55,972,552		29,271,435
剰余金増加額又は欠損金減少額		70,561,289		11,042,444
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		70,561,289		11,042,444
剰余金減少額又は欠損金増加額		38,102,180		4,937,158
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		38,102,180		4,937,158
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,271,435		71,611,167

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第3期 (平成28年 1月20日現在)	第4期 (平成29年 1月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	508,217,486口	604,113,649口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0576円 (10,576円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1185円 (11,185円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日			第4期 自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	14,487,123円	費用控除後の配当等収益額	A	18,078,092円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	21,252,771円	収益調整金額	C	33,798,097円
分配準備積立金額	D	10,390,550円	分配準備積立金額	D	21,394,549円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,130,444円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,270,738円
当ファンドの期末残存口数	F	508,217,486口	当ファンドの期末残存口数	F	604,113,649口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	907円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,212円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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4期 (平成29年 1月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第3期	第4期
	自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日	自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	321,421,941円	508,217,486円
期中追加設定元本額	400,244,016円	182,370,280円
期中一部解約元本額	213,448,471円	86,474,117円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 (平成28年 1月20日現在)	第4期 (平成29年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	57,327,640	36,925,663
合計	57,327,640	36,925,663

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	21,810,846	51,911,994
	国内株式インデックス マザーファンド	12,568,679	16,779,186
	外国株式インデックス マザーファンド	47,716,285	100,748,164
	国内債券インデックス マザーファンド	35,995,309	49,641,130
	外国債券インデックス マザーファンド	112,696,687	298,364,478
	新興国債券インデックス マザーファンド	95,454,536	150,064,076
合計		326,242,342	667,509,028

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	平成29年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,523,542
コール・ローン	756,433,683
国債証券	262,023,097,550
地方債証券	18,144,694,443
特殊債券	23,914,659,009
社債券	13,878,202,930
未収入金	406,901,000
未収利息	674,194,120
前払費用	13,697,172
流動資産合計	319,815,403,449
資産合計	319,815,403,449
負債の部	
流動負債	
未払金	400,000,000
未払解約金	297,057,690
未払利息	1,633
流動負債合計	697,059,323
負債合計	697,059,323
純資産の部	
元本等	

	平成29年 1月20日現在
項目	金額（円）
元本	231,388,249,721
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,730,094,405
元本等合計	319,118,344,126
純資産合計	319,118,344,126
負債純資産合計	319,815,403,449

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	231,388,249,721口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 105,280,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3791円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,791円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 1月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

平成29年 1月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)



該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	246,359,831,966円
期中追加設定元本額	41,678,276,594円
期中一部解約元本額	56,649,858,839円
期末元本額	231,388,249,721円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,940,238,184円
S B I 資産設計オープン（分配型）	20,803,609円
S M T 国内債券インデックス・オープン	8,466,302,979円
世界経済インデックスファンド	653,313,974円
マイセクション25	68,663,243円
マイセクション50	69,661,567円
マイセクション75	19,303,255円
D Cマイセクション25	15,290,195,120円
D Cマイセクション50	17,809,825,437円
D Cマイセクション75	4,700,671,949円
D C日本債券インデックス・オープン	440,793,190円
D C日本債券インデックス・オープンS	67,614,666,549円
D C日本債券インデックス・オープンP	29,433,872,911円
D CマイセクションS25	6,205,078,450円
D CマイセクションS50	7,003,580,869円
D CマイセクションS75	1,326,308,188円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,224,845,799円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	852,803,349円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	212,646,110円
D C世界経済インデックスファンド	807,537,397円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	457,720,039円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	9,660,484円

区分	平成29年 1月20日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	117,216,284円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,285,874円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	871,490円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	438,896,218円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	627,288,834円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	125,536,447円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	250,375,850円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,592,660,125円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,314,679,160円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,872,752,027円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,112,130,852円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	827,171,735円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,738,956,796円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,557,378,639円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,847,661,591円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,664,444,449円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	201,007,238円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,544,818,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	8,404,929,070円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,196,586,038円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,887,765,157円
分散投資コア戦略ファンドA	1,128,562,474円
分散投資コア戦略ファンドS	511,031,711円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	23,804,676円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	320,826,233円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	15,039,912,077円
コア投資戦略ファンド（切替型）	292,491,702円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	58,415,770円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,995,309円
SMT インデックスバランス・オープン	83,567,429円
債券コア戦略ファンド	11,957,488円
債券コア・セレクション	245,892,734円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	800,982,811円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	4,860,677,005円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,184,524,750
地方債証券	280,633,745

特殊債券	293,262,901
社債券	128,701,100
合計	8,887,122,496

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第3 6 2 回利付国債(2年)	1,390,000,000	1,396,421,800	
	第3 6 4 回利付国債(2年)	1,650,000,000	1,658,299,500	
	第3 6 5 回利付国債(2年)	400,000,000	402,060,000	
	第3 6 6 回利付国債(2年)	1,440,000,000	1,447,646,400	
	第3 6 7 回利付国債(2年)	2,300,000,000	2,312,926,000	
	第3 6 8 回利付国債(2年)	650,000,000	653,744,000	
	第3 6 9 回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,066,413,000	
	第3 7 0 回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,479,334,500	
	第3 7 1 回利付国債(2年)	970,000,000	976,353,500	
	第3 7 2 回利付国債(2年)	380,000,000	382,561,200	
	第1 0 9 回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,195,557,300	
	第1 1 0 回利付国債(5年)	700,000,000	704,886,000	
	第1 1 1 回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,209,768,000	
	第1 1 2 回利付国債(5年)	900,000,000	908,550,000	
	第1 1 3 回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,425,515,100	
	第1 1 4 回利付国債(5年)	810,000,000	817,395,300	
	第1 1 5 回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,468,105,500	
	第1 1 6 回利付国債(5年)	3,770,000,000	3,801,705,700	
	第1 1 7 回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,551,926,400	
	第1 1 8 回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,544,749,000	
第1 1 9 回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,007,480,000		

第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,587,315,200	
第121回利付国債(5年)	630,000,000	635,040,000	
第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,590,117,600	
第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,167,851,800	
第124回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,179,106,000	
第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,644,475,500	
第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,989,629,600	
第127回利付国債(5年)	3,350,000,000	3,384,974,000	
第128回利付国債(5年)	2,850,000,000	2,880,295,500	
第129回利付国債(5年)	3,700,000,000	3,740,700,000	
第130回利付国債(5年)	850,000,000	859,647,500	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	216,042,000	
第2回利付国債(40年)	420,000,000	584,568,600	
第3回利付国債(40年)	420,000,000	587,928,600	
第4回利付国債(40年)	630,000,000	886,788,000	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	663,146,400	
第6回利付国債(40年)	690,000,000	916,968,600	
第7回利付国債(40年)	730,000,000	927,450,400	
第8回利付国債(40年)	670,000,000	787,497,900	
第9回利付国債(40年)	540,000,000	455,895,000	
第290回利付国債(10年)	470,000,000	479,249,600	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	855,565,200	
第292回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,135,696,500	
第293回利付国債(10年)	190,000,000	195,549,900	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	185,005,800	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	102,499,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,160,879,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	577,511,200	
第298回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,595,492,500	
第299回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,280,721,600	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	860,842,800	
第301回利付国債(10年)	640,000,000	666,265,600	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	207,724,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,449,353,000	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	499,214,400	
第305回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,097,756,600	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,228,371,300	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	732,711,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,039,628,700	
第309回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,679,680,800	
第310回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,136,270,500	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	631,411,000	

第3 1 2 回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,758,176,000	代用有価証券 100,000,000円
第3 1 3 回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,526,558,400	
第3 1 4 回利付国債(10年)	810,000,000	851,925,600	
第3 1 5 回利付国債(10年)	900,000,000	953,208,000	
第3 1 6 回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,149,612,100	
第3 1 7 回利付国債(10年)	540,000,000	571,104,000	
第3 1 8 回利付国債(10年)	650,000,000	684,391,500	
第3 1 9 回利付国債(10年)	870,000,000	922,356,600	
第3 2 0 回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,181,880,000	
第3 2 1 回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,734,283,600	
第3 2 2 回利付国債(10年)	750,000,000	789,232,500	
第3 2 3 回利付国債(10年)	970,000,000	1,023,243,300	
第3 2 4 回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,899,504,500	
第3 2 5 回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,407,202,200	
第3 2 6 回利付国債(10年)	600,000,000	628,134,000	
第3 2 7 回利付国債(10年)	740,000,000	779,086,800	
第3 2 8 回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,792,842,000	
第3 2 9 回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,848,507,500	
第3 3 0 回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,629,027,400	
第3 3 1 回利付国債(10年)	680,000,000	710,219,200	
第3 3 2 回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,414,850,900	
第3 3 3 回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,153,771,200	
第3 3 4 回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,541,682,800	
第3 3 5 回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,379,447,400	
第3 3 6 回利付国債(10年)	730,000,000	759,148,900	
第3 3 7 回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,382,548,500	
第3 3 8 回利付国債(10年)	2,150,000,000	2,220,090,000	
第3 3 9 回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,180,839,200	
第3 4 0 回利付国債(10年)	2,840,000,000	2,934,486,800	
第3 4 1 回利付国債(10年)	2,710,000,000	2,777,424,800	
第3 4 2 回利付国債(10年)	3,000,000,000	3,019,140,000	
第3 4 3 回利付国債(10年)	2,810,000,000	2,827,112,900	
第3 4 4 回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,934,016,000	
第3 4 5 回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,726,759,600	
第1 回利付国債(30年)	40,000,000	52,999,600	
第2 回利付国債(30年)	160,000,000	204,977,600	
第3 回利付国債(30年)	120,000,000	152,590,800	
第4 回利付国債(30年)	110,000,000	149,443,800	
第5 回利付国債(30年)	50,000,000	63,346,000	
第6 回利付国債(30年)	190,000,000	246,971,500	
第7 回利付国債(30年)	180,000,000	232,210,800	
第8 回利付国債(30年)	50,000,000	60,872,500	

第9回利付国債(30年)	240,000,000	277,336,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,393,600	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,175,500	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	240,621,700	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	362,891,500	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,028,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	453,951,000	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	494,863,900	
第17回利付国債(30年)	330,000,000	436,260,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	450,583,800	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	365,859,200	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	563,812,200	
第21回利付国債(30年)	270,000,000	353,327,400	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	537,936,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	579,033,700	
第24回利付国債(30年)	260,000,000	350,238,200	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	380,361,100	
第26回利付国債(30年)	610,000,000	811,763,600	
第27回利付国債(30年)	830,000,000	1,124,973,700	
第28回利付国債(30年)	690,000,000	938,696,700	
第29回利付国債(30年)	760,000,000	1,023,150,000	
第30回利付国債(30年)	770,000,000	1,024,931,600	
第31回利付国債(30年)	740,000,000	973,218,400	
第32回利付国債(30年)	880,000,000	1,179,296,800	
第33回利付国債(30年)	920,000,000	1,178,262,400	
第34回利付国債(30年)	995,000,000	1,322,444,550	
第35回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,494,346,800	
第36回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,421,002,000	
第37回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,475,578,000	
第38回利付国債(30年)	590,000,000	738,349,600	
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,072,990,800	
第40回利付国債(30年)	630,000,000	790,108,200	
第41回利付国債(30年)	580,000,000	714,548,400	
第42回利付国債(30年)	650,000,000	801,034,000	
第43回利付国債(30年)	750,000,000	924,562,500	
第44回利付国債(30年)	720,000,000	887,846,400	
第45回利付国債(30年)	670,000,000	793,273,300	
第46回利付国債(30年)	750,000,000	889,005,000	
第47回利付国債(30年)	820,000,000	993,667,800	
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,277,672,000	
第49回利付国債(30年)	710,000,000	825,509,900	
第50回利付国債(30年)	720,000,000	725,140,800	

第5 1 回利付国債(30年)	1,090,000,000	954,589,300
第5 2 回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,030,179,900
第5 3 回利付国債(30年)	460,000,000	438,324,800
第3 8 回利付国債(20年)	20,000,000	20,693,800
第3 9 回利付国債(20年)	500,000,000	516,770,000
第4 0 回利付国債(20年)	100,000,000	104,219,000
第4 1 回利付国債(20年)	330,000,000	342,226,500
第4 2 回利付国債(20年)	80,000,000	84,865,600
第4 3 回利付国債(20年)	140,000,000	151,562,600
第4 4 回利付国債(20年)	170,000,000	184,376,900
第4 5 回利付国債(20年)	290,000,000	313,606,000
第4 6 回利付国債(20年)	170,000,000	183,780,200
第4 7 回利付国債(20年)	90,000,000	97,795,800
第4 8 回利付国債(20年)	130,000,000	143,481,000
第4 9 回利付国債(20年)	140,000,000	153,077,400
第5 0 回利付国債(20年)	220,000,000	238,711,000
第5 1 回利付国債(20年)	100,000,000	109,413,000
第5 2 回利付国債(20年)	110,000,000	121,465,300
第5 3 回利付国債(20年)	80,000,000	88,760,800
第5 4 回利付国債(20年)	200,000,000	222,888,000
第5 5 回利付国債(20年)	140,000,000	155,309,000
第5 6 回利付国債(20年)	150,000,000	167,155,500
第5 7 回利付国債(20年)	240,000,000	266,145,600
第5 8 回利付国債(20年)	300,000,000	334,026,000
第5 9 回利付国債(20年)	200,000,000	221,248,000
第6 0 回利付国債(20年)	350,000,000	380,954,000
第6 1 回利付国債(20年)	240,000,000	256,099,200
第6 2 回利付国債(20年)	320,000,000	337,904,000
第6 3 回利付国債(20年)	200,000,000	224,054,000
第6 4 回利付国債(20年)	320,000,000	361,904,000
第6 5 回利付国債(20年)	220,000,000	249,893,600
第6 6 回利付国債(20年)	330,000,000	372,553,500
第6 7 回利付国債(20年)	130,000,000	148,085,600
第6 8 回利付国債(20年)	190,000,000	220,519,700
第6 9 回利付国債(20年)	390,000,000	449,849,400
第7 0 回利付国債(20年)	400,000,000	471,764,000
第7 1 回利付国債(20年)	200,000,000	232,916,000
第7 2 回利付国債(20年)	630,000,000	731,549,700
第7 3 回利付国債(20年)	360,000,000	417,074,400
第7 4 回利付国債(20年)	200,000,000	233,288,000
第7 5 回利付国債(20年)	130,000,000	152,250,800
第7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	311,812,200
第7 7 回利付国債(20年)	290,000,000	337,272,900

第78回利付国債(20年)	170,000,000	196,973,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	315,108,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	258,601,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	456,912,300	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	708,126,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	343,612,300	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	552,710,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	344,937,600	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	253,617,000	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	659,213,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	508,914,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	420,815,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	760,510,800	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	547,546,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,057,267,200	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	489,753,200	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	734,806,000	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	749,324,000	
第96回利付国債(20年)	320,000,000	386,486,400	
第97回利付国債(20年)	540,000,000	659,896,200	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	533,051,200	
第99回利付国債(20年)	870,000,000	1,057,110,900	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	590,179,200	
第101回利付国債(20年)	415,000,000	519,397,400	
第102回利付国債(20年)	320,000,000	401,843,200	
第103回利付国債(20年)	360,000,000	448,027,200	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	439,930,800	
第105回利付国債(20年)	760,000,000	931,349,600	
第106回利付国債(20年)	330,000,000	408,190,200	
第107回利付国債(20年)	150,000,000	184,207,500	
第108回利付国債(20年)	610,000,000	734,842,600	
第109回利付国債(20年)	440,000,000	531,251,600	
第110回利付国債(20年)	790,000,000	972,663,800	
第111回利付国債(20年)	290,000,000	361,505,300	
第112回利付国債(20年)	850,000,000	1,049,265,500	
第113回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,447,945,200	
第114回利付国債(20年)	590,000,000	731,936,300	
第115回利付国債(20年)	670,000,000	839,617,200	
第116回利付国債(20年)	650,000,000	816,049,000	
第117回利付国債(20年)	820,000,000	1,018,981,200	
第118回利付国債(20年)	690,000,000	849,893,700	
第119回利付国債(20年)	380,000,000	458,162,200	



第120回利付国債(20年)	330,000,000	389,033,700	
第121回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,330,105,200	
第122回利付国債(20年)	280,000,000	337,974,000	
第123回利付国債(20年)	920,000,000	1,149,466,400	
第124回利付国債(20年)	390,000,000	482,028,300	
第125回利付国債(20年)	460,000,000	582,194,400	
第126回利付国債(20年)	570,000,000	705,363,600	
第127回利付国債(20年)	460,000,000	562,961,800	
第128回利付国債(20年)	820,000,000	1,004,598,400	
第129回利付国債(20年)	300,000,000	363,381,000	
第130回利付国債(20年)	630,000,000	763,723,800	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	455,316,000	
第132回利付国債(20年)	630,000,000	755,288,100	
第133回利付国債(20年)	680,000,000	824,921,600	
第134回利付国債(20年)	560,000,000	679,761,600	
第135回利付国債(20年)	450,000,000	539,734,500	
第136回利付国債(20年)	410,000,000	485,833,600	
第137回利付国債(20年)	290,000,000	348,234,900	
第138回利付国債(20年)	390,000,000	456,545,700	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	604,492,800	
第140回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,572,471,600	
第141回利付国債(20年)	360,000,000	432,565,200	
第142回利付国債(20年)	820,000,000	997,620,200	
第143回利付国債(20年)	850,000,000	1,008,559,000	
第144回利付国債(20年)	590,000,000	690,547,800	
第145回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,658,691,000	
第146回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,718,931,500	
第147回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,625,148,800	
第148回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,554,823,200	
第149回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,741,079,900	
第150回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,508,596,000	
第151回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,530,098,200	
第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,517,148,000	
第153回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,482,854,500	
第154回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,346,475,900	
第155回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,645,071,300	
第156回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,052,547,600	
第157回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,482,320,000	
第158回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,625,090,200	
第159回利付国債(20年)	470,000,000	467,504,300	
第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	200,534,000	
国債証券合計	239,775,000,000	262,023,097,550	

地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,677,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,371,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	129,892,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,404,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,453,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,465,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,634,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,736,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	104,994,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	105,268,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	104,775,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	210,326,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	104,460,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,753,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	105,409,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	104,140,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,718,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,340,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,284,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,565,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	133,890,000	
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,162,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,943,000	
	第172回神奈川県公募公債	200,000,000	208,404,000	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	205,180,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,440,000	
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	236,974,000	
	第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,855,000	
	第322回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,366,000	
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,947,000	
	第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,894,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,859,000	
	第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,308,000	
	第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,100,000	
	第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,116,000	
	第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,218,000	
	第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,950,000	
	平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	104,245,000	
	平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,273,000	
	平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,947,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,475,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	107,294,000		

第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,418,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,630,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	104,662,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,978,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,602,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	114,437,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	102,648,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,654,882	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	104,914,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,924,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,178,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	123,181,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	209,140,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,899,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,284,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,934,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,693,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,154,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	122,999,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,586,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,535,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,692,000	
平成20年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,063,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,048,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	203,124,780	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,443,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,866,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,065,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,856,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	121,143,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	210,514,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	127,150,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,996,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,401,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,612,800	

平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,193,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,435,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,454,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,340,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,705,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,721,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,690,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,447,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	155,871,621	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,375,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,908,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,977,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,246,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	376,911,440	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,139,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,261,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,146,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,441,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,672,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,515,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,046,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,240,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,062,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,178,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,058,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,564,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,297,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,769,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,469,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,989,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,510,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,974,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,238,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	208,902,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,870,000	
第13回回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	243,248,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	104,348,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	132,286,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	120,085,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	119,059,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,184,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,050,420	

	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,301,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,448,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,927,000	
	平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,156,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,972,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	121,288,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	207,314,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,343,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,040,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,514,000	
	平成25年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	100,442,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,426,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,597,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	103,408,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	104,038,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,594,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	206,524,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,292,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	156,243,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,634,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	210,360,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,252,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	120,777,000	
	地方債券合計	16,924,590,000	18,144,694,443	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,858,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,137,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,133,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,604,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,858,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,008,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,097,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,913,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	482,384,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,019,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,551,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,069,000	

第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,263,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,617,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,264,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,704,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,693,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	30,494,400	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	112,952,490	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,609,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	185,736,770	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,011,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,146,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,423,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,858,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,709,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,958,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,083,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,067,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	144,087,180	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,555,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,526,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,667,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,503,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,502,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,072,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,576,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,848,000	
	100,000,000	104,893,000	

第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,632,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,071,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,649,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,254,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	314,984,460	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,882,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,984,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,614,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,347,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,027,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,057,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,021,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,280,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,844,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,634,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,426,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	155,903,200	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,408,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,992,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	106,689,960	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,476,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,169,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,745,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,201,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,102,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	207,666,100	

第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,633,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,977,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,502,000	
第2回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,382,000	
第3回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	328,842,000	
第3回公営企業債券(20年)	110,000,000	116,625,300	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	109,461,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,062,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	133,465,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	46,167,200	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,390,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,528,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,788,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,778,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,538,030	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,742,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,500,460	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,633,780	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,018,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,626,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,633,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	522,325,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,513,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,982,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,411,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,852,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,516,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,044,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,630,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,066,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,365,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,813,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	81,328,800	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	104,532,980	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,929,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,705,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	116,397,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,888,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,184,200	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,097,000	23,454,860	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,401,000	21,769,499	



第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,909,000	22,494,738	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,547,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,108,000	24,733,185	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,300,000	23,813,278	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,854,000	18,708,492	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	37,390,000	39,903,729	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,673,000	22,993,969	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,759,000	21,081,667	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,083,000	24,532,150	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,507,000	20,825,673	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,823,000	24,111,586	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,986,000	28,014,706	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,393,000	28,401,062	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,483,000	34,120,645	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,178,000	34,963,327	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,273,000	37,257,150	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,638,000	41,486,393	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,205,000	44,183,709	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,899,000	44,779,556	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,560,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,910,000	95,011,004	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,361,000	22,460,237	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,321,000	50,352,856	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,490,000	22,579,972	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,384,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,255,000	22,743,062	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,051,000	56,635,125	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,355,000	20,634,365	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,535,000	57,302,257	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,880,000	54,572,870	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,978,000	23,563,712	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,920,000	106,101,051	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,719,000	58,120,880	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,178,000	23,625,558	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,217,000	69,745,703	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,142,000	67,582,576	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,470,000	67,983,615	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,786,000	

第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,392,000	141,025,589	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,200,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,306,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,204,000	148,803,276	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,486,000	75,198,426	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,389,000	75,823,858	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,899,000	77,508,966	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,496,000	70,731,758	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,165,000	71,837,535	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,449,000	77,283,037	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,518,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,568,000	71,215,410	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,524,000	78,212,654	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,078,000	79,869,765	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,042,000	78,520,208	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,975,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,138,000	165,254,409	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,757,000	82,940,669	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,036,000	169,486,228	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,172,000	89,340,839	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,842,000	91,723,291	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,148,000	91,561,236	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,362,000	186,830,064	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,902,000	93,369,989	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,438,000	98,059,681	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,047,000	98,494,317	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,388,000	98,533,263	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,233,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,861,000	99,491,514	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,234,000	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,000,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	124,837,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	120,134,000	
い第756号商工債	100,000,000	100,400,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,637,000	
い第786号商工債	300,000,000	302,142,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,912,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,681,000	

	い第780号農林債	100,000,000	100,836,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,933,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,868,000	
	第290回信金中金債(5年)	100,000,000	100,594,000	
	第299回信金中金債(5年)	100,000,000	100,526,000	
	第300回信金中金債(5年)	300,000,000	301,839,000	
	第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,745,000	
	第309回信金中金債(5年)	100,000,000	100,774,000	
	第317回信金中金債(5年)	200,000,000	200,188,000	
	第201号商工債(3年)	300,000,000	300,003,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,979,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,756,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,371,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,478,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	209,090,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,151,000	
	特殊債券合計	22,475,524,000	23,914,659,009	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,302,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,894,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,080,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	100,077,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	99,575,000	
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,627,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,323,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,299,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,554,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,259,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,311,000	
	第9回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	100,450,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,104,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,136,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,378,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,022,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,331,000	

第10回日本たばこ産業株式会社債	100,000,000	101,189,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,387,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,565,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,720,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,530,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,810,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,716,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,059,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,618,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,327,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,323,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,932,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,143,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,147,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,806,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	203,280,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,765,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,538,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,092,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,539,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,020,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,543,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,769,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,862,000	
第6回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,485,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,313,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,502,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,398,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,829,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,433,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,627,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,878,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,558,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,997,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	126,669,000	
	100,000,000	104,220,000	

第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)			
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,076,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	120,621,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,989,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,759,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,278,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	102,493,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,121,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,511,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,391,000	
第36回株式会社みずほ銀行無担保社債	300,000,000	301,941,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,078,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,924,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,483,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,819,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,155,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,063,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,480,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,967,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,687,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,883,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,460,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,775,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,406,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,713,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,023,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,252,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,117,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,616,000	

第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,834,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,792,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,069,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,470,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,262,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	247,266,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,126,860	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	123,216,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,835,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,208,800	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,931,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,090,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,764,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	104,325,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,776,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,017,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,669,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	123,882,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,494,500	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,866,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,557,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,803,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,534,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,117,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,065,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,022,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,459,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,861,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,550,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,889,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,123,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,590,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,287,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,894,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	133,430,220	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,185,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,905,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,628,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,978,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,870,000	

第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,772,550	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,823,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,126,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,692,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,742,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,014,000	
社債券合計	13,396,000,000	13,878,202,930	
合計		317,960,653,932	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成29年 1月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,015,069
コール・ローン	1,291,314,518
株式	155,434,240,080
派生商品評価勘定	7,233,820
未収入金	646,853,154
未収配当金	208,119,182
差入委託証拠金	89,460,000
流動資産合計	157,683,235,823
資産合計	157,683,235,823
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,118,160
前受金	6,121,600
未払金	9,427,121
未払解約金	283,895,892
未払利息	2,787
流動負債合計	300,565,560
負債合計	300,565,560
純資産の部	
元本等	
元本	117,889,777,095
剰余金	

	平成29年 1月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	39,492,893,168
元本等合計	157,382,670,263
純資産合計	157,382,670,263
負債純資産合計	157,683,235,823

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,889,777,095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	<p>1口当たり純資産額 1.3350円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,350円)</p>

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項



	平成29年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

平成29年 1月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	117,031,123,296円
期中追加設定元本額	27,188,763,081円
期中一部解約元本額	26,330,109,282円
期末元本額	117,889,777,095円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	898,213,142円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,965,959,349円
SBI資産設計オープン（分配型）	27,497,453円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,108,031,918円
世界経済インデックスファンド	826,598,452円
マイセクション25	24,127,745円
マイセクション50	65,106,840円
マイセクション75	59,201,920円
日本株式インデックス・オープン	11,765,786,902円
DCマイセクション25	5,499,048,928円

区分	平成29年 1月20日現在
DCマイセレクション50	16,768,884,869円
DCマイセレクション75	15,542,730,048円
DC日本株式インデックス・オープン	4,841,270,880円
DCマイセレクションS25	2,239,456,853円
DCマイセレクションS50	6,552,100,192円
DCマイセレクションS75	4,243,360,819円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,764,052,115円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	513,423,403円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	551,814,062円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	330,112,994円
DC世界経済インデックスファンド	1,068,289,135円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	311,550,018円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	29,772,759円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	106,068,627円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	61,680,121円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	683,827,003円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,952,304円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	230,445,995円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	811,544,940円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	136,899,476円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	936,085,607円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,842,599,347円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,104,583,722円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,001,745,757円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	970,316,659円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	393,457,305円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,213,967,485円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,365,533,076円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	654,119,118円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	939,468,731円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	72,722,541円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,463,736,334円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,033,468,970円
日本株式ファンド・シリーズ2	908,838,998円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	85,626,102円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	107,532,894円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	198,813,884円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,568,679円
SMT インデックスバランス・オープン	88,776,001円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	3,466,006,623円

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		17,496,775,493
合計		17,496,775,493

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

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(平成29年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,929,874,340	-	1,935,990,000	6,115,660
	合計	1,929,874,340	-	1,935,990,000	6,115,660

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,100	2,737.00	8,484,700	
日本水産	101,200	545.00	55,154,000	
マルハニチロ	14,800	3,190.00	47,212,000	
カネコ種苗	2,700	1,512.00	4,082,400	
サカタのタネ	11,500	3,300.00	37,950,000	
ホクト	7,900	2,053.00	16,218,700	
ホクリヨウ	800	732.00	585,600	
住石ホールディングス	21,600	98.00	2,116,800	
日鉄鉱業	2,200	5,670.00	12,474,000	
三井松島産業	4,800	1,377.00	6,609,600	
国際石油開発帝石	410,300	1,153.00	473,075,900	
日本海洋掘削	2,700	2,400.00	6,480,000	

石油資源開発	12,300	2,583.00	31,770,900
K & O エナジーグループ	5,200	1,752.00	9,110,400
ショーボンドホールディングス	8,200	4,860.00	39,852,000
ミライト・ホールディングス	24,000	1,052.00	25,248,000
タマホーム	5,800	546.00	3,166,800
サンヨーホームズ	1,600	648.00	1,036,800
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,605.00	2,889,000
安藤・間	56,000	767.00	42,952,000
東急建設	27,700	906.00	25,096,200
コムシスホールディングス	30,400	2,136.00	64,934,400
ミサワホーム	9,400	1,092.00	10,264,800
ビーアールホールディングス	7,700	274.00	2,109,800
高松コンストラクショングループ	5,900	2,511.00	14,814,900
東建コーポレーション	3,200	8,050.00	25,760,000
ソネック	1,000	635.00	635,000
ヤマウラ	3,700	574.00	2,123,800
大成建設	396,000	818.00	323,928,000
大林組	233,600	1,070.00	249,952,000
清水建設	238,000	1,049.00	249,662,000
飛鳥建設	76,200	180.00	13,716,000
長谷工コーポレーション	90,900	1,284.00	116,715,600
松井建設	8,700	1,073.00	9,335,100
銭高組	11,000	470.00	5,170,000
鹿島建設	342,000	796.00	272,232,000
不動テトラ	63,600	209.00	13,292,400
大末建設	2,700	971.00	2,621,700
鉄建建設	48,000	335.00	16,080,000
西松建設	90,000	560.00	50,400,000
三井住友建設	298,500	123.00	36,715,500
大豊建設	28,000	534.00	14,952,000
前田建設工業	48,000	988.00	47,424,000
佐田建設	5,500	440.00	2,420,000
ナカノフドー建設	6,200	602.00	3,732,400
奥村組	64,000	668.00	42,752,000
東鉄工業	9,400	3,170.00	29,798,000
イチケン	7,000	450.00	3,150,000
浅沼組	25,000	355.00	8,875,000
戸田建設	91,000	622.00	56,602,000
熊谷組	122,000	328.00	40,016,000
青木あすなろ建設	5,100	793.00	4,044,300
北野建設	16,000	317.00	5,072,000
植木組	10,000	259.00	2,590,000

三井ホーム	10,000	557.00	5,570,000
矢作建設工業	10,600	1,100.00	11,660,000
ピーエス三菱	8,400	390.00	3,276,000
日本ハウスホールディングス	15,900	524.00	8,331,600
大東建託	28,700	16,665.00	478,285,500
新日本建設	9,400	904.00	8,497,600
N I P P O	18,000	2,121.00	38,178,000
東亜道路工業	15,000	348.00	5,220,000
前田道路	24,000	1,964.00	47,136,000
日本道路	23,000	443.00	10,189,000
東亜建設工業	6,300	1,838.00	11,579,400
若築建設	45,000	152.00	6,840,000
東洋建設	22,400	409.00	9,161,600
五洋建設	86,400	561.00	48,470,400
大林道路	8,100	697.00	5,645,700
世紀東急工業	11,300	496.00	5,604,800
福田組	13,000	1,101.00	14,313,000
住友林業	53,600	1,558.00	83,508,800
日本基礎技術	8,700	353.00	3,071,100
日成ビルド工業	23,000	549.00	12,627,000
巴コーポレーション	9,800	359.00	3,518,200
パナホーム	29,000	970.00	28,130,000
大和ハウス工業	230,100	3,134.00	721,133,400
ライト工業	15,000	1,206.00	18,090,000
積水ハウス	245,100	1,914.50	469,243,950
日特建設	6,600	473.00	3,121,800
北陸電気工事	3,800	906.00	3,442,800
ユアテック	12,000	800.00	9,600,000
西部電気工業	1,300	2,263.00	2,941,900
四電工	6,000	443.00	2,658,000
中電工	9,800	2,527.00	24,764,600
関電工	31,000	1,040.00	32,240,000
きんでん	51,800	1,481.00	76,715,800
東京エネシス	8,000	1,033.00	8,264,000
トーエネック	11,000	581.00	6,391,000
住友電設	5,400	1,322.00	7,138,800
日本電設工業	12,700	1,831.00	23,253,700
協和エクシオ	30,500	1,709.00	52,124,500
新日本空調	6,100	1,268.00	7,734,800
N D S	1,200	2,932.00	3,518,400
九電工	15,100	3,080.00	46,508,000
三機工業	17,300	962.00	16,642,600

日揮	72,700	2,104.00	152,960,800
中外炉工業	24,000	228.00	5,472,000
ヤマト	7,000	575.00	4,025,000
太平電業	11,000	1,124.00	12,364,000
高砂熱学工業	21,400	1,559.00	33,362,600
三晃金属工業	700	3,220.00	2,254,000
朝日工業社	1,800	2,937.00	5,286,600
明星工業	14,100	582.00	8,206,200
大気社	10,300	2,858.00	29,437,400
ダイダン	10,000	971.00	9,710,000
日比谷総合設備	8,700	1,689.00	14,694,300
東芝プラントシステム	12,700	1,648.00	20,929,600
O S J Bホールディングス	23,800	257.00	6,116,600
東洋エンジニアリング	46,000	302.00	13,892,000
千代田化工建設	56,000	838.00	46,928,000
新興プランテック	16,000	828.00	13,248,000
日本製粉	23,200	1,619.00	37,560,800
日清製粉グループ本社	85,400	1,720.00	146,888,000
日東富士製粉	500	3,860.00	1,930,000
昭和産業	32,000	602.00	19,264,000
鳥越製粉	6,200	797.00	4,941,400
中部飼料	8,500	1,041.00	8,848,500
フィード・ワン	46,900	170.00	7,973,000
東洋精糖	12,000	115.00	1,380,000
日本甜菜製糖	4,000	2,372.00	9,488,000
三井製糖	5,500	2,510.00	13,805,000
塩水港精糖	8,300	248.00	2,058,400
日新製糖	3,300	1,701.00	5,613,300
森永製菓	15,200	4,640.00	70,528,000
中村屋	1,800	5,020.00	9,036,000
江崎グリコ	19,500	5,080.00	99,060,000
名糖産業	3,400	1,408.00	4,787,200
不二家	45,000	219.00	9,855,000
山崎製パン	57,100	2,198.00	125,505,800
第一屋製パン	12,000	133.00	1,596,000
モロゾフ	12,000	516.00	6,192,000
亀田製菓	4,300	5,310.00	22,833,000
寿スピリッツ	5,500	2,692.00	14,806,000
カルビー	31,800	3,520.00	111,936,000
森永乳業	70,000	788.00	55,160,000
六甲バター	3,500	2,354.00	8,239,000
ヤクルト本社	41,800	5,340.00	223,212,000

明治ホールディングス	46,100	8,770.00	404,297,000
雪印メグミルク	16,800	3,015.00	50,652,000
プリマハム	49,000	417.00	20,433,000
日本ハム	53,000	3,105.00	164,565,000
林兼産業	2,500	858.00	2,145,000
丸大食品	37,000	494.00	18,278,000
S Foods	4,200	3,075.00	12,915,000
伊藤ハム米久ホールディングス	44,900	1,014.00	45,528,600
サッポロホールディングス	25,500	2,941.00	74,995,500
アサヒグループホールディングス	146,100	3,715.00	542,761,500
キリンホールディングス	335,400	1,895.00	635,583,000
宝ホールディングス	56,400	1,029.00	58,035,600
オエノンホールディングス	20,000	272.00	5,440,000
養命酒製造	2,400	1,896.00	4,550,400
コカ・コーラウエスト	26,400	3,315.00	87,516,000
コカ・コーライーストジャパン	30,300	2,473.00	74,931,900
サントリー食品インターナショナル	53,400	4,825.00	257,655,000
ダイドードリンコ	3,600	5,980.00	21,528,000
伊藤園	23,100	3,800.00	87,780,000
キーコーヒー	6,900	2,213.00	15,269,700
ユニカフェ	2,100	972.00	2,041,200
ジャパンフーズ	1,000	1,271.00	1,271,000
日清オイリオグループ	45,000	540.00	24,300,000
不二製油グループ本社	20,800	2,336.00	48,588,800
かどや製油	800	3,945.00	3,156,000
J - オイルミルズ	3,600	3,920.00	14,112,000
キッコーマン	54,000	3,585.00	193,590,000
味の素	160,500	2,264.00	363,372,000
キューピー	39,600	2,808.00	111,196,800
ハウス食品グループ本社	28,800	2,409.00	69,379,200
カゴメ	28,000	2,851.00	79,828,000
焼津水産化学工業	3,700	1,206.00	4,462,200
アリアケジャパン	6,400	6,040.00	38,656,000
ピエトロ	900	1,664.00	1,497,600
エバラ食品工業	1,900	2,079.00	3,950,100
ニチレイ	38,300	2,360.00	90,388,000
東洋水産	38,300	4,055.00	155,306,500
イトアンド	900	2,174.00	1,956,600
大冷	600	1,751.00	1,050,600
日清食品ホールディングス	30,400	6,080.00	184,832,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,417.00	9,919,000
一正蒲鉾	2,700	1,134.00	3,061,800



フジッコ	7,600	2,351.00	17,867,600
ロック・フィールド	8,100	1,548.00	12,538,800
日本たばこ産業	431,700	3,764.00	1,624,918,800
ケンコーマヨネーズ	2,800	3,050.00	8,540,000
わらべや日洋ホールディングス	4,600	2,444.00	11,242,400
なとり	3,900	1,876.00	7,316,400
北の達人コーポレーション	1,700	533.00	906,100
ユーグレナ	25,100	1,198.00	30,069,800
ミヨシ油脂	27,000	143.00	3,861,000
理研ビタミン	2,300	4,460.00	10,258,000
片倉工業	9,200	1,330.00	12,236,000
ゲンゼ	54,000	379.00	20,466,000
東洋紡	289,000	187.00	54,043,000
ユニチカ	200,000	81.00	16,200,000
富士紡ホールディングス	3,600	3,440.00	12,384,000
倉敷紡績	74,000	237.00	17,538,000
シキボウ	39,000	159.00	6,201,000
日本毛織	20,600	884.00	18,210,400
トーア紡コーポレーション	3,100	542.00	1,680,200
ダイドーリミテッド	8,200	417.00	3,419,400
帝国繊維	7,600	1,521.00	11,559,600
帝人	59,500	2,407.00	143,216,500
東レ	528,000	978.00	516,384,000
サカイオーベックス	1,800	1,786.00	3,214,800
住江織物	18,000	274.00	4,932,000
日本フェルト	4,200	512.00	2,150,400
イチカワ	5,000	303.00	1,515,000
日東製網	800	2,064.00	1,651,200
アツギ	60,000	126.00	7,560,000
ダイニック	14,000	191.00	2,674,000
セーレン	18,200	1,419.00	25,825,800
ソトー	2,900	1,157.00	3,355,300
東海染工	13,000	141.00	1,833,000
小松精練	10,600	732.00	7,759,200
ワコールホールディングス	43,000	1,351.00	58,093,000
ホギメディカル	4,600	6,830.00	31,418,000
レナウン	19,700	117.00	2,304,900
クラウディア	2,500	539.00	1,347,500
T S Iホールディングス	30,000	812.00	24,360,000
三陽商会	42,000	175.00	7,350,000
オンワードホールディングス	47,000	846.00	39,762,000
ルック	17,000	173.00	2,941,000

ゴールドウイン	3,200	5,270.00	16,864,000	
デサント	16,800	1,335.00	22,428,000	
キング	3,700	411.00	1,520,700	
ヤマトインターナショナル	4,500	409.00	1,840,500	
特種東海製紙	4,200	4,000.00	16,800,000	
王子ホールディングス	285,000	503.00	143,355,000	
日本製紙	32,600	2,082.00	67,873,200	
三菱製紙	10,400	786.00	8,174,400	
北越紀州製紙	40,700	677.00	27,553,900	
中越パルプ工業	29,000	244.00	7,076,000	
巴川製紙所	11,000	227.00	2,497,000	
大王製紙	29,000	1,316.00	38,164,000	
阿波製紙	1,300	615.00	799,500	
レンゴー	70,200	670.00	47,034,000	
トーモク	23,000	335.00	7,705,000	
ザ・パック	5,200	2,815.00	14,638,000	
クラレ	122,600	1,771.00	217,124,600	
旭化成	454,000	1,035.00	469,890,000	
共和レザー	4,300	874.00	3,758,200	
昭和電工	48,500	1,751.00	84,923,500	
住友化学	536,000	576.00	308,736,000	
住友精化	3,000	4,540.00	13,620,000	
日産化学工業	39,900	3,925.00	156,607,500	
ラサ工業	27,000	135.00	3,645,000	
クレハ	5,500	4,615.00	25,382,500	
多木化学	5,000	814.00	4,070,000	
テイカ	11,000	687.00	7,557,000	
石原産業	13,100	929.00	12,169,900	
片倉コープアグリ	10,000	234.00	2,340,000	
日東エフシー	4,300	935.00	4,020,500	
日本曹達	44,000	553.00	24,332,000	
東ソー	211,000	839.00	177,029,000	
トクヤマ	113,000	479.00	54,127,000	
セントラル硝子	74,000	543.00	40,182,000	
東亜合成	45,600	1,196.00	54,537,600	
大阪ソーダ	31,000	488.00	15,128,000	
関東電化工業	15,000	1,049.00	15,735,000	
デンカ	151,000	528.00	79,728,000	
信越化学工業	130,600	9,655.00	1,260,943,000	
日本カーバイド工業	25,000	150.00	3,750,000	
堺化学工業	27,000	398.00	10,746,000	
エア・ウォーター	60,000	2,123.00	127,380,000	

大陽日酸	56,100	1,358.00	76,183,800
日本化学工業	27,000	238.00	6,426,000
日本パーカライジング	37,200	1,377.00	51,224,400
高压ガス工業	10,800	741.00	8,002,800
チタン工業	8,000	193.00	1,544,000
四国化成工業	10,000	1,095.00	10,950,000
戸田工業	14,000	285.00	3,990,000
ステラ ケミファ	3,500	3,300.00	11,550,000
保土谷化学工業	2,500	2,819.00	7,047,500
日本触媒	11,400	7,740.00	88,236,000
大日精化工業	30,000	667.00	20,010,000
カネカ	98,000	975.00	95,550,000
三菱瓦斯化学	67,800	2,148.00	145,634,400
三井化学	331,000	531.00	175,761,000
J S R	73,200	1,995.00	146,034,000
東京応化工業	13,600	3,955.00	53,788,000
大阪有機化学工業	4,700	911.00	4,281,700
三菱ケミカルホールディングス	490,500	771.10	378,224,550
K Hネオケム	8,900	1,345.00	11,970,500
ダイセル	98,200	1,262.00	123,928,400
住友ベークライト	64,000	665.00	42,560,000
積水化学工業	165,300	1,929.00	318,863,700
日本ゼオン	61,000	1,214.00	74,054,000
アイカ工業	23,400	3,055.00	71,487,000
宇部興産	367,000	281.00	103,127,000
積水樹脂	11,200	1,844.00	20,652,800
タキロン	15,000	531.00	7,965,000
旭有機材	24,000	227.00	5,448,000
日立化成	40,500	3,035.00	122,917,500
ニチバン	7,000	845.00	5,915,000
リケンテクノス	15,700	551.00	8,650,700
大倉工業	17,000	509.00	8,653,000
積水化成成品工業	10,400	819.00	8,517,600
群栄化学工業	1,700	3,390.00	5,763,000
タイガースポリマー	3,600	802.00	2,887,200
ミライアル	2,700	966.00	2,608,200
ダイキアクシス	1,200	1,121.00	1,345,200
ダイキョーニシカワ	12,800	1,424.00	18,227,200
日本化薬	47,000	1,452.00	68,244,000
カーリットホールディングス	6,800	553.00	3,760,400
日本精化	6,000	897.00	5,382,000
扶桑化学工業	5,200	2,408.00	12,521,600

A D E K A	31,300	1,640.00	51,332,000
日油	59,000	1,168.00	68,912,000
ハリマ化成グループ	6,200	780.00	4,836,000
花王	184,900	5,393.00	997,165,700
第一工業製薬	16,000	386.00	6,176,000
ニイタカ	1,100	1,444.00	1,588,400
三洋化成工業	4,600	5,060.00	23,276,000
有機合成薬品工業	4,900	263.00	1,288,700
大日本塗料	42,000	240.00	10,080,000
日本ペイントホールディングス	56,200	3,270.00	183,774,000
関西ペイント	76,500	2,187.00	167,305,500
神東塗料	5,000	217.00	1,085,000
中国塗料	20,900	858.00	17,932,200
日本特殊塗料	5,100	1,745.00	8,899,500
藤倉化成	9,900	666.00	6,593,400
太陽ホールディングス	5,900	4,635.00	27,346,500
D I C	28,800	3,455.00	99,504,000
サカタインクス	14,900	1,481.00	22,066,900
東洋インキS Cホールディングス	72,000	542.00	39,024,000
T & K T O K A	5,300	1,046.00	5,543,800
富士フィルムホールディングス	144,400	4,323.00	624,241,200
資生堂	138,100	3,062.00	422,862,200
ライオン	90,000	1,911.00	171,990,000
高砂香料工業	4,800	3,070.00	14,736,000
マンダム	7,300	5,110.00	37,303,000
ミルボン	3,900	4,375.00	17,062,500
ファンケル	15,500	1,707.00	26,458,500
コーセー	11,800	9,800.00	115,640,000
コタ	2,800	1,312.00	3,673,600
シーズ・ホールディングス	9,500	3,280.00	31,160,000
シーボン	800	2,483.00	1,986,400
ポーラ・オルビスホールディングス	7,400	10,270.00	75,998,000
ノエビアホールディングス	4,600	3,815.00	17,549,000
アジュバンコスメジャパン	1,400	937.00	1,311,800
エステー	5,000	1,691.00	8,455,000
アグロ カネショウ	2,800	1,206.00	3,376,800
コニシ	11,400	1,316.00	15,002,400
長谷川香料	9,200	1,955.00	17,986,000
星光P M C	4,000	1,198.00	4,792,000
小林製薬	20,200	5,000.00	101,000,000
荒川化学工業	6,200	1,868.00	11,581,600
メック	5,700	992.00	5,654,400

日本高純度化学	2,100	2,471.00	5,189,100
タカラバイオ	15,600	1,614.00	25,178,400
J C U	2,300	5,940.00	13,662,000
新田ゼラチン	4,400	749.00	3,295,600
O A Tアグリオ	900	1,322.00	1,189,800
デクセリアルズ	19,100	1,146.00	21,888,600
アース製薬	5,200	4,825.00	25,090,000
イハラケミカル工業	10,100	1,068.00	10,786,800
北興化学工業	7,000	453.00	3,171,000
大成ラミック	2,000	3,070.00	6,140,000
クミアイ化学工業	15,000	677.00	10,155,000
日本農薬	16,600	613.00	10,175,800
アキレス	6,000	1,700.00	10,200,000
有沢製作所	12,300	652.00	8,019,600
日東電工	52,500	8,784.00	461,160,000
レック	2,300	3,415.00	7,854,500
きもと	13,100	243.00	3,183,300
藤森工業	5,400	2,971.00	16,043,400
前澤化成工業	4,800	1,196.00	5,740,800
J S P	3,400	2,688.00	9,139,200
エフピコ	6,500	5,480.00	35,620,000
天馬	4,800	2,048.00	9,830,400
信越ポリマー	14,300	884.00	12,641,200
東リ	17,400	404.00	7,029,600
ニフコ	12,800	5,980.00	76,544,000
日本バルカー工業	5,600	1,523.00	8,528,800
ユニ・チャーム	147,400	2,510.50	370,047,700
協和発酵キリン	87,100	1,593.00	138,750,300
武田薬品工業	273,000	4,714.00	1,286,922,000
アステラス製薬	743,800	1,544.00	1,148,427,200
大日本住友製薬	51,500	2,024.00	104,236,000
塩野義製薬	98,500	5,471.00	538,893,500
田辺三菱製薬	84,800	2,272.00	192,665,600
わかもと製薬	8,000	249.00	1,992,000
あすか製薬	7,900	1,725.00	13,627,500
日本新薬	16,700	5,890.00	98,363,000
バイオフェルミン製薬	1,200	2,891.00	3,469,200
中外製薬	72,500	3,410.00	247,225,000
科研製薬	13,600	5,950.00	80,920,000
エーザイ	89,600	6,476.00	580,249,600
ロート製薬	35,600	1,913.00	68,102,800
小野薬品工業	165,300	2,327.50	384,735,750

久光製薬	20,500	5,990.00	122,795,000
持田製薬	5,000	8,160.00	40,800,000
参天製薬	134,100	1,375.00	184,387,500
扶桑薬品工業	2,400	2,881.00	6,914,400
日本ケミファ	1,000	5,580.00	5,580,000
ツムラ	24,400	3,305.00	80,642,000
日医工	17,000	1,666.00	28,322,000
キッセイ薬品工業	12,900	2,818.00	36,352,200
生化学工業	13,500	1,706.00	23,031,000
栄研化学	6,100	3,000.00	18,300,000
日水製薬	2,900	1,298.00	3,764,200
鳥居薬品	5,000	2,560.00	12,800,000
JCRファーマ	5,600	2,813.00	15,752,800
東和薬品	3,300	4,600.00	15,180,000
富士製薬工業	2,400	2,752.00	6,604,800
沢井製薬	12,400	6,110.00	75,764,000
ゼリア新薬工業	14,900	1,784.00	26,581,600
第一三共	214,200	2,498.00	535,071,600
キョーリン製薬ホールディングス	17,800	2,577.00	45,870,600
大幸薬品	3,600	1,810.00	6,516,000
ダイト	4,100	2,316.00	9,495,600
大塚ホールディングス	156,500	5,395.00	844,317,500
大正製薬ホールディングス	15,600	9,620.00	150,072,000
ペプチドリーム	12,400	5,900.00	73,160,000
日本コークス工業	58,700	109.00	6,398,300
昭和シェル石油	65,100	1,127.00	73,367,700
ニチレキ	8,900	918.00	8,170,200
東燃ゼネラル石油	118,000	1,313.00	154,934,000
ユシロ化学工業	3,900	1,459.00	5,690,100
ビーピー・カストロール	3,000	1,412.00	4,236,000
富士石油	16,900	404.00	6,827,600
MORESCO	2,500	1,756.00	4,390,000
出光興産	34,500	3,425.00	118,162,500
JXホールディングス	808,000	525.00	424,200,000
コスモエネルギーホールディングス	22,000	1,933.00	42,526,000
横浜ゴム	43,900	2,056.00	90,258,400
東洋ゴム工業	38,400	1,405.00	53,952,000
ブリヂストン	245,700	4,122.00	1,012,775,400
住友ゴム工業	68,100	1,804.00	122,852,400
藤倉ゴム工業	6,100	648.00	3,952,800
オカモト	22,000	1,058.00	23,276,000
フコク	3,000	930.00	2,790,000

ニッタ	6,500	3,105.00	20,182,500
住友理工	13,500	1,103.00	14,890,500
三ツ星ベルト	18,000	1,026.00	18,468,000
バンドー化学	13,200	1,028.00	13,569,600
日東紡績	59,000	462.00	27,258,000
旭硝子	359,000	823.00	295,457,000
日本板硝子	33,200	905.00	30,046,000
石塚硝子	10,000	201.00	2,010,000
日本山村硝子	29,000	200.00	5,800,000
日本電気硝子	150,000	639.00	95,850,000
オハラ	3,100	827.00	2,563,700
住友大阪セメント	135,000	463.00	62,505,000
太平洋セメント	439,000	386.00	169,454,000
日本ヒューム	7,000	710.00	4,970,000
日本コンクリート工業	17,400	344.00	5,985,600
三谷セキサン	3,600	3,050.00	10,980,000
アジアパイルホールディングス	9,500	563.00	5,348,500
東海カーボン	68,000	383.00	26,044,000
日本カーボン	37,000	289.00	10,693,000
東洋炭素	4,000	1,891.00	7,564,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,100	2,862.00	11,734,200
TOTO	53,500	4,610.00	246,635,000
日本碍子	91,900	2,268.00	208,429,200
日本特殊陶業	62,700	2,550.00	159,885,000
MARUWA	2,700	3,650.00	9,855,000
品川リフラクトリーズ	18,000	258.00	4,644,000
黒崎播磨	16,000	316.00	5,056,000
ヨータイ	4,000	356.00	1,424,000
イソライト工業	4,700	313.00	1,471,100
東京窯業	8,900	191.00	1,699,900
ニッカトー	2,400	418.00	1,003,200
フジインコーポレーテッド	6,200	2,245.00	13,919,000
ニチアス	38,000	1,155.00	43,890,000
ニチハ	9,700	2,881.00	27,945,700
新日鐵住金	328,200	2,714.50	890,898,900
神戸製鋼所	125,800	1,123.00	141,273,400
中山製鋼所	8,200	740.00	6,068,000
合同製鐵	4,100	2,085.00	8,548,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,900	1,955.00	388,849,500
日新製鋼	33,200	1,519.00	50,430,800
東京製鐵	36,800	949.00	34,923,200
共英製鋼	7,800	2,265.00	17,667,000

大和工業	14,600	3,350.00	48,910,000
東京鐵鋼	15,000	469.00	7,035,000
大阪製鐵	4,600	2,231.00	10,262,600
淀川製鋼所	10,100	3,175.00	32,067,500
東洋鋼鈹	17,400	389.00	6,768,600
丸一鋼管	24,300	3,740.00	90,882,000
モリ工業	2,300	2,018.00	4,641,400
大同特殊鋼	122,000	506.00	61,732,000
日本高周波鋼業	25,000	88.00	2,200,000
日本冶金工業	60,200	190.00	11,438,000
山陽特殊製鋼	43,000	577.00	24,811,000
愛知製鋼	4,300	5,050.00	21,715,000
日立金属	74,100	1,609.00	119,226,900
日本金属	1,700	1,299.00	2,208,300
大平洋金属	46,000	357.00	16,422,000
新日本電工	41,200	274.00	11,288,800
栗本鐵工所	3,500	2,311.00	8,088,500
虹技	10,000	257.00	2,570,000
日本鑄鉄管	7,000	189.00	1,323,000
三菱製鋼	51,000	247.00	12,597,000
日亜鋼業	10,100	264.00	2,666,400
日本精線	5,000	606.00	3,030,000
シンニッタン	5,900	685.00	4,041,500
新家工業	16,000	161.00	2,576,000
大紀アルミニウム工業所	12,000	515.00	6,180,000
日本輕金属ホールディングス	164,800	263.00	43,342,400
三井金属鋁業	198,000	306.00	60,588,000
東邦亜鉛	41,000	480.00	19,680,000
三菱マテリアル	45,400	3,825.00	173,655,000
住友金属鋁山	188,000	1,516.50	285,102,000
D O W A ホールディングス	80,000	955.00	76,400,000
古河機械金属	114,000	228.00	25,992,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,900	1,668.00	13,177,200
東邦チタニウム	12,300	779.00	9,581,700
U A C J	92,000	349.00	32,108,000
古河電気工業	24,400	3,745.00	91,378,000
住友電気工業	274,200	1,670.50	458,051,100
フジクラ	95,800	687.00	65,814,600
昭和電線ホールディングス	86,000	89.00	7,654,000
東京特殊電線	1,000	1,242.00	1,242,000
タツタ電線	13,900	462.00	6,421,800
沖電線	9,000	234.00	2,106,000



カナレ電気	1,000	2,200.00	2,200,000
平河ヒューテック	3,700	1,240.00	4,588,000
リョービ	44,000	481.00	21,164,000
アーレスティ	8,400	1,236.00	10,382,400
アサヒホールディングス	11,000	2,115.00	23,265,000
稲葉製作所	3,900	1,357.00	5,292,300
宮地エンジニアリンググループ	21,000	198.00	4,158,000
トーカロ	4,800	2,499.00	11,995,200
アルファC o	2,400	1,183.00	2,839,200
SUMCO	76,000	1,691.00	128,516,000
川田テクノロジーズ	1,400	8,060.00	11,284,000
RS Technologies	300	3,675.00	1,102,500
東洋製罐グループホールディングス	51,700	2,126.00	109,914,200
ホッカンホールディングス	19,000	466.00	8,854,000
コロナ	3,800	1,152.00	4,377,600
横河ブリッジホールディングス	12,800	1,388.00	17,766,400
駒井ハルテック	1,400	2,152.00	3,012,800
高田機工	6,000	233.00	1,398,000
三和ホールディングス	72,200	1,113.00	80,358,600
文化シャッター	20,300	903.00	18,330,900
三協立山	9,500	1,745.00	16,577,500
アルインコ	5,000	1,040.00	5,200,000
東洋シャッター	1,800	636.00	1,144,800
LIXILグループ	101,400	2,678.00	271,549,200
日本フィルコン	5,300	577.00	3,058,100
ノーリツ	14,300	1,990.00	28,457,000
長府製作所	7,800	2,606.00	20,326,800
リンナイ	12,400	9,510.00	117,924,000
ダイニチ工業	3,700	732.00	2,708,400
日東精工	10,400	414.00	4,305,600
三洋工業	9,000	198.00	1,782,000
岡部	15,100	949.00	14,329,900
ジーテクト	7,600	2,138.00	16,248,800
東プレ	14,000	2,895.00	40,530,000
高周波熱錬	13,500	907.00	12,244,500
東京製綱	4,900	1,917.00	9,393,300
サンコール	3,900	544.00	2,121,600
モリテック スチール	3,700	289.00	1,069,300
パイオラックス	3,700	7,580.00	28,046,000
日本発條	68,500	1,090.00	74,665,000
中央発條	8,000	325.00	2,600,000
アドバネクス	1,300	1,849.00	2,403,700

立川ブラインド工業	3,000	895.00	2,685,000
三益半導体工業	5,400	1,751.00	9,455,400
日本ドライケミカル	900	2,332.00	2,098,800
日本製鋼所	24,100	2,116.00	50,995,600
三浦工業	29,800	1,779.00	53,014,200
タクマ	23,300	987.00	22,997,100
ツガミ	20,000	697.00	13,940,000
オークマ	47,000	1,181.00	55,507,000
東芝機械	43,000	513.00	22,059,000
アマダホールディングス	97,900	1,321.00	129,325,900
アイダエンジニアリング	20,700	1,110.00	22,977,000
滝澤鉄工所	21,000	164.00	3,444,000
富士機械製造	22,200	1,379.00	30,613,800
牧野フライス製作所	36,000	970.00	34,920,000
オーエスジー	33,100	2,333.00	77,222,300
ダイジェット工業	11,000	181.00	1,991,000
旭ダイヤモンド工業	21,000	857.00	17,997,000
D M G 森精機	43,300	1,478.00	63,997,400
ソディック	18,500	971.00	17,963,500
ディスコ	8,500	14,330.00	121,805,000
日東工器	4,200	2,501.00	10,504,200
パンチ工業	2,600	908.00	2,360,800
豊和工業	4,400	647.00	2,846,800
O K K	28,000	123.00	3,444,000
東洋機械金属	4,900	466.00	2,283,400
島精機製作所	9,500	3,980.00	37,810,000
N C ホールディングス	2,400	932.00	2,236,800
フリー	1,400	4,550.00	6,370,000
ヤマシンフィルタ	1,400	1,419.00	1,986,600
日阪製作所	9,900	923.00	9,137,700
やまびこ	13,300	1,638.00	21,785,400
ペガサスミシン製造	7,000	701.00	4,907,000
ナプテスコ	37,800	2,898.00	109,544,400
三井海洋開発	7,300	1,974.00	14,410,200
レオン自動機	6,100	962.00	5,868,200
S M C	21,800	27,460.00	598,628,000
新川	6,100	818.00	4,989,800
ホソカワミクロン	12,000	782.00	9,384,000
ユニオンツール	3,100	3,130.00	9,703,000
オイレス工業	9,400	2,022.00	19,006,800
日精エー・エス・ビー機械	2,300	2,232.00	5,133,600
サトーホールディングス	9,000	2,364.00	21,276,000

日本エアーテック	2,300	642.00	1,476,600
日精樹脂工業	6,000	1,032.00	6,192,000
オカダアイヨン	1,500	1,103.00	1,654,500
ワイエイシイ	2,700	1,294.00	3,493,800
小松製作所	335,700	2,755.50	925,021,350
住友重機械工業	212,000	774.00	164,088,000
日立建機	32,500	2,650.00	86,125,000
日工	2,200	2,171.00	4,776,200
巴工業	3,000	1,933.00	5,799,000
井関農機	75,000	228.00	17,100,000
TOWA	5,900	1,606.00	9,475,400
丸山製作所	18,000	186.00	3,348,000
北川鉄工所	3,400	2,446.00	8,316,400
ローツェ	2,600	2,196.00	5,709,600
タカキタ	2,400	551.00	1,322,400
クボタ	349,300	1,805.00	630,486,500
荏原実業	2,000	1,335.00	2,670,000
三菱化工機	24,000	218.00	5,232,000
月島機械	13,800	1,214.00	16,753,200
帝国電機製作所	5,300	1,007.00	5,337,100
新東工業	16,500	1,002.00	16,533,000
澁谷工業	6,100	2,360.00	14,396,000
アイチ コーポレーション	10,300	830.00	8,549,000
小森コーポレーション	17,500	1,513.00	26,477,500
鶴見製作所	5,400	1,682.00	9,082,800
住友精密工業	11,000	364.00	4,004,000
酒井重工業	14,000	341.00	4,774,000
荏原製作所	32,000	3,440.00	110,080,000
石井鐵工所	1,100	1,816.00	1,997,600
西島製作所	7,400	1,128.00	8,347,200
北越工業	7,800	802.00	6,255,600
ダイキン工業	94,900	11,340.00	1,076,166,000
オルガノ	14,000	486.00	6,804,000
トーヨーカネツ	35,000	323.00	11,305,000
栗田工業	41,200	2,605.00	107,326,000
椿本チエイン	41,000	934.00	38,294,000
大同工業	16,000	257.00	4,112,000
木村化工機	7,700	335.00	2,579,500
アネスト岩田	12,600	1,156.00	14,565,600
ダイフク	34,700	2,479.00	86,021,300
サムコ	1,700	1,138.00	1,934,600
加藤製作所	4,000	3,010.00	12,040,000

油研工業	14,000	221.00	3,094,000
タダノ	36,400	1,492.00	54,308,800
フジテック	20,200	1,371.00	27,694,200
C K D	20,800	1,487.00	30,929,600
キトー	8,800	1,294.00	11,387,200
平和	21,500	2,736.00	58,824,000
理想科学工業	6,900	2,016.00	13,910,400
S A N K Y O	19,300	3,750.00	72,375,000
日本金銭機械	6,400	1,488.00	9,523,200
マースエンジニアリング	3,900	2,138.00	8,338,200
福島工業	4,300	3,465.00	14,899,500
オーイズミ	2,900	698.00	2,024,200
ダイコク電機	2,900	1,772.00	5,138,800
竹内製作所	12,700	2,499.00	31,737,300
アマノ	21,500	2,160.00	46,440,000
J U K I	11,000	1,191.00	13,101,000
サンデンホールディングス	42,000	377.00	15,834,000
蛇の目マシン工業	6,700	867.00	5,808,900
マックス	11,000	1,433.00	15,763,000
グローリー	22,200	3,610.00	80,142,000
新晃工業	4,800	1,438.00	6,902,400
大和冷機工業	11,200	970.00	10,864,000
セガサミーホールディングス	69,000	1,743.00	120,267,000
日本ピストンリング	2,700	2,106.00	5,686,200
リケン	3,200	4,240.00	13,568,000
T P R	7,800	3,275.00	25,545,000
ツバキ・ナカシマ	7,800	1,790.00	13,962,000
ホシザキ	15,200	9,520.00	144,704,000
大豊工業	5,600	1,657.00	9,279,200
日本精工	142,800	1,380.00	197,064,000
N T N	161,000	490.00	78,890,000
ジェイテクト	74,100	1,907.00	141,308,700
不二越	70,000	559.00	39,130,000
日本トムソン	22,200	502.00	11,144,400
T H K	49,100	2,640.00	129,624,000
ユースン精機	3,100	2,847.00	8,825,700
前澤給装工業	2,600	1,525.00	3,965,000
イーグル工業	7,500	1,564.00	11,730,000
前澤工業	5,100	372.00	1,897,200
日本ピラー工業	7,000	1,262.00	8,834,000
キッツ	33,400	658.00	21,977,200
日立工機	18,700	1,400.00	26,180,000

マキタ	45,300	7,930.00	359,229,000
日立造船	55,100	626.00	34,492,600
三菱重工業	1,165,000	532.60	620,479,000
I H I	536,000	308.00	165,088,000
スター精密	12,200	1,717.00	20,947,400
日清紡ホールディングス	38,600	1,111.00	42,884,600
イビデン	48,700	1,605.00	78,163,500
コニカミノルタ	162,800	1,170.00	190,476,000
ブラザー工業	89,900	2,141.00	192,475,900
ミネベア	112,000	1,114.00	124,768,000
日立製作所	1,669,000	658.60	1,099,203,400
東芝	1,555,000	246.70	383,618,500
三菱電機	741,500	1,692.00	1,254,618,000
富士電機	209,000	659.00	137,731,000
東洋電機製造	2,700	1,647.00	4,446,900
安川電機	80,600	1,971.00	158,862,600
シンフォニアテクノロジー	45,000	275.00	12,375,000
明電舎	64,000	389.00	24,896,000
オリジン電気	10,000	305.00	3,050,000
山洋電気	18,000	861.00	15,498,000
デンヨー	6,400	1,624.00	10,393,600
東芝テック	44,000	647.00	28,468,000
芝浦メカトロニクス	11,000	284.00	3,124,000
マブチモーター	19,600	6,050.00	118,580,000
日本電産	90,100	10,780.00	971,278,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	3,055.00	2,444,000
東光高岳	3,500	2,101.00	7,353,500
ダブル・スコープ	6,700	1,718.00	11,510,600
ダイヘン	38,000	750.00	28,500,000
田淵電機	10,600	385.00	4,081,000
ヤーマン	900	5,240.00	4,716,000
J V C ケンウッド	51,100	309.00	15,789,900
ミマキエンジニアリング	6,300	697.00	4,391,100
第一精工	3,300	1,334.00	4,402,200
日新電機	14,000	1,289.00	18,046,000
大崎電気工業	14,000	1,169.00	16,366,000
オムロン	73,900	4,730.00	349,547,000
日東工業	10,200	1,607.00	16,391,400
I D E C	9,100	1,122.00	10,210,200
不二電機工業	800	1,429.00	1,143,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	134,000	472.00	63,248,000
サクサホールディングス	18,000	228.00	4,104,000

メルコホールディングス	3,900	3,190.00	12,441,000
テクノメディカ	1,600	2,087.00	3,339,200
日本電気	956,000	321.00	306,876,000
富士通	670,000	684.90	458,883,000
沖電気工業	30,100	1,660.00	49,966,000
岩崎通信機	30,000	86.00	2,580,000
電気興業	20,000	589.00	11,780,000
サンケン電気	41,000	552.00	22,632,000
ナカヨ	7,000	398.00	2,786,000
アイホン	3,900	1,971.00	7,686,900
ルネサスエレクトロニクス	36,000	1,001.00	36,036,000
セイコーエプソン	103,500	2,391.00	247,468,500
ワコム	54,000	328.00	17,712,000
アルバック	12,800	3,700.00	47,360,000
アクセル	2,900	1,004.00	2,911,600
E I Z O	6,900	3,410.00	23,529,000
ジャパンディスプレイ	129,900	300.00	38,970,000
日本信号	19,200	1,051.00	20,179,200
京三製作所	16,000	400.00	6,400,000
能美防災	7,900	1,745.00	13,785,500
ホーチキ	5,100	1,436.00	7,323,600
エレコム	6,000	1,903.00	11,418,000
日本無線	4,200	1,355.00	5,691,000
パナソニック	794,200	1,206.50	958,202,300
アンリツ	50,700	692.00	35,084,400
富士通ゼネラル	24,000	2,643.00	63,432,000
日立国際電気	18,200	2,608.00	47,465,600
ソニー	490,800	3,472.00	1,704,057,600
T D K	39,200	7,830.00	306,936,000
帝国通信工業	16,000	175.00	2,800,000
ミツミ電機	24,600	655.00	16,113,000
タムラ製作所	27,000	443.00	11,961,000
アルプス電気	64,200	2,784.00	178,732,800
池上通信機	22,000	160.00	3,520,000
パイオニア	104,400	254.00	26,517,600
日本電波工業	6,800	881.00	5,990,800
鈴木	2,800	510.00	1,428,000
日本トリム	1,700	4,270.00	7,259,000
ローランド ディー . ジー .	3,600	3,115.00	11,214,000
フォスター電機	8,100	1,942.00	15,730,200
クラリオン	37,000	443.00	16,391,000
S M K	18,000	419.00	7,542,000

ヨコオ	5,000	1,013.00	5,065,000	
ホシデン	21,100	864.00	18,230,400	
ヒロセ電機	11,200	14,480.00	162,176,000	
日本航空電子工業	22,000	1,565.00	34,430,000	
TOA	8,200	1,034.00	8,478,800	
日立マクセル	10,400	2,123.00	22,079,200	
古野電気	9,000	740.00	6,660,000	
ユニデンホールディングス	20,000	165.00	3,300,000	
アルパイン	16,600	1,568.00	26,028,800	
スミダコーポレーション	5,700	1,099.00	6,264,300	
アイコム	3,800	2,230.00	8,474,000	
リオン	2,700	1,565.00	4,225,500	
本多通信工業	2,300	1,234.00	2,838,200	
船井電機	7,800	916.00	7,144,800	
横河電機	75,400	1,773.00	133,684,200	
新電元工業	27,000	423.00	11,421,000	
アズビル	21,100	3,350.00	70,685,000	
東亜ディーケーケー	3,500	544.00	1,904,000	
日本光電工業	29,100	2,592.00	75,427,200	
チノー	2,500	1,116.00	2,790,000	
共和電業	7,900	405.00	3,199,500	
日本電子材料	2,700	607.00	1,638,900	
堀場製作所	13,800	5,730.00	79,074,000	
アドバンテスト	47,400	2,018.00	95,653,200	
小野測器	3,400	875.00	2,975,000	
エスペック	6,200	1,324.00	8,208,800	
パナソニック デバイスSUNX	6,100	818.00	4,989,800	
キーエンス	31,500	41,200.00	1,297,800,000	
日置電機	3,700	2,166.00	8,014,200	
シスメックス	54,000	6,790.00	366,660,000	
日本マイクロニクス	13,000	1,085.00	14,105,000	
メガチップス	6,500	2,512.00	16,328,000	
OBARA GROUP	4,100	5,300.00	21,730,000	
澤藤電機	4,000	215.00	860,000	
コーセル	9,700	1,302.00	12,629,400	
イリソ電子工業	2,200	6,640.00	14,608,000	
新日本無線	5,900	397.00	2,342,300	
オブテックスグループ	5,200	2,603.00	13,535,600	
千代田インテグレ	3,700	2,403.00	8,891,100	
アイ・オー・データ機器	2,200	1,251.00	2,752,200	
レーザーテック	8,200	2,203.00	18,064,600	
スタンレー電気	49,600	3,070.00	152,272,000	

岩崎電気	26,000	186.00	4,836,000
ウシオ電機	42,200	1,452.00	61,274,400
岡谷電機産業	3,800	410.00	1,558,000
ハリオス テクノ ホールディング	6,500	531.00	3,451,500
日本セラミック	5,700	2,101.00	11,975,700
遠藤照明	3,600	913.00	3,286,800
古河電池	5,000	756.00	3,780,000
双信電機	3,500	292.00	1,022,000
山一電機	6,600	1,261.00	8,322,600
図研	4,600	1,295.00	5,957,000
日本電子	25,000	582.00	14,550,000
カシオ計算機	55,900	1,609.00	89,943,100
ファナック	70,500	21,355.00	1,505,527,500
日本シイエムケイ	15,000	669.00	10,035,000
エンプラス	3,200	3,370.00	10,784,000
大真空	2,600	1,451.00	3,772,600
ローム	33,600	7,180.00	241,248,000
浜松ホトニクス	54,300	3,260.00	177,018,000
三井ハイテック	9,200	854.00	7,856,800
新光電気工業	26,300	847.00	22,276,100
京セラ	114,100	5,768.00	658,128,800
太陽誘電	33,800	1,344.00	45,427,200
村田製作所	72,900	15,095.00	1,100,425,500
ユーシン	9,300	821.00	7,635,300
双葉電子工業	11,400	1,955.00	22,287,000
北陸電気工業	28,000	135.00	3,780,000
ニチコン	21,900	1,061.00	23,235,900
日本ケミコン	60,000	254.00	15,240,000
K O A	9,600	1,177.00	11,299,200
市光工業	15,000	421.00	6,315,000
小糸製作所	41,700	6,200.00	258,540,000
ミツバ	12,800	2,012.00	25,753,600
S C R E E Nホールディングス	14,300	6,890.00	98,527,000
キャノン電子	6,400	1,740.00	11,136,000
キャノン	374,200	3,310.00	1,238,602,000
リコー	209,000	1,002.00	209,418,000
M U T O Hホールディングス	10,000	253.00	2,530,000
東京エレクトロン	46,400	11,200.00	519,680,000
トヨタ紡織	24,500	2,642.00	64,729,000
芦森工業	17,000	160.00	2,720,000
ユニプレス	13,500	2,319.00	31,306,500
豊田自動織機	63,400	5,560.00	352,504,000



モリタホールディングス	12,200	1,623.00	19,800,600
三櫻工業	8,900	826.00	7,351,400
デンソー	171,400	5,040.00	863,856,000
東海理化電機製作所	18,300	2,344.00	42,895,200
三井造船	253,000	185.00	46,805,000
川崎重工業	543,000	367.00	199,281,000
名村造船所	21,500	761.00	16,361,500
サノヤスホールディングス	10,700	274.00	2,931,800
ニチユ三菱フォークリフト	8,100	807.00	6,536,700
近畿車輛	1,000	2,596.00	2,596,000
日産自動車	832,400	1,150.50	957,676,200
いすゞ自動車	201,600	1,582.00	318,931,200
トヨタ自動車	845,200	6,801.00	5,748,205,200
日野自動車	99,600	1,214.00	120,914,400
三菱自動車工業	254,800	665.00	169,442,000
エフテック	4,000	1,312.00	5,248,000
レシップホールディングス	2,300	897.00	2,063,100
G M B	1,200	1,165.00	1,398,000
ファルテック	1,200	1,357.00	1,628,400
武蔵精密工業	8,200	3,160.00	25,912,000
日産車体	30,800	1,111.00	34,218,800
新明和工業	28,000	1,056.00	29,568,000
極東開発工業	13,900	1,588.00	22,073,200
日信工業	15,600	1,871.00	29,187,600
トピー工業	5,800	3,175.00	18,415,000
ティラド	27,000	296.00	7,992,000
曙ブレーキ工業	32,300	318.00	10,271,400
タチエス	11,800	1,878.00	22,160,400
N O K	33,600	2,329.00	78,254,400
フタバ産業	22,600	700.00	15,820,000
K Y B	78,000	557.00	43,446,000
大同メタル工業	8,900	1,122.00	9,985,800
プレス工業	37,200	513.00	19,083,600
ミクニ	9,000	397.00	3,573,000
カルソニックカンセイ	50,000	1,791.00	89,550,000
太平洋工業	14,300	1,460.00	20,878,000
ケーヒン	16,000	2,070.00	33,120,000
河西工業	9,500	1,362.00	12,939,000
アイシン精機	63,700	5,220.00	332,514,000
富士機工	6,900	476.00	3,284,400
マツダ	220,400	1,813.00	399,585,200
今仙電機製作所	6,400	1,002.00	6,412,800

本田技研工業	625,700	3,492.00	2,184,944,400
スズキ	137,800	4,290.00	591,162,000
富士重工業	215,800	4,817.00	1,039,508,600
安永	3,000	1,638.00	4,914,000
ヤマハ発動機	98,300	2,476.00	243,390,800
ショーワ	18,900	802.00	15,157,800
T B K	8,900	497.00	4,423,300
エクセディ	9,400	3,240.00	30,456,000
豊田合成	22,500	2,768.00	62,280,000
愛三工業	12,200	955.00	11,651,000
盟和産業	1,100	1,187.00	1,305,700
ヨロズ	6,500	1,625.00	10,562,500
エフ・シー・シー	11,500	2,082.00	23,943,000
シマノ	28,000	18,400.00	515,200,000
テイ・エス テック	16,200	3,020.00	48,924,000
ジャムコ	4,400	2,746.00	12,082,400
テルモ	106,600	4,260.00	454,116,000
クリエートメディック	2,300	953.00	2,191,900
日機装	24,100	1,054.00	25,401,400
島津製作所	89,500	1,862.00	166,649,000
J M S	13,000	310.00	4,030,000
長野計器	5,500	698.00	3,839,000
ブイ・テクノロジー	1,400	13,360.00	18,704,000
東京計器	24,000	239.00	5,736,000
愛知時計電機	900	3,880.00	3,492,000
オーバル	6,900	285.00	1,966,500
東京精密	13,400	3,565.00	47,771,000
マニー	9,200	2,849.00	26,210,800
ニコン	121,200	1,833.00	222,159,600
トプコン	35,000	1,704.00	59,640,000
オリンパス	111,000	4,060.00	450,660,000
理研計器	6,100	1,657.00	10,107,700
タムロン	6,200	2,014.00	12,486,800
H O Y A	143,000	4,698.00	671,814,000
ノーリツ鋼機	7,100	884.00	6,276,400
エー・アンド・デイ	6,400	480.00	3,072,000
シチズン時計	76,100	700.00	53,270,000
リズム時計工業	28,000	184.00	5,152,000
大研医器	6,200	801.00	4,966,200
メニコン	4,800	3,365.00	16,152,000
松風	3,700	1,372.00	5,076,400
セイコーホールディングス	49,000	415.00	20,335,000

ニプロ	48,100	1,286.00	61,856,600
スノーピーク	1,100	3,010.00	3,311,000
パラマウントベッドホールディングス	6,700	4,450.00	29,815,000
トランザクション	1,500	1,897.00	2,845,500
S H O - B I	2,300	421.00	968,300
ニホンフラッシュ	3,200	1,315.00	4,208,000
前田工織	7,000	1,303.00	9,121,000
永大産業	9,000	511.00	4,599,000
アートネイチャー	7,400	716.00	5,298,400
ダンロップスポーツ	4,400	1,071.00	4,712,400
バンダイナムコホールディングス	76,700	3,145.00	241,221,500
アイフィスジャパン	1,500	417.00	625,500
共立印刷	11,500	329.00	3,783,500
S H O E I	3,100	2,185.00	6,773,500
フランスベッドホールディングス	8,700	948.00	8,247,600
パイロットコーポレーション	12,100	4,705.00	56,930,500
萩原工業	1,900	2,651.00	5,036,900
トッパン・フォームズ	12,400	1,190.00	14,756,000
フジシールインターナショナル	15,600	2,444.00	38,126,400
タカラトミー	27,000	1,211.00	32,697,000
廣済堂	7,000	401.00	2,807,000
A s - m e エステール	1,900	697.00	1,324,300
アーク	29,200	127.00	3,708,400
タカノ	3,100	903.00	2,799,300
プロネクサス	6,500	1,087.00	7,065,500
ホクシン	4,900	215.00	1,053,500
ウッドワン	12,000	274.00	3,288,000
大建工業	4,900	2,161.00	10,588,900
凸版印刷	196,000	1,129.00	221,284,000
大日本印刷	200,000	1,158.00	231,600,000
図書印刷	9,000	468.00	4,212,000
共同印刷	21,000	399.00	8,379,000
日本写真印刷	11,700	3,115.00	36,445,500
光村印刷	6,000	251.00	1,506,000
宝印刷	3,400	1,501.00	5,103,400
アシックス	69,100	2,273.00	157,064,300
ツツミ	2,600	2,009.00	5,223,400
小松ウオール工業	2,400	1,939.00	4,653,600
ヤマハ	46,800	3,550.00	166,140,000
河合楽器製作所	2,700	2,269.00	6,126,300
クリナップ	8,100	892.00	7,225,200
ピジョン	42,000	3,010.00	126,420,000

兼松サステック	7,000	199.00	1,393,000
キングジム	5,800	849.00	4,924,200
リンテック	16,500	2,522.00	41,613,000
T A S A K I	1,900	1,578.00	2,998,200
イトーキ	14,600	721.00	10,526,600
任天堂	42,800	23,630.00	1,011,364,000
三菱鉛筆	5,700	6,140.00	34,998,000
タカスタンダード	14,400	1,947.00	28,036,800
コクヨ	36,100	1,384.00	49,962,400
ナカバヤシ	12,000	267.00	3,204,000
グロープライド	3,400	1,907.00	6,483,800
岡村製作所	24,300	1,036.00	25,174,800
美津濃	37,000	582.00	21,534,000
東京電力ホールディングス	589,700	465.00	274,210,500
中部電力	229,100	1,596.00	365,643,600
関西電力	283,700	1,322.50	375,193,250
中国電力	96,100	1,371.00	131,753,100
北陸電力	68,100	1,316.00	89,619,600
東北電力	173,700	1,450.00	251,865,000
四国電力	62,600	1,164.00	72,866,400
九州電力	153,500	1,322.00	202,927,000
北海道電力	65,100	900.00	58,590,000
沖縄電力	10,200	2,689.00	27,427,800
電源開発	55,300	2,789.00	154,231,700
エフオン	2,800	1,031.00	2,886,800
イーレックス	2,900	3,375.00	9,787,500
東京瓦斯	746,000	528.90	394,559,400
大阪瓦斯	675,000	442.60	298,755,000
東邦瓦斯	175,000	936.00	163,800,000
北海道瓦斯	17,000	276.00	4,692,000
広島ガス	14,300	372.00	5,319,600
西部瓦斯	78,000	256.00	19,968,000
静岡ガス	21,400	783.00	16,756,200
メタウォーター	3,900	2,714.00	10,584,600
S B S ホールディングス	6,900	799.00	5,513,100
東武鉄道	371,000	583.00	216,293,000
相鉄ホールディングス	111,000	584.00	64,824,000
東京急行電鉄	378,000	864.00	326,592,000
京浜急行電鉄	190,000	1,358.00	258,020,000
小田急電鉄	111,400	2,307.00	256,999,800
京王電鉄	194,000	958.00	185,852,000
京成電鉄	52,100	2,792.00	145,463,200

富士急行	19,000	1,122.00	21,318,000
新京成電鉄	9,000	417.00	3,753,000
東日本旅客鉄道	134,500	10,410.00	1,400,145,000
西日本旅客鉄道	66,900	7,318.00	489,574,200
東海旅客鉄道	57,800	19,240.00	1,112,072,000
西武ホールディングス	96,000	1,988.00	190,848,000
鴻池運輸	9,800	1,505.00	14,749,000
西日本鉄道	84,000	535.00	44,940,000
ハマキョウレックス	4,500	2,135.00	9,607,500
サカイ引越センター	2,400	2,659.00	6,381,600
近鉄グループホールディングス	700,000	446.00	312,200,000
阪急阪神ホールディングス	87,800	3,890.00	341,542,000
南海電気鉄道	147,000	589.00	86,583,000
京阪ホールディングス	156,000	767.00	119,652,000
神戸電鉄	17,000	379.00	6,443,000
名古屋鉄道	253,000	567.00	143,451,000
山陽電気鉄道	25,000	616.00	15,400,000
日本通運	269,000	622.00	167,318,000
ヤマトホールディングス	124,300	2,395.00	297,698,500
山九	91,000	705.00	64,155,000
丸運	3,800	250.00	950,000
丸全昭和運輸	23,000	446.00	10,258,000
センコー	31,300	781.00	24,445,300
トナミホールディングス	14,000	362.00	5,068,000
ニッコンホールディングス	23,600	2,352.00	55,507,200
日本石油輸送	800	2,448.00	1,958,400
福山通運	42,000	641.00	26,922,000
セイノーホールディングス	49,300	1,330.00	65,569,000
神奈川中央交通	8,000	726.00	5,808,000
日立物流	14,500	2,323.00	33,683,500
丸和運輸機関	1,700	2,730.00	4,641,000
C & F ロジホールディングス	7,200	1,299.00	9,352,800
九州旅客鉄道	51,800	3,055.00	158,249,000
日本郵船	587,000	240.00	140,880,000
商船三井	365,000	362.00	132,130,000
川崎汽船	265,000	284.00	75,260,000
N S ユナイテッド海運	32,000	218.00	6,976,000
飯野海運	37,800	481.00	18,181,800
共栄タンカー	6,000	221.00	1,326,000
乾汽船	5,100	965.00	4,921,500
日本航空	125,300	3,677.00	460,728,100
A N A ホールディングス	1,290,000	326.30	420,927,000

パスコ	6,000	415.00	2,490,000
トランコム	2,000	5,770.00	11,540,000
日新	28,000	365.00	10,220,000
三菱倉庫	46,000	1,659.00	76,314,000
三井倉庫ホールディングス	40,000	341.00	13,640,000
住友倉庫	51,000	614.00	31,314,000
澁澤倉庫	18,000	352.00	6,336,000
東陽倉庫	11,900	295.00	3,510,500
日本トランスシティ	16,000	443.00	7,088,000
ケイヒン	13,000	154.00	2,002,000
中央倉庫	4,000	1,090.00	4,360,000
安田倉庫	5,400	758.00	4,093,200
東洋埠頭	20,000	186.00	3,720,000
宇徳	5,600	410.00	2,296,000
上組	83,000	1,113.00	92,379,000
サンリツ	1,700	529.00	899,300
キムラユニティー	1,800	1,225.00	2,205,000
キューソー流通システム	2,200	2,471.00	5,436,200
郵船ロジスティクス	6,400	1,199.00	7,673,600
近鉄エクスプレス	12,400	1,562.00	19,368,800
東海運	3,700	443.00	1,639,100
エーアイティー	4,300	1,044.00	4,489,200
内外トランスライン	2,100	1,080.00	2,268,000
NEC ネットエスアイ	7,500	2,166.00	16,245,000
システナ	5,500	1,735.00	9,542,500
デジタルアーツ	3,100	2,699.00	8,366,900
新日鉄住金ソリューションズ	11,500	2,044.00	23,506,000
キューブシステム	3,000	685.00	2,055,000
コア	2,900	1,236.00	3,584,400
ソフトクリエイトホールディングス	3,300	1,358.00	4,481,400
T I S	22,700	2,460.00	55,842,000
ネオス	2,100	438.00	919,800
電算システム	2,400	1,688.00	4,051,200
グリー	41,700	630.00	26,271,000
コーエーテクモホールディングス	16,300	1,951.00	31,801,300
三菱総合研究所	2,700	3,190.00	8,613,000
ボルテージ	1,400	1,149.00	1,608,600
電算	800	2,360.00	1,888,000
A G S	1,700	1,538.00	2,614,600
ファインデックス	5,100	921.00	4,697,100
ヒト・コミュニケーションズ	1,600	1,494.00	2,390,400
ブレインパッド	1,000	1,386.00	1,386,000

K L a b	13,100	638.00	8,357,800
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,000	1,050.00	5,250,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,100	890.00	979,000
ネクソン	75,100	1,702.00	127,820,200
アイスタイル	10,500	762.00	8,001,000
エムアップ	2,000	635.00	1,270,000
エイチーム	3,800	2,190.00	8,322,000
テクノスジャパン	5,300	1,269.00	6,725,700
コロプラ	19,100	994.00	18,985,400
モバイルクリエイト	4,600	407.00	1,872,200
ブロードリーフ	16,900	655.00	11,069,500
ハーツユナイテッドグループ	3,600	1,703.00	6,130,800
メディアドゥ	1,500	1,458.00	2,187,000
ブイキューブ	3,800	655.00	2,489,000
サイバーリンクス	1,100	1,059.00	1,164,900
ディー・エル・イー	2,000	710.00	1,420,000
フィックスターズ	1,000	3,730.00	3,730,000
VOYAGE GROUP	2,300	1,111.00	2,555,300
オブティム	700	5,720.00	4,004,000
ベリサーブ	800	3,065.00	2,452,000
ティーガイア	6,800	1,841.00	12,518,800
日本アジアグループ	7,800	434.00	3,385,200
豆蔵ホールディングス	5,000	990.00	4,950,000
テクマトリックス	2,100	1,976.00	4,149,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	143,900	252.00	36,262,800
GMOペイメントゲートウェイ	5,600	5,230.00	29,288,000
ザッパラス	3,900	440.00	1,716,000
インターネットイニシアティブ	10,100	1,822.00	18,402,200
さくらインターネット	5,300	1,144.00	6,063,200
GMOクラウド	1,500	1,418.00	2,127,000
SRAホールディングス	3,600	2,582.00	9,295,200
Minor iソリューションズ	1,500	1,078.00	1,617,000
朝日ネット	6,300	490.00	3,087,000
アドソル日進	1,400	1,314.00	1,839,600
フリービット	3,800	943.00	3,583,400
コムチュア	1,200	3,325.00	3,990,000
サイバーコム	900	972.00	874,800
メディカル・データ・ビジョン	1,100	2,687.00	2,955,700
gumi	7,100	992.00	7,043,200
PCIホールディングス	800	2,536.00	2,028,800
パイブドHD	1,200	1,092.00	1,310,400
アイビーシー	600	1,002.00	601,200

LINE	11,500	4,025.00	46,287,500
AOI TYO Holdings	5,600	861.00	4,821,600
ソルクシーズ	2,000	545.00	1,090,000
フェイス	1,800	1,294.00	2,329,200
ハイマックス	900	1,432.00	1,288,800
野村総合研究所	51,300	3,585.00	183,910,500
サイバネットシステム	5,600	634.00	3,550,400
CEホールディングス	1,100	1,096.00	1,205,600
インテージホールディングス	3,900	1,983.00	7,733,700
東邦システムサイエンス	2,300	657.00	1,511,100
ソースネクスト	4,100	668.00	2,738,800
フォーカスシステムズ	2,700	560.00	1,512,000
クレスコ	1,600	2,495.00	3,992,000
フジ・メディア・ホールディングス	71,500	1,640.00	117,260,000
オービック	23,700	5,050.00	119,685,000
ジャストシステム	11,100	1,162.00	12,898,200
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,000	1,148.00	3,444,000
ヤフー	491,800	466.00	229,178,800
トレンドマイクロ	36,300	4,215.00	153,004,500
インフォメーション・ディベロプメント	1,900	1,134.00	2,154,600
日本オラクル	11,000	6,070.00	66,770,000
アルファシステムズ	2,300	1,988.00	4,572,400
フューチャー	9,300	755.00	7,021,500
CAC Holdings	5,100	911.00	4,646,100
ソフトバンク・テクノロジー	1,600	3,515.00	5,624,000
トーセ	1,900	824.00	1,565,600
オービックビジネスコンサルタント	3,500	5,080.00	17,780,000
伊藤忠テクノソリューションズ	15,500	2,965.00	45,957,500
アイティフォー	8,900	612.00	5,446,800
東計電算	1,200	2,119.00	2,542,800
エクスネット	600	1,809.00	1,085,400
大塚商会	18,500	5,360.00	99,160,000
サイボウズ	9,200	446.00	4,103,200
ソフトブレーン	9,400	400.00	3,760,000
電通国際情報サービス	4,200	1,763.00	7,404,600
デジタルガレージ	10,700	2,016.00	21,571,200
EMシステムズ	2,300	1,661.00	3,820,300
ウェザーニューズ	2,300	3,510.00	8,073,000
CIJ	6,300	517.00	3,257,100
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,516.00	1,061,200
日本エンタープライズ	7,100	272.00	1,931,200
WOWOW	3,300	3,390.00	11,187,000



スカラ	4,300	789.00	3,392,700
日本コロムビア	2,000	618.00	1,236,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	5,800	697.00	4,042,600
ネットワンシステムズ	29,700	733.00	21,770,100
システムソフト	12,200	161.00	1,964,200
アルゴグラフィックス	3,100	2,262.00	7,012,200
マーベラス	11,600	790.00	9,164,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,600	1,702.00	21,445,200
日本ユニシス	19,000	1,428.00	27,132,000
兼松エレクトロニクス	4,300	2,586.00	11,119,800
東京放送ホールディングス	45,200	1,952.00	88,230,400
日本テレビホールディングス	62,700	2,097.00	131,481,900
朝日放送	6,800	743.00	5,052,400
テレビ朝日ホールディングス	18,800	2,259.00	42,469,200
スカパーJ S A Tホールディングス	44,700	518.00	23,154,600
テレビ東京ホールディングス	5,600	2,307.00	12,919,200
日本BS放送	1,600	1,042.00	1,667,200
U - N E X T	1,800	682.00	1,227,600
ワイヤレスゲート	2,400	1,759.00	4,221,600
コネクシオ	6,100	1,495.00	9,119,500
日本通信	57,500	169.00	9,717,500
クロップス	1,500	569.00	853,500
日本電信電話	550,800	5,101.00	2,809,630,800
K D D I	678,700	3,079.00	2,089,717,300
光通信	8,200	10,580.00	86,756,000
N T T ドコモ	512,700	2,755.00	1,412,488,500
エムティーアイ	10,500	715.00	7,507,500
G M O インターネット	25,000	1,617.00	40,425,000
カドカワ	19,900	1,752.00	34,864,800
学研ホールディングス	23,000	317.00	7,291,000
ゼンリン	9,100	2,227.00	20,265,700
昭文社	3,800	698.00	2,652,400
インプレスホールディングス	5,600	145.00	812,000
アイネット	3,900	1,130.00	4,407,000
松竹	45,000	1,425.00	64,125,000
東宝	44,900	3,245.00	145,700,500
東映	26,000	999.00	25,974,000
エヌ・ティ・ティ・データ	42,400	5,610.00	237,864,000
ピー・シー・エー	1,000	1,451.00	1,451,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,200	1,057.00	1,268,400
D T S	7,100	2,499.00	17,742,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,400	3,195.00	84,348,000

シーイーシー	4,100	1,817.00	7,449,700
カブコン	16,100	2,590.00	41,699,000
アイ・エス・ピー	1,300	920.00	1,196,000
ジャステック	4,400	1,089.00	4,791,600
S C S K	18,700	4,070.00	76,109,000
日本システムウエア	2,300	1,517.00	3,489,100
アイネス	8,700	1,221.00	10,622,700
T K C	6,400	3,390.00	21,696,000
富士ソフト	10,200	2,809.00	28,651,800
N S D	14,600	1,817.00	26,528,200
コナミホールディングス	31,000	4,560.00	141,360,000
福井コンピュータホールディングス	2,000	3,015.00	6,030,000
J B C Cホールディングス	5,800	795.00	4,611,000
ミロク情報サービス	5,100	1,698.00	8,659,800
ソフトバンクグループ	308,800	8,450.00	2,609,360,000
ハウスイ	6,000	131.00	786,000
高千穂交易	2,700	1,008.00	2,721,600
伊藤忠食品	1,700	4,320.00	7,344,000
エレマテック	2,700	2,015.00	5,440,500
J A L U X	2,200	2,052.00	4,514,400
あらた	3,100	2,708.00	8,394,800
トーメンデバイス	1,000	2,132.00	2,132,000
東京エレクトロン デバイス	2,500	1,597.00	3,992,500
フィールズ	5,300	1,345.00	7,128,500
双日	405,200	290.00	117,508,000
アルフレッサ ホールディングス	81,200	1,898.00	154,117,600
横浜冷凍	17,000	1,033.00	17,561,000
神栄	9,000	173.00	1,557,000
山下医科器械	600	1,785.00	1,071,000
ラサ商事	3,000	622.00	1,866,000
ラクーン	3,000	446.00	1,338,000
アルコニックス	3,900	1,709.00	6,665,100
神戸物産	3,700	3,795.00	14,041,500
あい ホールディングス	12,200	2,241.00	27,340,200
ディー・ブイエックス	2,400	1,299.00	3,117,600
ダイワボウホールディングス	58,000	281.00	16,298,000
マクニカ・富士エレホールディングス	12,700	1,583.00	20,104,100
バイタルケー・エスケー・ホールディングス	12,900	998.00	12,874,200
八洲電機	5,300	634.00	3,360,200
U K Cホールディングス	4,400	2,290.00	10,076,000
O C H Iホールディングス	2,000	1,304.00	2,608,000
T O K A Iホールディングス	30,200	788.00	23,797,600

大阪工機	800	734.00	587,200
三洋貿易	3,800	1,599.00	6,076,200
ビューティガレージ	600	1,097.00	658,200
ウイン・パートナーズ	5,000	1,003.00	5,015,000
ミタチ産業	1,800	622.00	1,119,600
シップヘルスケアホールディングス	13,200	2,909.00	38,398,800
明治電機工業	2,400	1,230.00	2,952,000
デリカフーズ	1,500	1,031.00	1,546,500
スターティア	1,600	531.00	849,600
コメダホールディングス	9,300	1,902.00	17,688,600
富士興産	2,500	460.00	1,150,000
協栄産業	8,000	160.00	1,280,000
小野建	6,000	1,355.00	8,130,000
佐島電機	5,400	742.00	4,006,800
エコートレーディング	1,600	694.00	1,110,400
伯東	4,700	1,035.00	4,864,500
コンドーテック	5,500	849.00	4,669,500
中山福	4,000	817.00	3,268,000
ナガイレーベン	9,900	2,480.00	24,552,000
三菱食品	7,500	3,300.00	24,750,000
松田産業	5,000	1,534.00	7,670,000
第一興商	11,200	4,550.00	50,960,000
メディバルホールディングス	68,600	1,837.00	126,018,200
S P K	1,500	2,421.00	3,631,500
萩原電気	2,300	2,119.00	4,873,700
アズワン	5,400	5,120.00	27,648,000
スズデン	2,500	1,033.00	2,582,500
尾家産業	2,200	1,122.00	2,468,400
シモジマ	4,200	1,148.00	4,821,600
ドウシシャ	8,100	2,130.00	17,253,000
小津産業	1,500	2,170.00	3,255,000
高速	4,100	1,085.00	4,448,500
たけびし	2,400	1,242.00	2,980,800
黒田電気	9,400	2,373.00	22,306,200
リックス	1,600	1,587.00	2,539,200
丸文	6,100	693.00	4,227,300
ハピネット	5,700	1,270.00	7,239,000
橋本総業ホールディングス	1,400	1,530.00	2,142,000
日本ライフライン	5,900	2,064.00	12,177,600
エクセル	2,900	1,528.00	4,431,200
マルカキカイ	2,200	1,619.00	3,561,800
I D O M	18,500	717.00	13,264,500

日本エム・ディ・エム	5,200	890.00	4,628,000	
進和	4,100	1,776.00	7,281,600	
エスケイジャパン	1,300	302.00	392,600	
ダイترون	3,200	931.00	2,979,200	
シークス	4,900	4,075.00	19,967,500	
田中商事	2,100	708.00	1,486,800	
オーハシテクニカ	3,900	1,482.00	5,779,800	
白銅	1,700	1,471.00	2,500,700	
伊藤忠商事	502,500	1,561.00	784,402,500	
丸紅	675,200	687.60	464,267,520	
高島	12,000	201.00	2,412,000	
長瀬産業	41,300	1,543.00	63,725,900	
蝶理	4,400	1,848.00	8,131,200	
豊田通商	76,400	3,015.00	230,346,000	
三共生興	10,400	413.00	4,295,200	
兼松	146,000	194.00	28,324,000	
ツカモトコーポレーション	12,000	129.00	1,548,000	
三井物産	620,400	1,649.00	1,023,039,600	
日本紙パルプ商事	36,000	374.00	13,464,000	
日立ハイテクノロジーズ	23,800	4,630.00	110,194,000	
カメイ	8,900	1,237.00	11,009,300	
東都水産	1,100	1,860.00	2,046,000	
OUGホールディングス	11,000	261.00	2,871,000	
スターゼン	2,900	4,800.00	13,920,000	
山善	26,400	967.00	25,528,800	
椿本興業	8,000	365.00	2,920,000	
住友商事	431,900	1,403.00	605,955,700	
内田洋行	3,400	2,432.00	8,268,800	
三菱商事	514,800	2,557.50	1,316,601,000	
第一実業	16,000	668.00	10,688,000	
キャノンマーケティングジャパン	19,600	1,953.00	38,278,800	
西華産業	22,000	343.00	7,546,000	
佐藤商事	6,100	860.00	5,246,000	
菱洋エレクトロ	6,600	1,473.00	9,721,800	
東京産業	6,900	471.00	3,249,900	
ユアサ商事	6,500	2,939.00	19,103,500	
神鋼商事	1,700	2,442.00	4,151,400	
小林産業	5,100	261.00	1,331,100	
阪和興業	69,000	760.00	52,440,000	
カナデン	6,600	1,029.00	6,791,400	
菱電商事	11,000	748.00	8,228,000	
フルサト工業	3,800	1,752.00	6,657,600	

岩谷産業	76,000	621.00	47,196,000
すてきナイスグループ	29,000	154.00	4,466,000
昭光通商	24,000	103.00	2,472,000
ニチモウ	10,000	177.00	1,770,000
極東貿易	11,000	239.00	2,629,000
イワキ	10,000	266.00	2,660,000
三愛石油	18,400	861.00	15,842,400
稲畑産業	16,500	1,294.00	21,351,000
G S I クレオス	17,000	133.00	2,261,000
明和産業	6,400	393.00	2,515,200
ワキタ	14,600	1,033.00	15,081,800
東邦ホールディングス	22,000	2,388.00	52,536,000
サンゲツ	23,500	2,043.00	48,010,500
ミツウロコグループホールディングス	11,100	725.00	8,047,500
シナネンホールディングス	3,000	2,186.00	6,558,000
伊藤忠エネクス	15,200	933.00	14,181,600
サンリオ	21,200	2,300.00	48,760,000
サンワテクノス	4,100	953.00	3,907,300
リョーサン	10,200	3,505.00	35,751,000
新光商事	7,500	1,240.00	9,300,000
トーヨー	3,100	2,543.00	7,883,300
三信電気	7,600	1,216.00	9,241,600
東陽テクニカ	9,100	1,006.00	9,154,600
モスフードサービス	9,000	3,365.00	30,285,000
加賀電子	6,200	1,945.00	12,059,000
ソーダニッカ	7,100	508.00	3,606,800
立花エレテック	4,600	1,380.00	6,348,000
フォーバル	3,000	741.00	2,223,000
P A L T A C	11,000	2,843.00	31,273,000
三谷産業	7,300	365.00	2,664,500
ヤマタネ	3,400	1,606.00	5,460,400
丸紅建材リース	7,000	226.00	1,582,000
日鉄住金物産	6,000	4,645.00	27,870,000
トラスコ中山	15,700	2,556.00	40,129,200
オートバックスセブン	25,400	1,776.00	45,110,400
加藤産業	10,700	2,723.00	29,136,100
イノテック	5,900	599.00	3,534,100
イエローハット	6,500	2,577.00	16,750,500
J K ホールディングス	6,900	596.00	4,112,400
日伝	2,800	3,255.00	9,114,000
北沢産業	5,800	201.00	1,165,800
杉本商事	3,900	1,504.00	5,865,600

因幡電機産業	9,600	3,980.00	38,208,000
バイテックホールディングス	2,800	1,259.00	3,525,200
ミスミグループ本社	77,100	1,925.00	148,417,500
アルテック	5,800	211.00	1,223,800
タキヒヨー	10,000	473.00	4,730,000
蔵王産業	1,100	1,467.00	1,613,700
スズケン	31,200	3,810.00	118,872,000
ジェコス	4,700	1,117.00	5,249,900
ルネサスイーストン	6,300	561.00	3,534,300
ローソン	24,200	8,010.00	193,842,000
サンエー	5,200	5,210.00	27,092,000
カワチ薬品	5,300	2,989.00	15,841,700
エービーシー・マート	12,500	6,410.00	80,125,000
ハードオフコーポレーション	3,100	1,198.00	3,713,800
アスクル	8,400	3,580.00	30,072,000
ゲオホールディングス	11,500	1,313.00	15,099,500
アダストリア	10,500	3,155.00	33,127,500
ジーフット	4,200	805.00	3,381,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	717.00	645,300
くらコーポレーション	4,500	4,700.00	21,150,000
キャンドウ	3,700	1,831.00	6,774,700
パルグループホールディングス	3,500	2,916.00	10,206,000
エディオン	26,700	1,081.00	28,862,700
サーラコーポレーション	8,700	646.00	5,620,200
ワッツ	3,000	1,124.00	3,372,000
ハローズ	2,300	2,369.00	5,448,700
あみやき亭	1,300	3,935.00	5,115,500
ひらまつ	9,600	656.00	6,297,600
ゲンキー	1,400	6,600.00	9,240,000
大黒天物産	1,700	5,120.00	8,704,000
ハニーズ	6,000	1,072.00	6,432,000
ファーマライズホールディングス	1,800	511.00	919,800
アルペン	6,200	2,024.00	12,548,800
クオール	7,800	1,440.00	11,232,000
ジェイアイエヌ	4,700	5,680.00	26,696,000
ビックカメラ	39,500	1,067.00	42,146,500
D C Mホールディングス	41,700	1,023.00	42,659,100
Monotaro	24,300	2,501.00	60,774,300
東京一番フーズ	1,800	571.00	1,027,800
ダイヤモンドダイニング	1,500	1,396.00	2,094,000
きちり	2,000	648.00	1,296,000
アーランドサービスホールディングス	2,200	2,949.00	6,487,800

J・フロント リテイリング	86,800	1,695.00	147,126,000
ドトール・日レスホールディングス	12,100	2,090.00	25,289,000
マツモトキヨシホールディングス	13,000	5,620.00	73,060,000
ブロンコピリー	3,600	2,846.00	10,245,600
スタートトゥデイ	62,600	2,041.00	127,766,600
トレジャー・ファクトリー	2,000	834.00	1,668,000
物語コーポレーション	1,800	4,030.00	7,254,000
ココカラファイン	7,200	4,340.00	31,248,000
三越伊勢丹ホールディングス	136,500	1,335.00	182,227,500
H a m e e	1,000	892.00	892,000
ウエルシアホールディングス	6,800	6,320.00	42,976,000
クリエイティブSDホールディングス	10,100	2,557.00	25,825,700
丸善C H Iホールディングス	8,000	364.00	2,912,000
ミサワ	1,400	518.00	725,200
ティーライフ	700	1,406.00	984,200
エー・ピーカンパニー	1,300	775.00	1,007,500
チムニー	2,100	2,828.00	5,938,800
シュッピン	2,600	1,413.00	3,673,800
ネクステージ	1,400	2,080.00	2,912,000
ジョイフル本田	11,100	3,120.00	34,632,000
鳥貴族	1,700	2,414.00	4,103,800
麒麟堂ホールディングス	2,300	850.00	1,955,000
ホットランド	3,200	1,088.00	3,481,600
すかいらーく	29,500	1,503.00	44,338,500
綿半ホールディングス	2,800	1,605.00	4,494,000
ヨシックス	700	1,344.00	940,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	22,800	992.00	22,617,600
ブックオフコーポレーション	4,000	818.00	3,272,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	907.00	2,539,600
B E E N O S	800	1,430.00	1,144,000
あさひ	5,200	1,336.00	6,947,200
日本調剤	2,400	4,360.00	10,464,000
コスモス薬品	3,500	21,000.00	73,500,000
トーエル	3,400	963.00	3,274,200
一六堂	1,600	384.00	614,400
オンリー	900	816.00	734,400
セブン&アイ・ホールディングス	287,200	4,647.00	1,334,618,400
薬王堂	3,400	2,083.00	7,082,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	18,500	982.00	18,167,000
ツルハホールディングス	15,800	10,710.00	169,218,000
サンマルクホールディングス	4,400	3,395.00	14,938,000

フェリシモ	2,000	1,020.00	2,040,000
トリドールホールディングス	8,400	2,475.00	20,790,000
サツドラホールディングス	1,000	1,988.00	1,988,000
ダイユー・リックホールディングス	2,400	777.00	1,864,800
パロックジャパンリミテッド	4,100	1,271.00	5,211,100
クスリのアオキホールディングス	6,100	4,925.00	30,042,500
メディカルシステムネットワーク	7,900	430.00	3,397,000
総合メディカル	3,300	4,190.00	13,827,000
はるやまホールディングス	3,300	865.00	2,854,500
ノジマ	8,000	1,258.00	10,064,000
カッパ・クリエイト	9,700	1,311.00	12,716,700
ライトオン	5,200	1,001.00	5,205,200
良品計画	9,100	21,360.00	194,376,000
三城ホールディングス	8,600	477.00	4,102,200
アドヴァン	7,000	1,137.00	7,959,000
アルビス	1,800	3,240.00	5,832,000
コナカ	8,900	575.00	5,117,500
ハウス オブ ローゼ	900	1,570.00	1,413,000
G-7ホールディングス	2,100	1,860.00	3,906,000
イオン北海道	6,900	597.00	4,119,300
コジマ	10,500	272.00	2,856,000
ヒマラヤ	2,300	866.00	1,991,800
コーナン商事	9,800	2,107.00	20,648,600
エコス	2,700	1,215.00	3,280,500
マルシェ	1,700	826.00	1,404,200
ドンキホーテホールディングス	44,400	4,235.00	188,034,000
西松屋チェーン	12,100	1,392.00	16,843,200
ゼンショーホールディングス	35,500	1,893.00	67,201,500
幸楽苑ホールディングス	4,400	1,650.00	7,260,000
ハークスレイ	1,800	1,100.00	1,980,000
サイゼリヤ	11,300	2,640.00	29,832,000
V Tホールディングス	23,300	550.00	12,815,000
魚力	2,200	1,298.00	2,855,600
ポブラ	1,700	510.00	867,000
フジ・コーポレーション	1,100	2,021.00	2,223,100
ユナイテッドアローズ	9,100	3,385.00	30,803,500
ハイデイ日高	6,300	2,706.00	17,047,800
京都きもの友禅	4,400	984.00	4,329,600
コロワイド	22,800	1,925.00	43,890,000
ピーシーデポコーポレーション	9,100	611.00	5,560,100
壱番屋	6,200	3,705.00	22,971,000
トップカルチャー	2,700	480.00	1,296,000



PLANT	1,600	1,200.00	1,920,000
スギホールディングス	15,100	5,210.00	78,671,000
スクロール	10,600	342.00	3,625,200
ヨンドシーホールディングス	5,300	2,391.00	12,672,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	30,100	7,280.00	219,128,000
木曽路	8,400	2,351.00	19,748,400
サトレストランシステムズ	8,200	825.00	6,765,000
千趣会	12,500	723.00	9,037,500
タカキュー	5,900	203.00	1,197,700
ケーヨー	11,600	566.00	6,565,600
上新電機	16,000	1,058.00	16,928,000
日本瓦斯	12,600	3,360.00	42,336,000
ベスト電器	22,100	146.00	3,226,600
ロイヤルホールディングス	11,400	1,909.00	21,762,600
いなげや	7,700	1,525.00	11,742,500
島忠	17,800	2,790.00	49,662,000
チヨダ	8,100	2,718.00	22,015,800
ライフコーポレーション	5,300	3,275.00	17,357,500
リンガーハット	7,800	2,312.00	18,033,600
MrMax	8,800	402.00	3,537,600
テンアライド	6,300	387.00	2,438,100
AOKIホールディングス	13,700	1,447.00	19,823,900
オークワ	10,000	1,153.00	11,530,000
コメリ	10,600	2,755.00	29,203,000
青山商事	14,400	3,935.00	56,664,000
しまむら	8,000	14,890.00	119,120,000
はせがわ	3,900	443.00	1,727,700
高島屋	115,000	987.00	113,505,000
松屋	15,500	984.00	15,252,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,200	1,827.00	64,310,400
近鉄百貨店	26,000	361.00	9,386,000
パルコ	6,600	1,078.00	7,114,800
丸井グループ	72,500	1,698.00	123,105,000
アクシアル リテイリング	5,300	4,160.00	22,048,000
イオン	282,300	1,668.00	470,876,400
イズミ	13,700	4,740.00	64,938,000
東武ストア	800	2,880.00	2,304,000
平和堂	13,900	2,669.00	37,099,100
フジ	7,600	2,375.00	18,050,000
ヤオコー	7,800	4,580.00	35,724,000
ゼビオホールディングス	9,300	1,778.00	16,535,400
ケーブホールディングス	31,600	2,083.00	65,822,800

Olympicグループ	4,200	624.00	2,620,800
日産東京販売ホールディングス	10,300	335.00	3,450,500
アインホールディングス	8,300	8,040.00	66,732,000
元気寿司	1,800	2,158.00	3,884,400
ヤマダ電機	229,600	635.00	145,796,000
アークランドサカモト	11,700	1,391.00	16,274,700
ニトリホールディングス	29,600	12,600.00	372,960,000
グルメ杵屋	5,000	1,016.00	5,080,000
愛眼	5,000	197.00	985,000
ケーユーホールディングス	3,700	845.00	3,126,500
吉野家ホールディングス	23,900	1,630.00	38,957,000
松屋フーズ	3,300	3,850.00	12,705,000
サガミチェーン	8,600	1,306.00	11,231,600
関西スーパーマーケット	5,600	1,543.00	8,640,800
王将フードサービス	5,000	4,410.00	22,050,000
プレナス	7,700	2,457.00	18,918,900
ミニストップ	5,100	2,004.00	10,220,400
アークス	12,900	2,552.00	32,920,800
パローホールディングス	14,800	2,986.00	44,192,800
藤久	600	1,712.00	1,027,200
ベルク	3,100	4,240.00	13,144,000
大庄	3,700	1,583.00	5,857,100
ファーストリテイリング	11,400	37,240.00	424,536,000
サンドラッグ	13,100	8,090.00	105,979,000
サックスパー ホールディングス	6,500	1,107.00	7,195,500
ヤマザワ	1,500	1,838.00	2,757,000
やまや	1,400	1,713.00	2,398,200
ベルーナ	17,200	746.00	12,831,200
島根銀行	1,400	1,369.00	1,916,600
じもとホールディングス	49,200	192.00	9,446,400
めぶきフィナンシャルグループ	330,800	438.00	144,890,400
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,900	4,130.00	40,887,000
九州フィナンシャルグループ	112,500	786.00	88,425,000
ゆうちょ銀行	194,300	1,382.00	268,522,600
富山第一銀行	17,400	522.00	9,082,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	449,200	585.80	263,141,360
西日本フィナンシャルホールディングス	46,500	1,229.00	57,148,500
新生銀行	653,000	197.00	128,641,000
あおぞら銀行	434,000	417.00	180,978,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,199,000	731.10	3,800,988,900
りそなホールディングス	802,600	611.90	491,110,940
三井住友トラスト・ホールディングス	143,200	4,247.00	608,170,400

三井住友フィナンシャルグループ	549,400	4,487.00	2,465,157,800	
第四銀行	84,000	521.00	43,764,000	
北越銀行	7,400	2,664.00	19,713,600	
千葉銀行	265,000	721.00	191,065,000	
群馬銀行	152,500	631.00	96,227,500	
武蔵野銀行	10,900	3,405.00	37,114,500	
千葉興業銀行	18,800	600.00	11,280,000	
筑波銀行	28,500	351.00	10,003,500	
七十七銀行	108,000	559.00	60,372,000	
青森銀行	53,000	384.00	20,352,000	
秋田銀行	45,000	374.00	16,830,000	
山形銀行	39,000	492.00	19,188,000	
岩手銀行	4,500	4,695.00	21,127,500	
東邦銀行	61,000	431.00	26,291,000	
東北銀行	35,000	158.00	5,530,000	
みちのく銀行	34,000	193.00	6,562,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	278,000	508.00	141,224,000	
静岡銀行	187,000	991.00	185,317,000	
十六銀行	92,000	406.00	37,352,000	
スルガ銀行	70,100	2,553.00	178,965,300	
八十二銀行	132,400	674.00	89,237,600	
山梨中央銀行	42,000	549.00	23,058,000	
大垣共立銀行	92,000	454.00	41,768,000	
福井銀行	59,000	301.00	17,759,000	
北國銀行	73,000	438.00	31,974,000	
清水銀行	2,300	3,730.00	8,579,000	
富山銀行	1,300	4,260.00	5,538,000	
滋賀銀行	64,000	638.00	40,832,000	
南都銀行	6,600	4,595.00	30,327,000	
百五銀行	62,000	471.00	29,202,000	
京都銀行	123,000	882.00	108,486,000	
紀陽銀行	25,800	1,840.00	47,472,000	
三重銀行	3,100	2,421.00	7,505,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	45,600	1,987.00	90,607,200	
広島銀行	202,000	538.00	108,676,000	
山陰合同銀行	41,200	968.00	39,881,600	
中国銀行	48,600	1,670.00	81,162,000	
鳥取銀行	2,200	1,924.00	4,232,800	
伊予銀行	73,400	769.00	56,444,600	
百十四銀行	75,000	388.00	29,100,000	
四国銀行	53,000	286.00	15,158,000	
阿波銀行	59,000	696.00	41,064,000	

大分銀行	39,000	433.00	16,887,000
宮崎銀行	46,000	377.00	17,342,000
佐賀銀行	42,000	303.00	12,726,000
十八銀行	42,000	354.00	14,868,000
沖縄銀行	6,700	4,145.00	27,771,500
琉球銀行	14,100	1,519.00	21,417,900
セブン銀行	257,200	323.00	83,075,600
みずほフィナンシャルグループ	9,315,100	212.80	1,982,253,280
高知銀行	25,000	136.00	3,400,000
山口フィナンシャルグループ	64,000	1,253.00	80,192,000
長野銀行	2,200	2,007.00	4,415,400
名古屋銀行	5,800	4,210.00	24,418,000
北洋銀行	112,000	464.00	51,968,000
愛知銀行	2,300	6,680.00	15,364,000
第三銀行	3,900	1,810.00	7,059,000
中京銀行	2,800	2,340.00	6,552,000
大光銀行	24,000	259.00	6,216,000
愛媛銀行	8,100	1,360.00	11,016,000
トマト銀行	2,600	1,611.00	4,188,600
みなと銀行	6,200	2,164.00	13,416,800
京葉銀行	56,000	535.00	29,960,000
関西アーバン銀行	9,600	1,449.00	13,910,400
栃木銀行	37,900	585.00	22,171,500
北日本銀行	2,100	3,125.00	6,562,500
東和銀行	128,000	114.00	14,592,000
福島銀行	74,000	96.00	7,104,000
大東銀行	36,000	169.00	6,084,000
トモニホールディングス	56,500	609.00	34,408,500
フィデアホールディングス	66,600	211.00	14,052,600
池田泉州ホールディングス	72,800	543.00	39,530,400
F P G	25,200	1,047.00	26,384,400
S B I ホールディングス	77,600	1,550.00	120,280,000
ジャフコ	11,500	3,755.00	43,182,500
大和証券グループ本社	642,000	727.10	466,798,200
野村ホールディングス	1,402,600	701.30	983,643,380
岡三証券グループ	58,000	737.00	42,746,000
丸三証券	21,800	984.00	21,451,200
東洋証券	25,000	277.00	6,925,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	78,700	639.00	50,289,300
光世証券	17,000	193.00	3,281,000
水戸証券	21,300	315.00	6,709,500
いちよし証券	15,400	894.00	13,767,600

松井証券	39,200	1,006.00	39,435,200
だいこう証券ビジネス	4,200	621.00	2,608,200
マネックスグループ	75,700	318.00	24,072,600
カブドットコム証券	51,200	399.00	20,428,800
極東証券	9,200	1,719.00	15,814,800
岩井コスモホールディングス	6,500	1,064.00	6,916,000
藍澤証券	12,800	664.00	8,499,200
マネーパートナーズグループ	10,500	526.00	5,523,000
かんぽ生命保険	25,900	2,484.00	64,335,600
S O M P Oホールディングス	143,400	4,144.00	594,249,600
アニコム ホールディングス	4,600	2,280.00	10,488,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	205,000	3,796.00	778,180,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	65,700	1,914.00	125,749,800
第一生命ホールディングス	413,700	2,064.00	853,876,800
東京海上ホールディングス	278,000	4,812.00	1,337,736,000
T & Dホールディングス	250,100	1,636.50	409,288,650
アドバンスクリエイト	1,600	1,925.00	3,080,000
全国保証	19,300	3,875.00	74,787,500
クレディセゾン	52,000	2,076.00	107,952,000
アクリーティブ	5,800	457.00	2,650,600
芙蓉総合リース	7,800	5,610.00	43,758,000
興銀リース	12,900	2,559.00	33,011,100
東京センチュリー	13,800	3,960.00	54,648,000
日本証券金融	30,200	617.00	18,633,400
アイフル	115,100	339.00	39,018,900
ポケットカード	5,100	606.00	3,090,600
リコーリース	5,400	3,550.00	19,170,000
イオンフィナンシャルサービス	43,800	2,003.00	87,731,400
アコム	137,800	481.00	66,281,800
ジャックス	38,000	511.00	19,418,000
オリエントコーポレーション	148,300	207.00	30,698,100
日立キャピタル	16,200	2,885.00	46,737,000
アプラスフィナンシャル	32,900	118.00	3,882,200
オリックス	485,800	1,845.00	896,301,000
三菱UFJリース	174,000	617.00	107,358,000
日本取引所グループ	213,300	1,632.00	348,105,600
イー・ギャランティ	2,000	2,597.00	5,194,000
アサックス	1,200	1,563.00	1,875,600
N E Cキャピタルソリューション	2,800	1,754.00	4,911,200
いちご	65,300	400.00	26,120,000
日本駐車場開発	83,000	154.00	12,782,000
ヒューリック	143,100	1,026.00	146,820,600

三栄建築設計	2,800	1,659.00	4,645,200
野村不動産ホールディングス	45,600	1,969.00	89,786,400
三重交通グループホールディングス	12,300	392.00	4,821,600
サムティ	5,500	1,149.00	6,319,500
ディア・ライフ	4,700	379.00	1,781,300
エー・ディー・ワークス	63,800	44.00	2,807,200
日本商業開発	3,800	1,963.00	7,459,400
プレサンスコーポレーション	10,700	1,337.00	14,305,900
ユニゾホールディングス	5,700	3,160.00	18,012,000
THEグローバル社	2,500	450.00	1,125,000
日本管理センター	5,000	1,292.00	6,460,000
サンセイランディック	1,500	729.00	1,093,500
エストラスト	1,300	675.00	877,500
フージャースホールディングス	8,900	607.00	5,402,300
オープンハウス	9,900	2,660.00	26,334,000
東急不動産ホールディングス	166,000	694.00	115,204,000
飯田グループホールディングス	57,200	2,205.00	126,126,000
ムゲンエステート	2,400	747.00	1,792,800
ファーストブラザーズ	700	1,826.00	1,278,200
シーアールイー	1,000	1,496.00	1,496,000
パーク24	34,800	3,050.00	106,140,000
パラカ	2,000	2,003.00	4,006,000
三井不動産	364,000	2,646.50	963,326,000
三菱地所	510,000	2,248.00	1,146,480,000
平和不動産	13,000	1,585.00	20,605,000
東京建物	79,600	1,538.00	122,424,800
ダイビル	17,700	998.00	17,664,600
京阪神ビルディング	11,400	609.00	6,942,600
住友不動産	164,000	3,122.00	512,008,000
大京	128,000	234.00	29,952,000
テーオーシー	26,600	911.00	24,232,600
東京楽天地	11,000	537.00	5,907,000
レオパレス21	86,700	658.00	57,048,600
スターツコーポレーション	7,000	2,018.00	14,126,000
フジ住宅	8,800	749.00	6,591,200
空港施設	8,400	576.00	4,838,400
明和地所	3,800	717.00	2,724,600
住友不動産販売	6,200	2,630.00	16,306,000
ゴールドクレスト	6,200	2,155.00	13,361,000
日本エスリード	2,700	1,339.00	3,615,300
日神不動産	8,200	539.00	4,419,800
日本エスコン	9,200	392.00	3,606,400

タカラレーベン	30,000	697.00	20,910,000
サンヨーハウジング名古屋	3,600	1,034.00	3,722,400
イオンモール	44,200	1,662.00	73,460,400
ファースト住建	2,600	1,445.00	3,757,000
トーセイ	9,400	790.00	7,426,000
穴吹興産	800	2,601.00	2,080,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	42,700	1,012.00	43,212,400
サンフロンティア不動産	7,400	1,011.00	7,481,400
エフ・ジェー・ネクスト	6,000	730.00	4,380,000
インテリックス	1,500	789.00	1,183,500
ランドビジネス	4,000	280.00	1,120,000
グランディハウス	6,100	418.00	2,549,800
日本空港ビルデング	21,900	4,195.00	91,870,500
日本工営	4,900	2,517.00	12,333,300
ネクスト	18,000	805.00	14,490,000
ジェイエシーリクルートメント	4,500	1,343.00	6,043,500
日本M&Aセンター	21,000	3,375.00	70,875,000
中広	900	694.00	624,600
タケエイ	6,400	1,030.00	6,592,000
トラスト・テック	3,000	1,690.00	5,070,000
コシダカホールディングス	2,500	2,210.00	5,525,000
パソナグループ	6,500	758.00	4,927,000
CDS	1,700	1,037.00	1,762,900
リンクアンドモチベーション	17,500	431.00	7,542,500
GCA	6,500	816.00	5,304,000
エス・エム・エス	10,300	2,734.00	28,160,200
テンプホールディングス	56,100	1,934.00	108,497,400
リニカル	4,400	1,260.00	5,544,000
クックパッド	16,200	1,046.00	16,945,200
エスクリ	3,000	613.00	1,839,000
アイ・ケイ・ケイ	3,300	697.00	2,300,100
学情	3,100	1,200.00	3,720,000
スタジオアリス	3,000	2,172.00	6,516,000
シミックホールディングス	3,700	1,550.00	5,735,000
NJS	1,700	1,378.00	2,342,600
総合警備保障	26,400	4,625.00	122,100,000
カカクコム	51,800	1,970.00	102,046,000
アイロムグループ	2,100	1,325.00	2,782,500
ルネサンス	3,800	1,472.00	5,593,600
ディップ	9,400	2,244.00	21,093,600
オプトホールディング	5,500	713.00	3,921,500
ツクイ	17,600	795.00	13,992,000

キャリアデザインセンター	1,600	1,298.00	2,076,800
エムスリー	62,900	3,035.00	190,901,500
ツカダ・グローバルホールディング	5,500	660.00	3,630,000
アウトソーシング	4,200	3,945.00	16,569,000
ウェルネット	5,600	1,278.00	7,156,800
ワールドホールディングス	1,700	2,057.00	3,496,900
ディー・エヌ・エー	32,600	2,651.00	86,422,600
博報堂D Yホールディングス	100,700	1,410.00	141,987,000
ぐるなび	10,500	2,478.00	26,019,000
エスアールジータカミヤ	8,200	606.00	4,969,200
ジャパンベストレスキューシステム	9,000	241.00	2,169,000
ファンコミュニケーションズ	18,500	743.00	13,745,500
ライク	1,600	2,568.00	4,108,800
WDBホールディングス	2,600	1,311.00	3,408,600
ティア	3,600	631.00	2,271,600
バリューコマース	6,800	336.00	2,284,800
インフォマート	30,900	626.00	19,343,400
J Pホールディングス	21,900	262.00	5,737,800
E P Sホールディングス	9,000	1,408.00	12,672,000
レッグス	1,700	849.00	1,443,300
プレステージ・インターナショナル	10,300	804.00	8,281,200
アミューズ	4,000	1,816.00	7,264,000
ドリームインキュベータ	2,200	2,019.00	4,441,800
クイック	3,800	1,054.00	4,005,200
T A C	5,000	227.00	1,135,000
ケネディクス	97,600	433.00	42,260,800
電通	80,900	5,400.00	436,860,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	771.00	2,852,700
ぴあ	2,200	2,818.00	6,199,600
イオンファンタジー	2,100	3,225.00	6,772,500
シーティーエス	2,100	1,305.00	2,740,500
ネクシィーズグループ	2,700	1,490.00	4,023,000
みらかホールディングス	18,500	5,240.00	96,940,000
アルプス技研	2,900	2,583.00	7,490,700
ダイオーズ	1,300	1,059.00	1,376,700
日本空調サービス	7,000	624.00	4,368,000
オリエンタルランド	78,500	6,402.00	502,557,000
ダスキン	18,600	2,356.00	43,821,600
明光ネットワークジャパン	9,000	1,209.00	10,881,000
ファルコホールディングス	3,400	1,492.00	5,072,800
ラウンドワン	22,700	794.00	18,023,800
リゾートトラスト	28,100	2,116.00	59,459,600



ビー・エム・エル	9,500	2,760.00	26,220,000
ワタベウェディング	1,200	427.00	512,400
りらいあコミュニケーションズ	12,000	1,196.00	14,352,000
リソー教育	12,400	582.00	7,216,800
早稲田アカデミー	1,000	1,120.00	1,120,000
ユー・エス・エス	87,900	1,995.00	175,360,500
東京個別指導学院	2,400	937.00	2,248,800
サイバーエージェント	38,200	2,976.00	113,683,200
楽天	371,000	1,136.50	421,641,500
クリーク・アンド・リバー社	2,800	928.00	2,598,400
テー・オー・ダブリュー	5,900	642.00	3,787,800
セントラルスポーツ	2,500	2,944.00	7,360,000
フルキャストホールディングス	7,500	956.00	7,170,000
リソルホールディングス	7,000	339.00	2,373,000
テクノプロ・ホールディングス	11,800	3,745.00	44,191,000
アトラ	1,000	754.00	754,000
インターワークス	1,600	1,208.00	1,932,800
K e e P e r 技研	800	1,935.00	1,548,000
ファーストロジック	400	2,036.00	814,400
デザインワン・ジャパン	600	2,535.00	1,521,000
イー・ガーディアン	2,400	1,758.00	4,219,200
リブセンス	5,000	445.00	2,225,000
ジャパンマテリアル	5,300	1,729.00	9,163,700
ベクトル	6,000	1,115.00	6,690,000
ウチヤマホールディングス	3,600	437.00	1,573,200
サクセスホールディングス	800	1,366.00	1,092,800
キャリアリンク	1,700	761.00	1,293,700
I B J	5,700	640.00	3,648,000
アサンテ	2,700	1,725.00	4,657,500
N・フィールド	3,500	1,406.00	4,921,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,000	3,180.00	3,180,000
ライドオン・エクスプレス	1,800	837.00	1,506,600
E R Iホールディングス	2,000	801.00	1,602,000
アビスト	1,100	3,765.00	4,141,500
ウィルグループ	3,200	720.00	2,304,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,300	1,759.00	2,286,700
日本ビューホテル	1,100	1,383.00	1,521,300
リクルートホールディングス	158,600	5,000.00	793,000,000
エラン	1,000	1,269.00	1,269,000
土木管理総合試験所	800	732.00	585,600
日本郵政	189,500	1,445.00	273,827,500
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,024.00	11,571,200

ソラスト	3,300	1,321.00	4,359,300	
リログループ	2,700	15,990.00	43,173,000	
東祥	1,600	5,130.00	8,208,000	
エイチ・アイ・エス	11,900	3,000.00	35,700,000	
ラックランド	1,300	1,849.00	2,403,700	
共立メンテナンス	5,900	7,380.00	43,542,000	
イチネンホールディングス	7,700	1,145.00	8,816,500	
建設技術研究所	4,600	1,046.00	4,811,600	
スペース	4,000	1,226.00	4,904,000	
燦ホールディングス	1,500	1,570.00	2,355,000	
スバル興業	5,000	551.00	2,755,000	
東京テアトル	28,000	166.00	4,648,000	
タナベ経営	1,500	1,278.00	1,917,000	
ナガワ	1,300	4,495.00	5,843,500	
よみうりランド	15,000	471.00	7,065,000	
東京都競馬	50,000	270.00	13,500,000	
カナモト	10,100	3,080.00	31,108,000	
東京ドーム	29,100	1,109.00	32,271,900	
西尾レントオール	5,900	3,435.00	20,266,500	
トランス・コスモス	8,400	2,824.00	23,721,600	
乃村工藝社	15,600	1,908.00	29,764,800	
藤田観光	24,000	352.00	8,448,000	
KNT-CTホールディングス	41,000	145.00	5,945,000	
日本管財	6,200	1,754.00	10,874,800	
トーカイ	3,200	4,080.00	13,056,000	
白洋舎	700	2,693.00	1,885,100	
セコム	75,500	8,367.00	631,708,500	
セントラル警備保障	3,200	1,980.00	6,336,000	
丹青社	12,600	857.00	10,798,200	
メイテック	8,800	4,405.00	38,764,000	
アサツー ディ・ケイ	11,800	2,984.00	35,211,200	
応用地質	6,900	1,409.00	9,722,100	
船井総研ホールディングス	9,300	1,757.00	16,340,100	
進学会	3,100	570.00	1,767,000	
オオバ	5,400	462.00	2,494,800	
学究社	1,900	1,488.00	2,827,200	
ベネッセホールディングス	24,300	3,210.00	78,003,000	
イオンディライト	8,200	3,225.00	26,445,000	
ナック	4,500	968.00	4,356,000	
ニチイ学館	13,000	844.00	10,972,000	
ダイセキ	12,700	2,231.00	28,333,700	
ステップ	2,500	1,368.00	3,420,000	

合 計	104,394,300	155,434,240,080	
-----	-------------	-----------------	--

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	119,952,694
金銭信託	7,149,842
コール・ローン	1,534,927,694
国債証券	216,527,647,502
派生商品評価勘定	3,227,866
未収入金	239,235
未収利息	1,710,245,633
前払費用	205,141,384
差入委託証拠金	133,812,057
流動資産合計	220,242,343,907
資産合計	220,242,343,907
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,884,827
前受金	536,109
前受収益	259,974
未払金	11,122,465
未払解約金	549,061,526
未払利息	3,313
流動負債合計	565,868,214
負債合計	565,868,214
純資産の部	
元本等	
元本	82,975,491,740
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	136,700,983,953
元本等合計	219,676,475,693
純資産合計	219,676,475,693
負債純資産合計	220,242,343,907

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	82,975,491,740口

		平成29年 1月20日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6475円 (26,475円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成29年 1月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		平成29年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		

	平成29年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	79,917,600,176円
期中追加設定元本額	19,820,910,304円
期中一部解約元本額	16,763,018,740円
期末元本額	82,975,491,740円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,519,415,215円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	975,015,923円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	694,810,707円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,781,688,131円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,891,624円

区分	平成29年 1月20日現在
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,423,872,045円
世界経済インデックスファンド	2,543,290,709円
マイセレクション25	5,999,492円
マイセレクション50	4,583,526円
マイセレクション75	2,986,691円
DCマイセレクション25	1,358,041,858円
DCマイセレクション50	1,172,483,309円
DCマイセレクション75	670,947,158円
DC外国債券インデックス・オープン	1,559,531,415円
DCマイセレクションS25	552,207,650円
DCマイセレクションS50	457,582,200円
DCマイセレクションS75	180,285,642円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	57,733,909円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	47,960,281円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	19,082,087円
DC世界経済インデックスファンド	3,213,730,687円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	542,910,068円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	131,899,426円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,641,322円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,114,906円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	88,026,677円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	264,879,580円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	400,452,791円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	324,662,175円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	740,159,766円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,344,100,514円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	883,479,458円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,026,285,479円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,198,711,291円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	680,552,427円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	896,026,026円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,099,136,331円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	319,395,750円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	462,855,663円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,492,605,689円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	918,424,017円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	663,176,416円
外国債券ファンド・シリーズ1	496,559,301円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,509,438,753円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,189,078,767円
分散投資コア戦略ファンドA	874,860,142円
分散投資コア戦略ファンドS	1,837,335,568円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	82,281,936円

区分	平成29年 1月20日現在
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	993,177,711円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,168,497,098円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	192,931,141円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,696,687円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	494,997,566円
SMT インデックスバランス・オープン	258,802,373円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	23,157,378,288円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,141,375,690円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	723,256,143円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	188,545円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,585,154,324
合計	5,585,154,324

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成29年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	619,900,017	-	620,436,126	536,109
	合計	619,900,017	-	620,436,126	536,109

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成29年 1月20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	787,519,970	-	785,326,900	2,193,070
	アメリカドル	404,234,485	-	401,559,400	2,675,085
	カナダドル	43,742,000	-	43,175,000	567,000
	ユーロ	263,287,925	-	263,912,500	624,575
	イギリスポンド	76,255,560	-	76,680,000	424,440
合計		787,519,970	-	785,326,900	2,193,070

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,953,666.90	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,392,195.89	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,991,669.06	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,896,667.95	
		T 0.875% 01/15/18	5,200,000.00	5,200,711.04	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,499,067.03	
		T 0.875% 03/31/18	4,750,000.00	4,745,929.06	
		T 0.875% 07/15/18	10,000,000.00	9,970,601.50	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,428,504.78	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,980,204.20	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,786,683.95	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,938,849.84	
		T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	3,002,682.36	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,476,183.89	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,827,493.25	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,970,970.20	

T 1.25% 01/31/19	900,000.00	899,955.72	
T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,308,549.38	
T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,368,208.26	
T 1.25% 03/31/21	10,000,000.00	9,756,968.80	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,276,729.77	
T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,507,095.46	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,469,624.49	
T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,555,061.97	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,976,923.35	
T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,717,386.48	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,103,962.51	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,970,337.75	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,847,708.50	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	992,349.67	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,306,423.15	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,537,050.54	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,209,789.01	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,742,303.00	
T 1.375% 07/31/18	4,000,000.00	4,016,823.00	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,364,954.15	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,914,247.28	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,947,910.80	
T 1.375% 09/30/23	3,000,000.00	2,835,365.67	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,915,505.72	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,622,538.71	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,008,889.09	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,009,611.02	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,393,736.23	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,009,000.62	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,305,693.08	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,418,379.19	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,836,456.08	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,025,454.64	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,112,410.94	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,834,531.40	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,553,147.99	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,001,257.65	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,563,446.68	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,555,033.53	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,020,360.94	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,032,177.10	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,696,078.87	

T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,995,613.25	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,988,192.40	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,387,704.03	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,538,389.27	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,640,428.76	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,951,776.26	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,032,275.99	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,367,415.63	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,467,867.92	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,416,895.43	
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,664,174.46	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,742,684.06	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,803,684.02	
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	1,959,061.12	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,000,654.72	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,185,045.90	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,238,640.00	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,948,942.24	
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,104,211.50	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,377,052.21	
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,802,269.48	
T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,548,649.01	
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	4,997,427.55	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,920,175.40	
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,419,221.25	
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,187,780.67	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,953,680.20	
T 1% 11/30/18	5,200,000.00	5,180,921.77	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,214,697.37	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,035,770.74	
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,512,126.28	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,570,758.45	
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,508,647.76	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,150,951.47	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,592,724.32	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,015,382.38	
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,982,010.16	
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,531,745.47	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,099,965.55	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,555,336.05	
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,393,203.04	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,042,134.34	
T 2.25% 08/15/46	1,000,000.00	843,455.16	

T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,062,426.10	
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,855,396.14	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,071,382.04	
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,519,869.43	
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,351,528.94	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,640,552.54	
T 2.5% 02/15/46	19,000,000.00	16,953,026.82	
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,506,785.16	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,620,313.92	
T 2.625% 01/31/18	8,000,000.00	8,141,912.88	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,103,334.35	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,674,379.37	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,350,919.58	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,737,835.50	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,090,605.91	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,876,052.85	
T 2.75% 08/15/42	2,000,000.00	1,902,250.52	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,110,453.86	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,990,301.89	
T 2.75% 12/31/17	1,200,000.00	1,221,175.76	
T 2.875% 03/31/18	5,250,000.00	5,369,001.38	
T 2.875% 05/15/43	14,150,000.00	13,751,237.00	
T 2.875% 08/15/45	9,900,000.00	9,565,697.68	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,500,109.40	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,574,276.25	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,158,784.92	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,027,544.92	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,817,592.48	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,254,841.59	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,985,234.21	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,890,361.53	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,816,188.48	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,047,366.00	
T 2% 10/31/21	400,000.00	400,562.48	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,403,487.96	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,545,661.55	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,983,265.24	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,018,396.47	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,201,727.00	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,575,304.31	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	6,612,071.89	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,449,639.65	

T	3.375%	05/15/44	5,610,000.00	5,976,818.82	
T	3.375%	11/15/19	8,750,000.00	9,210,955.86	
T	3.5%	02/15/18	5,700,000.00	5,856,537.73	
T	3.5%	02/15/39	3,000,000.00	3,287,705.55	
T	3.625%	02/15/21	5,500,000.00	5,892,155.22	
T	3.625%	02/15/44	5,000,000.00	5,565,345.55	
T	3.625%	08/15/19	2,700,000.00	2,850,248.11	
T	3.625%	08/15/43	2,000,000.00	2,226,358.56	
T	3.75%	08/15/41	3,900,000.00	4,414,627.65	
T	3.75%	11/15/18	5,000,000.00	5,230,473.90	
T	3.75%	11/15/43	2,300,000.00	2,617,675.81	
T	3.875%	08/15/40	1,650,000.00	1,902,277.60	
T	3%	05/15/42	3,950,000.00	3,940,060.77	
T	3%	05/15/45	3,500,000.00	3,468,389.33	
T	3%	11/15/44	2,300,000.00	2,282,548.79	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	1,095,407.28	
T	4.25%	11/15/40	1,450,000.00	1,766,094.78	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,245,245.55	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	2,354,194.71	
T	4.375%	05/15/41	1,500,000.00	1,863,130.42	
T	4.375%	11/15/39	2,700,000.00	3,341,775.28	
T	4.5%	02/15/36	1,840,000.00	2,328,433.92	
T	4.5%	05/15/38	1,000,000.00	1,265,535.01	
T	4.5%	08/15/39	250,000.00	314,809.23	
T	4.625%	02/15/40	3,900,000.00	4,998,129.74	
T	5.0%	05/15/37	1,100,000.00	1,477,748.34	
T	5.25%	02/15/29	400,000.00	510,926.68	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,654,454.34	
T	5.375%	02/15/31	1,600,000.00	2,130,209.53	
T	5.5%	08/15/28	1,200,000.00	1,551,942.34	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	2,193,594.13	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	1,942,719.84	
T	6.25%	05/15/30	400,000.00	565,199.76	
T	6.25%	08/15/23	1,650,000.00	2,060,049.68	
T	8.0%	11/15/21	1,700,000.00	2,171,710.13	
T	8.125%	08/15/19	2,100,000.00	2,455,793.71	
アメリカドル 小計			829,570,000.00	833,209,401.73 (95,944,062,609)	
カナダドル	CAN	0.25%	05/01/18	3,400,000.00	3,381,385.00
	CAN	0.5%	11/01/18	1,500,000.00	1,493,235.00
	CAN	0.75%	03/01/21	1,250,000.00	1,232,387.50
	CAN	0.75%	09/01/20	1,350,000.00	1,336,371.75
	CAN	0.75%	09/01/21	1,730,000.00	1,699,526.05

	CAN 1.25% 02/01/18	1,000,000.00	1,006,330.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	3,100,000.00	3,120,305.00	
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	503,970.00	
	CAN 1.5% 03/01/20	2,600,000.00	2,643,186.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,550,000.00	1,557,633.75	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,480,000.00	1,447,780.40	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,428,126.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	2,250,000.00	2,302,065.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,070,000.00	983,388.85	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,620,935.75	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,850,000.00	1,971,785.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,744,922.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,450,000.00	1,573,815.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	468,852.30	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,690,000.00	1,842,581.65	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,949,076.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,060,000.00	2,530,967.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,419,152.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,588,050.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,100,000.00	2,200,243.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,200,000.00	1,685,178.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,610,000.00	2,380,191.80	
	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,283,008.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	567,819.00	
	カナダドル 小計	49,620,000.00	53,962,268.80 (4,662,340,024)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	10,650,000.00	12,594,636.75	
	MBONO 10% 12/05/24	30,950,000.00	35,284,702.25	
	MBONO 4.75% 06/14/18	22,400,000.00	21,772,912.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	8,900,000.00	7,771,969.50	
	MBONO 5% 12/11/19	31,100,000.00	29,396,186.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	11,327,705.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	37,300,000.00	36,145,751.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	14,374,468.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	16,669,422.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	14,200,000.00	13,685,321.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	3,850,000.00	3,713,402.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,260,192.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	17,090,122.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	25,300,000.00	25,971,335.50	
	MBONO 8% 06/11/20	15,500,000.00	15,859,987.50	
	MBONO 8% 12/07/23	22,600,000.00	23,130,648.00	

	メキシコペソ 小計	298,450,000.00	301,048,762.50 (1,580,506,003)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	750,000.00	752,482.50
	BGB 0.8% 06/22/25	1,570,000.00	1,606,549.60
	BGB 1.25% 06/22/18	1,800,000.00	1,846,827.00
	BGB 1.6% 06/22/47	700,000.00	662,252.50
	BGB 1.9% 06/22/38	760,000.00	812,869.40
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,157,529.50
	BGB 1% 06/22/31	1,200,000.00	1,167,672.00
	BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	347,956.00
	BGB 2.25% 06/22/23	1,660,000.00	1,894,167.90
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,503,532.50
	BGB 3.75% 06/22/45	1,240,000.00	1,799,388.80
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,887,975.00
	BGB 3% 06/22/34	1,650,000.00	2,079,726.00
	BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,191,390.00
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,871,071.00
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,842,932.00
	BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,552,014.50
	BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,809,518.75
	BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,487,057.00
	BGB 4% 03/28/18	550,000.00	580,010.75
	BGB 4% 03/28/22	1,200,000.00	1,465,182.00
	BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,430,546.40
	BGB 5.5% 03/28/28	2,390,000.00	3,588,059.20
	BGB 5% 03/28/35	1,720,000.00	2,752,507.40
	BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,001,835.00
	BTPS 0.25% 05/15/18	1,500,000.00	1,508,310.00
	BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,007,015.00
	BTPS 0.35% 11/01/21	850,000.00	837,543.25
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,396,850.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,248,533.00
	BTPS 0.65% 11/01/20	3,900,000.00	3,952,396.50
	BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,625,415.00
	BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,486,717.50
	BTPS 1.05% 12/01/19	3,700,000.00	3,799,474.50
BTPS 1.25% 12/01/26	1,350,000.00	1,263,633.75	
BTPS 1.35% 04/15/22	650,000.00	666,877.25	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,000,000.00	1,028,160.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,572,528.00	
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,485,968.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,558,352.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,300,000.00	2,094,713.50	

BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,675,150.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,550,000.00	1,451,032.50	
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,639,325.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,612,459.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,620,000.00	1,478,962.80	
BTPS 2.8% 03/01/67	550,000.00	465,888.50	
BTPS 2% 12/01/25	2,950,000.00	2,987,583.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,584,813.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,760,000.00	3,119,959.20	
BTPS 3.5% 06/01/18	2,700,000.00	2,834,136.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	800,000.00	853,608.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,690,960.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,761,706.75	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,570,180.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,800,000.00	2,083,140.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,130,543.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	5,064,075.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,936,345.75	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,516,472.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,865,292.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,900,650.25	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,950,000.00	3,565,724.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	3,950,000.00	4,800,593.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,464,674.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	4,000,000.00	4,282,940.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,150,000.00	6,307,308.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,851,932.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,461,342.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,150,000.00	2,789,797.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,300,000.00	3,912,958.50	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,023,357.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,250,000.00	3,004,863.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,371,526.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,247,127.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,550,000.00	4,444,280.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,150,000.00	3,040,626.75	
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,720,846.25	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,320,582.50	
BTPS 5% 08/01/34	2,650,000.00	3,518,193.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,791,412.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,496,152.50	
BTPS 6% 05/01/31	3,850,000.00	5,509,215.25	



BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,063,096.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,200,228.00	
DBR 0.5% 02/15/25	2,400,000.00	2,487,744.00	
DBR 0.5% 02/15/26	4,450,000.00	4,565,944.75	
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,039,247.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,000,000.00	2,215,740.00	
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,275,267.00	
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,780,477.15	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,600,836.25	
DBR 1.75% 02/15/24	1,300,000.00	1,472,211.00	
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,012,052.50	
DBR 1% 08/15/24	1,680,000.00	1,811,275.20	
DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,224,580.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,763,950.00	
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,255,680.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,600,000.00	4,043,664.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,450,000.00	3,258,916.50	
DBR 2.5% 08/15/46	2,350,000.00	3,154,405.00	
DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,532,032.00	
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,405,602.50	
DBR 3.25% 01/04/20	3,000,000.00	3,352,650.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,977,252.00	
DBR 3.25% 07/04/42	1,650,000.00	2,452,254.75	
DBR 3.5% 07/04/19	5,100,000.00	5,632,287.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,516,050.75	
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,944,272.50	
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,770,005.25	
DBR 4.0% 01/04/37	2,900,000.00	4,556,364.00	
DBR 4.25% 07/04/18	6,050,000.00	6,487,626.75	
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,745,732.00	
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,575,965.60	
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	4,125,587.50	
DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	3,576,280.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,642,001.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,418,255.75	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,313,232.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,802,797.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,959,600.00	
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,578,120.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	1,250,000.00	1,178,793.75	
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,179,903.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	3,400,000.00	3,315,527.00	
FRTR 0.5% 11/25/19	3,350,000.00	3,445,173.50	

FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,030,285.00	
FRTR 1.25% 05/25/36	2,100,000.00	1,976,530.50	
FRTR 1.5% 05/25/31	3,650,000.00	3,750,831.25	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,650,000.00	6,223,588.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	600,000.00	522,852.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,550,000.00	5,012,757.75	
FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,851,863.75	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,369,957.50	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,573,600.00	
FRTR 1% 11/25/25	4,250,000.00	4,370,041.25	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,450,000.00	3,932,672.25	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,626,973.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,065,967.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	6,039,962.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,950,000.00	5,854,439.25	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,850,000.00	3,705,997.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,050,148.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,700,000.00	6,431,053.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,276,967.30	
FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000.00	5,509,880.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,562,970.00	
FRTR 3% 04/25/22	4,800,000.00	5,581,032.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,100,000.00	6,766,577.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,233,976.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,555,409.25	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,620,000.00	5,588,031.10	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,050,000.00	4,656,130.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,739,100.80	
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,685,121.25	
FRTR 4% 04/25/60	1,450,000.00	2,261,224.25	
FRTR 4% 10/25/38	3,500,000.00	5,015,517.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,050,000.00	4,611,035.75	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,750,000.00	6,119,175.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,517,836.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,523,255.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,401,075.20	
IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	467,511.75	
IRISH 1% 05/15/26	930,000.00	932,748.15	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,150,000.00	1,284,877.75	
IRISH 2% 02/18/45	720,000.00	709,318.80	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,079,158.50	
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,099,107.00	

IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,228,419.50
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,404,521.60
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	966,691.30
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,912,575.00
IRISH 5.9% 10/18/19	880,000.00	1,031,588.80
IRISH 5% 10/18/20	300,000.00	359,524.50
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,948,184.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,678,871.35
NETHER 0.5% 07/15/26	1,950,000.00	1,952,671.50
NETHER 1.25% 01/15/18	2,050,000.00	2,088,478.50
NETHER 1.25% 01/15/19	2,700,000.00	2,801,655.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,674,727.50
NETHER 2.25% 07/15/22	2,970,000.00	3,375,390.15
NETHER 2.5% 01/15/33	1,600,000.00	1,995,528.00
NETHER 2.75% 01/15/47	1,400,000.00	1,931,195.00
NETHER 2% 07/15/24	2,000,000.00	2,274,570.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,120,000.00	2,472,142.60
NETHER 3.5% 07/15/20	1,750,000.00	1,999,856.25
NETHER 3.75% 01/15/23	1,650,000.00	2,038,476.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,800,000.00	2,833,335.00
NETHER 4.0% 07/15/18	3,150,000.00	3,367,775.25
NETHER 4% 01/15/37	1,880,000.00	2,917,280.60
NETHER 4% 07/15/19	1,000,000.00	1,115,815.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,423,549.55
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	291,915.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,125,672.50
OBL 0.25% 10/11/19	1,150,000.00	1,180,567.00
OBL 0.25% 10/16/20	3,100,000.00	3,199,184.50
OBL 0.5% 02/23/18	2,800,000.00	2,837,576.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,440,000.00	1,479,981.60
OBL 0% 10/08/21	2,350,000.00	2,400,619.00
OBL 1% 02/22/19	1,450,000.00	1,502,678.50
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,214,059.25
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,073,950.50
RAGB 0.75% 10/20/26	1,450,000.00	1,476,092.75
RAGB 1.15% 10/19/18	650,000.00	670,228.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,250,000.00	1,337,581.25
RAGB 1.5% 02/20/47	300,000.00	300,364.50
RAGB 1.65% 10/21/24	1,200,000.00	1,332,858.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,955,852.50
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	1,008,434.50
RAGB 2.4% 05/23/34	840,000.00	1,023,330.00
RAGB 3.15% 06/20/44	850,000.00	1,191,474.75

RAGB 3.4% 11/22/22	1,150,000.00	1,386,313.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,086,644.15	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,323,294.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	704,583.60	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,900,000.00	2,189,873.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,226,351.75	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,550,000.00	1,715,199.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,420,024.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,329,900.25	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,347,228.75	
RFGB 0.375% 09/15/20	860,000.00	885,507.60	
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	569,789.10	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	526,794.30	
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	572,500.50	
RFGB 0% 09/15/23	490,000.00	487,824.40	
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	566,010.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	700,000.00	766,430.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	649,649.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	550,000.00	715,728.75	
RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	787,936.00	
RFGB 2% 04/15/24	470,000.00	532,557.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	788,322.50	
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	861,448.80	
RFGB 4.375% 07/04/19	670,000.00	752,446.85	
RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,048,300.00	
SPGB 0.25% 01/31/19	140,000.00	141,275.40	
SPGB 0.25% 04/30/18	3,200,000.00	3,222,000.00	
SPGB 0.75% 07/30/21	2,850,000.00	2,916,647.25	
SPGB 1.15% 07/30/20	1,350,000.00	1,403,493.75	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,100,000.00	2,067,544.50	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,921,100.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	550,000.00	567,325.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,350,000.00	2,460,461.75	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,750,000.00	2,765,578.75	
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,790,796.50	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,399,996.25	
SPGB 2.75% 10/31/24	2,950,000.00	3,312,230.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,050,000.00	1,075,945.50	
SPGB 3.45% 07/30/66	500,000.00	530,772.50	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,500,940.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,352,552.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,280,000.00	3,497,693.60	

	SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,717,274.00
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,371,100.50
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,650,000.00	3,277,255.00
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,300,000.00	2,412,619.50
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,389,736.75
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,309,800.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,100,000.00	2,912,280.00
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,864,533.00
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,535,710.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,850,000.00	2,624,881.75
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,390,465.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,150,000.00	4,309,546.50
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,500,000.00	2,212,800.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,700,000.00	3,464,329.50
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,681,810.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,270,000.00	3,395,159.55
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,627,807.75
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,345,086.80
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,537,179.00
	ユーロ 小計	601,570,000.00	704,988,140.70 (86,523,194,508)
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	1,500,000.00	1,472,167.50
	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,839,856.30
	UKT 1.5% 01/22/21	3,430,000.00	3,556,446.95
	UKT 1.5% 07/22/26	2,200,000.00	2,218,183.00
	UKT 1.5% 07/22/47	950,000.00	844,507.25
	UKT 1.75% 07/22/19	5,050,000.00	5,235,461.25
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,996,703.75
	UKT 1.75% 09/07/37	550,000.00	524,793.50
	UKT 2.25% 09/07/23	2,800,000.00	3,031,448.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,600,000.00	1,926,560.00
	UKT 2.75% 09/07/24	2,250,000.00	2,519,550.00
	UKT 2% 07/22/20	5,100,000.00	5,370,198.00
	UKT 2% 09/07/25	2,690,000.00	2,851,924.55
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,619,345.00
	UKT 3.5% 01/22/45	3,000,000.00	3,920,850.00
	UKT 3.5% 07/22/68	2,250,000.00	3,469,038.75
	UKT 3.75% 07/22/52	2,200,000.00	3,219,282.00
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	600,366.25
	UKT 3.75% 09/07/20	1,550,000.00	1,734,984.75
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,285,760.00
UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,623,729.25	
UKT 4.25% 06/07/32	2,200,000.00	2,926,935.00	

	UKT 4.25% 09/07/39	1,700,000.00	2,387,531.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,836,864.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,100,000.00	2,982,315.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,143,070.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,830,000.00	2,834,560.20	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,162,777.60	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,510,392.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,900,000.00	4,033,508.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,200,000.00	3,297,965.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,100,000.00	2,387,227.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,479,743.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,829,746.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,750,000.00	2,853,637.50	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,692,469.00	
	UKT 5% 03/07/18	2,300,000.00	2,424,303.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,463,939.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,856,706.25	
	UKT 8% 06/07/21	1,050,000.00	1,389,097.50	
	イギリスポンド 小計	88,040,000.00	108,353,944.10 (15,391,677,759)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	443,146.00	
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,117,965.00	
	SWISS 3% 01/08/18	1,140,000.00	1,183,758.90	
	SWISS 4% 02/11/23	850,000.00	1,085,641.25	
	SWISS 4% 04/08/28	530,000.00	772,440.55	
	スイスフラン 小計	3,920,000.00	4,602,951.70 (526,393,556)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	10,200,000.00	11,074,650.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,050,000.00	9,341,138.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,600,000.00	8,876,534.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,750,000.00	7,761,953.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	11,000,000.00	13,069,485.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	12,750,000.00	14,076,510.00	
	SGB 5% 12/01/20	11,800,000.00	14,219,354.00	
	スウェーデンクローナ 小計	68,150,000.00	78,419,625.25 (1,008,476,380)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,620,000.00	4,580,499.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,500,000.00	4,584,600.00	
	NGB 2% 05/24/23	6,900,000.00	7,190,559.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	10,150,000.00	11,322,680.25	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,154,450.50	
	NGB 4.5% 05/22/19	9,200,000.00	10,012,866.00	

ノルウェークローネ 小計		40,920,000.00	43,845,654.75 (597,616,274)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/18	6,100,000.00	6,195,160.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,950,000.00	8,746,510.50
	DGB 1.75% 11/15/25	10,300,000.00	11,538,523.50
	DGB 3% 11/15/21	11,650,000.00	13,468,273.75
	DGB 4.5% 11/15/39	15,800,000.00	26,632,085.00
	DGB 4% 11/15/19	11,950,000.00	13,479,480.50
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,376,700.00
デンマーククローネ 小計		67,250,000.00	85,436,733.25 (1,409,706,098)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	4,200,000.00	4,065,033.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	3,650,000.00	3,475,676.00
	POLGB 2.5% 07/25/18	7,200,000.00	7,266,492.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,500,000.00	4,077,135.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,050,000.00	933,801.75
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,383,905.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,450,000.00	3,531,057.75
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,585,939.20
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,500,000.00	1,536,915.00
	POLGB 4% 10/25/23	3,650,000.00	3,781,637.25
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,760,875.15
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,818,049.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,125,289.25
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,268,590.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,292,260.75
ポーランドズロチ 小計		46,500,000.00	46,902,656.10 (1,316,088,530)
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,100,000.00	2,069,403.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,030,000.00	1,898,313.90
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,967,430.20
	ACGB 2.75% 06/21/35	650,000.00	588,747.25
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,499,318.50
	ACGB 2.75% 11/21/27	2,450,000.00	2,420,943.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,485,641.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,450,000.00	1,485,539.50
	ACGB 3.25% 06/21/39	610,000.00	572,765.60
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,150,000.00	2,201,460.25
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,100,000.00	1,133,874.50
	ACGB 3% 03/21/47	1,000,000.00	850,755.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,960,000.00	4,441,496.40
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,020,000.00	3,249,655.90
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,300,000.00	1,502,416.50

	ACGB 4.75% 04/21/27	3,350,000.00	3,925,429.50	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,000,000.00	3,209,340.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,770,000.00	2,871,949.85	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,875,338.50	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,150,000.00	4,753,057.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	3,018,246.55	
	オーストラリアドル 小計	49,700,000.00	53,021,122.65 (4,614,428,304)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	595,959.00	
	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	243,800.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	160,000.00	160,845.60	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	245,135.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	885,142.35	
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	271,071.90	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,150,000.00	1,180,038.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	280,000.00	280,527.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	621,047.80	
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	580,616.40	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	205,859.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	580,000.00	593,789.50	
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	405,102.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	761,540.40	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	622,662.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	300,000.00	325,485.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	776,182.65	
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	809,824.40	
	SIGB 4% 09/01/18	980,000.00	1,024,467.50	
	シンガポールドル 小計	10,260,000.00	10,589,096.70 (854,540,103)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	1,550,000.00	1,554,355.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,432,200.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	1,979,705.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	1,996,600.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	736,020.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,163,641.75	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,606,896.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,205,015.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	500,000.00	496,250.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,022,028.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,515,022.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,079,212.15	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,390,000.00	1,357,175.15	



	MGS 4.048% 09/30/21	2,250,000.00	2,273,602.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,342,453.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,676,581.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,352,855.25	
	MGS 4.24% 02/07/18	1,150,000.00	1,163,886.25	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,254,208.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,805,184.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	489,965.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,350,000.00	1,353,469.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,004,956.00	
	マレーシアリングット 小計	36,220,000.00	35,861,283.55	(928,090,018)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	23,100,000.00	25,800,390.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,988,545.20	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,850,000.00	6,418,108.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	5,300,000.00	5,050,953.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,550,000.00	7,411,268.75	
	SAGB 7.75% 02/28/23	8,300,000.00	8,058,345.50	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,722,931.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	7,400,000.00	6,795,198.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	11,550,000.00	10,588,058.25	
	SAGB 8.75% 01/31/44	10,300,000.00	9,589,094.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,881,261.75	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,513,339.50	
	SAGB 8% 01/31/30	11,100,000.00	10,153,170.00	
	SAGB 8% 12/21/18	5,750,000.00	5,768,572.50	
SAGB 9% 01/31/40	3,100,000.00	2,969,862.00		
	南アフリカランド 小計	147,570,000.00	137,709,098.45	(1,170,527,336)
	合計		216,527,647,502	(216,527,647,502)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 179銘柄	100.0%	44.3%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.7%

ユーロ	国債証券	272銘柄	100.0%	40.0%
イギリスポンド	国債証券	40銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券	5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	23銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年 1月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	3,778,037,657
金銭信託	1,351,127
コール・ローン	290,059,792
株式	288,918,121,482
投資信託受益証券	286,031,879
投資証券	7,508,114,700
派生商品評価勘定	15,273,701
未収入金	2,916,897
未収配当金	261,153,290
差入委託証拠金	1,338,456,842
流動資産合計	302,399,517,367
資産合計	302,399,517,367
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,097,606
前受金	6,060,125
未払金	73,170,255
未払解約金	888,424,391
未払利息	626
流動負債合計	978,753,003

	平成29年 1月20日現在
項目	金額（円）
負債合計	978,753,003
純資産の部	
元本等	
元本	142,760,709,644
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	158,660,054,720
元本等合計	301,420,764,364
純資産合計	301,420,764,364
負債純資産合計	302,399,517,367

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	平成29年 1月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,760,709,644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 2.1114円 (1万口当たり純資産額) (21,114円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年 1月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	平成29年 1月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	平成29年 1月20日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	132,735,037,669円
期中追加設定元本額	35,652,482,052円
期中一部解約元本額	25,626,810,077円
期末元本額	142,760,709,644円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,524,521,442円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,413,704円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,067,699,816円
世界経済インデックスファンド	3,189,853,462円
マイセレクション25	3,869,349円
マイセレクション50	17,937,117円
マイセレクション75	19,065,292円
外国株式インデックス・オープン	1,031,625,392円
D C マイセレクション25	893,957,190円
D C マイセレクション50	4,572,253,753円
D C マイセレクション75	5,058,665,572円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,773,834,836円
D C マイセレクションS25	363,562,508円
D C マイセレクションS50	1,784,421,229円
D C マイセレクションS75	1,369,286,324円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	162,029,431円

区分	平成29年 1月20日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2035	175,469,758円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	104,216,249円
DC世界経済インデックスファンド	4,035,251,024円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,739,382,454円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	28,950,049円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	19,638,019円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	117,620,432円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	148,101,094円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	523,183,859円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	85,492,996円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	584,694,837円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,205,499,984円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	626,729,876円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,818,850,401円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,009,005,666円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	728,646,426円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	590,525,642円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	607,768,191円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	177,910,783円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,740,186,087円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,243,706,685円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,086,687,392円
コア投資戦略ファンド（安定型）	5,164,253,956円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,333,261,025円
分散投資コア戦略ファンドA	1,800,342,395円
分散投資コア戦略ファンドS	3,151,798,845円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	323,775,454円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	424,337,616円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,004,024,296円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	763,336,774円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,716,285円
SMT インデックスバランス・オープン	332,795,041円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,825,330,951円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	32,175,527,983円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,166,694,702円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,666,013,538

投資信託受益証券	5,602,739
投資証券	274,400,426
合計	20,386,010,373

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成29年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,404,058,522	-	4,410,118,647	6,060,125
	合計	4,404,058,522	-	4,410,118,647	6,060,125

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(平成29年 1月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	850,887,270	-	852,771,300	1,884,030
	アメリカドル	574,849,000	-	575,650,000	801,000
	カナダドル	30,314,550	-	30,236,500	78,050
	ユーロ	100,220,740	-	100,638,600	417,860
	イギリスポンド	63,507,990	-	63,918,000	410,010
	スイスフラン	22,795,000	-	22,872,000	77,000
	スウェーデンク ローナ	16,667,300	-	16,718,000	50,700
	デンマーククロー ネ	12,311,250	-	12,375,000	63,750
	オーストラリアド ル	14,637,340	-	14,791,700	154,360
	香港ドル	15,584,100	-	15,571,500	12,600
	合計	850,887,270	-	852,771,300	1,884,030

(注)時価の算定方法



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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	46,134	70.18	3,237,684.12	
	ANTERO RESOURCES CORP	12,683	25.78	326,967.74	
	APACHE CORP	31,708	62.22	1,972,871.76	
	BAKER HUGHES	33,958	61.96	2,104,037.68	
	CABOT OIL & GAS CORP	39,315	22.48	883,801.20	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	42.64	669,064.24	
	CHEVRON CORP	156,520	115.58	18,090,581.60	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	138.54	1,052,765.46	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	134.48	1,585,922.64	
	CONOCOPHILLIPS	102,991	49.86	5,135,131.26	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	50.91	389,308.77	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	121.24	405,669.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	39,423	46.09	1,817,006.07	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,511	102.26	768,074.86	
	EOG RESOURCES INC	47,948	105.19	5,043,650.12	
	EQT CORPORATION	13,878	62.49	867,236.22	
	EXXON MOBIL	343,903	84.73	29,138,901.19	
	HALLIBURTON CO	71,696	55.34	3,967,656.64	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	77.72	646,241.80	
	HESS CORP	23,898	57.72	1,379,392.56	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,448	29.85	371,572.80	
	KINDER MORGAN INC	158,099	22.47	3,552,484.53	
	MARATHON OIL CORP	71,172	17.27	1,229,140.44	
	MARATHON PETROLEUM CORP	44,180	48.37	2,136,986.60	
	MURPHY OIL CORP	13,898	31.60	439,176.80	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	37.90	1,148,786.90	
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	41.62	668,958.26		
NOBLE ENERGY INC	34,708	40.27	1,397,691.16		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,563	68.73	4,368,684.99		

ONEOK INC	17,740	55.96	992,730.40
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	11,347	36.86	418,250.42
PHILLIPS 66	39,215	82.99	3,254,452.85
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,150	183.95	2,602,892.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,622	32.95	218,194.90
RANGE RESOURCES CORP	16,160	34.47	557,035.20
SCHLUMBERGER	115,475	87.20	10,069,420.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,763	9.51	368,636.13
SPECTRA ENERGY CORP	58,534	41.55	2,432,087.70
TARGA RESOURCES CORP	14,130	59.89	846,245.70
TECHNIPFMC PLC	17,553	34.20	600,312.60
TESORO CORP	10,037	80.56	808,580.72
VALERO ENERGY CORP	38,495	66.07	2,543,364.65
WILLIAMS COS	59,701	28.45	1,698,493.45
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,300	145.47	2,516,631.00
ALBEMARLE CORP	9,581	93.05	891,512.05
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	4,845	109.77	531,835.65
AVERY DENNISON CORP	7,457	72.49	540,557.93
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	28.60	503,531.60
BALL CORP	13,571	75.61	1,026,103.31
CELANESE CORP-SERIES A	12,298	82.21	1,011,018.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,559	32.25	663,027.75
CROWN HOLDINGS INC	12,217	54.11	661,061.87
DOW CHEMICAL CO	94,421	57.09	5,390,494.89
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	73,263	72.95	5,344,535.85
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	76.02	901,445.16
ECOLAB INC	22,063	118.85	2,622,187.55
FMC CORP	10,402	59.34	617,254.68
FREEPORT-MCMORAN INC	103,175	15.26	1,574,450.50
INT'L PAPER CO	32,952	52.68	1,735,911.36
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,792	117.51	798,127.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,711	89.76	2,666,859.36
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	225.76	1,126,316.64
MONSANTO CO	36,715	108.12	3,969,625.80
MOSAIC CO/THE	27,677	30.25	837,229.25
NEWMONT MINING CORP	42,952	34.93	1,500,313.36
NUCOR CORP	26,866	60.15	1,615,989.90
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,070	85.76	692,083.20
PPG INDUSTRIES INC	22,422	97.50	2,186,145.00
PRAXAIR INC	23,965	116.10	2,782,336.50
SEALED AIR CORP	16,796	48.12	808,223.52
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,361	283.09	1,800,735.49

VALSPAR CORP/THE	6,135	107.76	661,107.60
VULCAN MATERIALS CO	10,740	126.30	1,356,462.00
WESTROCK CO	20,913	51.28	1,072,418.64
WR GRACE & CO	5,635	68.60	386,561.00
3 M COMPANY	50,057	178.68	8,944,184.76
ACUITY BRANDS INC	3,505	206.45	723,607.25
AERCAP HOLDINGS NV	13,847	41.68	577,142.96
AGCO CORP	5,969	61.68	368,167.92
AMETEK INC	18,866	50.68	956,128.88
ARCONIC INC	37,079	21.31	790,153.49
B/E AEROSPACE INC	8,805	61.38	540,450.90
BOEING CO	49,099	159.00	7,806,741.00
CATERPILLAR	48,474	93.38	4,526,502.12
CUMMINS INC	12,985	140.97	1,830,495.45
DEERE&CO	22,250	105.02	2,336,695.00
DOVER CORP	13,056	78.25	1,021,632.00
EATON CORP	36,887	67.73	2,498,356.51
EMERSON ELECTRIC CO	53,501	58.43	3,126,063.43
FASTENAL CO	23,228	50.55	1,174,175.40
FLOWSERVE CORP	10,826	50.33	544,872.58
FLUOR CORP	11,267	52.78	594,672.26
FORTIVE CORP	26,022	54.27	1,412,213.94
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	54.86	702,756.60
GENERAL DYNAMICS CORP	21,548	177.81	3,831,449.88
GENERAL ELECTRIC CO	741,280	31.21	23,135,348.80
GRAINGER (WW) INC	4,749	244.17	1,159,563.33
HONEYWELL INTL INC	59,897	117.91	7,062,455.27
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,963	194.82	772,071.66
ILLINOIS TOOL WORKS	26,544	123.37	3,274,733.28
INGERSOLL-RAND PLC	21,549	78.25	1,686,209.25
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	57.61	558,413.73
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,900	59.51	1,184,249.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	77,610	42.87	3,327,140.70
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	151.91	929,233.47
LOCKHEED MARTIN CORP	21,895	257.03	5,627,671.85
MASCO CORP	27,841	31.93	888,963.13
MIDDLEBY CORP	4,364	134.66	587,656.24
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,097	232.39	3,276,001.83
PACCAR INC	29,238	65.74	1,922,106.12
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	143.75	1,572,912.50
PENTAIR PLC	13,583	58.93	800,446.19
RAYTHEON COMPANY	24,513	146.95	3,602,185.35

ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	140.00	1,456,700.00
ROCKWELL COLLIN	10,382	89.21	926,178.22
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	185.42	1,501,902.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.06	567,777.68
SMITH (A.O.) CORP	12,146	47.45	576,327.70
SNAP-ON INC	4,900	174.87	856,863.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	119.66	1,437,714.90
TEXTRON	21,877	49.42	1,081,161.34
TRANSDIGM GROUP INC	4,471	251.76	1,125,618.96
UNITED RENTALS INC	7,302	110.45	806,505.90
UNITED TECHNOLOGIES CORP	65,880	110.73	7,294,892.40
WABCO HOLDINGS INC	4,697	104.35	490,131.95
WABTEC CORP	7,158	86.92	622,173.36
XYLEM INC	13,941	49.05	683,806.05
CINTAS CORP	7,034	113.74	800,047.16
DUN & BRADSTREET CORP	3,101	121.31	376,182.31
EQUIFAX INC	10,011	120.18	1,203,121.98
IHS MARKIT LTD	28,842	38.17	1,100,899.14
MANPOWER GROUP	5,123	92.25	472,596.75
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,941	41.45	1,241,054.45
REPUBLIC SERVICES INC	20,141	57.31	1,154,280.71
ROBERT HALF INTL INC	11,558	48.59	561,603.22
STERICYCLE INC	6,767	79.96	541,089.32
VERISK ANALYTICS INC	13,480	80.92	1,090,801.60
WASTE CONNECTIONS INC	14,407	79.73	1,148,670.11
WASTE MANAGEMENT INC	36,805	69.57	2,560,523.85
AMERCO	602	367.95	221,505.90
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	47.26	468,819.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	73.37	839,939.76
CSX CORP	78,664	45.51	3,579,998.64
DELTA AIR LINES INC	15,095	49.70	750,221.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,281	53.32	814,782.92
FEDEX CORP	20,939	186.17	3,898,213.63
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	94.36	673,164.24
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	84.50	738,783.50
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	82.34	478,313.06
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,812	114.42	2,724,569.04
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	50.07	661,624.98
UNION PACIFIC CORP	69,012	106.24	7,331,834.88
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	74.02	444,342.06
UNITED PARCEL SERVICE B	57,287	114.27	6,546,185.49
AUTOLIV INC	7,451	113.03	842,186.53

BORGWARNER INC	18,147	39.82	722,613.54
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,378	72.01	1,611,439.78
FORD MOTOR COMPANY	307,808	12.43	3,826,053.44
GENERAL MOTORS CO	115,985	37.30	4,326,240.50
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	30.39	657,244.53
HARLEY-DAVIDSON	14,677	58.23	854,641.71
LEAR CORP	6,041	141.63	855,586.83
TESLA MOTORS INC	10,725	243.76	2,614,326.00
COACH INC	22,032	35.10	773,323.20
DR HORTON INC	28,586	28.01	800,693.86
GARMIN LTD	9,564	47.61	455,342.04
HANESBRANDS INC	31,136	22.08	687,482.88
HARMAN INTL INDS INC	5,462	110.55	603,824.10
HASBRO INC	9,007	83.77	754,516.39
LEGGETT & PLATT INC	10,594	47.49	503,109.06
LENNAR CORP-CL A	14,466	43.73	632,598.18
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	66.99	567,539.28
MATTEL INC	27,399	30.07	823,887.93
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	42.03	585,057.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	205.90	1,042,265.80
NEWELL BRANDS INC	35,538	45.97	1,633,681.86
NIKE B	111,815	52.93	5,918,367.95
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	85.90	402,956.90
PULTE GROUP INC	24,602	18.94	465,961.88
PVH CORP	6,800	91.57	622,676.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	88.20	403,779.60
TOLL BROTHERS INC	14,067	30.98	435,795.66
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	29.20	465,740.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	25.26	411,308.58
VF CORP	26,718	51.49	1,375,709.82
WHIRLPOOL CORP	6,165	185.23	1,141,942.95
ARAMARK	19,980	33.19	663,136.20
BLOCK H & R INC	16,984	23.27	395,217.68
CARNIVAL CORPORATION	29,255	53.45	1,563,679.75
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,441	408.87	998,051.67
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	72.59	728,150.29
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	166.04	678,771.52
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,573	57.50	952,947.50
LAS VEGAS SANDS CORP	36,438	55.84	2,034,697.92
MARRIOTT INTL A	27,539	84.53	2,327,871.67
MCDONALD'S CORP	70,679	122.18	8,635,560.22
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	17,662	16.60	293,189.20

MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	28.69	1,036,971.36
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12,935	45.62	590,094.70
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,436	84.56	1,220,708.16
STARBUCKS CORP	121,526	57.89	7,035,140.14
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	9,314	77.79	724,536.06
WYNN RESORTS LTD	6,619	90.93	601,865.67
YUM BRANDS INC	30,886	64.03	1,977,630.58
CBS CORP-CL B	33,901	62.63	2,123,219.63
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,975	306.13	5,502,686.75
COMCAST CORP-CL A	198,825	72.61	14,436,683.25
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	28.00	358,512.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	27.35	463,445.75
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	61.68	1,123,686.24
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	23.05	779,873.70
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	78.32	678,486.16
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19,082	34.94	666,725.08
LIBERTY GLOBAL PLC-C	49,866	33.66	1,678,489.56
LIBERTY LILAC GROUP-C	9,040	21.87	197,704.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	34.95	532,393.35
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	35.31	225,419.04
NEWS CORP-CLASS A	33,479	12.04	403,087.16
OMNICOM GROUP	19,057	84.56	1,611,459.92
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	74.36	472,632.16
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	4.59	594,427.95
TEGNA INC	15,014	21.45	322,050.30
THE WALT DISNEY CO	126,365	107.28	13,556,437.20
TIME WARNER INC	64,476	95.69	6,169,708.44
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,565	29.80	2,639,237.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,931	29.21	1,078,754.51
VIACOM INC-CLASS B	29,194	39.80	1,161,921.20
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	171.72	1,062,259.92
AMAZON.COM	33,331	809.04	26,966,112.24
AUTONATION INC	5,015	51.62	258,874.30
AUTOZONE INC	2,370	769.90	1,824,663.00
BED BATH & BEYOND INC	12,615	40.89	515,827.35
BEST BUY COMPANY INC	24,368	43.63	1,063,175.84
CARMAX INC	16,101	66.47	1,070,233.47
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	50.87	399,380.37
DOLLAR GENERAL CORP	22,756	71.01	1,615,903.56
DOLLAR TREE INC	19,681	76.26	1,500,873.06
EXPEDIA INC	9,800	118.84	1,164,632.00
FOOT LOCKER INC	11,410	68.55	782,155.50

GAP	20,859	23.87	497,904.33
GENUINE PARTS CO	12,484	99.11	1,237,289.24
HOME DEPOT	102,258	135.39	13,844,710.62
KOHL'S CORP	15,495	40.23	623,363.85
L BRANDS INC	19,499	60.92	1,187,879.08
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	18.85	661,088.35
LKQ CORP	24,693	31.48	777,335.64
LOWES COMPANIES	73,056	71.60	5,230,809.60
MACY'S INC	25,926	29.45	763,520.70
NETFLIX INC	35,576	138.41	4,924,074.16
NORDSTROM INC	10,094	42.93	433,335.42
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,909	275.05	2,175,370.45
PRICELINE GROUP INC/THE	4,097	1,539.02	6,305,364.94
ROSS STORES INC	32,319	65.96	2,131,761.24
SIGNET JEWELERS LTD	5,407	80.77	436,723.39
STAPLES INC	55,506	9.05	502,329.30
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,365	65.39	2,966,417.35
TIFFANY & CO	10,306	79.03	814,483.18
TJX COMPANIES INC	54,500	75.08	4,091,860.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,274	74.79	843,182.46
TRIPADVISOR INC	10,393	52.16	542,098.88
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,911	266.12	1,306,915.32
COSTCO WHOLESALE CORP	36,318	163.70	5,945,256.60
CVS HEALTH CORP	88,352	83.20	7,350,886.40
KROGER CO	74,999	34.26	2,569,465.74
RITE AID CORP	83,480	8.60	717,928.00
SYSCO CORP	43,900	53.62	2,353,918.00
WAL-MART STORES	128,085	67.62	8,661,107.70
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	76,245	83.49	6,365,695.05
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	30.77	773,188.56
ALTRIA GROUP INC	161,764	69.55	11,250,686.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,319	44.50	2,105,695.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,848	44.61	796,199.28
BUNGE LIMITED	11,767	68.00	800,156.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	16,395	62.24	1,020,424.80
COCA-COLA CO	339,336	41.14	13,960,283.04
CONAGRA BRANDS INC	33,243	38.69	1,286,171.67
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,754	149.59	2,207,050.86
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	90.37	1,342,446.35
GENERAL MILLS INC	49,832	61.65	3,072,142.80
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,152	105.22	1,278,633.44
HORMEL FOODS CORP	23,465	36.23	850,136.95

INGREDION INC	5,835	125.44	731,942.40
JM SMUCKER CO	9,562	132.86	1,270,407.32
KELLOGG CO	21,051	71.78	1,511,040.78
KRAFT HEINZ CO/THE	50,527	87.85	4,438,796.95
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	93.01	862,760.76
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,072	74.85	1,128,139.20
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	97.54	1,472,854.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	128,964	44.59	5,750,504.76
MONSTER BEVERAGE CORP	33,431	43.35	1,449,233.85
PEPSICO INC	119,123	102.36	12,193,430.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	128,423	93.85	12,052,498.55
REYNOLDS AMERICAN INC	71,099	58.58	4,164,979.42
TYSON FOODS INC	24,113	62.34	1,503,204.42
WHITEWAVE FOODS CO	14,578	55.40	807,621.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	44.93	949,191.18
CLOROX COMPANY	10,847	120.25	1,304,351.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,265	67.04	4,710,565.60
COTY INC-CL A	39,000	18.60	725,400.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	76.11	342,799.44
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	78.89	1,405,977.58
KIMBERLY-CLARK CORP	29,876	115.90	3,462,628.40
PROCTER & GAMBLE CO	211,553	84.70	17,918,539.10
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	122.50	232,015.00
ABBOTT LABORATORIES	142,876	40.40	5,772,190.40
AETNA INC	29,181	122.56	3,576,423.36
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,441	90.55	492,682.55
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,981	85.47	1,365,896.07
ANTHEM INC	21,908	148.11	3,244,793.88
BARD C R INC	5,875	231.88	1,362,295.00
BAXTER INTERNATIONAL	39,728	46.57	1,850,132.96
BECTON DICKINSON & CO	17,730	173.52	3,076,509.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	113,469	23.88	2,709,639.72
CARDINAL HEALTH	26,613	75.55	2,010,612.15
CENTENE CORP	13,787	62.26	858,378.62
CERNER CORP	24,798	51.64	1,280,568.72
CIGNA CORP	21,371	144.16	3,080,843.36
DANAHER CORP	51,670	80.60	4,164,602.00
DAVITA INC	13,384	62.90	841,853.60
DENTSPLY SIRONA INC	19,455	55.67	1,083,059.85
DEXCOM INC	6,289	81.59	513,119.51
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,815	96.29	1,715,406.35
ENVISION HEALTHCARE	9,978	67.43	672,816.54



EXPRESS SCRIPTS HOLDING	52,426	72.45	3,798,263.70
HCA HOLDINGS INC	25,310	78.62	1,989,872.20
HENRY SCHEIN INC	6,884	157.73	1,085,813.32
HOLOGIC INC	21,094	39.60	835,322.40
HUMANA INC	12,426	206.00	2,559,756.00
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	120.28	876,961.48
INTUITIVE SURGICAL INC	3,214	658.06	2,115,004.84
LABORATORY CRP OF AMER	8,605	132.74	1,142,227.70
MCKESSON CORP	18,807	147.29	2,770,083.03
MEDNAX INC	8,151	69.87	569,510.37
MEDTRONIC PLC	115,608	75.30	8,705,282.40
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	40.69	288,166.58
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	91.53	1,047,011.67
RESMED INC	11,925	62.90	750,082.50
STRYKER CORP	28,035	122.13	3,423,914.55
TELEFLEX INC	3,320	166.03	551,219.60
THE COOPER COS INC	4,109	181.91	747,468.19
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,959	158.70	12,530,793.30
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	111.75	809,964.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	89.48	699,912.56
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	114.58	1,840,498.54
ABBVIE INC	135,109	61.38	8,292,990.42
AGILENT TECHNOLOGIES	27,320	47.64	1,301,524.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,714	134.35	2,514,225.90
ALKERMES PLC	12,547	56.08	703,635.76
ALLERGAN PLC	32,871	214.58	7,053,459.18
AMGEN	62,074	153.80	9,546,981.20
BIOGEN INC	18,202	280.35	5,102,930.70
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	86.15	1,235,477.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	138,629	55.49	7,692,523.21
CELGENE CORP	64,321	113.62	7,308,152.02
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,990	12.90	206,271.00
GILEAD SCIENCES INC	109,486	71.57	7,835,913.02
ILLUMINA INC	11,836	160.58	1,900,624.88
INCYTE CORP	14,173	117.53	1,665,752.69
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	124.42	618,491.82
JOHNSON & JOHNSON	226,660	114.20	25,884,572.00
LILLY (ELI) & CO	82,493	76.84	6,338,762.12
MALLINCKRODT PLC	9,552	48.12	459,642.24
MERCK & CO	229,216	60.33	13,828,601.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,234	415.72	928,718.48
MYLAN NV	36,548	36.95	1,350,448.60

PERRIGO CO PLC	12,071	76.47	923,069.37
PFIZER	502,720	31.70	15,936,224.00
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	12,414	76.07	944,332.98
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,465	363.41	2,349,445.65
SEATTLE GENETICS INC	7,471	59.27	442,806.17
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	101.34	147,753.72
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,215	33.47	2,550,916.05
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,762	144.32	4,728,211.84
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	153.44	498,219.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	80.91	1,608,814.44
WATERS CORP	6,513	141.74	923,152.62
ZOETIS INC	37,987	53.50	2,032,304.50
BANK OF AMERICA CORP	844,265	22.53	19,021,290.45
BB&T CORP	67,692	45.29	3,065,770.68
CIT GROUP INC	16,516	42.02	694,002.32
CITIGROUP	240,442	56.66	13,623,443.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,979	34.73	1,492,660.67
COMERICA INC	14,625	66.31	969,783.75
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	25.99	1,618,007.45
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	92.11	1,158,559.58
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	13.01	1,137,308.18
JPMORGAN CHASE & CO	298,764	83.30	24,887,041.20
KEY CORP	87,033	17.84	1,552,668.72
M & T BANK CORP	11,456	155.35	1,779,689.60
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	15.69	613,400.55
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	19.13	523,855.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,768	115.61	4,713,188.48
REGIONS FINL CORP	104,938	13.98	1,467,033.24
SIGNATURE BANK	4,354	150.97	657,323.38
SUNTRUST BANKS	40,264	53.84	2,167,813.76
US BANCORP	141,805	50.73	7,193,767.65
WELLS FARGO & CO	396,520	54.58	21,642,061.60
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	141.34	626,560.22
ALLY FINANCIAL INC	36,028	19.32	696,060.96
AMERICAN EXPRESS	65,135	76.69	4,995,203.15
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,493	112.98	1,524,439.14
BANK NEW YORK CO	88,609	44.84	3,973,227.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100,809	159.41	16,069,962.69
BLACKROCK INC	10,123	377.35	3,819,914.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,022	86.72	3,644,147.84
CME GROUP INC	28,150	116.36	3,275,534.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33,601	70.00	2,352,070.00

E*TRADE FINANCIAL CORP	23,110	36.24	837,506.40
EATON VANCE CORP	10,061	42.65	429,101.65
FRANKLIN RESOURCES INC	30,723	39.86	1,224,618.78
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,234	231.41	6,996,449.94
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,541	56.96	2,821,855.36
INVESCO LTD	34,427	30.17	1,038,662.59
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	22.93	589,438.58
MOODY'S CORP	13,995	99.96	1,398,940.20
MORGAN STANLEY	118,922	42.45	5,048,238.90
MSCI INC	7,670	81.16	622,497.20
NASDAQ INC	9,070	67.06	608,234.20
NAVIENT CORP	23,616	15.86	374,549.76
NORTHERN TRUST CORP	17,320	83.52	1,446,566.40
PRICE T ROWE GROUP INC	20,771	72.75	1,511,090.25
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	72.21	717,189.72
S&P GLOBAL INC	21,973	114.40	2,513,711.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,859	41.44	4,096,716.96
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	50.04	540,532.08
STATE STREET CORP	32,453	78.75	2,555,673.75
SYNCHRONY FINANCIAL	69,397	35.61	2,471,227.17
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,142	46.32	1,025,617.44
VOYA FINANCIAL INC	16,094	39.24	631,528.56
AFLAC	34,103	69.46	2,368,794.38
ALLEGHANY CORP	1,276	609.09	777,198.84
ALLSTATE CORP	30,117	74.22	2,235,283.74
AMERICAN INT'L GROUP	88,760	66.29	5,883,900.40
AON PLC	22,107	112.28	2,482,173.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	87.68	885,743.36
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	52.67	788,575.24
ASSURANT INC	4,769	95.65	456,154.85
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	64.82	473,315.64
CHUBB LTD	38,573	131.27	5,063,477.71
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	69.89	867,544.57
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	219.39	735,614.67
FNF GROUP	20,786	34.19	710,673.34
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,480	48.24	1,518,595.20
LINCOLN NATIONAL CORP	19,498	66.69	1,300,321.62
LOEWS CORP	24,048	45.70	1,098,993.60
MARKEL CORP	1,132	895.61	1,013,830.52
MARSH & MCLENNAN COS	43,151	67.45	2,910,534.95
METLIFE INC	77,508	54.02	4,186,982.16
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	58.30	1,349,936.50

PROGRESSIVE CORP	46,702	36.38	1,699,018.76
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,283	104.76	3,801,007.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	124.51	676,213.81
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	136.52	443,553.48
TORCHMARK CORP	9,592	73.62	706,163.04
TRAVELERS COS INC/THE	23,972	117.99	2,828,456.28
UNUM GROUP	18,574	44.43	825,242.82
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,506	125.49	1,318,397.94
WR BERKLEY CORP	8,610	67.13	577,989.30
XL GROUP LTD	23,201	37.33	866,093.33
CBRE GROUP INC-A	24,306	30.25	735,256.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.75	666,225.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	100.14	367,814.22
WEYERHAEUSER CO	62,451	30.21	1,886,644.71
ACCENTURE PLC-CL A	51,642	115.50	5,964,651.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	49,539	38.86	1,925,085.54
ADOBE SYSTEMS INC	41,388	109.79	4,543,988.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	68.98	977,998.44
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,727	230.22	1,088,249.94
ALPHABET INC-CL A	24,414	824.37	20,126,169.18
ALPHABET INC-CL C	25,606	802.17	20,540,493.05
ANSYS INC	6,865	93.49	641,808.85
AUTODESK INC	16,740	79.98	1,338,865.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	37,914	102.97	3,904,004.58
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	65.74	634,391.00
CA INC	26,520	32.55	863,226.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,646	25.97	640,056.62
CDK GLOBAL INC	10,687	59.97	640,899.39
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	96.34	1,040,568.34
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	92.63	1,158,893.93
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	50,516	56.65	2,861,731.40
COMPUTER SCIENCES CORP	11,898	62.27	740,888.46
COSTAR GROUP INC	2,453	198.89	487,877.17
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	18,749	58.81	1,102,628.69
EBAY	89,313	30.72	2,743,695.36
ELECTRONIC ARTS INC	24,276	80.38	1,951,304.88
FACEBOOK INC-A	192,324	127.55	24,530,926.20
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	25,988	79.15	2,056,950.20
FIRST DATA CORP- CLASS A	22,617	15.61	353,051.37
FISERV INC	17,872	109.35	1,954,303.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,774	150.26	1,168,121.24
FORTINET INC	10,871	32.35	351,676.85

GARTNER INC	7,002	99.01	693,268.02
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	79.39	993,407.07
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,227	166.81	12,548,615.87
INTUIT INC	20,256	115.95	2,348,683.20
MASTERCARD INC-CLASS A	80,390	108.53	8,724,726.70
MERCADOLIBRE INC	2,992	174.90	523,300.80
MICROSOFT CORP	612,726	62.30	38,172,829.80
MOBILEYE NV	14,784	43.34	640,738.56
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,427	15.77	369,443.79
ORACLE CORP	256,230	39.21	10,046,778.30
PAYCHEX INC	27,128	60.90	1,652,095.20
PAYPAL HOLDINGS INC	90,300	41.27	3,726,681.00
RED HAT INC	15,196	73.92	1,123,288.32
SABRE CORP	17,243	24.80	427,626.40
SALESFORCE.COM INC	53,493	75.57	4,042,466.01
SERVICENOW INC	13,102	82.70	1,083,535.40
SPLUNK INC	10,741	53.82	578,080.62
SYMANTEC CORP	51,622	26.56	1,371,080.32
SYNOPSYS INC	12,264	60.91	747,000.24
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	53.38	673,121.80
TWITTER INC	47,756	16.79	801,823.24
VANTIV INC - CL A	12,864	62.28	801,169.92
VERISIGN INC	7,289	80.38	585,889.82
VISA INC-CLASS A SHARES	156,284	81.73	12,773,091.32
VMWARE INC-CLASS A	6,552	82.69	541,784.88
WESTERN UNION CO	38,757	21.13	818,935.41
WORKDAY INC-CLASS A	9,123	82.04	748,450.92
XEROX CORP	66,872	6.94	464,091.68
YAHOO	75,253	42.09	3,167,398.77
ZILLOW GROUP INC-C	9,847	36.60	360,400.20
AMPHENOL CORPORATION	25,794	68.21	1,759,408.74
APPLE INC	445,942	119.78	53,414,932.76
ARROW ELECTRONICS INC	8,043	72.83	585,771.69
AVNET INC	10,936	46.97	513,663.92
CDW CORP/DE	12,482	52.01	649,188.82
CISCO SYSTEMS	416,677	29.98	12,491,976.46
CORNING	86,492	24.42	2,112,134.64
F5 NETWORKS INC	5,350	142.54	762,589.00
FLEX LTD	45,803	14.57	667,349.71
FLIR SYSTEMS INC	11,686	35.04	409,477.44
HARRIS CORP	9,931	99.99	993,000.69
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	138,201	22.77	3,146,836.77

HP INC	142,630	14.86	2,119,481.80
JUNIPER NETWORKS INC	27,826	27.42	762,988.92
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	81.86	1,033,073.20
NETAPP INC	23,085	35.83	827,135.55
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	141.92	1,023,385.12
SEAGATE TECHNOLOGY	25,224	36.34	916,640.16
TE CONNECTIVITY LTD	29,658	69.60	2,064,196.80
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	29.96	617,835.12
WESTERN DIGITAL CORP	23,771	71.67	1,703,667.57
AT&T INC	508,935	41.00	20,866,335.00
CENTURYLINK INC	45,847	25.50	1,169,098.50
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	103,537	3.48	360,308.76
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	58.77	1,439,923.77
SPRINT CORP	64,825	8.97	581,480.25
T-MOBILE US INC	24,103	60.07	1,447,867.21
VERIZON COMMUNICATIONS	337,277	52.36	17,659,823.72
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,715	31.85	373,122.75
AES CORP	52,646	11.73	617,537.58
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	37.28	717,863.68
AMEREN CORPORATION	20,393	51.81	1,056,561.33
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,921	62.70	2,565,746.70
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	71.87	1,026,519.21
ATMOS ENERGY CORP	8,018	74.26	595,416.68
CALPINE CORP	25,284	12.19	308,211.96
CENTERPOINT ENERGY INC	34,527	25.44	878,366.88
CMS ENERGY CORP	23,551	42.13	992,203.63
CONSOLIDATED EDISON INC	25,402	73.49	1,866,792.98
DOMINION RESOURCES	52,141	75.62	3,942,902.42
DTE ENERGY COMPANY	14,355	98.14	1,408,799.70
DUKE ENERGY CORP	57,178	77.12	4,409,567.36
EDISON INTL	26,184	71.72	1,877,916.48
ENERGY CORP	15,032	71.08	1,068,474.56
EVERSOURCE ENERGY	25,381	55.07	1,397,731.67
EXELON CORP	76,765	35.74	2,743,581.10
FIRSTENERGY CORP	35,696	30.31	1,081,945.76
NEXTERA ENERGY INC	38,335	119.28	4,572,598.80
NISOURCE INC	26,021	22.34	581,309.14
OGE ENERGY CORP	15,686	33.22	521,088.92
PG&E CORP	41,948	61.10	2,563,022.80
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	77.05	725,502.80
PPL CORPORATION	56,554	34.23	1,935,843.42
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	43.68	1,773,670.08

SCANA CORP	11,459	70.99	813,474.41	
SEMPRA ENERGY	19,787	102.08	2,019,856.96	
SOUTHERN CO	81,254	49.05	3,985,508.70	
UGI CORP	13,950	46.10	643,095.00	
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	58.56	1,480,806.72	
WESTAR ENERGY INC	11,492	55.54	638,265.68	
XCEL ENERGY INC	40,763	40.89	1,666,799.07	
ANALOG DEVICES	25,671	72.44	1,859,607.24	
APPLIED MATERIALS	89,944	33.75	3,035,610.00	
BROADCOM LTD	32,817	185.56	6,089,522.52	
INTEL CORP	391,125	36.57	14,303,441.25	
KLA-TENCOR CORP	13,122	81.15	1,064,850.30	
LAM RESEARCH CORP	13,421	110.84	1,487,583.64	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,108	62.37	1,254,135.96	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	14.10	505,259.40	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	40.58	952,331.44	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,416	65.69	1,144,057.04	
MICRON TECHNOLOGY	86,755	21.71	1,883,451.05	
NVIDIA CORP	44,436	105.16	4,672,889.76	
NXP SEMICONDUCTORS NV	24,593	98.06	2,411,589.58	
QORVO INC	10,609	58.31	618,610.79	
QUALCOMM	122,170	64.44	7,872,634.80	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,621	78.46	1,225,623.66	
TEXAS INSTRUMENTS	83,231	73.88	6,149,106.28	
XILINX INC	20,299	57.98	1,176,936.02	
アメリカドル 小計	25,632,662		1,652,358,992.99 (190,269,138,042)	
カナダドル				
ALTAGAS INCOME LTD	11,886	32.23	383,085.78	
ARC RESOURCES LTD	27,117	21.19	574,609.23	
CAMECO CORP	28,709	15.85	455,037.65	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,328	40.40	3,770,451.20	
CENOVUS ENERGY INC	68,484	19.29	1,321,056.36	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	15.91	688,012.04	
ENBRIDGE	79,035	56.73	4,483,655.55	
ENCANA CORP	76,271	17.39	1,326,352.69	
HUSKY ENERGY INC	31,439	16.10	506,167.90	
IMPERIAL OIL	24,763	44.29	1,096,753.27	
INTER PIPELINE LTD	30,317	28.71	870,401.07	
KEYERA CORP	14,929	39.44	588,799.76	
PEMBINA PIPELINE CORP	31,251	41.67	1,302,229.17	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	29.51	372,799.83	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	19,888	31.63	629,057.44	

SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	25.96	519,459.60
SUNCOR ENERGY	140,006	42.14	5,899,852.84
TOURMALINE OIL CORP	19,965	31.31	625,104.15
TRANSCANADA CORP	72,377	61.91	4,480,860.07
VERESEN INC	23,263	13.29	309,165.27
VERMILION ENERGY INC	10,067	55.13	554,993.71
AGNICO EAGLE MINES	17,661	60.30	1,064,958.30
AGRIUM INC	10,925	134.62	1,470,723.50
BARRICK GOLD CORP	94,395	22.56	2,129,551.20
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,100	260.34	546,714.00
ELDORADO GOLD CORP	67,212	4.45	299,093.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	16.89	961,041.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	83.92	1,196,447.44
GOLDCORP INC	76,747	20.11	1,543,382.17
KINROSS GOLD CORP	107,615	4.68	503,638.20
METHANEX CORP	8,985	59.23	532,181.55
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	73,754	24.07	1,775,258.78
SILVER WHEATON CORP	36,838	27.77	1,022,991.26
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	31.32	1,430,603.64
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	4.48	318,080.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	44.91	194,325.57
YAMANA GOLD INC	85,214	4.20	357,898.80
BOMBARDIER B	157,835	2.68	422,997.80
CAE INC	26,979	18.53	499,920.87
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	26.54	312,216.56
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	56.62	686,913.84
CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,027	91.64	5,959,074.28
CP RAILWAY LIMITED	12,045	200.11	2,410,324.95
LINAMAR CORP	3,889	55.41	215,489.49
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,692	56.67	1,795,985.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	33.17	585,749.03
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	64.60	1,186,831.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.83	1,000,405.01
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	142.17	768,997.53
DOLLARAMA INC	9,011	98.76	889,926.36
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,137	61.58	2,225,316.46
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	16.30	187,433.70
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	20.24	111,603.36
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	69.77	1,280,488.81
METRO INC	19,179	41.36	793,243.44
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	112.39	536,662.25
SAPUTO INC	20,380	47.52	968,457.60



	BANK MONTREAL	54,240	98.05	5,318,232.00
	BANK NOVA SCOTIA	100,608	76.74	7,720,657.92
	CANADIAN IMPERIAL BANK	33,438	111.33	3,722,652.54
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	55.55	1,564,454.65
	ROYAL BANK OF CANADA	123,741	93.28	11,542,560.48
	TORONTO-DOMINION BANK	154,660	66.61	10,301,902.60
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	73,353	44.69	3,278,145.57
	CI FINANCIAL CORP	18,671	27.66	516,439.86
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	12.13	351,600.18
	IGM FINANCIAL INC	7,685	39.62	304,479.70
	ONEX CORP	6,603	87.09	575,055.27
	THOMSON REUTERS CORP	26,956	59.17	1,594,986.52
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,946	613.10	1,193,092.60
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	35.64	847,804.32
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	55.03	452,896.90
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	93.23	975,745.18
	MANULIFE FINANCIAL CORP	166,653	24.51	4,084,665.03
	POWER CORP OF CANADA	29,774	29.86	889,051.64
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	33.49	694,582.60
	SUN LIFE FINANCIAL INC	52,370	52.53	2,750,996.10
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.90	260,518.50
	CGI GROUP INC - CL A	17,309	63.59	1,100,679.31
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	591.17	900,943.08
	OPEN TEXT CORP	9,997	83.29	832,650.13
	BCE INC	12,539	58.41	732,402.99
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	52.03	1,502,678.43
	TELUS CORP	16,454	43.61	717,558.94
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	45.51	238,517.91
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	37.21	384,156.04
	EMERA INC	4,086	45.88	187,465.68
	FORTIS INC	31,686	41.53	1,315,919.58
	HYDRO ONE LTD	15,938	24.27	386,815.26
	カナダドル 小計	3,313,702		136,183,139.08 (11,766,223,216)
ユーロ	ENI	212,054	15.51	3,288,957.54
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	14.07	560,928.69
	NESTE OIL OYJ	11,490	34.22	393,187.80
	OMV AG	13,475	33.93	457,206.75
	REPSOL SA	88,586	14.10	1,249,062.60
	SAIPEM	590,236	0.50	296,003.35
	SNAM SPA	200,612	3.78	758,714.58
	TECHNIPFMC PLC	18,452	32.20	594,154.40

TENARIS SA	40,648	16.91	687,357.68
TOTAL SA	186,776	47.61	8,893,339.24
VOPAK	6,360	43.43	276,214.80
AIR LIQUIDE	32,390	103.25	3,344,267.50
AKZO NOBEL	19,791	61.99	1,226,844.09
ARCELORMITTAL	152,837	7.60	1,162,631.05
ARKEMA	5,896	91.52	539,601.92
BASF SE	76,229	89.50	6,822,495.50
COVESTRO AG	6,408	66.63	426,965.04
CRH	69,404	32.31	2,242,790.26
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	29.16	392,385.91
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	42.24	243,386.88
HEIDELBERGCEMENT AG	12,605	85.70	1,080,248.50
IMERYS SA	3,000	73.65	220,950.00
K+S AG	14,355	23.43	336,409.42
KONINKLIJKE DSM NV	15,469	58.52	905,245.88
LANXESS	7,293	65.66	478,858.38
LINDE AG	15,517	152.25	2,362,463.25
SOLVAY SA	6,365	109.15	694,739.75
STORA ENSO OYJ R	48,306	10.66	514,941.96
SYMRISE AG	10,667	57.65	614,952.55
THYSSEN KRUPP	29,964	23.61	707,599.86
UMICORE	8,516	53.12	452,369.92
UPM KYMMENE CORP	44,370	23.93	1,061,774.10
VOESTALPINE AG	10,429	38.60	402,559.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,761	29.30	491,097.30
AIRBUS SE	48,316	65.48	3,163,731.68
ALSTOM	11,216	25.96	291,223.44
ANDRITZ AG	5,242	49.60	260,029.41
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	34.23	285,375.51
BOUYGUES ORD	16,815	34.06	572,718.90
BRENTAG AG	13,290	51.90	689,751.00
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	8.50	730,235.00
DASSAULT AVIATION SA	213	1,099.50	234,193.50
EIFFAGE	4,952	67.78	335,646.56
FERROVIAL SA	42,255	17.27	729,955.12
GEA GROUP AG	15,822	37.64	595,619.19
HOCHTIEF AG	1,912	134.45	257,068.40
KONE OYJ-B	26,924	43.24	1,164,193.76
KONINKLIJKE PHILIPS	79,336	28.29	2,244,812.12
LEGRAND SA	21,312	53.66	1,143,601.92
LEONARDO SPA	35,425	13.10	464,067.50

MAN SE	3,262	95.55	311,684.10
METSO OYJ	9,561	27.58	263,692.38
OSRAM LICHT AG	7,897	51.70	408,274.90
PRYSMIAN SPA	14,715	24.40	359,046.00
REXEL SA	24,339	16.55	402,810.45
SAFRAN SA	26,239	63.62	1,669,325.18
SAINT-GOBAIN	41,889	45.53	1,907,415.61
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,873	67.55	3,166,271.15
SIEMENS	63,463	116.30	7,380,746.90
THALES SA	9,039	88.62	801,036.18
VINCI S.A.	42,263	65.18	2,754,702.34
WARTSILA OYJ	11,462	42.82	490,802.84
ZARDOYA OTIS SA	13,496	7.95	107,293.20
ZODIAC AEROSPACE	17,832	28.65	510,886.80
BUREAU VERITAS SA	19,558	17.72	346,567.76
EDENRED	18,941	20.01	379,009.41
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	54.29	520,532.52
RELX NV	79,547	15.43	1,227,410.21
SOCIETE BIC SA	2,424	124.45	301,666.80
WOLTERS KLUWER	25,743	34.60	890,707.80
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	55,946	13.53	757,229.11
ADP	2,382	104.90	249,871.80
AENA SA	5,610	134.45	754,264.50
ATLANTIA SPA	33,587	21.89	735,219.43
BOLLORE	61,805	3.66	226,515.32
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	11.79	249,688.62
DEUTSCHE POST AG-REG	81,055	31.48	2,551,611.40
FRAPORT AG	3,561	55.79	198,668.19
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	8.99	328,192.56
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	76,542	5.68	435,064.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,664	86.59	2,395,425.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	71.34	356,057.94
CONTINENTAL AG	8,828	188.85	1,667,167.80
DAIMLER AG	79,968	70.68	5,652,138.24
FERRARI NV	10,626	56.80	603,556.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	77,742	9.37	728,442.54
MICHELIN	14,594	103.15	1,505,371.10
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	35.51	365,468.92
PEUGEOT SA	40,815	16.96	692,426.47
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	55.92	719,075.28
RENAULT SA	15,635	85.98	1,344,297.30
SCHAEFFLER AG	15,247	14.70	224,130.90

VALEO SA	19,350	55.50	1,073,925.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,545	147.80	2,297,551.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	149.05	386,635.70
ADIDAS AG	15,749	152.30	2,398,572.70
CHRISTIAN DIOR	4,454	206.00	917,524.00
HERMES INTERNATIONAL	2,148	408.15	876,706.20
HUGO BOSS AG	4,852	62.98	305,578.96
KERING	6,060	230.10	1,394,406.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	51.25	682,598.75
LVMH	23,232	190.00	4,414,080.00
SEB SA	2,075	118.35	245,576.25
ACCOR	14,931	38.18	570,065.58
PADDY POWER PLC	6,543	99.05	648,084.15
SODEXO	7,874	103.15	812,203.10
ALTICE NV -A	28,394	18.92	537,356.45
ALTICE NV -B	10,461	18.88	197,555.98
AXEL SPRINGER SE	3,827	47.10	180,251.70
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	17.91	214,490.16
JC DECAUX SA	4,674	29.55	138,140.07
LAGADERE S.C.A	9,057	24.79	224,523.03
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	39.05	748,744.70
PUBLICIS GROUPE	16,272	65.07	1,058,819.04
RTL GROUP	3,513	70.28	246,925.25
SES	31,369	20.14	631,771.66
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	50.26	251,199.48
VIVENDI	86,540	17.62	1,525,267.50
INDITEX	91,250	31.22	2,849,281.25
ZALANDO SE	6,805	36.80	250,424.00
CARREFOUR	48,047	23.11	1,110,606.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	50.97	187,926.39
COLRUYT SA	6,317	46.00	290,582.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.78	221,087.77
JERONIMO MARTINS	20,234	15.84	320,607.73
KONINKLIJKE AHOLD NV	107,272	20.68	2,218,384.96
METRO STAMM	13,712	31.97	438,372.64
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,256	98.85	6,252,855.60
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	31.58	539,260.08
DANONE (GROUPE)	49,227	59.69	2,938,359.63
HEINEKEN HOLDING NV	8,736	65.76	574,479.36
HEINEKEN NV	18,465	70.66	1,304,736.90
KERRY GROUP PLC-A	13,457	67.75	911,711.75
PERNOD-RICARD	17,080	108.45	1,852,326.00

REMY COINTREAU	1,575	87.08	137,151.00
BEIERSDORF AG	8,668	81.71	708,262.28
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	97.10	836,807.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	113.45	1,623,923.30
LOREAL	20,980	170.50	3,577,090.00
UNILEVER NV-CVA	135,348	38.69	5,236,614.12
ESSILOR INTERNATIONAL	17,383	109.90	1,910,391.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	75.82	1,329,882.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	34,244	73.87	2,529,604.28
BAYER	68,627	101.90	6,993,091.30
EUROFINS SCIENTIFIC	971	413.75	401,751.25
GRIFOLS SA	27,339	19.80	541,312.20
MERCK KGAA	10,480	102.80	1,077,344.00
ORION OYJ-CLASS B	7,975	43.10	343,722.50
QIAGEN N.V.	18,223	26.38	480,813.85
SANOFI	96,244	75.77	7,292,407.88
UCB (GROUPE)	10,465	63.58	665,364.70
ABN AMRO GROUP NV-CVA	24,776	22.26	551,637.64
BANCO BILBAO VIZCAYA	554,475	6.11	3,391,723.57
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.34	597,111.42
BANCO SANTANDER SA	1,224,142	5.08	6,227,210.35
BANKINTER SA	58,881	7.61	448,378.81
BNP PARIBAS	88,876	59.76	5,311,229.76
CAIXABANK	256,871	3.31	852,297.97
COMMERZBANK AG	89,792	7.84	704,328.44
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	12.38	1,149,749.09
ERSTE GROUP BANK AG	25,921	28.27	732,786.67
ING GROEP NV-CVA	325,667	13.27	4,323,229.42
INTESA SANPAOLO	1,070,014	2.45	2,630,094.41
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.25	146,510.00
KBC GROEP NV	20,232	59.23	1,198,341.36
MEDIOBANCA	41,923	8.06	338,108.99
NATIXIS	69,996	5.50	384,978.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	19.50	179,341.50
SOCIETE GENERALE	64,610	45.70	2,952,677.00
UNICREDIT SPA	447,855	2.73	1,222,644.15
DEUTSCHE BANK NAMEN	116,602	17.70	2,064,438.41
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	15,552	78.34	1,218,343.68
EURAZEO	2,901	56.62	164,254.62
EXOR NV	9,778	41.91	409,795.98
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	78.51	490,451.97
WENDEL	2,712	112.25	304,422.00

AEGON	153,883	5.01	771,569.36
AGEAS	16,065	39.38	632,720.02
ALLIANZ SE-REG	38,319	159.55	6,113,796.45
ASSICURAZIONI GENERALI	94,259	13.72	1,293,233.48
AXA	163,008	23.26	3,791,566.08
CNP ASSURANCES	11,830	17.44	206,374.35
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	101.55	477,894.30
MAPFRE SA	90,939	2.74	249,718.49
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,595	177.70	2,415,831.50
NN GROUP NV	26,436	32.64	863,003.22
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.13	282,424.72
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	42.01	1,521,308.13
SCOR SE	13,354	31.63	422,453.79
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.04	193,963.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	27,553	29.83	821,905.99
VONOVIA SE	37,270	30.45	1,134,871.50
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	43.56	1,533,923.65
ATOS SE	7,634	101.30	773,324.20
CAP GEMINI SA	13,366	77.94	1,041,746.04
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	72.34	757,327.46
GEMALTO	6,158	53.14	327,236.12
SAP SE	81,564	83.99	6,850,560.36
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	38.44	365,727.28
INGENICO GROUP	4,681	77.49	362,730.69
NOKIA OYJ	488,237	4.42	2,159,960.48
DEUTSCHE TELEKOM	272,279	16.22	4,416,365.38
ELISA A	12,839	31.43	403,529.77
ILIAD SA	2,053	185.05	379,907.65
KPN (KON.)	292,091	2.77	811,428.79
ORANGE	166,846	14.86	2,480,165.79
PROXIMUS	13,141	27.42	360,326.22
SFR GROUP SA	7,526	26.51	199,514.26
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.84	716,143.68
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.68	323,931.28
TELEFONICA	388,943	9.06	3,524,212.52
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.11	275,234.37
E.ON SE	162,253	7.31	1,186,718.44
ELECTRICITE DE FRANCE	22,799	9.31	212,349.88
ENAGAS	18,299	23.59	431,673.41
ENDESA	24,774	19.55	484,455.57
ENEL	636,793	4.13	2,629,955.09
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.80	541,077.60

	ENGIE	117,274	11.67	1,368,587.58
	FORTUM OYJ	38,513	15.20	585,397.60
	GAS NATURAL SDG SA	31,393	17.68	555,028.24
	IBERDROLA SA	452,775	5.94	2,692,652.92
	INNOGY SE	11,000	31.45	345,950.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	37,798	17.10	646,345.80
	RWE STAMM	42,828	12.71	544,558.02
	SUEZ	28,043	13.94	390,919.42
	TERNA SPA	130,916	4.33	567,651.77
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	15.49	570,510.40
	ASML HOLDING NV	30,709	114.40	3,513,109.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	16.41	1,489,546.34
	STMICROELECTRONICS	53,368	10.88	580,643.84
	ユーロ 小計	16,394,882		291,794,933.22 (35,811,992,154)
イギリスポンド	BP PLC	1,557,305	4.99	7,773,287.90
	PETROFAC LTD	16,711	9.18	153,406.98
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	358,610	22.08	7,919,901.85
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	310,582	23.00	7,144,938.91
	ANGLO AMERICAN PLC	117,838	13.02	1,534,250.76
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	7.52	269,816.40
	BHP BILLITON PLC	176,281	14.46	2,549,904.66
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	33.50	343,140.50
	FRESNILLO PLC	17,743	13.98	248,047.14
	GLENCORE PLC	1,019,571	3.16	3,222,863.93
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,720	31.52	527,014.40
	MONDI PLC	31,777	17.64	560,546.28
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	66.90	487,968.60
	RIO TINTO PLC REG	102,981	34.58	3,561,597.88
	ASHTREAD GROUP PLC	42,818	15.70	672,242.60
	BAE SYSTEMS PLC	266,139	6.02	1,602,156.78
	BUNZL PLC	27,712	21.27	589,434.24
	COBHAM PLC	151,109	1.40	212,610.36
	DCC PLC	7,320	60.45	442,494.00
	IMI PLC	23,923	10.82	258,846.86
	MEGGITT PLC	66,268	4.42	292,904.56
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	147,055	7.02	1,033,061.37
	SMITHS GROUP PLC	34,243	14.92	510,905.56
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	14.66	272,016.30
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	19.92	370,233.12
	WOLSELEY LTD	20,276	49.28	999,201.28
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	9.34	183,932.62

CAPITA GROUP PLC	53,334	5.01	267,470.01
EXPERIAN PLC	76,879	15.34	1,179,323.86
G4S PLC	132,555	2.46	327,145.74
INTERTEK GROUP PLC	12,430	34.78	432,315.40
RELX PLC	87,723	14.21	1,246,543.83
EASYJET PLC	11,633	10.41	121,099.53
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.22	317,436.92
NEW GKN	148,431	3.42	507,634.02
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	87,767	5.05	443,662.18
BURBERRY GROUP PLC	38,199	16.65	636,013.35
PERSIMMON PLC	26,773	19.55	523,412.15
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.69	458,660.22
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	28.65	303,661.35
CARNIVAL PLC	15,765	41.80	658,977.00
COMPASS GROUP PLC	137,382	14.16	1,945,329.12
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,585	37.62	548,687.70
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.80	312,926.08
TUI AG-DI	42,055	11.31	475,642.05
WHITBREAD PLC	14,664	40.71	596,971.44
WILLIAM HILL	70,325	2.82	198,668.12
ITV PLC	295,435	2.03	601,210.22
PEARSON	66,305	5.88	390,204.92
SKY PLC	87,511	9.99	874,234.89
WPP PLC	103,971	18.51	1,924,503.21
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	3.48	290,424.36
KINGFISHER PLC	187,310	3.50	655,585.00
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.43	464,357.87
NEXT PLC	11,202	39.94	447,407.88
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.41	405,349.37
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.68	397,537.80
TESCO	656,079	2.02	1,329,216.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,282	25.85	782,789.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	154,598	47.34	7,318,669.32
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	18.13	253,801.87
DIAGEO	209,214	21.62	4,523,206.68
IMPERIAL BRANDS PLC	79,880	35.57	2,841,731.00
TATE & LYLE	40,576	6.81	276,322.56
RECKITT BENCKISER PLC	52,601	68.76	3,616,844.76
UNILEVER PLC	106,796	33.40	3,567,520.38
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	7.93	238,114.11
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	12.09	858,716.43
ASTRAZENECA	105,039	44.68	4,693,667.71



	GLAXOSMITHKLINE	404,417	15.53	6,280,596.01	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	19.43	237,182.01	
	SHIRE PLC	74,905	44.83	3,358,365.67	
	BARCLAYS	1,421,766	2.28	3,245,891.77	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,663,903	6.79	11,302,893.07	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,396,994	0.64	3,494,013.91	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.20	650,448.32	
	STANDARD CHARTERED PLC	277,314	7.48	2,074,308.72	
	3I GROUP PLC	84,479	7.11	600,645.69	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	2.65	196,971.98	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	13.21	270,395.49	
	INVESTEC PLC	54,280	5.66	307,496.20	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	30.10	783,141.80	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	28.21	313,525.94	
	SCHRODERS PLC	12,069	29.82	359,897.58	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	17.32	281,536.60	
	AVIVA PIC	343,399	4.76	1,635,609.43	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.47	394,818.48	
	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.41	1,169,859.79	
	OLD MUTUAL PLC	397,509	2.09	831,986.33	
	PRUDENTIAL	216,701	15.52	3,363,199.52	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.65	488,939.70	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	10.53	471,217.50	
	STANDARD LIFE PLC	164,930	3.54	584,511.92	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.95	316,679.58	
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.43	574,334.03	
	WORLDPAY GROUP PLC	157,060	2.87	451,390.44	
	BT GROUP PLC	703,646	3.78	2,660,133.70	
	INMARSAT PLC	33,632	6.53	219,785.12	
	VODAFONE GROUP PLC	2,210,642	2.06	4,556,133.16	
	CENTRICA PLC	440,558	2.29	1,012,402.28	
	NATIONAL GRID PLC	313,593	9.36	2,936,798.44	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	22.35	404,803.20	
	SSE PLC	80,824	15.15	1,224,483.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.99	529,421.10	
	イギリス債券 小計	24,737,158		149,573,540.08 (21,246,921,368)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	505.00	339,360.00	
	GIVAUDAN-REG	740	1,818.00	1,345,320.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	51.10	1,870,464.40	
	SIKA AG-BR	184	4,815.00	885,960.00	
	SYNGENTA AG	7,722	425.80	3,288,027.60	

ABB LTD	156,930	22.67	3,557,603.10	
GEBERIT AG-REG	3,021	422.40	1,276,070.40	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	179.60	337,827.60	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,528	180.90	638,215.20	
ADECCO GROUP AG-REG	13,224	70.75	935,598.00	
SGS SA	437	2,090.00	913,330.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,674	133.70	624,913.80	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,578	76.70	3,342,432.60	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	348.10	864,332.30	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	68.05	267,980.90	
DUFREY AG-REG	3,918	137.60	539,116.80	
ARYZTA AG	7,596	45.40	344,858.40	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,255.00	261,040.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,660.00	424,500.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	65,860.00	526,880.00	
NESTLE SA - REGISTERED	257,643	73.20	18,859,467.60	
SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	128.70	532,818.00	
ACTELION LTD-REG	8,161	226.80	1,850,914.80	
GALENICA AG-REG	291	1,120.00	325,920.00	
LONZA GROUP AG-REG	4,551	183.30	834,198.30	
NOVARTIS	184,971	71.10	13,151,438.10	
ROCHE HOLDING GENUSS	58,196	233.00	13,559,668.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG	167,531	15.40	2,579,977.40	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	47.05	884,681.15	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	65.45	222,333.65	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	499.50	740,259.00	
UBS GROUP AG	307,047	16.77	5,149,178.19	
BALOISE HOLDING AG	3,877	127.50	494,317.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,777	296.40	823,102.80	
SWISS RE LTD	27,348	92.50	2,529,690.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,669	276.30	3,500,444.70	
SWISS PRIME SITE-REG	6,277	83.35	523,187.95	
SWISSCOM	2,064	446.70	921,988.80	
スイスフラン 小計	1,362,646		90,067,417.04 (10,300,109,812)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	196.30	2,785,693.30
	BOLIDEN AB	23,656	249.50	5,902,172.00
	ALFA LAVAL AB	25,732	155.50	4,001,326.00
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	166.00	13,328,970.00
	ATLAS COPCO A	53,833	278.10	14,970,957.30
	ATLAS COPCO B	33,265	247.60	8,236,414.00
	SANDVIK AB	87,313	117.30	10,241,814.90

	SKANSKA B	28,530	212.40	6,059,772.00	
	SKF AB-B	33,479	169.30	5,667,994.70	
	VOLVO B	123,214	110.90	13,664,432.60	
	SECURITAS B	22,844	137.70	3,145,618.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	234.40	4,259,048.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	68.45	2,649,836.40	
	HENNES & MAURITZ B	79,480	243.70	19,369,276.00	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	282.30	1,617,579.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	281.30	4,261,413.70	
	SCA SV CELLULOSA B	48,571	250.20	12,152,464.20	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	154.10	2,441,714.50	
	NORDEA BANK AB	256,066	102.00	26,118,732.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	96.55	11,825,830.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	129,044	125.10	16,143,404.40	
	SWEDBANK AB-A	76,740	213.50	16,383,990.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	166.80	2,133,705.60	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	342.70	12,594,910.40	
	KINNEVIK AB - B	18,104	222.90	4,035,381.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	554.00	2,016,560.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	52.50	13,028,872.50	
	HEXAGON AB-B SHS	21,517	345.80	7,440,578.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	427.90	2,650,412.60	
	TELE2 AB-B SHS	33,524	73.50	2,464,014.00	
	TELIA CO AB	221,808	36.69	8,138,135.52	
	スウェーデンクローナ 小計	1,934,843		259,731,024.82 (3,340,140,979)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	94,332	159.30	15,027,087.60	
	NORSK HYDRO	106,150	44.89	4,765,073.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	346.80	4,671,396.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	198.00	1,380,258.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	214.20	1,284,129.00	
	MARINE HARVEST	32,238	156.10	5,032,351.80	
	ORKLA	70,520	77.65	5,475,878.00	
	DNB ASA	80,217	135.50	10,869,403.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	137.80	2,559,497.20	
	TELENOR ASA	60,821	131.80	8,016,207.80	
	ノルウェークローネ 小計	489,288		59,081,282.40 (805,277,879)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	401.40	2,970,761.40	
	NOVOZYMES A/S	17,687	249.10	4,405,831.70	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	471.00	8,346,120.00	
	ISS A/S	14,253	242.00	3,449,226.00	

	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	11,050.00	3,303,950.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	11,620.00	5,902,960.00	
	DSV A/S	14,599	328.20	4,791,391.80	
	PANDORA A/S	9,424	876.50	8,260,136.00	
	CARLSBERG AS-B	8,236	614.00	5,056,904.00	
	COLOPLAST-B	10,121	491.80	4,977,507.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	125.40	930,468.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,262.00	5,694,144.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	158,816	250.50	39,783,408.00	
	DANSKE BANK A/S	55,801	223.20	12,454,783.20	
	TRYG A/S	9,828	135.90	1,335,625.20	
	TDC A/S	72,376	37.00	2,677,912.00	
	DONG ENERGY A/S	6,052	260.30	1,575,335.60	
	デンマーククローネ 小計	415,053		115,916,464.70 (1,912,621,667)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	30.29	624,852.41	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.18	852,847.58	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	150,725	7.25	1,092,756.25	
	SANTOS	128,132	4.11	526,622.52	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	32.08	1,946,293.60	
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.82	311,085.85	
	AMCOR	98,286	14.77	1,451,684.22	
	BHP BILLITON LTD	266,962	26.69	7,125,215.78	
	BORAL LIMITED	104,098	5.56	578,784.88	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	6.25	841,725.00	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.55	534,626.45	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	20.48	765,194.24	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	21.60	1,321,034.40	
	ORICA LTD	29,211	18.53	541,279.83	
	RIO TINTO LTD	34,814	63.53	2,211,733.42	
	SOUTH32 LTD	453,795	2.78	1,261,550.10	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	35.82	330,260.40	
	BRAMBLES LTD	129,297	12.33	1,594,232.01	
	SEEK LTD	26,358	14.74	388,516.92	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.01	799,029.87	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	3.47	118,517.85	
	TRANSURBAN GROUP	162,844	10.39	1,691,949.16	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	15.42	674,239.50	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	11.70	354,837.60	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	64.84	358,111.32	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	31.24	101,936.12	
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.88	306,127.28	

	TATTS GROUP LTD	124,218	4.34	539,106.12
	REA GROUP LTD	3,593	56.31	202,321.83
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.91	221,750.33
	WESFARMERS LTD	93,998	41.50	3,900,917.00
	WOOLWORTHS LTD	102,821	24.40	2,508,832.40
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.86	454,841.80
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	11.09	647,378.75
	COCHLEAR LIMITED	5,007	128.19	641,847.33
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.32	325,447.28
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	69.27	848,418.96
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	21.07	669,541.39
	CSL LIMITED	38,103	111.50	4,248,484.50
	AUST AND NZ BANKING GROUP	243,225	29.89	7,269,995.25
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.89	423,284.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	12.63	535,941.42
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	142,239	82.67	11,758,898.13
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	220,875	30.42	6,719,017.50
	WESTPAC BANKING	277,759	32.33	8,979,948.47
	AMP LTD	244,230	5.08	1,240,688.40
	ASX LTD	15,814	49.32	779,946.48
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	11.04	486,510.72
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,553	85.04	2,087,987.12
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	202,082	6.00	1,212,492.00
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.74	587,762.88
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.44	1,406,876.92
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.40	1,379,141.40
	COMPUTERSHARE LIMITED	42,996	12.48	536,590.08
	TELSTRA CORP	342,339	5.14	1,759,622.46
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.02	220,954.50
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	41,989	4.23	177,613.47
	AGL ENERGY LTD	57,548	22.55	1,297,707.40
	AUSNET SERVICES	120,230	1.57	188,761.10
	オーストラリアドル 小計	5,948,983		92,963,671.95 (8,090,628,369)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	10.38	649,860.66
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.76	574,262.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	8.47	307,604.99
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.53	513,434.97
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.94	291,277.22
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.09	191,088.39
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.71	300,126.96
		560,571		2,827,655.19

	ニュージーランドドル 小計			(233,988,466)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	225,496	91.20	20,565,235.20
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	13.08	1,294,920.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	10.40	894,400.00
	MTR CORP	114,000	38.80	4,423,200.00
	LI & FUNG	554,800	3.44	1,908,512.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	28.00	3,332,000.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	28.15	1,928,275.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	200,000	35.75	7,150,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	14.88	999,936.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	34.85	7,067,580.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.34	817,320.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.04	797,280.00
	WYNN MACAU LTD	102,800	13.06	1,342,568.00
	WH GROUP LTD	699,000	6.19	4,326,810.00
	BANK EAST ASIA	109,160	31.60	3,449,456.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	30.40	9,180,800.00
	HANG SENG BANK	61,100	152.90	9,342,190.00
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.70	729,600.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,700	187.20	18,102,240.00
	AIA GROUP LTD	1,001,000	47.55	47,597,550.00
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	216,496	52.10	11,279,441.60
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	28.55	2,312,550.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.08	3,127,840.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	94,996	42.90	4,075,328.40
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	35.40	2,088,600.00
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	21.85	841,225.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	8.91	4,379,265.00
	SINO LAND CO	235,400	12.70	2,989,580.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	105.00	12,285,000.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	78.40	3,175,200.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.90	2,106,780.00
	WHARF HOLDINGS	117,000	57.70	6,750,900.00
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	46.55	3,025,750.00
	PCCW LTD	357,000	4.71	1,681,470.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	62.15	3,107,500.00
	CLP HOLDINGS	133,500	74.90	9,999,150.00
	HONG KONG & CHINA GAS	609,846	14.48	8,830,570.08
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	72.15	8,008,650.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	86.00	2,038,200.00
	香港ドル 小計	7,577,194		237,352,872.28 (3,522,316,624)

シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.15	690,645.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.12	177,840.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.39	369,510.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	0.82	109,725.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.45	407,925.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.91	429,430.03	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.19	265,728.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.93	395,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	3.53	448,663.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	40.94	405,306.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.42	178,075.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	155,000	3.82	592,100.00	
	DBS GROUP	148,700	18.28	2,718,236.00	
	OCBC BANK	264,400	9.30	2,458,920.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	20.80	2,159,040.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.48	466,004.00	
	CAPITALAND LTD	229,700	3.18	730,446.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	8.87	276,744.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	2.61	649,890.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	6.28	204,100.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.78	2,422,764.54		
STARHUB LTD	38,000	3.03	115,140.00		
シンガポールドル 小計		3,608,876		16,671,481.57 (1,345,388,562)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,247	201.00	451,647.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	16.74	548,335.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	400.50	584,730.00	
	BANK HAPOLIM BM	93,717	22.76	2,132,998.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	15.61	1,807,544.34	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	57.28	469,696.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	169.00	730,587.00	
	NICE LTD	4,894	263.00	1,287,122.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	6.80	1,051,475.40	
イスラエルシェケル 小計		417,997		9,064,136.10 (273,374,344)	
合 計		92,393,855		288,918,121,482 (288,918,121,482)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472,900	203,347.00	
	アメリカドル 小計		472,900	203,347.00	(23,415,407)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	772,102.02	
		DUET GROUP	177,921	519,529.32	
		LENDLEASE GROUP	44,009	611,285.01	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	530,174.00	
	オーストラリアドル 小計		401,361	2,433,090.35	(211,751,853)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,426,635.00	
HKT TRUST AND HKT LTD		187,000	2,000,900.00		
香港ドル 小計		407,500	3,427,535.00	(50,864,619)	
投資信託受益証券合計			1,281,761	286,031,879	(286,031,879)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	515,052.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,956	654,623.96	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,333	3,690,178.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	829,809.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,452	2,006,619.44	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,580,191.90	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	597,345.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	585,728.28	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	612,480.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,103	2,411,237.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,352	1,398,622.00	
		DUKE REALTY CORP	29,929	796,709.98	
		EQUINIX INC	5,924	2,257,932.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	30,490	1,920,870.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,491	1,244,644.97	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	737,725.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	839,538.25	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	48,203	1,187,239.89	
		HCP INC	39,255	1,176,079.80	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,082,049.36	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	694,986.88	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	884,466.86	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	477,963.46	
		MACERICH CO/THE	10,128	700,857.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,565	911,161.90			
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	492,043.00			



	PROLOGIS INC	43,893	2,315,794.68	
	PUBLIC STORAGE	12,263	2,640,591.79	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,283,673.38	
	REGENCY CENTERS CORP	8,492	585,183.72	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,469	1,107,201.44	
	SIMON PROPERTY GROUP	26,069	4,768,541.48	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	865,831.11	
	UDR INC	20,960	748,481.60	
	VENTAS INC	29,328	1,797,806.40	
	VEREIT INC	77,798	659,727.04	
	VORNADO REALTY TRUST	14,213	1,495,349.73	
	WELLTOWER INC	29,857	1,982,504.80	
	アメリカドル 小計	927,599	50,536,845.38 (5,819,317,745)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	212,075.65	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	404,753.70	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	179,628.90	
	カナダドル 小計	30,576	796,458.25 (68,813,992)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	180,434.10	
	GECINA SA	3,549	433,687.80	
	ICADE	2,845	186,119.90	
	KLEPIERRE	18,936	667,778.04	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,334	1,785,559.50	
	ユーロ 小計	35,974	3,253,579.34 (399,311,792)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	84,399	502,596.04	
	HAMMERSON PLC	61,184	334,370.56	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	202,241.72	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	62,454	617,045.52	
	SEGRO PLC	64,553	297,202.01	
	イギリスポンド 小計	346,079	1,953,455.85 (277,488,403)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	662,364.60	
	GOODMAN GROUP	140,271	959,453.64	
	GPT GROUP	136,015	647,431.40	
	MIRVAC GROUP	306,089	615,238.89	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,890,117.09	
	STOCKLAND	207,412	898,093.96	
	VICINITY CENTERS	291,115	838,411.20	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,451,354.59	
	オーストラリアドル 小計	1,743,096	7,962,465.37	

			(692,973,361)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	9,316,050.00	
香港ドル 小計		179,500	9,316,050.00	
			(138,250,182)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	474,000.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	223,795.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	394,591.00	
	SUNTEC REIT	173,000	294,965.00	
シンガポールドル 小計		713,800	1,387,351.00	
			(111,959,225)	
投資証券合計		3,976,624	7,508,114,700	
			(7,508,114,700)	
合計			7,794,146,579	
			(7,794,146,579)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 600銘柄	97.0%			64.1%
	投資信託受益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 38銘柄			3.0%	2.0%
カナダドル	株式 89銘柄	99.4%			4.0%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	98.9%			12.1%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.7%			7.2%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	89.9%			2.7%
	投資信託受益証券 4銘柄		2.4%		0.1%
	投資証券 8銘柄			7.7%	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	94.9%			1.2%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	22銘柄	92.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年 1月20日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	564,730,592
金銭信託	487,157
コール・ローン	104,582,785
国債証券	22,322,459,968
派生商品評価勘定	859,988
未収入金	378,026
未収利息	359,100,854
前払費用	24,449,207
流動資産合計	23,377,048,577
<b>資産合計</b>	23,377,048,577
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	628,855
未払金	349,527,207
未払解約金	40,515,479
未払利息	225
流動負債合計	390,671,766
<b>負債合計</b>	390,671,766
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	14,621,557,846
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	8,364,818,965
元本等合計	22,986,376,811
<b>純資産合計</b>	22,986,376,811
<b>負債純資産合計</b>	23,377,048,577

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成29年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,621,557,846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	<p>1口当たり純資産額 1.5721円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (15,721円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成29年 1月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成29年 1月20日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	11,182,201,829円
期中追加設定元本額	4,827,400,197円
期中一部解約元本額	1,388,044,180円
期末元本額	14,621,557,846円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,261,187,302円
世界経済インデックスファンド	2,154,282,764円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,022,539,514円
DC世界経済インデックスファンド	2,725,360,027円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,028,677,875円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	16,887,179円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	71,594,386円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	846,297,670円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	164,369,304円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	95,454,536円

区分	平成29年 1月20日現在
新興国債券インデックス・オープン	14,743,504円
SMT インデックスバランス・オープン	220,163,785円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	270,424,230	
合計	270,424,230	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成29年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	245,761,060	-	246,510,448	749,388
	メキシコペソ	26,220,000	-	26,200,000	20,000
	ブラジルリアル	30,191,301	-	30,274,772	83,471
	トルコリラ	36,162,600	-	36,072,000	90,600
	ハンガリーフォリント	15,876,000	-	15,892,000	16,000
	ポーランドズロチ	30,778,000	-	30,855,000	77,000
	マレーシアリングット	29,494,132	-	29,583,294	89,162
	タイバーツ	28,262,252	-	28,329,169	66,917
	インドネシアルピア	44,567,275	-	45,059,213	491,938
	南アフリカランド	4,209,500	-	4,245,000	35,500
	売建	275,385,828	-	275,904,083	518,255
	アメリカドル	275,385,828	-	275,904,083	518,255
	合計	521,146,888	-	522,414,531	231,133

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	9,500,000.00	11,234,652.50		
		MBONO 10% 12/05/24	36,650,000.00	41,783,015.75		
		MBONO 4.75% 06/14/18	37,000,000.00	35,964,185.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	23,600,000.00	20,608,818.00		
		MBONO 5% 12/11/19	47,800,000.00	45,181,277.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	23,300,000.00	22,367,417.50		
		MBONO 6.5% 06/10/21	50,800,000.00	49,227,994.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	16,100,000.00	15,743,465.50		
		MBONO 7.75% 05/29/31	23,500,000.00	22,908,270.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	32,600,000.00	31,418,413.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	12,000,000.00	11,574,240.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	14,100,000.00	14,696,712.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	17,700,000.00	18,333,040.50		
		MBONO 8.5% 12/13/18	29,700,000.00	30,488,089.50		
		MBONO 8% 06/11/20	21,400,000.00	21,897,015.00		
		MBONO 8% 12/07/23	14,900,000.00	15,249,852.00		
		メキシコペソ 小計			410,650,000.00	408,676,457.25 (2,145,551,400)
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/19	7,000,000.00	5,780,278.00	
			BLTN 0% 01/01/20	7,900,000.00	5,890,721.90	
			BLTN 0% 07/01/18	9,100,000.00	7,886,123.70	
			BLTN 0% 07/01/19	2,150,000.00	1,690,624.55	
			BLTN 0% 10/01/18	8,450,000.00	7,147,195.90	
			BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000.00	6,716,029.43	
BNTNF 10% 01/01/21			13,200,000.00	12,968,172.67		
BNTNF 10% 01/01/23			9,300,000.00	8,984,528.41		
BNTNF 10% 01/01/25			5,500,000.00	5,260,432.78		
BNTNF 10% 01/01/27			3,450,000.00	3,266,768.16		
BRAZIL 10.25% 01/10/28			700,000.00	702,625.00		



	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	491,062.50	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	300,000.00	287,812.50	
ブラジルレアル 小計		74,250,000.00	67,072,375.50	(2,411,251,899)
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	150,000,000.00	158,571,000.00	
チリペソ 小計		150,000,000.00	158,571,000.00	(27,638,925)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000.00	11,479,203,750.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	16,500,000,000.00	17,226,082,500.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	13,050,000,000.00	15,772,817,250.00	
コロンビアペソ 小計		42,500,000,000.00	44,478,103,500.00	(1,739,093,846)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	2,150,000.00	2,143,485.50	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	3,000,000.00	3,002,130.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	1,800,000.00	1,839,582.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	2,850,000.00	2,942,297.25	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,250,000.00	1,362,543.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,400,000.00	2,753,088.00	
ペルーヌエボソル 小計		13,450,000.00	14,043,126.50	(487,436,920)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,541,504.00	
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,660,917.50	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	4,600,000.00	4,528,148.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	3,300,000.00	3,199,449.00	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	5,150,000.00	5,071,694.25	
	TURKGB 6.3% 02/14/18	3,100,000.00	2,957,136.50	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	4,950,000.00	4,072,142.25	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,481,940.00	
	TURKGB 8.3% 06/20/18	4,000,000.00	3,851,740.00	
	TURKGB 8.5% 07/10/19	4,200,000.00	3,965,367.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	2,450,000.00	2,181,051.25	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	3,400,000.00	3,030,029.00	
	TURKGB 8.8% 11/14/18	4,800,000.00	4,616,448.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	5,300,000.00	4,424,069.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	2,000,000.00	1,860,050.00	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	4,900,000.00	4,657,082.50	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,813,670.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	5,150,000.00	4,602,503.50	
	トルコリラ 小計		68,450,000.00	63,514,941.75
ハンガリーフォリント	HGB 2.5% 06/22/18	142,000,000.00	146,495,010.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	206,000,000.00	211,276,690.00	
	HGB 2% 10/30/19	155,000,000.00	159,767,025.00	

	HGB 3.5% 06/24/20	282,000,000.00	302,564,850.00	
	HGB 3% 06/26/24	205,000,000.00	206,165,425.00	
	HGB 3% 10/27/27	100,200,000.00	96,339,294.00	
	HGB 4% 04/25/18	75,000,000.00	78,523,125.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	267,400,000.00	314,507,858.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	170,000,000.00	186,359,950.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	268,000,000.00	325,603,920.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	362,000,000.00	411,499,880.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	205,000,000.00	250,032,350.00	
	HGB 7% 06/24/22	256,000,000.00	320,463,360.00	
ハンガリーフォリント 小計		2,693,600,000.00	3,009,598,737.00 (1,195,713,578)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 10/25/18	1,300,000.00	1,255,858.50	
	POLGB 1.5% 04/25/20	5,700,000.00	5,516,830.50	
	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000.00	7,998,816.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	600,000.00	575,172.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	7,100,000.00	7,165,568.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	8,500,000.00	7,701,255.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	800,000.00	711,468.00	
	POLGB 2% 04/25/21	5,400,000.00	5,220,882.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	7,200,000.00	7,369,164.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,900,000.00	6,723,636.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	5,900,000.00	6,045,199.00	
	POLGB 4% 10/25/23	6,250,000.00	6,475,406.25	
	POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000.00	5,074,335.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,985,779.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,500,000.00	6,220,500.00	
POLGB 5.75% 10/25/21	3,700,000.00	4,157,708.50		
ポーランドズロチ 小計		82,500,000.00	83,197,579.00 (2,334,524,066)	
ロシアルー ブル	RFLB 6.4% 05/27/20	56,000,000.00	53,791,360.00	
	RFLB 6.7% 05/15/19	58,500,000.00	57,169,125.00	
	RFLB 6.8% 12/11/19	46,200,000.00	45,099,978.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	73,600,000.00	68,578,272.00	
	RFLB 7.5% 02/27/19	45,800,000.00	45,628,937.00	
	RFLB 7.5% 03/15/18	28,100,000.00	28,039,444.50	
	RFLB 7.5% 08/18/21	75,500,000.00	74,753,305.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	35,000,000.00	34,844,600.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	47,500,000.00	47,153,250.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	29,800,000.00	29,237,525.00	
	RFLB 7% 01/25/23	42,700,000.00	41,011,428.50	
	RFLB 7% 08/16/23	76,200,000.00	73,108,185.00	

	RFLB 8.15% 02/03/27	75,000,000.00	76,285,125.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	48,100,000.00	49,294,804.00	
	RUSSIA 7.85% 03/10/18	30,000,000.00	29,867,850.00	
	ロシアルーブル 小計	768,000,000.00	753,863,189.00 (1,454,955,954)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	3,250,000.00	3,259,132.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	3,400,000.00	3,307,792.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	4,250,000.00	4,104,267.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	3,800,000.00	3,793,540.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	4,950,000.00	4,981,407.75	
	MGS 3.62% 11/30/21	3,300,000.00	3,288,252.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	2,900,000.00	2,912,499.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	3,400,000.00	3,405,899.00	
	MGS 3.759% 03/15/19	1,650,000.00	1,666,384.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	3,200,000.00	3,176,000.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	4,400,000.00	4,335,804.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,600,000.00	1,616,024.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	5,500,000.00	5,343,772.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,550,000.00	3,466,166.75	
	MGS 4.048% 09/30/21	3,950,000.00	3,991,435.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	4,550,000.00	4,623,300.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,704,495.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,200,000.00	2,096,391.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	1,300,000.00	1,315,697.50	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,950,000.00	1,831,713.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,174,432.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,100,000.00	3,108,928.00	
MGS 4.498% 04/15/30	3,730,000.00	3,655,138.90		
MGS 5.734% 07/30/19	2,900,000.00	3,057,774.50		
	マレーシアリンギット 小計	81,580,000.00	81,216,247.90 (2,101,876,495)	
タイバーツ	THA IGB 1.875% 06/17/22	21,500,000.00	21,084,727.50	
	THA IGB 2.125% 12/17/26	10,000,000.00	9,552,000.00	
	THA IGB 2.55% 06/26/20	56,950,000.00	58,182,967.50	
	THA IGB 3.4% 06/17/36	16,000,000.00	16,392,160.00	
	THA IGB 3.45% 03/08/19	13,000,000.00	13,473,200.00	
	THA IGB 3.625% 06/16/23	65,700,000.00	70,405,434.00	
	THA IGB 3.65% 12/17/21	84,500,000.00	90,371,905.00	
	THA IGB 3.85% 12/12/25	60,400,000.00	66,343,058.00	
	THA IGB 3.875% 06/13/19	97,700,000.00	102,693,935.50	
	THA IGB 4.875% 06/22/29	63,000,000.00	75,358,710.00	
	THA IGB 5.125% 03/13/18	23,000,000.00	23,930,925.00	
			511,750,000.00	547,789,022.50

	タイバーツ 小計		(1,785,792,213)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,547,550.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	10,000,000.00	10,154,350.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	21,780,100.00	
	フィリピンペソ 小計	40,000,000.00	41,482,000.00	(95,408,600)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,578,522,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	6,700,000,000.00	8,066,565,500.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	12,500,000,000.00	14,043,937,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	5,700,000,000.00	6,861,945,000.00	
	INDOGB 5.25% 05/15/18	3,500,000,000.00	3,447,587,500.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	11,000,000,000.00	9,988,330,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	6,500,000,000.00	5,624,905,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	17,000,000,000.00	14,782,350,000.00	
	INDOGB 7.875% 04/15/19	12,300,000,000.00	12,549,444,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	8,000,000,000.00	7,933,800,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	8,900,000,000.00	8,560,776,500.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	10,200,000,000.00	10,413,078,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	7,500,000,000.00	7,607,962,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	23,400,000,000.00	24,289,200,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000.00	33,373,280,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	21,000,000,000.00	21,574,560,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	24,100,000,000.00	25,376,818,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	16,400,000,000.00	17,512,986,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	8,400,000,000.00	9,456,216,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	21,500,000,000.00	23,205,487,500.00	
	インドネシアルピア 小計	262,900,000,000.00	272,247,751,000.00	(2,368,555,433)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	42,000,000.00	46,909,800.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,300,000.00	11,841,298.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	21,800,000.00	15,809,578.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,900,000.00	14,199,849.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	15,500,000.00	15,215,187.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	15,000,000.00	14,563,275.00	
	SAGB 7% 02/28/31	23,600,000.00	19,617,146.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	19,000,000.00	17,447,130.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	22,400,000.00	20,534,416.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	19,500,000.00	18,154,110.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	24,700,000.00	22,972,358.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	6,300,000.00	6,026,296.50	
	SAGB 8% 01/31/30	22,300,000.00	20,397,810.00	
	SAGB 8% 12/21/18	9,450,000.00	9,480,523.50	
	SAGB 9% 01/31/40	13,700,000.00	13,124,874.00	

	南アフリカランド 小計	286,450,000.00	266,293,652.00 (2,263,496,042)	
	合計		22,322,459,968 (22,322,459,968)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルレアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.8%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 6銘柄	100.0%	2.2%
トルコリラ	国債証券 18銘柄	100.0%	8.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	5.4%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.5%
ロシアルーブル	国債証券 15銘柄	100.0%	6.5%
マレーシアリングット	国債証券 24銘柄	100.0%	9.4%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.0%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.4%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	10.6%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	10.1%

(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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	236,717,174
金銭信託	103,116
コール・ローン	22,136,832
株式	30,406,800,507
投資信託受益証券	56,731,397
投資証券	151,162,015
派生商品評価勘定	18,076,247
未収入金	317,398
未収配当金	27,677,849
差入委託証拠金	186,242,949
流動資産合計	31,105,965,484
資産合計	31,105,965,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	218,780
前受金	17,919,067
未払金	5,874
未払解約金	47,629,104
未払利息	47
流動負債合計	65,772,872
負債合計	65,772,872
純資産の部	
元本等	
元本	13,041,313,502
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,998,879,110
元本等合計	31,040,192,612
純資産合計	31,040,192,612
負債純資産合計	31,105,965,484

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

平成29年 1月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,041,313,502口

		平成29年 1月20日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3801円 (23,801円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成29年 1月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		平成29年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		



	平成29年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	11,448,031,282円
期中追加設定元本額	2,807,172,694円
期中一部解約元本額	1,213,890,474円
期末元本額	13,041,313,502円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,992,616,148円
世界経済インデックスファンド	1,464,831,911円
DC新興国株式インデックス・オープン	2,825,684,524円
DC世界経済インデックスファンド	1,861,109,279円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	14,235,398円

区分	平成29年 1月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	148,864,402円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	191,715,736円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	351,048,980円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,810,846円
新興国株式インデックス・オープン	15,032,079円
S M T インデックスバランス・オープン	154,364,199円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	877,272,360
投資信託受益証券	5,349,044
投資証券	2,098,745
合計	880,522,659

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成29年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	403,113,090	-	421,032,157	17,919,067
	合計	403,113,090	-	421,032,157	17,919,067

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成29年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	売建	32,174,800	-	32,236,400	61,600
	アメリカドル	32,174,800	-	32,236,400	61,600
	合計	32,174,800	-	32,236,400	61,600

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	411,180	4.99	2,055,283.23	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	28,801	53.30	1,535,093.30	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	6,180	121.00	747,780.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	84,139	6.28	528,392.92	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	81,414	5.24	426,609.36	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	16,303	41.27	672,824.81	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	12.91	218,566.30	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	40,199	16.05	645,193.95	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	9,620	15.20	146,224.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	15,540	15.40	239,316.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	35.85	193,661.70	
	DP WORLD LTD	10,914	19.75	215,551.50	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	9,585	48.03	460,367.55	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,546	80.50	204,953.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	25,137	26.00	653,562.00	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	23,721	43.54	1,032,812.34	
	JD.COM INC-ADR	42,534	27.75	1,180,318.50	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	1,562	30.46	47,578.52	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	25,484	10.92	278,285.28	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,737	38.60	800,448.20	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	62,817	4.00	251,582.08	
	CREDICORP LTD	4,266	159.01	678,336.66	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	182,125	11.20	2,039,800.00	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	200,292	2.25	450,657.00		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.41	64,093.68		

	58.COM INC-ADR	4,981	29.51	146,989.31
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	72,965	96.17	7,017,044.05
	BAIDU INC - SPON ADR	17,688	176.09	3,114,679.92
	NETEASE INC-ADR	4,995	238.98	1,193,705.10
	SINA CORP	4,000	67.80	271,200.00
	WEIBO CORP-SPON ADR	2,001	47.08	94,207.08
	YY INC-ADR	2,307	43.98	101,461.86
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	38,757	1.80	69,762.60
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.54	420,061.16
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	21,667	8.53	184,819.51
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.77	193,990.23
	アメリカドル 小計	1,691,602		28,575,212.70 (3,290,435,742)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	922,463	18.11	16,705,804.93
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	261,292	60.42	15,787,262.64
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	491.27	4,875,854.75
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	49.70	4,813,544.40
	ALFA S.A.B.-A	175,000	25.51	4,464,250.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	82.06	3,077,250.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	295.44	4,574,888.40
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,780	160.12	2,846,933.60
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	20.62	775,312.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	168.64	2,863,507.20
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	167,090	90.61	15,140,024.90
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	134.84	1,469,756.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	324,680	35.39	11,490,425.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	108.33	3,648,012.75
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	29,500	131.35	3,874,825.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	117,540	164.99	19,392,924.60
	GRUMA S.A.B.-B	14,210	263.20	3,740,072.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	92,400	46.55	4,301,220.00
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	28.78	1,030,324.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	34.20	3,166,920.00
	GRUPO FIN SANTANDER-B	93,000	30.37	2,824,410.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	168,700	98.71	16,652,377.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	150,500	29.25	4,402,125.00
	GENTERA SAB DE CV	77,100	29.47	2,272,137.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,085,540	13.58	28,321,633.20
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	91.14	3,435,978.00
	メキシコペソ 小計	5,121,812		185,947,772.57 (976,225,805)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	5,400	39.58	213,732.00

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	189,200	17.93	3,392,356.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	265,640	15.77	4,189,142.80
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	23,700	66.15	1,567,755.00
BRASKEM SA-PREF A	8,900	34.65	308,385.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	11.72	384,416.00
DURATEX SA	21,672	7.16	155,171.52
FIBRIA CELULOSE SA	13,900	32.96	458,144.00
GERDAU SA-PREF	50,000	12.10	605,000.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	14.07	260,295.00
VALE SA	86,700	31.47	2,728,449.00
VALE SA-PREF A	127,415	28.69	3,655,536.35
EMBRAER SA	41,400	17.65	730,710.00
WEG SA	27,440	15.36	421,478.40
CCR SA	61,900	15.48	958,212.00
LOCALIZA RENT A CAR	10,890	37.00	402,930.00
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	47,800	6.90	329,820.00
KROTON EDUCATIONAL SA	97,284	14.05	1,366,840.20
LOJAS AMERICANAS SA	10,800	13.65	147,420.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	38,216	17.66	674,894.56
LOJAS RENNER S.A.	42,700	23.65	1,009,855.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	56.58	611,064.00
RAIA DROGASIL SA	17,000	63.82	1,084,940.00
AMBEV SA	299,300	17.30	5,177,890.00
BRF SA	38,800	45.28	1,756,864.00
JBS SA	44,400	12.00	532,800.00
M DIAS BRANCO SA	2,100	128.62	270,102.00
NATURA COSMETICOS SA	10,700	24.51	262,257.00
ODONTOPREV S.A.	12,400	11.41	141,484.00
QUALICORP SA	20,800	19.49	405,392.00
HYPERMARCAS SA	21,600	26.25	567,000.00
BANCO BRADESCO S.A.	53,108	31.40	1,667,591.20
BANCO BRADESCO SA-PREF	176,228	31.67	5,581,140.76
BANCO DO BRASIL S.A.	52,000	28.71	1,492,920.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	212,821	36.49	7,765,838.29
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	235,959	9.03	2,130,709.77
BM&FBOVESPA SA	118,600	17.85	2,117,010.00
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,405	46.40	529,192.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,000	27.18	1,223,100.00
PORTO SEGURO SA	7,300	25.84	188,632.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	49,620	13.37	663,419.40
MULTIPLAN EMPREENDIMENTO-RTS	298	6.85	2,041.30
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	62.63	344,465.00

	CIELO SA	69,308	25.21	1,747,254.68	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	45.39	1,443,402.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	8.80	641,520.00	
	AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	14,552	14.41	209,694.32	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	24.96	441,792.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	21.63	270,375.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	8.63	569,510.96	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	31.12	102,696.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	31.75	828,675.00	
	CPFL ENERGIA SA	16,044	25.26	405,271.44	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	13.65	363,090.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	35.80	479,720.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,800	55.49	710,272.00	
	ブラジルリアル 小計	3,050,992		66,689,668.95 (2,397,493,598)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	32,412	6,743.50	218,570,322.00	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	1,394.60	117,536,888.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	21,395.00	155,327,700.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	6,106.80	135,003,027.60	
	S.A.C.I. FALABELLA	39,263	5,262.80	206,633,316.40	
	CENCOSUD SA	94,716	1,884.40	178,482,830.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	7,248.20	67,574,968.60	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,540.40	38,644,564.80	
	BANCO DE CHILE	1,139,593	78.41	89,355,487.13	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,476	34,420.00	85,223,920.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,238,261	36.24	153,594,578.64	
	ITAU CORPBANCA	5,388,760	5.55	29,934,561.80	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	7,764	7,224.10	56,087,912.40	
	AES GENER SA	141,749	225.69	31,991,331.81	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	360.80	58,899,878.40	
	COLBUN SA	475,888	130.91	62,298,498.08	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	115.80	250,426,879.80	
	ENEL CHILE SA	1,030,498	66.38	68,404,457.24	
	ENEL GENERACION CHILE SA	216,099	443.29	95,794,525.71	
	チリペソ 小計	15,271,490		2,099,785,648.81 (365,992,638)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	1,395.00	498,471,165.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	11,900.00	380,930,900.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	19,440.00	344,535,120.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	24,176	27,660.00	668,708,160.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,200.00	364,449,600.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	3,259	35,800.00	116,672,200.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	38,500.00	560,252,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	4,705	37,680.00	177,284,400.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	22,489	10,140.00	228,038,460.00
	コロンビアペソ 小計	779,950		3,339,342,005.00 (130,568,272)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	22.20	96,747.60
	OPAP SA	17,668	8.46	149,471.28
	FF GROUP	3,404	18.05	61,442.20
	JUMBO SA	8,599	14.68	126,233.32
	ALPHA BANK AE	94,467	1.84	173,819.28
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.62	93,558.18
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.24	96,366.00
	PIRAEUS BANK S.A	372,029	0.19	73,661.74
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,621	8.80	93,464.80
	ユーロ 小計	1,061,649		964,764.40 (118,405,534)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	7,408	76.90	569,675.20
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	5.52	644,487.60
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	4.06	194,932.78
	KOC HOLDING AS	38,796	14.31	555,170.76
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,331	3.94	154,964.14
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	15.33	150,785.88
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	5.15	320,283.65
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	32.30	105,233.40
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	24.66	166,455.00
	ARCELIK AS	15,358	21.74	333,882.92
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	53.10	827,138.70
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	21.32	239,423.60
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	37.66	166,344.22
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	16.50	158,829.00
	AKBANK T.A.S.	122,650	7.78	954,217.00
	TURKIYE GARANTI BANKASI	166,475	7.80	1,298,505.00
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	10.63	557,341.53
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	5.57	619,211.33
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	4.58	237,898.94
	YAPI VE KREDI BANKASI	16,880	3.48	58,742.40
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	9.45	580,664.70
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	5.51	98,055.96
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	56,101	10.60	594,670.60
	トルコリラ 小計	1,045,437		9,586,914.31 (288,470,251)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,530	885.00	4,009,050.00

	MONETA MONEY BANK AS	26,717	80.50	2,150,718.50	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	268.50	1,208,250.00	
	CEZ AS	13,737	428.40	5,884,930.80	
	チェココルナ 小計	49,484		13,252,949.30 (60,168,389)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	20,775.00	47,616,300.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	6,251.00	52,877,209.00	
	OTP BANK NYRT	16,123	8,799.00	141,866,277.00	
	ハンガリーフォリント 小計	26,874		242,359,786.00 (96,289,542)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	38.58	212,807.28	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	21,535	86.50	1,862,777.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	5.43	795,478.71	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	70.84	197,360.24	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	68.95	287,590.45	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8,323	112.70	938,002.10	
	SYNTHOS SA	33,750	5.47	184,612.50	
	CCC SA	1,281	214.00	274,134.00	
	LPP SA	67	5,425.70	363,521.90	
	CYFROWY POLSAT SA	9,012	24.40	219,892.80	
	EUROCASH SA	5,057	39.37	199,094.09	
	ALIOR BANK SA	8,830	59.10	521,853.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	75.62	151,996.20	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	5.60	184,895.20	
	BANK PEKAO SA	10,614	128.30	1,361,776.20	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	332.00	796,136.00	
	M BANK SA	747	351.95	262,906.65	
	PKO BANK POLSKI SA	49,981	30.00	1,499,430.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	40,673	34.33	1,396,304.09	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.40	300,553.20	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.04	637,499.84		
TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	2.76	157,411.08		
	ポーランドズロチ 小計	562,452		12,806,033.03 (359,337,286)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	51,000	3.84	195,840.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	7.75	806,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,611,400	6.08	9,797,312.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	210,000	15.86	3,330,600.00	
	CNOOC LTD-R	1,181,000	10.00	11,810,000.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	6.14	1,584,120.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,330,000	6.24	8,299,200.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	5.65	632,800.00	



ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.57	1,213,800.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	76,500	24.00	1,836,000.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	126,000	4.05	510,300.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	12.10	1,004,300.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	7.60	767,600.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	4.87	969,130.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	379,000	2.64	1,000,560.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.76	714,240.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	38.90	1,517,100.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	9.34	2,914,080.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85,500	14.00	1,197,000.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	10.54	1,154,130.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.66	1,998,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	100,000	12.88	1,288,000.00
CITIC LTD	288,000	11.46	3,300,480.00
CRRC CORP LTD-H	313,050	7.32	2,291,526.00
FOSUN INTERNATIONAL	185,000	11.80	2,183,000.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	16.12	564,200.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.63	609,840.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	21.75	826,500.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	6.13	416,840.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	54,400	13.52	735,488.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	39,500	42.40	1,674,800.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	147,000	9.45	1,389,150.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	5.42	639,560.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	7.35	793,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	91,513	20.65	1,889,743.45
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.42	777,920.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	7.75	790,500.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.04	682,720.00
SINOTRANS LIMITED-H	91,000	3.36	305,760.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.90	695,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	172,000	11.20	1,926,400.00
BYD CO LTD-H	49,500	43.15	2,135,925.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE-B	47,600	10.68	508,368.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	166,000	8.33	1,382,780.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	23.65	643,280.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	335,000	9.11	3,051,850.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	8.13	1,656,487.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	122,246	10.92	1,334,926.32
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,000	23.95	1,700,450.00
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	401,000	4.83	1,936,830.00

HAIER ELECTRONICS GROUP CO	70,000	13.80	966,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	51.45	1,646,400.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	1.27	990,600.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	593,958	1.03	611,776.74
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	7.65	1,491,750.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	2.86	1,244,100.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	197,000	14.24	2,805,280.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	86,000	14.52	1,248,720.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	8.54	1,041,880.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	29.30	586,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	5.04	1,658,160.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	49,000	60.60	2,969,400.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	224,000	3.69	826,560.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	5.28	570,240.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	20.25	870,750.00
SINOPHARM GROUP CO-H	69,600	35.70	2,484,720.00
3SBIO INC	84,500	7.62	643,890.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	12.86	1,286,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	298,000	8.37	2,494,260.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	25.00	650,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	243,000	5.95	1,445,850.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,591,000	3.27	5,202,570.00
BANK OF CHINA LTD-H	5,198,200	3.55	18,453,610.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	609,475	5.75	3,504,481.25
CHINA CITIC BANK-H	627,200	5.17	3,242,624.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,444,620	5.85	31,851,027.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.76	838,480.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	246,923	19.10	4,716,229.30
CHINA MINSHENG BANKING-H	342,000	8.49	2,903,580.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	4.67	649,130.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	4,795,515	4.78	22,922,561.70
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	506,000	2.75	1,391,500.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	14.66	908,920.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	167,000	7.18	1,199,060.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	201,000	3.01	605,010.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	141,500	16.00	2,264,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	6.90	972,900.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	16.82	1,776,192.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	203,600	14.12	2,874,832.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	15.14	1,595,756.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	470,000	21.70	10,199,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	176,800	27.85	4,923,880.00

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	101,824	16.58	1,688,241.92
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	48,800	38.15	1,861,720.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	355,000	3.05	1,082,750.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	322,859	11.70	3,777,450.30
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	347,000	40.65	14,105,550.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	295,000	5.30	1,563,500.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	2.25	495,000.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	249,040	22.75	5,665,660.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	171,111	18.88	3,230,575.68
CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	19.74	1,480,500.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	421,285	4.40	1,853,654.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	460,000	3.42	1,573,200.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	9.75	670,800.00
LONGFOR PROPERTIES	73,000	10.94	798,620.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	10.34	677,270.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	3.46	649,064.86
SOHO CHINA LTD	113,000	3.91	441,830.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	88,000	6.56	577,280.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	16.28	1,074,480.00
TENCENT HOLDINGS LTD	369,300	199.50	73,675,350.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	17.08	905,240.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	51,000	76.75	3,914,250.00
LENOVO GROUP LTD	424,000	5.13	2,175,120.00
SUNNY OPTICAL TECH	46,000	41.10	1,890,600.00
ZTE CORP-H	48,508	12.32	597,618.56
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	5.51	716,300.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	399,500	86.35	34,496,825.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	824,000	3.71	3,057,040.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	372,000	8.87	3,299,640.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	226,000	5.50	1,243,000.00
CGN POWER CO LTD-H	669,000	2.19	1,465,110.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	11.32	1,539,520.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	6.65	1,682,450.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	208,000	2.83	588,640.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	52,000	24.95	1,297,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	113,400	13.68	1,551,312.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	38.15	2,136,400.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	152,000	10.86	1,650,720.00
HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	5.11	1,318,380.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.50	765,000.00
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	0.98	1,014,300.00
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00

	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	148,000	10.92	1,616,160.00	
	香港ドル 小計	47,316,068		428,891,338.58 (6,364,747,464)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,800	23.40	88,920.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	282,600	1.70	480,420.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	7.08	184,788.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	138,800	7.19	997,972.00	
	DIALOG GROUP BHD	222,968	1.55	345,600.40	
	GAMUDA BHD	139,200	4.92	684,864.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.95	341,890.00	
	IJM CORP BHD	198,100	3.38	669,578.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	8.54	1,428,280.84	
	AIRASIA BHD	64,800	2.58	167,184.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	6.25	334,962.50	
	MISC BHD	56,540	7.37	416,699.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.21	294,700.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	4.62	157,080.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	31,541	2.98	93,992.18	
	GENTING BHD	148,900	8.35	1,243,315.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	4.83	1,082,403.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.74	324,690.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	44.78	488,102.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.73	138,919.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	11.00	154,000.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.49	806,583.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	28,600	24.22	692,692.00	
	PPB GROUP BERHAD	43,900	16.10	706,790.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	4.56	164,160.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.30	1,444,590.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	3.81	268,986.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.45	579,390.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	180,506	4.82	870,038.92	
	HONG LEONG BANK BERHAD	26,192	13.32	348,877.44	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	14.90	222,501.70	
	MALAYAN BANKING BHD	192,475	8.25	1,587,918.75	
PUBLIC BANK BERHAD	169,920	20.10	3,415,392.00		
RHB BANK BHD	53,119	4.92	261,345.48		
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	123,060	2.15	264,579.00		
AXIATA GROUP BERHAD	153,920	4.64	714,188.80		
DIGI.COM BERHAD	196,300	4.91	963,833.00		
MAXIS BHD	135,500	6.00	813,000.00		
TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.00	423,312.00		

	PETRONAS GAS BHD	44,600	20.16	899,136.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	219,775	13.88	3,050,477.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	247,417	1.53	378,548.01	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.43	174,924.75	
	マレーシアリングット 小計	4,793,023		29,169,625.17 (754,909,899)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	19.30	2,287,050.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	28.50	1,957,950.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	5.15	2,949,920.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	78,600	94.25	7,408,050.00	
	PTT PCL-NVDR	66,400	385.00	25,564,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	70.00	3,360,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	34.75	3,541,025.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,734	65.50	9,742,077.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	4,900	496.00	2,430,400.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	498.00	9,312,600.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	48.25	3,271,350.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	30,500	394.00	12,017,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	7.35	2,875,320.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.45	3,105,375.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	34.25	5,541,992.50	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	18.00	1,009,800.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	10.10	2,339,513.50	
	ROBINSON DEPT STORE-NVDR	34,800	59.00	2,053,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	296,500	59.25	17,567,625.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	155,700	28.50	4,437,450.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	77,600	20.90	1,621,840.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	188,900	22.50	4,250,250.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	180.00	4,608,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	171.00	2,770,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	68,600	182.50	12,519,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	182.00	9,391,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	18.40	4,549,400.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	118,600	155.00	18,383,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.26	3,020,490.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	74,800	55.50	4,151,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	84.75	2,737,425.00	
KCE ELECTRONICS - NVDR	24,700	116.50	2,877,550.00		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	70,900	155.00	10,989,500.00		
TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	6.90	4,193,192.10		
GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	79.50	2,353,200.00		
		5,991,638		211,187,845.10	

タイパーツ 小計				(688,472,375)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	74.80	8,578,812.00
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	12.88	1,791,608.00
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	13.10	4,525,395.00
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	167,940	75.50	12,679,470.00
	SM INVESTMENTS CORP	13,285	680.00	9,033,800.00
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	73.95	4,676,598.00
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	205.00	5,217,250.00
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	173.00	10,964,740.00
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	89.95	4,715,179.00
	BDO UNIBANK INC	114,901	110.80	12,731,030.80
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	77.00	3,168,704.00
	SECURITY BANK CORP	160	213.00	34,080.00
	AYALA CORPORATION	15,430	800.00	12,344,000.00
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,340.00	8,220,900.00
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	6.88	5,061,616.00
	AYALA LAND INC	445,100	34.90	15,533,990.00
	MEGAWORLD CORP	638,000	3.69	2,354,220.00
	ROBINSONS LAND CO	93,000	25.55	2,376,150.00
	SM PRIME HOLDINGS INC	590,250	30.40	17,943,600.00
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,688.00	3,021,520.00
PLDT INC	6,225	1,505.00	9,368,625.00	
ABOITIZ POWER CORP	89,500	44.05	3,942,475.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	5.46	3,310,398.00	
フィリピンペソ 小計		4,368,598		161,594,160.80 (371,666,569)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,730.00	1,384,865,000.00
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	21,775.00	2,806,797,500.00
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	105,300	14,925.00	1,571,602,500.00
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	8,725.00	2,046,885,000.00
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	6,400.00	897,280,000.00
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	2,670.00	1,047,708,000.00
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	4,250.00	524,875,000.00
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,259,100	8,150.00	10,261,665,000.00
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	630,500	1,690.00	1,065,545,000.00
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	2,680.00	1,428,440,000.00
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	14,900.00	2,763,950,000.00
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,230.00	1,395,683,000.00
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	63,400.00	1,952,720,000.00
	HM SAMPOERNA TBK PT	501,900	3,870.00	1,942,353,000.00
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,600.00	1,384,600,000.00
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	248,900	8,025.00	1,997,422,500.00

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	90,200	40,400.00	3,644,080,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,500.00	1,880,100,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	15,375.00	12,779,700,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	4,180.00	821,370,000.00	
	BANK MANDIRI	558,898	11,050.00	6,175,822,900.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	471,600	5,450.00	2,570,220,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	732,500	12,000.00	8,790,000,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,870.00	1,277,958,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	755.00	915,815,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	600.00	966,240,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	453,200	1,400.00	634,480,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,164,200	3,970.00	12,561,874,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	5,075.00	677,005,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	2,650.00	457,125,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,720.00	2,152,880,000.00	
	インドネシアルピア 小計	18,264,098		90,777,061,400.00 (789,760,434)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	53,200.00	224,876,400.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	84,500.00	287,384,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	4,435	162,500.00	720,687,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,389	27,250.00	174,100,250.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	145,000.00	204,305,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,404	62,000.00	273,048,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	484	515,000.00	249,260,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	86,900.00	91,331,900.00	
	LG CHEM LTD	2,847	270,500.00	770,113,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	181,500.00	86,938,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	383,500.00	425,685,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	90,300.00	101,768,100.00	
	POSCO	4,842	278,000.00	1,346,076,000.00	
	CJ CORP	1,230	190,000.00	233,700,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	84,300.00	132,435,300.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,340.00	44,161,800.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	28,600.00	95,581,200.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	26,400.00	89,707,200.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	36,650.00	103,536,250.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	44,600.00	168,454,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	3,917	40,000.00	156,680,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,694	140,000.00	377,160,000.00	
	KCC CORP	326	346,500.00	112,959,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	66,900.00	346,274,400.00	
	LG CORP	7,072	59,600.00	421,491,200.00	

POSCO DAEWOO CORP	1,560	27,000.00	42,120,000.00
SAMSUNG C&T CORP	5,328	124,000.00	660,672,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,041	10,350.00	124,624,350.00
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,160	44,100.00	95,256,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,880	218,000.00	627,840,000.00
SK NETWORKS CO LTD	2,484	6,630.00	16,468,920.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	56,300.00	52,978,300.00
S-1 CORPORATION	960	87,600.00	84,096,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	165,000.00	240,075,000.00
KOREA EXPRESS CO LTD	324	169,500.00	54,918,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,921	27,900.00	53,595,900.00
HANKOOK TIRE CO LTD	4,770	60,300.00	287,631,000.00
HANON SYSTEMS	10,825	9,930.00	107,492,250.00
HYUNDAI MOBIS	4,313	277,000.00	1,194,701,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	10,030	152,000.00	1,524,560,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	103,500.00	299,322,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,250	99,500.00	124,375,000.00
HYUNDAI WIA CORP	1,737	77,900.00	135,312,300.00
KIA MOTORS CORPORATION	16,538	40,800.00	674,750,400.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	86,200.00	343,248,400.00
HANSSEM CO LTD	615	213,000.00	130,995,000.00
LG ELECTRONICS INC	6,703	54,500.00	365,313,500.00
KANGWON LAND INC	8,683	34,200.00	296,958,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	16,850.00	85,429,500.00
CJ E&M CORP	2,024	87,200.00	176,492,800.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	46,150.00	99,314,800.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	99,400.00	121,466,800.00
LOTTE SHOPPING CO	710	216,500.00	153,715,000.00
SHINSEGAE CO LTD	417	174,000.00	72,558,000.00
BGF RETAIL CO LTD	1,576	90,300.00	142,312,800.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	26,650.00	40,534,650.00
EMART	1,193	193,500.00	230,845,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	48,750.00	63,911,250.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	354,000.00	178,062,000.00
KT&G CORP	7,242	101,000.00	731,442,000.00
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	31	1,411,000.00	43,741,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	450	177,500.00	79,875,000.00
ORION CORP	303	626,000.00	189,678,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	652,000.00	44,336,000.00
AMOREPACIFIC CORP	1,979	311,000.00	615,469,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	185,500.00	131,705,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	610	876,000.00	534,360,000.00



LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	534,000.00	72,090,000.00	
PACIFIC CORP	2,115	135,500.00	286,582,500.00	
CELLTRION INC	5,440	100,500.00	546,720,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	342	293,000.00	100,206,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	565	57,800.00	32,657,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,050	152,500.00	160,125,000.00	
YUHAN CORPORATION	572	199,500.00	114,114,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,211	8,840.00	107,945,240.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,980.00	122,514,480.00	
HANA FINANCIAL GROUP	19,070	33,250.00	634,077,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	12,850.00	231,891,100.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	24,874	45,550.00	1,133,010,700.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	26,764	46,500.00	1,244,526,000.00	
WOORI BANK	20,802	13,000.00	270,426,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	46,400.00	104,632,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	19,387	8,710.00	168,860,770.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	11,200.00	126,537,600.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	39,150.00	74,345,850.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,091	32,750.00	166,730,250.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,614	61,200.00	159,976,800.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	6,650.00	81,263,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	31,300.00	135,153,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,049	270,000.00	553,230,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,343	115,000.00	499,445,000.00	
KAKAO CORP	1,728	82,300.00	142,214,400.00	
NAVER CORP	1,788	801,000.00	1,432,188,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,174	300,000.00	352,200,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,320	135,000.00	313,200,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	15,287	31,250.00	477,718,750.00	
LG INNOTEK CO LTD	857	88,000.00	75,416,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	52,200.00	238,345,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,463	1,874,000.00	12,111,662,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,111	1,484,000.00	1,648,724,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,866	105,500.00	407,863,000.00	
KT CORP	3,800	29,050.00	110,390,000.00	
LG UPLUS CORP	12,570	11,400.00	143,298,000.00	
SK TELECOM	1,647	224,000.00	368,928,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,000	43,350.00	693,600,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,432	47,200.00	67,590,400.00	
SK HYNIX INC	36,626	49,600.00	1,816,649,600.00	
韓国ウォン 小計	534,258		46,037,315,760.00 (4,511,656,944)	

新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	68,240	104.00	7,096,960.00
	ASIA CEMENT CORP	132,176	26.30	3,476,228.80
	CHINA STEEL	765,261	25.10	19,208,051.10
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	203,061	94.70	19,229,876.70
	FORMOSA PLASTICS CORP	277,824	88.00	24,448,512.00
	NAN YA PLASTICS CORP	309,752	72.40	22,426,044.80
	TAIWAN CEMENT	192,929	34.65	6,684,989.85
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	40.35	1,371,900.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	189,028	25.25	4,772,957.00
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,764	155.00	1,978,420.00
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	27.85	3,091,350.00
	CHINA AIRLINES LTD	33,203	9.33	309,783.99
	EVA AIRWAYS CORP	139,739	14.95	2,089,098.05
	EVERGREEN MARINE	107,563	12.90	1,387,562.70
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	122,061	62.50	7,628,812.50
	YULON MOTOR COMPANY	51,000	27.15	1,384,650.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,703	327.00	3,826,881.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	137.50	4,525,950.00
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	30.05	1,202,000.00
	GIANT MANUFACTURING	25,464	187.00	4,761,768.00
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	166.00	1,917,300.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	291.00	2,037,000.00
	POU CHEN	153,780	39.35	6,051,243.00
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	56.80	2,092,909.60
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	14,000	360.00	5,040,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	229.50	10,452,348.00
	STANDARD FOODS CORP	34,381	75.90	2,609,517.90
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	301,395	54.60	16,456,167.00
	OBI PHARMA INC	6,000	276.00	1,656,000.00
	TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	161.50	2,099,500.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	377,496	17.30	6,530,680.80
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	827,780	7.94	6,572,573.20
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,199,237	17.55	21,046,609.35
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	591,492	18.30	10,824,303.60
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	702,926	17.30	12,160,619.80	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	453,564	16.30	7,393,093.20	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	750,339	23.40	17,557,932.60	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	624,851	9.08	5,673,647.08	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	538,707	11.80	6,356,742.60	
TAIWAN BUSINESS BANK	186,370	8.13	1,515,188.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	429,313	14.15	6,074,778.95	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	64,429	55.30	3,562,923.70	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	469,082	50.20	23,547,916.40
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	12.35	9,536,089.55
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	541,951	46.85	25,390,404.35
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	222,966	30.10	6,711,276.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	8.02	4,938,483.42
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	46.30	1,950,156.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,445	37.30	1,732,398.50
ACER INC	255,803	14.20	3,632,402.60
ADVANTECH CO LTD	18,548	264.00	4,896,672.00
ASUSTEK COMPUTER INC	40,092	271.00	10,864,932.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	12.85	7,582,656.50
CASETEK HOLDINGS LTD	9,000	89.30	803,700.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	41,700	232.50	9,695,250.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,507	72.90	2,078,160.30
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	552,000	13.15	7,258,800.00
COMPAL ELECTRONICS	241,760	18.90	4,569,264.00
DELTA ELECTRONICS INC	125,903	168.50	21,214,655.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	46,850	85.90	4,024,415.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,017,311	83.50	84,945,468.50
HTC CORPORATION	37,430	80.40	3,009,372.00
INVENTEC CO LTD	136,511	23.75	3,242,136.25
LARGAN PRECISION CO LTD	7,040	4,295.00	30,236,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	47.80	7,191,605.60
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	31,000	75.50	2,340,500.00
PEGATRON CORP	122,474	74.50	9,124,313.00
QUANTA COMPUTER INC	196,270	64.00	12,561,280.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	32.30	2,522,630.00
TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	85.20	804,714.00
WISTRON CORP	121,991	26.30	3,208,363.30
WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	37.30	3,028,275.10
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	65.90	1,444,659.80
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	10.25	2,029,500.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	244,315	101.00	24,675,815.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	95,000	74.10	7,039,500.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	110,200	105.50	11,626,100.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	412,739	34.05	14,053,762.95
MEDIATEK INC	93,804	213.00	19,980,252.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	48.20	2,313,600.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	108.50	4,344,882.50
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	250.00	2,899,750.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	83.10	3,969,687.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	108.50	3,031,924.00

	SILICONWARE PRECISION INDS	99,000	47.70	4,722,300.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,593,389	180.50	287,606,714.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	727,000	11.60	8,433,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	55.80	3,013,200.00	
	新台湾ドル 小計	20,704,364		1,010,410,813.19	(3,677,895,360)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	32,889	673.90	22,163,897.10	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	270.40	5,989,360.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	307.35	12,885,341.40	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	26,300	495.05	13,019,815.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	200.85	20,650,191.90	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	85,812	1,033.70	88,703,864.40	
	ACC LTD	1,768	1,361.05	2,406,336.40	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	220.35	8,193,714.75	
	ASIAN PAINTS LTD	18,180	962.70	17,501,886.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	176.10	13,915,598.10	
	JSW STEEL LTD	42,740	192.65	8,233,861.00	
	SHREE CEMENT LTD	383	15,647.90	5,993,145.70	
	TATA STEEL LTD	25,839	467.15	12,070,688.85	
	ULTRATECH CEMENT LTD	5,485	3,461.45	18,986,053.25	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	739.60	19,390,832.80	
	VEDANTA LTD	72,716	245.25	17,833,599.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	87.05	5,499,035.55	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,997	132.40	4,501,202.80	
	EICHER MOTORS LTD	939	22,822.05	21,429,904.95	
	HAVELLS INDIA LTD	10,541	387.75	4,087,272.75	
	LARSEN & TOUBRO LTD	20,632	1,449.45	29,905,052.40	
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,182.00	6,333,156.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	295.35	18,467,054.10	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,670	1,180.30	3,151,401.00	
	BAJAJ AUTO LTD	5,458	2,695.30	14,710,947.40	
	BHARAT FORGE LTD	6,696	943.45	6,317,341.20	
	BOSCH LTD	431	21,245.00	9,156,595.00	
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,102.35	10,079,535.15	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	25,703	1,210.80	31,121,192.40	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,984	5,718.35	39,936,956.40	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	34,150	325.65	11,120,947.50	
	TATA MOTORS LTD	99,021	531.45	52,624,710.45	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	34,784	337.45	11,737,860.80		
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	372.70	10,368,141.30		
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	32,407	477.55	15,475,962.85		
ITC LTD	211,077	254.15	53,645,219.55		

NESTLE INDIA LIMITED	1,289	5,911.45	7,619,859.05	
UNITED SPIRITS LTD	3,561	2,044.80	7,281,532.80	
DABUR INDIA LTD	30,963	276.90	8,573,654.70	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	9,312	1,569.40	14,614,252.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	39,891	860.30	34,318,227.30	
MARICO LTD	42,465	257.95	10,953,846.75	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	1,179.85	4,889,298.40	
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	714.65	14,533,122.40	
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	361.95	3,802,646.70	
CIPLA LTD	19,420	580.35	11,270,397.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,388	732.20	3,945,093.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,940.25	22,936,890.25	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,123	891.05	5,455,899.15	
LUPIN LTD	16,340	1,479.15	24,169,311.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,422	1,836.55	11,794,324.10	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	67,358	643.45	43,341,505.10	
AXIS BANK LTD	109,357	483.80	52,906,916.60	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	99,064	1,242.40	123,077,113.60	
ICICI BANK LTD	76,629	269.70	20,666,841.30	
IDFC BANK LTD	75,550	64.75	4,891,862.50	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	20,091	753.50	15,138,568.50	
LIC HOUSING FINANCE LTD	14,687	525.95	7,724,627.65	
STATE BANK OF INDIA	104,739	258.40	27,064,557.60	
YES BANK LTD	19,132	1,347.50	25,780,370.00	
BAJAJ FINANCE LTD	11,190	926.30	10,365,297.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	293.30	4,756,739.40	
POWER FINANCE CORPORATION	37,247	132.70	4,942,676.90	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	942.95	11,444,584.15	
BAJAJ FINSERV LTD	2,289	3,154.75	7,221,222.75	
HCL TECHNOLOGIES LTD	35,152	844.15	29,673,560.80	
INFOSYS LTD	121,050	958.10	115,978,005.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	29,461	2,291.00	67,495,151.00	
TECH MAHINDRA LTD	16,432	481.40	7,910,364.80	
WIPRO LTD	44,517	479.00	21,323,643.00	
BHARTI AIRTEL LTD	61,122	317.10	19,381,786.20	
BHARTI INFRATEL LTD	36,202	358.25	12,969,366.50	
IDEA CELLULAR LTD	59,982	69.35	4,159,751.70	
GAIL INDIA LTD	13,992	461.65	6,459,406.80	
NTPC LTD	97,417	174.15	16,965,170.55	
TATA POWER CO LTD	93,250	79.30	7,394,725.00	
インドルピー 小計	2,807,263		1,502,799,845.60 (2,554,759,737)	

カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	24.50	557,130.00	
	INDUSTRIES QATAR	9,924	120.00	1,190,880.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	7,576	32.25	244,326.00	
	DOHA BANK QSC	10,258	37.55	385,187.90	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	40.95	1,103,520.60	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	109.60	645,215.20	
	QATAR NATIONAL BANK	13,628	168.00	2,289,504.00	
	QATAR INSURANCE CO	7,974	88.80	708,091.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	35.75	136,779.50	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	16.07	780,182.43	
	OOREDOO QSC	7,280	106.70	776,776.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	243.00	386,613.00	
カタールリアル 小計		166,181		9,204,205.83	(291,681,282)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,692	98.00	459,816.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	308.98	986,264.16	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,367	164.38	4,662,967.46	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	46.30	2,990,100.30	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,653	49.05	2,827,879.65	
	MONDI LTD	9,893	294.99	2,918,336.07	
	SAPPI LIMITED	32,518	86.15	2,801,425.70	
	SASOL LTD	34,912	420.01	14,663,389.12	
	SIBANYE GOLD LTD	66,418	27.05	1,796,606.90	
	BIDVEST GROUP LTD	19,573	170.05	3,328,388.65	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	187,609	72.32	13,567,882.88	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	25,358	27.13	687,962.54	
	NASPERS LTD-N SHS	28,435	2,175.00	61,846,125.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	174.00	2,164,560.00	
	MR PRICE GROUP LTD	13,172	153.00	2,015,316.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	11,511	163.90	1,886,652.90	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	24,553	82.17	2,017,520.01	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	57,272	72.43	4,148,210.96	
	BID CORP LTD	20,131	242.09	4,873,513.79	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	130.27	1,092,835.03	
	PICK N PAY STORES LTD	18,180	67.20	1,221,696.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,370	179.50	4,553,915.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	197.46	2,885,482.98	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	168.94	1,487,516.70	
	TIGER BRANDS LTD	9,500	403.02	3,828,690.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	78,446	34.55	2,710,309.30	
NETCARE LTD	60,221	32.70	1,969,226.70		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	23,478	301.13	7,069,930.14		

	BARCLAYS AFRICA GROUP	25,675	165.00	4,236,375.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	716.00	2,306,952.00	
	NEDBANK GROUP LTD	14,966	236.28	3,536,166.48	
	STANDARD BANK GROUP LTD	87,709	148.58	13,031,803.22	
	BRAIT SE	20,371	79.20	1,613,383.20	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	67.25	679,494.00	
	FIRSTSTRAND LTD	212,701	51.93	11,045,562.93	
	INVESTEC LTD	12,710	94.99	1,207,322.90	
	PSG GROUP LTD	8,086	221.78	1,793,313.08	
	REMGRO LTD	37,207	221.75	8,250,652.25	
	RMB HOLDINGS LTD	43,247	66.80	2,888,899.60	
	DISCOVERY LIMITED	21,716	115.61	2,510,586.76	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	121.01	753,408.26	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	25.67	1,747,562.26	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	39.60	1,600,156.80	
	SANLAM LTD	89,542	65.00	5,820,230.00	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	36,400	35.14	1,279,096.00	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	49,578	17.65	875,051.70	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	19,495	157.00	3,060,715.00	
	MTN GROUP LTD	105,169	125.40	13,188,192.60	
	TELKOM SA LTD	11,353	74.50	845,798.50	
	VODACOM GROUP	21,700	151.82	3,294,494.00	
	南アフリカランド 小計	1,894,945		243,027,736.48 (2,065,735,760)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	234,432	1.19	278,974.08	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	113,289	7.57	857,597.73	
	DUBAI ISLAMIC BANK	96,441	5.99	577,681.59	
	FIRST GULF BANK	49,802	13.50	672,327.00	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	45,082	10.65	480,123.30	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.67	724,856.94	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.58	463,478.94	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	245,114	7.55	1,850,610.70	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	112,837	18.80	2,121,335.60	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,348,122		8,026,985.88 (252,127,626)	
	合 計	136,850,300		30,406,800,507 (30,406,800,507)	

## (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
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	848,680.00	

投資信託受益証券	ブラジルリアル	KLABIN SA-UNIT	27,700	465,360.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	14,318	264,023.92	
	ブラジルリアル 小計		70,018	1,578,063.92	(56,731,397)
投資信託受益証券合計			70,018	56,731,397	(56,731,397)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	189,100	5,504,701.00	
		メキシコペソ 小計		189,100	5,504,701.00
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	410,958.90	
		トルコリラ 小計		135,630	410,958.90
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	144,115	3,801,753.70	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,789,499.87	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	324,053	3,577,545.12	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	2,760,211.00	
	南アフリカランド 小計		514,189	12,929,009.69	(109,896,582)
	投資証券合計			838,919	151,162,015
合計				207,893,412	(207,893,412)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 36銘柄	100.0%			10.7%
メキシコペソ	株式 26銘柄	97.1%			3.2%
	投資証券 1銘柄			2.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	97.7%			7.8%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.3%		0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%			1.2%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
トルコリラ	株式 23銘柄	95.9%			0.9%
	投資証券 1銘柄			4.1%	0.0%



チェココルナ	株式	4銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%			1.2%
香港ドル	株式	135銘柄	100.0%			20.8%
マレーシアリングギット	株式	43銘柄	100.0%			2.5%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.2%
インドネシアルピア	株式	31銘柄	100.0%			2.6%
韓国ウォン	株式	107銘柄	100.0%			14.7%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%			12.0%
インドルピー	株式	76銘柄	100.0%			8.3%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式	50銘柄	94.9%			6.7%
	投資証券	4銘柄			5.1%	0.4%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## 【純資産額計算書】

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	675,465,404円
負債総額	852,082円
純資産総額（ - ）	674,613,322円
発行済口数	603,122,943口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1185円
（1万口当たり純資産額）	（11,185円）

（参考）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	306,579,466,898円
負債総額	7,065,131,252円
純資産総額（ - ）	299,514,335,646円
発行済口数	216,946,597,436口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3806円
（1万口当たり純資産額）	（13,806円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	156,891,238,929円
負債総額	93,470,103円
純資産総額（ - ）	156,797,768,826円
発行済口数	117,236,226,338口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3375円
（1万口当たり純資産額）	（13,375円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成29年 2月28日現在)

資産総額	215,029,116,906円
負債総額	385,735,542円
純資産総額( - )	214,643,381,364円
発行済口数	82,511,076,731口
1口当たり純資産額( / )	2.6014円
(1万口当たり純資産額)	(26,014円)

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成29年 2月28日現在)

資産総額	301,139,239,999円
負債総額	567,617,193円
純資産総額( - )	300,571,622,806円
発行済口数	140,309,483,002口
1口当たり純資産額( / )	2.1422円
(1万口当たり純資産額)	(21,422円)

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成29年 2月28日現在)

資産総額	23,567,229,413円
負債総額	15,481,197円
純資産総額( - )	23,551,748,216円
発行済口数	14,731,032,859口
1口当たり純資産額( / )	1.5988円
(1万口当たり純資産額)	(15,988円)

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年 2月28日現在）

資産総額	32,195,074,607円
負債総額	74,678,599円
純資産総額（ - ）	32,120,396,008円
発行済口数	13,131,956,042口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4460円
（1万口当たり純資産額）	（24,460円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（平成29年 2月28日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

###### [ DO（実行） ]

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

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

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成29年 4月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年2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	477	9,146,447
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	47	198,678
単位型公社債投資信託	0	0
合計	524	9,345,125

## 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30期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

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



	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975
未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	-	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	65,500	68,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	3,235	1,151
評価・換算差額等合計	3,235	1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）		（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬		28,159,652		32,163,066
運用受託報酬		8,732		-
営業収益合計		28,168,384		32,163,066
営業費用				
支払手数料		12,922,655		14,102,687
広告宣伝費		130,384		126,914
公告費		880		2,765
調査費		5,994,577		6,758,898
調査費		279,702		331,886
委託調査費		5,712,946		6,425,175
図書費		1,928		1,836
営業雑経費		1,299,065		1,399,773
通信費		17,456		17,552
印刷費		330,921		349,902
協会費		23,182		26,659
諸会費		105		105
情報機器関連費		857,009		927,524
その他営業雑経費		70,390		78,029
営業費用合計		20,347,563		22,391,039
一般管理費				
給料		2,185,555		2,123,392
役員報酬		89,055		89,280
給料・手当		1,839,000		1,759,320
賞与		257,499		274,792
退職給付費用		71,270		73,742
福利費		212,286		222,276
交際費		4,491		6,004
旅費交通費		55,788		67,392
租税公課		42,868		73,989
不動産賃借料		130,938		125,339
減価償却費		129,285		126,985
業務委託費	1	45,054	1	209,510
諸経費		167,290		217,580
一般管理費合計		3,044,830		3,246,214
営業利益		4,775,990		6,525,812

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）		（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）	
営業外収益				

受取利息		6,802		8,092
収益分配金		4,617		2,026
投資有価証券売却益		1,846		350
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,936		5,272
営業外収益合計		18,203		18,742
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	2	56,222		-
特別損失合計		56,222		-
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726

当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

### (企業結合に関する会計基準等の適用)

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

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

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

## 未適用の会計基準等

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

### (1) 概要

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

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

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

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

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

## (2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

## (3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

## 表示方法の変更

### (損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

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

### (損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

#### 2外国税関連費用

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

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法



## (1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

(単位:千円)

区分	平成27年3月31日	平成28年3月31日
非上場株式	3	3

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

## (有価証券関係)

## 1. 其他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

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

当事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	"	6,993	"
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	"	30,437	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	"	119,400	"
外国税関連費用損金不算入額	18,609	"	-	"
その他	5,855	"	7,674	"
繰延税金資産 合計	239,908	"	251,436	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,546	"	-	"
投資有価証券売却益益金不算入額	7,217	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	8,763	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	231,144	"	244,602	"

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

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

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

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

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

## （持分法損益等）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

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

## （関連情報）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間末

(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金

18,232,975

未収委託者報酬

5,229,663

繰延税金資産

79,566

その他流動資産		121,642
流動資産合計		23,663,848
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	51,958
器具備品	1	91,200
その他有形固定資産	1	3,289
有形固定資産合計		146,448
無形固定資産		213,226
投資その他の資産		
投資有価証券		64,884
長期貸付金		21,338
会員権		25,000
その他の投資		7,090
繰延税金資産		130,488
貸倒引当金		21,338
投資その他の資産合計		227,463
固定資産合計		587,137
資産合計		24,250,986
負債の部		
流動負債		
未払金		2,832,550
未払費用		127,589
未払法人税等		973,190
賞与引当金		98,952
その他流動負債	2	123,541
流動負債合計		4,155,824
固定負債		
退職給付引当金		412,240
資産除去債務		13,036
その他固定負債		2,561
固定負債合計		427,838
負債合計		4,583,662

(単位：千円)

第31期中間会計期間末  
(平成28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		71,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000

繰越利益剰余金	16,849,604
利益剰余金合計	19,021,104
株主資本合計	19,671,104
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,780
評価・換算差額等合計	3,780
純資産合計	19,667,324
負債・純資産合計	24,250,986

## 中間損益計算書

(単位：千円)

		第31期中間会計期間
		(自 平成28年4月1日
		至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		15,203,419
営業収益合計		15,203,419
営業費用		10,414,275
一般管理費	1	1,675,104
営業利益		3,114,038
営業外収益	2	6,265
営業外費用		4,736
経常利益		3,115,567
税引前中間純利益		3,115,567
法人税、住民税及び事業税		926,810
法人税等調整額		35,707
法人税等合計		962,518
中間純利益		2,153,049

## 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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	
	利益剰余金	その他利益剰余金

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			2,153,049	2,153,049	2,153,049
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	2,120,049	2,123,049	2,123,049
当中間期末残高	71,500	2,100,000	16,849,604	19,021,104	19,671,104

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,153,049
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	2,629	2,629	2,629
当中間期変動額合計	2,629	2,629	2,120,419
当中間期末残高	3,780	3,780	19,667,324

## 重要な会計方針

第31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>    その他有価証券</p> <p>        時価のあるもの</p> <p>            中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。             （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>        時価のないもの</p> <p>            移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産</p> <p>    定率法によっております。</p> <p>    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。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>    定額法によっております。</p> <p>    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。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p>



## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

第31期中間会計期間  
(自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30日)

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

この結果、当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はそれぞれ14千円増加しております。

## 追加情報

第31期中間会計期間  
(自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30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28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間末  
(平成28年9月30日)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	58,267千円
器具備品	281,219千円
その他有形固定資産	1,300千円
計	340,787千円

- 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31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	22,496千円
無形固定資産	41,925千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	3,038千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

## (リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## (金融商品関係)

第31期中間会計期間末(平成28年9月30日)

平成28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	18,232,975	18,232,975	-
(2)未収委託者報酬	5,229,663	5,229,663	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	64,881	64,881	-
(4)未払金	(2,832,550)	(2,832,550)	-
(5)未払法人税等	(973,190)	(973,190)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3)投資有価証券

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

## (4)未払金、並びに(5)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

## (有価証券関係)

第31期中間会計期間末（平成28年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	7,754	7,496	258
小計	7,754	7,496	258
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	57,127	62,834	5,707
小計	57,127	62,834	5,707
合計	64,881	70,330	5,449

(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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

ております。

## 2. 地域ごとの情報

### (1) 営業収益

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

### (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,855,519千円

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

### （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
1株当たり純資産額	6,555,774円71銭
1株当たり中間純利益	717,683円22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31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
中間純利益	2,153,049千円
普通株式に係る中間純利益	2,153,049千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

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

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

平成29年 4月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成28年9月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成28年9月末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
高木証券株式会社	11,069	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成28年9月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から

再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年 4月20日	有価証券届出書
平成28年 4月20日	有価証券報告書
平成28年10月20日	有価証券届出書
平成28年10月20日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成28年 6月 3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。



# 独立監査人の監査報告書

平成29年3月17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

青木裕晃

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の平成28年1月21日から平成29年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の平成29年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年12月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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