

【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30年1月19日提出
【計算期間】	第6期(自 平成29年4月21日至 平成29年10月20日)
【ファンド名】	SMT インデックスバランス・オープン
【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】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ ファン ズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ ショ ー ト 型 / 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセア ニア 中南米 アフリ カ 中近東 (中東)				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不 動産投信)資 産配分固定 型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(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)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

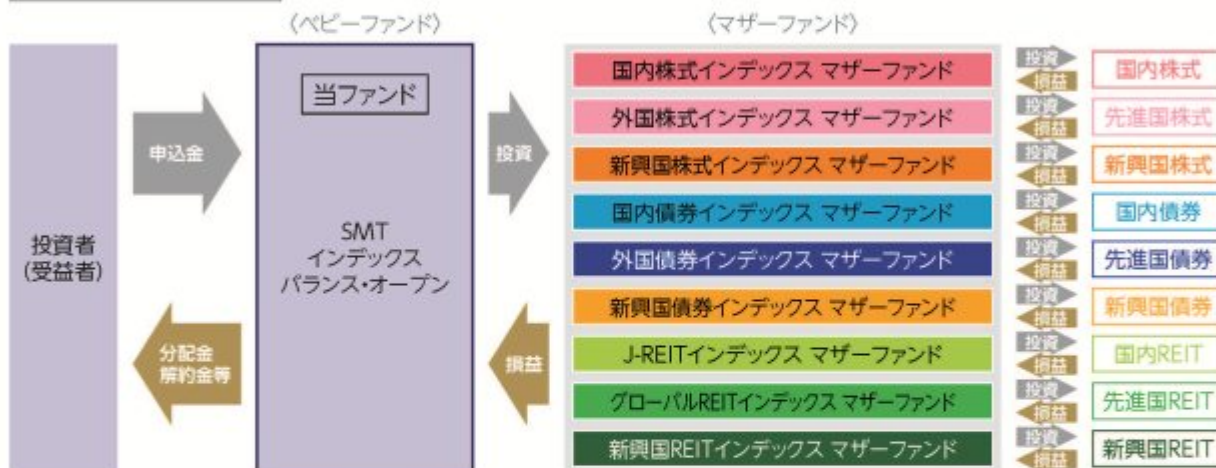
< ファンドの特色 >

特色1

世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

ファンドのしくみ



※各マザーファンド(J-REITインデックス マザーファンドを除く)の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。



ファミリーファンド方式とは

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



DR(預託証券)とは

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。



REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

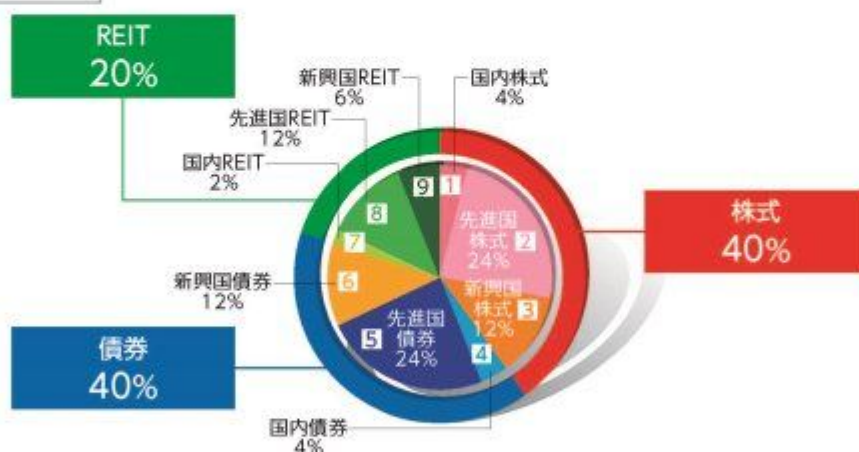
●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2

株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率
(2017年11月末現在)



●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資産配分比率を調整します。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数)
2 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
3 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)
4 国内債券	NOMURA-BPI 総合
5 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)
6 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・ディバースファイド(円換算ベース)
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み)
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)

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

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

詳しくは下記をご覧ください。

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

「MSCI コフサイ・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。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」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。

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

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

「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(円換算ベース)」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。

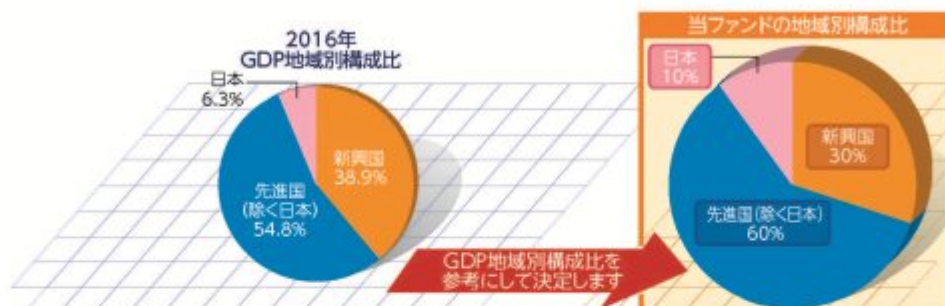
「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

「S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)」とは、SPDJIが公表する指数で、新興国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P新興国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるS&Pの登録商標で、Dow Jones®はDow Jonesの登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

特色3 世界経済全体の発展を享受します。

- 地域別の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
 - 地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



（出所）IMF「世界経済見通し2016年10月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

※当ファンドの地域別構成比は、2017年11月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

分配方針

- 年2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、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 投資信託証券（REIT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。
- 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。

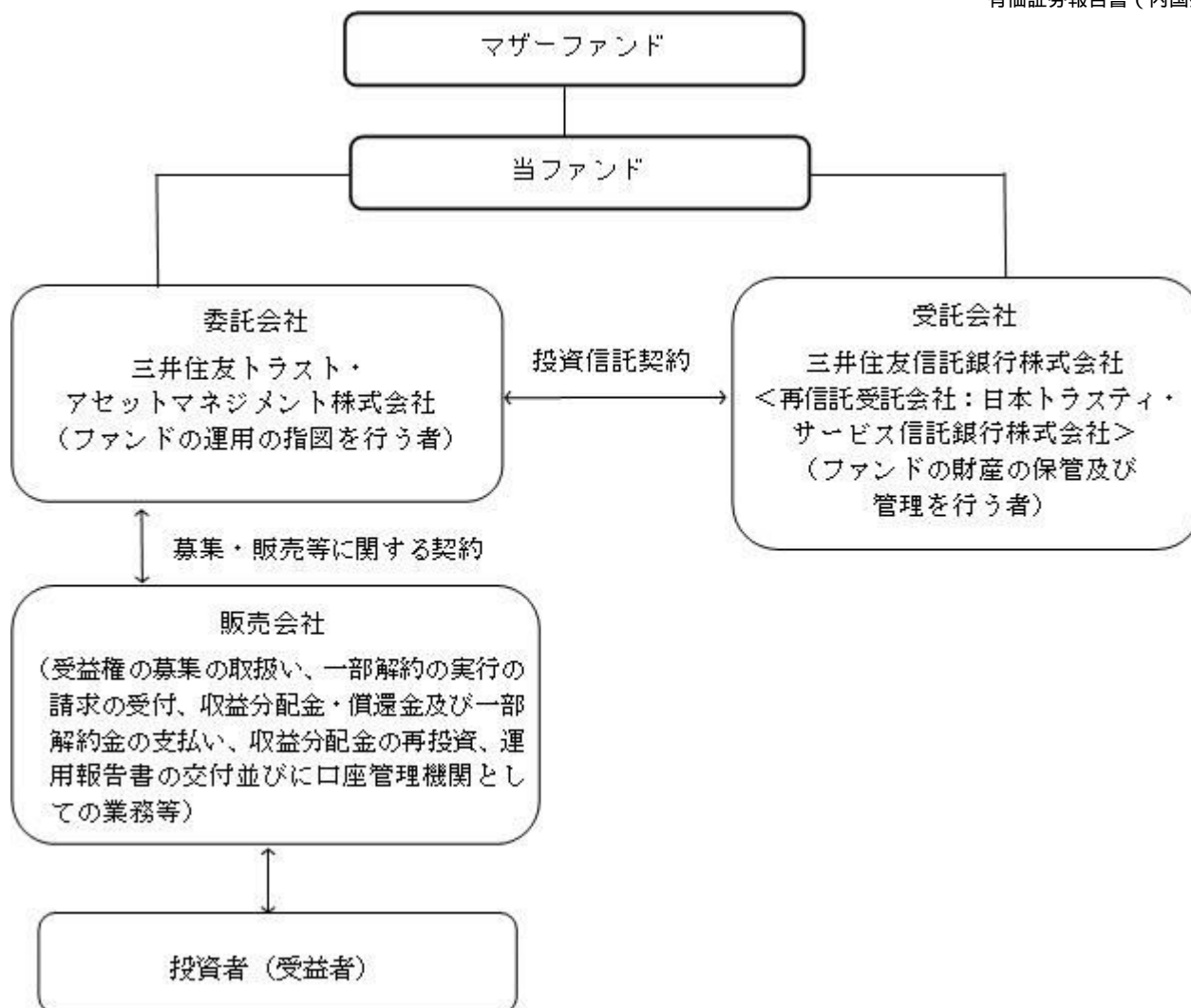
（2）【ファンドの沿革】

平成26年11月28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11月30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、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興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」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「新興国REITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。
- ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%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します。
- ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、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．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ホ．実質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。
- ヘ．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。

（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22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
 - 3. 金銭債権
 - 4. 約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファン

ド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興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」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「新興国REITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 6. 資産の流動化に関する法律に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。)
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関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。)
 9. 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。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))及び新株予約権証券
 12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
 13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 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。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券又は証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
 20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券(「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第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。以下同じ。）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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、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ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の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為替変動リスクを回避するため、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ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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なら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、なら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ならびに投資信託財産の規模によっ

ては、上記の運用ができない場合があります。

3. 運用制限

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。

「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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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価格変動リスクを回避するため、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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、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。

「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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の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ができます。

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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・マーケッツ・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・マーケッツ・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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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なら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、なら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ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方

法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場している(上場予定を含みます。以下同じ。)不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

「新興国REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場しているREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

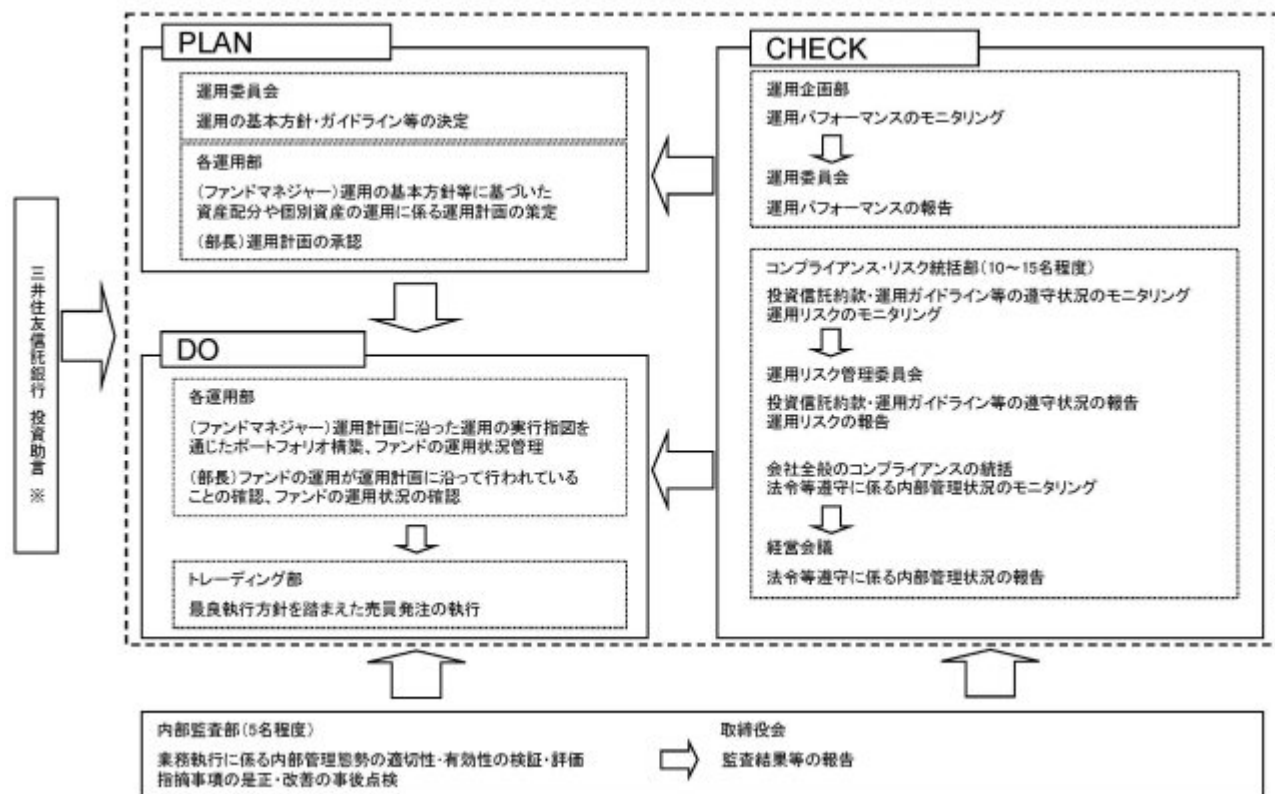
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）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（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

（４）【分配方針】

- ・年2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．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（REIT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．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

二．投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ．信用取引の指図範囲

- (イ) 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。
- (ロ) 上記（イ）の信用取引の指図は、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（前号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．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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。）
- (ロ) 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、わが国の金融商品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並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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。
- (ハ) 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、わが国の金融商品取引所等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金融商品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．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 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。
 - (ロ) 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、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 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、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
 - (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物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。
 - (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 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a.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債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、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、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。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の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を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 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。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財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、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、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係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。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において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は、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、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は、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

- (イ) 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り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。
- (ロ) 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。

(八) 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。

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ. 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。

タ. デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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。

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

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。

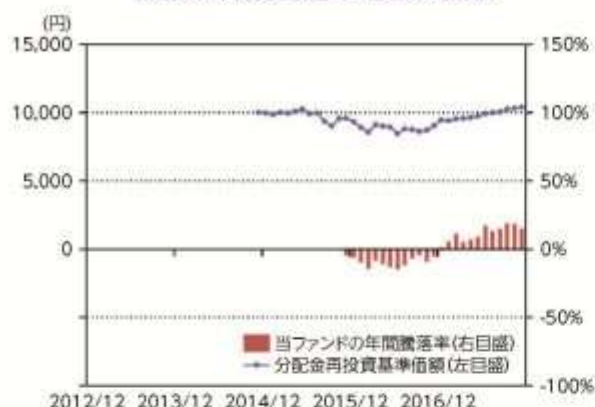
(2) リスクの管理体制

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2015年11月～2017年11月の2年1ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2012年12月～2017年11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、誤差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)^{※1}
- 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}
- 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{※3}
- 日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}
- 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}
- 新興国債… JPMorgan・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・ディバースファイド(円ベース)^{※6}

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.216% (税抜 0.2%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.27% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

(4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息 (「諸経費」といいます。) は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します (マ

ザーファンドにおいて負担する場合があります。)。

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期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。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（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11月30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11月30日現在の状況について記載してあります。

【SMT インデックスバランス・オープン】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	3,203,670,371	98.90

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		35,678,305	1.10
合計(純資産総額)		3,239,348,676	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	332,959,045	2.4050	800,790,286	2.4308	809,356,846	24.99
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	261,581,569	2.7868	728,984,560	2.7768	726,359,700	22.42
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	136,181,904	2.9708	404,577,370	3.0131	410,329,694	12.67
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	220,150,614	1.7420	383,522,485	1.7134	377,206,062	11.64
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	209,350,683	1.7598	368,429,600	1.7622	368,917,773	11.39
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	224,697,561	0.8576	192,720,365	0.8308	186,678,733	5.76
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	88,808,030	1.5372	136,523,750	1.5919	141,373,502	4.36
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	83,319,432	1.3801	114,990,205	1.3854	115,430,741	3.56
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	44,721,757	1.4897	66,626,017	1.5209	68,017,320	2.10

(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	98.90
合計	98.90

(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27年 4月20日）	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末（平成27年10月20日）	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末（平成28年 4月20日）	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末（平成28年10月20日）	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末（平成29年 4月20日）	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末（平成29年10月20日）	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
平成28年11月末日	2,799,710,047		9,052	
12月末日	2,942,729,285		9,459	
平成29年 1月末日	2,962,311,380		9,401	
2月末日	3,063,184,343		9,531	
3月末日	3,122,369,392		9,573	
4月末日	3,172,999,878		9,619	
5月末日	3,134,582,035		9,743	
6月末日	3,164,723,225		9,906	
7月末日	3,235,874,174		9,983	
8月末日	3,205,400,962		10,042	
9月末日	3,191,126,822		10,242	
10月末日	3,172,317,873		10,318	
11月末日	3,239,348,676		10,398	

【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26年11月28日～平成27年 4月20日	0
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	0
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	0
第4期計算期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	0
第5期計算期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	0
第6期計算期間	平成29年 4月21日～平成29年10月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第1期計算期間	平成26年11月28日～平成27年 4月20日	0.1
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	5.0
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	5.1
第4期計算期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	3.3
第5期計算期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	7.0
第6期計算期間	平成29年 4月21日～平成29年10月20日	11.2

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配)から前計算期間末の基準価額(分配)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配)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26年11月28日～平成27年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	平成29年 4月21日～平成29年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179

(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	184,106,621,200	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,756,705,941	1.48
合計(純資産総額)		186,863,327,141	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,965,050,000	1.59

(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	875,000	6,016.84	5,264,741,435	7,044.00	6,163,500,000	3.30
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,015,300	699.01	3,505,783,375	792.10	3,972,619,130	2.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	319,700	8,785.52	2,808,733,532	9,485.00	3,032,354,500	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	506,800	5,262.18	2,666,873,964	5,879.00	2,979,477,200	1.59
日本	株式	ソニー	電気機器	480,400	4,072.72	1,956,536,588	5,201.00	2,498,560,400	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	537,300	4,053.12	2,177,745,582	4,547.00	2,443,103,100	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	647,800	3,085.15	1,998,563,195	3,744.00	2,425,363,200	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,300	50,728.03	1,790,699,772	64,910.00	2,291,323,000	1.23
日本	株式	KDDI	情報・通信業	636,000	3,055.61	1,943,372,320	3,215.00	2,044,740,000	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	44,300	34,436.25	1,525,525,990	45,200.00	2,002,360,000	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,644,800	195.23	1,883,027,412	203.90	1,966,574,720	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	68,400	21,885.91	1,496,996,250	27,945.00	1,911,438,000	1.02
日本	株式	キヤノン	電気機器	387,400	3,824.06	1,481,443,100	4,298.00	1,665,045,200	0.89
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	446,900	4,170.18	1,863,654,258	3,720.00	1,662,468,000	0.89
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	265,100	5,800.47	1,537,705,000	6,184.00	1,639,378,400	0.88
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	522,900	2,717.54	1,421,005,752	2,907.50	1,520,331,750	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	125,500	9,953.47	1,249,160,614	11,765.00	1,476,507,500	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,728,000	677.47	1,170,674,300	834.20	1,441,497,600	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	129,300	10,688.62	1,382,038,872	10,865.00	1,404,844,500	0.75
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	530,600	2,010.02	1,066,521,390	2,647.00	1,404,498,200	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	497,400	2,248.21	1,118,262,042	2,813.00	1,399,186,200	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	822,200	1,390.94	1,143,638,312	1,668.00	1,371,429,600	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	297,100	4,720.80	1,402,550,872	4,605.00	1,368,145,500	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	64,400	18,486.69	1,190,542,928	20,775.00	1,337,910,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	719,700	1,559.13	1,122,107,998	1,852.50	1,333,244,250	0.71
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	267,400	4,689.28	1,253,914,988	4,960.00	1,326,304,000	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	86,600	10,998.12	952,437,437	15,270.00	1,322,382,000	0.71
日本	株式	花王	化学	177,000	6,911.78	1,223,385,980	7,438.00	1,316,526,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	254,400	4,736.60	1,204,991,580	5,095.00	1,296,168,000	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	98,200	10,994.77	1,079,686,976	12,920.00	1,268,744,000	0.68

(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	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	3.27
		食料品	4.42
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.17
		医薬品	4.31
		石油・石炭製品	0.62
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.15
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.70
		機械	5.40
		電気機器	13.74
		輸送用機器	8.63
		精密機器	1.59
		その他製品	2.12
		電気・ガス業	1.57
		陸運業	3.90
		海運業	0.23
		空運業	0.60
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	7.67
		卸売業	4.40
		小売業	4.61
		銀行業	7.18
		証券、商品先物取引業	0.98
		保険業	2.23
その他金融業	1.20		
不動産業	2.25		
サービス業	4.15		
	小計	98.52	
合計		98.52	

(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	165	円	2,849,904,540	2,965,050,000	1.59

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

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

国内債券インデックス 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	279,111,422,850	82.36
地方債証券	日本	19,446,123,409	5.74
特殊債券	日本	24,496,108,203	7.23
社債券	日本	12,613,110,970	3.72
	フランス	801,794,000	0.24
	オーストラリア	401,235,000	0.12
	オランダ	201,082,000	0.06
	スウェーデン	200,562,000	0.06
	イギリス	100,846,000	0.03
	小計	14,318,629,970	4.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,512,942,269	0.45
合計(純資産総額)		338,885,226,701	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	301,860,000	0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	101.05	5,598,703,700	100.97	5,593,738,000	0.100	2022/3/20	1.65
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,360,000,000	100.97	4,402,608,100	101.06	4,406,216,000	0.100	2022/9/20	1.30
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,060,000,000	100.61	4,084,766,000	100.78	4,091,992,800	0.100	2027/3/20	1.21
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	100.93	3,825,474,400	100.77	3,819,410,400	0.100	2021/3/20	1.13
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,680,000,000	103.40	3,805,431,900	103.40	3,805,340,800	0.400	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.89	3,642,318,700	101.00	3,646,244,400	0.100	2022/6/20	1.08
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.81	3,639,385,400	100.68	3,634,800,700	0.100	2020/9/20	1.07
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.64	3,542,563,200	100.50	3,537,670,400	0.100	2019/12/20	1.04
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	100.73	3,535,658,100	100.54	3,528,989,100	0.200	2019/6/20	1.04
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	100.66	3,322,077,000	100.45	3,314,916,000	0.200	2019/3/20	0.98
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	100.99	3,231,872,000	100.87	3,228,064,000	0.100	2021/9/20	0.95
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	100.70	3,162,074,200	100.56	3,157,678,200	0.100	2020/3/20	0.93
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,030,000,000	102.61	3,109,220,800	102.66	3,110,598,000	0.300	2025/12/20	0.92
日本	国債証券	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	100.49	3,065,027,300	100.40	3,062,383,000	0.100	2019/6/15	0.90
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,920,000,000	103.44	3,020,581,600	103.44	3,020,448,000	0.400	2025/9/20	0.89
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.87	2,985,900,000	100.71	2,981,252,800	0.100	2020/12/20	0.88
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	104.75	2,922,757,000	104.43	2,913,792,300	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	100.83	2,621,710,000	101.03	2,626,988,000	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第379回利付国債(2年)	2,600,000,000	100.50	2,613,131,700	100.45	2,611,700,000	0.100	2019/8/15	0.77
日本	国債証券	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	100.47	2,592,204,000	100.49	2,592,771,000	0.100	2019/10/15	0.77
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	100.81	2,580,736,000	100.62	2,576,102,400	0.200	2019/9/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,530,000,000	100.81	2,550,594,200	100.98	2,554,869,900	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,450,000,000	104.57	2,562,045,400	104.06	2,549,568,000	1.200	2020/12/20	0.75

日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	2,530,000,000	100.46	2,541,827,700	100.76	2,549,253,300	0.100	2027/6/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	103.33	2,531,708,200	103.40	2,533,447,000	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,400,000,000	104.09	2,498,160,000	103.92	2,494,224,000	0.500	2024/9/20	0.74
日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	2,340,000,000	103.60	2,424,414,800	103.15	2,413,710,000	1.100	2020/6/20	0.71
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	103.99	2,412,756,000	103.72	2,406,350,400	0.600	2023/3/20	0.71
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	104.82	2,400,584,100	104.38	2,390,439,400	0.800	2022/9/20	0.71
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	105.45	2,372,625,000	104.98	2,362,185,000	0.800	2023/6/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.36
地方債証券	5.74
特殊債券	7.23
社債券	4.23
合計	99.55

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	2円		302,080,648	301,860,000	0.09

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

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

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	191,511,497,645	58.38
	イギリス	21,760,078,826	6.63

	ドイツ	12,681,891,844	3.87
	フランス	12,459,669,554	3.80
	カナダ	12,243,967,704	3.73
	スイス	11,499,072,524	3.51
	オーストラリア	7,820,297,628	2.38
	オランダ	6,312,964,244	1.92
	アイルランド	4,486,081,622	1.37
	スペイン	4,353,768,103	1.33
	スウェーデン	3,571,523,923	1.09
	香港	3,022,968,433	0.92
	イタリア	2,574,444,549	0.78
	シンガポール	2,534,531,217	0.77
	デンマーク	2,332,904,044	0.71
	ジャージー	1,565,019,308	0.48
	バミューダ	1,533,899,799	0.47
	ベルギー	1,481,380,220	0.45
	フィンランド	1,236,078,302	0.38
	ノルウェー	898,342,102	0.27
	ケイマン	887,667,842	0.27
	キュラソー	760,563,158	0.23
	イスラエル	581,909,083	0.18
	ルクセンブルク	446,334,088	0.14
	オーストリア	331,520,532	0.10
	ニュージーランド	209,332,502	0.06
	ポルトガル	204,211,757	0.06
	パナマ	199,958,088	0.06
	リベリア	194,010,037	0.06
	英ヴァージン諸島	75,883,795	0.02
	パプアニューギニア	71,272,270	0.02
	マン島	48,083,820	0.01
	モーリシャス	13,245,512	0.00
	小計	309,904,374,075	94.48
投資信託受益証券	オーストラリア	187,877,888	0.06
	香港	60,722,096	0.02
	シンガポール	22,255,146	0.01
	小計	270,855,130	0.08
投資証券	アメリカ	6,015,658,131	1.83
	オーストラリア	711,819,612	0.22
	フランス	442,862,523	0.14
	イギリス	297,529,711	0.09
	香港	181,209,288	0.06
	シンガポール	128,447,273	0.04

	カナダ	65,120,076	0.02
	小計	7,842,646,614	2.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,000,577,249	3.05
合計(純資産総額)		328,018,453,068	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	6,882,933,447	2.10
	買建	カナダ	412,636,250	0.13
	買建	ドイツ	1,638,923,728	0.50
	買建	イギリス	855,770,061	0.26
	買建	オーストラリア	370,353,584	0.11

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		628,782,100	0.19

(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	410,453	17,216.48	7,066,556,892	18,990.23	7,794,598,516	2.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	577,311	7,843.50	4,528,138,829	9,338.24	5,391,072,714	1.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	31,930	111,553.61	3,561,907,039	130,120.30	4,154,741,291	1.27

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	186,097	17,079.78	3,178,496,098	19,623.31	3,651,840,331	1.11
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	212,084	14,223.62	3,016,603,709	15,665.71	3,322,446,546	1.01
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	279,283	9,567.94	2,672,165,640	11,622.94	3,246,091,367	0.99
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	333,839	9,117.50	3,043,779,920	9,218.35	3,077,445,914	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	24,569	108,809.51	2,673,340,950	114,477.00	2,812,585,487	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,417	111,237.63	2,604,851,757	116,238.42	2,721,955,292	0.83
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	782,115	2,604.04	2,036,660,309	3,168.77	2,478,345,677	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	373,086	5,870.29	2,190,126,559	6,350.99	2,369,466,947	0.72
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,267	9,428.53	2,303,080,911	9,669.85	2,362,027,326	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	98,049	18,602.54	1,823,960,543	21,272.69	2,085,766,227	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	200,955	9,783.08	1,965,959,947	10,015.02	2,012,570,153	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	482,995	4,270.22	2,062,497,565	4,087.58	1,974,282,634	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	149,192	11,738.35	1,751,269,107	13,130.01	1,958,893,795	0.60
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	469,558	3,603.52	1,692,065,401	4,057.33	1,905,151,995	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	75,819	19,926.97	1,510,843,090	24,973.70	1,893,481,264	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	93,822	17,356.54	1,628,425,765	19,860.86	1,863,385,841	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	370,336	4,060.69	1,503,820,433	4,924.59	1,823,755,740	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	216,295	6,959.42	1,505,288,938	8,408.23	1,818,658,540	0.55
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	320,438	5,081.46	1,628,295,283	5,591.29	1,791,663,387	0.55
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,185	10,613.37	1,540,902,994	12,309.81	1,787,200,200	0.54
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,577,916	1,016.23	1,603,526,839	1,117.25	1,762,930,690	0.54
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	174,408	8,949.31	1,560,832,061	9,527.57	1,661,684,603	0.51
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	393,079	3,529.57	1,387,401,811	4,199.63	1,650,787,933	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	318,834	5,085.94	1,621,573,623	5,098.27	1,625,503,411	0.50
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	55,064	30,309.51	1,668,963,085	28,207.07	1,553,194,323	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	371,337	4,582.84	1,701,779,914	4,167.13	1,547,413,081	0.47
アメリカ	株式	DOWDUPONT INC	素材	183,235	6,826.81	1,250,911,220	8,042.94	1,473,749,760	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	6.44
		素材	4.80
		資本財	7.24
		商業・専門サービス	0.95
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.55
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.81
		メディア	2.21
		小売	3.86
		食品・生活必需品小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	5.21
		家庭用品・パーソナル用品	2.00
		ヘルスケア機器・サービス	4.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.94
		銀行	9.44
		各種金融	4.45
		保険	4.14
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	9.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.99		
電気通信サービス	2.44		
公益事業	3.18		
半導体・半導体製造装置	2.85		
	小計	94.48	
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.39
合計			96.95

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	468	アメリカドル	60,100,536	6,734,265,059	61,427,340	6,882,933,447	2.10
	カナダ	モントルオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	4,710,732.5	410,304,801	4,737,500	412,636,250	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	40	スイスフラン	3,679,800	418,871,634	3,726,000	424,130,580	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	255	ユーロ	9,182,117.5	1,219,477,025	9,146,850	1,214,793,148	0.37
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	4,249,578	360,661,685	4,363,775	370,353,584	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	77	イギリスポンド	5,732,508.75	861,768,040	5,692,610	855,770,061	0.26

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,294,000.00	368,147,340	369,035,760	0.11
	カナダドル	買建	430,000.00	37,443,580	37,446,400	0.01
	ユーロ	買建	744,000.00	98,576,900	98,810,640	0.03
	イギリスポンド	買建	395,000.00	59,100,895	59,374,900	0.02
	スイスフラン	買建	280,000.00	31,872,120	31,875,200	0.01
	オーストラリアドル	買建	380,000.00	32,239,580	32,239,200	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。

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	107,469,286,052	42.10
	フランス	25,753,578,867	10.09
	イタリア	24,824,577,694	9.72
	ドイツ	18,067,255,322	7.08
	イギリス	17,420,892,847	6.82
	スペイン	14,596,848,846	5.72

	ベルギー	6,440,408,717	2.52
	オランダ	5,531,425,908	2.17
	カナダ	5,304,387,365	2.08
	オーストラリア	5,271,118,346	2.06
	オーストリア	3,944,438,825	1.55
	メキシコ	2,129,377,451	0.83
	アイルランド	1,990,790,101	0.78
	デンマーク	1,654,927,467	0.65
	ポーランド	1,560,853,951	0.61
	フィンランド	1,540,518,897	0.60
	南アフリカ	1,296,063,675	0.51
	スウェーデン	1,168,026,250	0.46
	マレーシア	1,107,723,471	0.43
	シンガポール	950,291,715	0.37
	ノルウェー	721,643,450	0.28
	スイス	442,063,096	0.17
	小計	249,186,498,313	97.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,107,246,301	2.39
合計(純資産総額)		255,293,744,614	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,157,290,917	0.45
	買建	ドイツ	1,743,553,585	0.68

(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		3,949,079,700	1.55

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	30,000,000	11,604.47	3,481,341,218	11,433.76	3,430,128,485	3.125	2019/5/15	1.34
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	16,900,000	11,529.93	1,948,558,985	11,374.75	1,922,334,043	2.500	2024/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	11,097.95	1,942,141,953	10,973.52	1,920,366,087	1.750	2023/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	17,050,000	10,273.86	1,751,693,897	10,501.50	1,790,506,268	2.500	2046/2/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	14,150,000	11,158.93	1,578,989,304	11,362.10	1,607,737,440	2.875	2043/5/15	0.63
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	14,763.52	1,623,987,464	14,589.84	1,604,882,680	3.500	2020/4/25	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,806.74	1,416,809,028	11,881.56	1,425,788,305	3.125	2044/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,520.89	1,388,757,708	10,449.99	1,379,399,769	1.500	2026/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	11,055.67	1,359,847,693	10,956.44	1,347,642,786	2.000	2025/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	11,180.57	1,285,765,906	11,121.31	1,278,951,341	1.250	2019/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,600.10	1,276,011,980	11,449.19	1,259,411,048	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	11,164.00	1,250,368,594	11,060.86	1,238,817,373	1.750	2022/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,818.56	1,168,408,688	9,940.52	1,182,922,867	2.250	2046/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	11,081.81	1,163,590,509	11,032.08	1,158,368,514	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,311.96	1,148,164,419	11,190.63	1,135,848,960	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,900,000	11,110.25	1,099,915,678	11,331.49	1,121,817,709	2.875	2045/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	11,082.86	1,124,910,462	11,028.59	1,119,402,868	1.750	2022/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	11,253.51	1,125,351,765	11,185.79	1,118,579,396	1.625	2019/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	11,197.15	1,119,715,650	11,106.15	1,110,615,453	1.500	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/19	10,000,000	11,121.52	1,112,152,275	11,077.50	1,107,750,536	0.875	2019/4/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,993.22	1,099,322,550	10,889.00	1,088,900,040	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,956.85	1,073,772,193	10,881.44	1,066,381,377	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,181.76	1,067,858,479	11,069.71	1,057,158,026	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,177.54	1,067,455,810	11,053.99	1,055,656,868	1.750	2022/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	11,085.73	1,053,144,908	10,993.94	1,044,424,580	1.375	2021/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	8,750,000	11,750.07	1,028,131,567	11,552.38	1,010,833,405	3.375	2019/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,291.72	1,016,255,403	11,102.11	999,189,928	1.875	2022/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,135.35	1,002,182,029	11,079.24	997,131,611	1.000	2019/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,239.89	1,005,970,583	11,081.41	991,786,814	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/23	9,000,000	10,954.34	985,890,671	10,856.16	977,054,935	1.625	2023/10/31	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.61
合計	97.61

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	41	アメリカ ドル	4,788,226.6	536,520,790	4,781,625	535,781,081	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカ ドル	3,120,990.75	349,707,014	3,111,718.75	348,668,086	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカ ドル	2,450,032.75	274,526,170	2,435,000	272,841,750	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	26	ユーロ	2,918,439	387,597,884	2,916,810	387,381,536	0.15
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,554,618	472,088,817	3,549,690	471,434,329	0.18
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	41	ユーロ	6,661,804	884,754,188	6,661,680	884,737,720	0.35

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	17,870,000.00	2,018,051,452	2,000,546,500	0.78
	カナダドル	買建	1,810,000.00	159,967,986	157,542,400	0.06
	ユーロ	買建	11,560,000.00	1,531,587,969	1,535,514,800	0.60
	イギリスポンド	買建	1,700,000.00	253,490,990	255,476,000	0.10

(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	ケイマン	7,745,617,142	16.15
	韓国	7,464,872,225	15.56
	台湾	5,436,381,924	11.33

	中国	4,504,108,702	9.39
	インド	4,134,821,103	8.62
	ブラジル	3,156,522,926	6.58
	南アフリカ	2,878,385,953	6.00
	香港	1,617,855,386	3.37
	ロシア	1,580,628,180	3.30
	メキシコ	1,379,249,938	2.88
	タイ	1,050,961,449	2.19
	マレーシア	1,041,939,656	2.17
	インドネシア	1,020,745,540	2.13
	ポーランド	615,311,000	1.28
	フィリピン	532,199,772	1.11
	チリ	513,668,508	1.07
	バミューダ	474,699,719	0.99
	トルコ	426,196,246	0.89
	アラブ首長国連邦	312,409,041	0.65
	カタール	242,610,998	0.51
	コロンビア	185,614,189	0.39
	アメリカ	158,626,520	0.33
	ハンガリー	151,102,707	0.32
	ギリシャ	138,031,640	0.29
	オランダ	110,769,007	0.23
	チェコ	86,798,810	0.18
	マン島	53,464,588	0.11
	エジプト	45,092,102	0.09
	ペルー	26,690,882	0.06
	マルタ共和国	7,550,308	0.02
	小計	47,092,926,161	98.18
投資信託受益証券	ブラジル	88,965,156	0.19
投資証券	南アフリカ	142,470,273	0.30
	メキシコ	54,060,083	0.11
	トルコ	9,215,244	0.02
	小計	205,745,600	0.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		576,709,564	1.20
合計(純資産総額)		47,964,346,481	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	646,887,060	1.35
----------	----	------	-------------	------

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

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

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		280,445,200	0.58
	売建		67,224,000	0.14

(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 (%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	450,700	5,564.93	2,508,113,951	5,906.46	2,662,041,522	5.55
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	7,759	292,404.59	2,268,767,291	272,994.00	2,118,160,446	4.42
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	90,297	20,743.81	1,873,104,399	20,158.91	1,820,289,593	3.80
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,948,389	901.34	1,756,160,942	877.03	1,708,795,605	3.56
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	35,016	29,232.26	1,023,596,886	31,233.80	1,093,682,741	2.28
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,604,620	98.72	652,060,923	98.72	652,060,923	1.36
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	21,592	26,898.72	580,797,227	26,386.65	569,740,644	1.19
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	482,500	1,142.97	551,486,644	1,148.71	554,256,194	1.16
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,869,515	89.97	528,106,678	88.25	517,999,373	1.08
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	424,500	1,054.00	447,426,184	1,148.00	487,326,000	1.02
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	1,223,311	405.78	496,407,370	385.21	471,243,863	0.98
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	46,200	8,553.12	395,154,144	8,553.12	395,154,144	0.82
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	202,157	1,779.91	359,822,124	1,880.19	380,095,389	0.79
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	255,021	1,431.26	365,003,524	1,446.11	368,790,050	0.77

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	120,033	3,037.49	364,599,757	2,999.30	360,015,457	0.75
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	208,670	1,584.87	330,716,909	1,664.95	347,427,203	0.72
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,245,200	55.39	345,927,873	54.53	340,550,756	0.71
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,433	236,767.79	339,288,257	221,094.00	316,827,702	0.66
ブラジル	株式	VALE SA	素材	244,278	1,135.85	277,465,125	1,232.72	301,126,620	0.63
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,721,740	100.33	273,097,214	98.89	269,158,312	0.56
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	235,710	1,129.47	266,228,859	1,134.65	267,449,719	0.56
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	151,755	1,679.92	254,936,260	1,729.55	262,468,164	0.55
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	369,000	698.19	257,634,545	709.93	261,966,679	0.55
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	37,201	6,350.99	236,263,328	6,358.83	236,555,114	0.49
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	454,644	493.80	224,505,184	511.50	232,554,157	0.48
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	54,590	4,459.58	243,449,018	4,238.85	231,398,903	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	ソフトウェア・サービス	6,195	35,055.96	217,171,691	36,351.26	225,196,062	0.47
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	583,000	394.62	230,066,376	373.81	217,935,603	0.45
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,389,000	159.57	221,645,508	154.98	215,267,220	0.45
韓国	株式	KB FINANCIAL GROUP INC	銀行	33,822	5,989.26	202,568,752	6,144.95	207,834,837	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.68
		素材	7.06
		資本財	3.53
		商業・専門サービス	0.12
		運輸	1.47
		自動車・自動車部品	3.32
		耐久消費財・アパレル	1.19
		消費者サービス	1.15
		メディア	2.71
		小売	1.92
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	3.42
		家庭用品・パーソナル用品	1.21
		ヘルスケア機器・サービス	0.53
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.99
		銀行	16.44
各種金融	2.51		

	保険	3.64
	不動産	2.25
	ソフトウェア・サービス	13.89
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.98
	電気通信サービス	4.65
	公益事業	2.30
	半導体・半導体製造装置	5.61
	小計	98.18
投資信託受益証券		0.19
投資証券		0.43
合計		98.80

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	102	アメリカドル	5,811,877	651,220,818	5,773,200	646,887,060	1.35

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,250,000.00	139,512,500	140,050,000	0.29
	ポーランドズロチ	買建	480,000.00	15,178,320	15,163,200	0.03
	香港ドル	買建	7,300,000.00	104,763,760	104,682,000	0.22
	マレーシアリングット	買建	750,000.00	20,564,250	20,550,000	0.04
	アメリカドル	売建	600,000.00	67,224,900	67,224,000	0.14

(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	3,191,382,121	10.03
	ブラジル	3,149,639,051	9.90
	インドネシア	3,067,258,729	9.64
	ポーランド	2,903,376,629	9.12
	タイ	2,554,983,734	8.03
	南アフリカ	2,527,807,066	7.94
	ロシア	2,381,437,354	7.48
	コロンビア	2,146,700,845	6.75
	トルコ	2,121,710,941	6.67
	マレーシア	1,838,320,458	5.78
	ハンガリー	1,478,239,635	4.65
	チェコ	1,228,312,070	3.86
	ペルー	872,523,965	2.74
	チリ	769,740,678	2.42
	フィリピン	95,525,060	0.30
ウルグアイ	88,968,445	0.28	
	小計	30,415,926,781	95.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,407,469,839	4.42
合計(純資産総額)		31,823,396,620	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 9.85% 06/28/27	19,500,000,000	4.66	909,103,854	4.67	912,496,942	9.850	2027/6/28	2.87
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000	3.96	776,311,920	3.95	775,924,447	7.750	2021/4/14	2.44
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	4,200,000,000	18.37	771,699,222	18.32	769,740,678	5.500	2020/8/5	2.42
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	3,538.83	523,747,613	3,530.58	522,527,178	10.000	2021/1/1	1.64
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000	2,903.81	518,330,212	2,919.62	521,152,527	0.000	2020/1/1	1.64
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000	3.52	457,054,962	3.53	458,279,456	4.375	2023/3/21	1.44
メキシコ	国債証券	MBONO 5% 12/11/19	78,200,000	579.87	453,464,569	579.74	453,358,471	5.000	2019/12/11	1.42
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	49,000,000	879.70	431,053,049	879.08	430,753,708	10.500	2026/12/21	1.35
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	11,100,000	3,500.67	388,575,050	3,470.32	385,206,329	10.000	2023/1/1	1.21

メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	63,000,000	592.98	373,581,926	591.82	372,848,738	6.500	2021/6/10	1.17
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	94,700,000	357.24	338,306,810	356.73	337,827,931	3.875	2019/6/13	1.06
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000	370.67	337,311,557	370.07	336,765,302	3.650	2021/12/17	1.06
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	11,800,000	2,760.29	325,714,244	2,772.12	327,110,589	0.000	2020/7/1	1.03
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000	3,118.25	321,180,409	3,125.50	321,927,385	2.250	2022/4/25	1.01
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000	0.93	314,485,340	0.93	316,249,937	8.375	2026/9/15	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	10,500,000	2,963.71	311,190,243	2,984.60	313,383,441	2.500	2026/7/25	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	44,350,000	700.15	310,517,565	697.71	309,435,809	10.000	2024/12/5	0.97
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000	0.91	292,343,264	0.91	294,162,624	8.375	2024/3/15	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	69,000,000	424.92	293,195,380	423.86	292,470,245	4.875	2029/6/22	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000	375.09	279,448,993	373.88	278,546,888	3.625	2023/6/16	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000	345.28	272,773,663	345.30	272,787,252	1.875	2022/6/17	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/19	8,650,000	3,124.59	270,277,811	3,143.34	271,899,071	0.000	2019/4/1	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000	3,253.01	271,626,719	3,250.10	271,383,968	3.250	2019/7/25	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000	353.25	271,122,138	352.85	270,819,835	2.550	2020/6/26	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000	3,097.14	260,160,398	3,102.20	260,585,102	1.750	2021/7/25	0.82
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	7,450,000	3,443.86	256,567,603	3,403.49	253,560,080	10.000	2027/1/1	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	65,400,000	385.27	251,967,496	385.45	252,086,733	3.850	2025/12/12	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	40,250,000	614.96	247,521,604	616.53	248,155,070	7.750	2042/11/13	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	41,700,000	590.13	246,085,036	588.74	245,505,442	6.500	2022/6/9	0.77
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000	3,552.13	239,769,425	3,553.63	239,870,319	10.000	2019/1/1	0.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.58
合計	95.58

(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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	84,156,330,400	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,995,521,749	2.32
合計(純資産総額)		86,151,852,149	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	1,985,742,000	2.30

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,732	536,083.26	5,753,245,631	563,000	6,042,116,000	7.01
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,476	519,091.34	5,438,000,893	546,000	5,719,896,000	6.64
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,796	137,710.45	4,378,641,563	141,700	4,505,493,200	5.23
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,321	199,106.22	4,245,143,921	199,300	4,249,275,300	4.93
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,444	160,008.08	3,911,237,699	159,300	3,893,929,200	4.52
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,383	153,312.04	3,278,271,460	157,700	3,372,099,100	3.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	13,940	232,822.2	3,245,541,603	241,100	3,360,934,000	3.90
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	11,399	258,135.25	2,942,483,745	269,400	3,070,890,600	3.56
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,261	263,033.25	2,698,984,261	273,700	2,808,435,700	3.26
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,997	359,542.23	2,515,717,004	377,500	2,641,367,500	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,988	75,108.92	2,402,584,273	78,200	2,501,461,600	2.90
日本	投資証券	G L P 投資法人	19,403	111,523.15	2,163,883,698	121,500	2,357,464,500	2.74
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,790	444,063.05	2,127,062,046	465,500	2,229,745,000	2.59

日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,239	590,075.32	1,911,253,985	632,000	2,047,048,000	2.38
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,770	439,556.19	1,657,126,843	457,000	1,722,890,000	2.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,683	437,052.41	1,609,664,031	454,000	1,672,082,000	1.94
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,906	131,210.34	1,562,190,339	137,600	1,638,265,600	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,383	203,410.49	1,501,779,711	207,500	1,531,972,500	1.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,011	464,055.78	1,397,271,960	491,500	1,479,906,500	1.72
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	30,396	46,605.86	1,416,631,770	48,150	1,463,567,400	1.70
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,925	130,611.53	1,296,319,494	135,000	1,339,875,000	1.56
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,390	548,025.19	1,309,780,214	556,000	1,328,840,000	1.54
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	7,921	159,511.51	1,263,490,695	164,000	1,299,044,000	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,527	157,912.93	1,188,610,691	165,300	1,244,213,100	1.44
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,525	113,509.86	1,194,691,356	116,900	1,230,372,500	1.43
日本	投資証券	プレミアム投資法人	10,010	99,411.82	995,112,374	105,600	1,057,056,000	1.23
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	12,466	78,310.84	976,223,036	83,000	1,034,678,000	1.20
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,431	131,618.3	978,055,602	138,900	1,032,165,900	1.20
日本	投資証券	日本リート投資法人	2,978	326,023.25	970,897,265	337,000	1,003,586,000	1.16
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,042	230,023.04	929,753,141	240,900	973,717,800	1.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.68
合計	97.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,188	円	1,910,506,290	1,985,742,000	2.30

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	43,924,706,189	71.05
	オーストラリア	4,899,314,648	7.93
	イギリス	3,193,610,147	5.17
	フランス	2,845,290,907	4.60
	シンガポール	2,139,100,853	3.46
	香港	1,260,134,200	2.04
	カナダ	1,133,974,311	1.83
	スペイン	459,987,598	0.74
	ベルギー	442,242,393	0.72
	オランダ	288,609,119	0.47
	ニュージーランド	258,719,447	0.42
	アイルランド	161,935,717	0.26
	ドイツ	150,538,010	0.24
	イタリア	77,751,246	0.13
	ガンジー	43,062,029	0.07
	イスラエル	34,715,889	0.06
	マン島	34,187,928	0.06
	小計	61,347,880,631	99.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		470,890,632	0.76
合計(純資産総額)		61,818,771,263	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		60,540,000	0.10
	売建		32,640,680	0.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	147,110	18,069.18	2,658,157,511	17,785.69	2,616,453,812	4.23
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	251,460	7,449.08	1,873,146,663	7,409.86	1,863,285,030	3.01
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	70,710	23,684.00	1,674,696,241	23,559.63	1,665,901,649	2.69
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	46,890	29,211.55	1,369,730,025	28,872.89	1,353,850,000	2.19
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	65,790	21,006.01	1,381,985,628	20,397.58	1,341,956,920	2.17
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	175,750	7,650.77	1,344,623,531	7,538.72	1,324,930,743	2.14
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	174,990	7,830.05	1,370,181,150	7,478.21	1,308,613,193	2.12
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	97,480	13,696.99	1,335,182,781	13,108.72	1,277,838,952	2.07
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	169,600	7,261.96	1,231,628,501	7,179.04	1,217,565,778	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	1,046,000	991.58	1,037,197,910	1,009.52	1,055,960,535	1.71
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	73,420	14,119.42	1,036,647,854	14,011.85	1,028,750,211	1.66
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,534,560	351.36	890,547,563	359.00	909,907,293	1.47
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	31,420	28,791.24	904,620,996	27,752.54	871,984,932	1.41
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	129,650	6,303.93	817,304,913	6,215.41	805,828,360	1.30
アメリカ	投資証券	GGP INC	297,720	2,465.10	733,909,572	2,621.96	780,612,908	1.26
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	351,850	2,241.00	788,495,850	2,204.02	775,485,668	1.25
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	81,960	8,432.88	691,159,091	8,620.00	706,495,733	1.14
アメリカ	投資証券	HCP INC	221,480	3,027.59	670,550,855	3,014.14	667,572,835	1.08
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	905,690	687.44	622,613,873	709.51	642,599,010	1.04
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,430	14,129.50	627,773,907	14,226.98	632,105,099	1.02
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	53,958	11,833.60	638,517,416	11,457.11	618,202,876	1.00
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	59,690	9,574.67	571,512,201	9,530.97	568,903,778	0.92
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	124,692	4,552.59	567,671,739	4,540.26	566,134,848	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	126,870	4,462.95	566,214,657	4,410.28	559,533,239	0.91
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	755,010	740.06	558,757,533	739.21	558,116,756	0.90
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	168,680	3,241.60	546,794,184	3,210.23	541,502,018	0.88
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	46,350	11,064.93	512,859,853	11,454.87	530,933,294	0.86
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	69,300	7,431.15	514,979,111	7,619.40	528,024,420	0.85
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,210	14,727.85	503,839,817	14,801.80	506,369,749	0.82
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	356,340	1,427.38	508,633,782	1,398.06	498,187,907	0.81

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.24
合計	99.24

(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

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	440,000.00	49,293,200	49,288,800	0.08
	ユーロ	買建	40,000.00	5,312,480	5,312,400	0.01
	オーストラリアドル	買建	70,000.00	5,938,870	5,938,800	0.01
	アメリカドル	売建	100,000.00	11,161,000	11,204,000	0.02
	ユーロ	売建	34,000.00	4,497,180	4,515,540	0.01
	オーストラリアドル	売建	49,000.00	4,156,866	4,158,140	0.01
	香港ドル	売建	600,000.00	8,581,800	8,604,000	0.01
	シンガポールドル	売建	50,000.00	4,146,900	4,159,000	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。

新興国REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	南アフリカ	217,250,157	47.58
	メキシコ	115,467,933	25.29
	タイ	40,811,265	8.94
	マレーシア	28,913,101	6.33
	トルコ	17,973,514	3.94
	台湾	5,812,408	1.27
	ギリシャ	4,741,317	1.04
	オランダ	1,418,208	0.31
	小計	432,387,903	94.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,182,594	5.30
合計(純資産総額)		456,570,497	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)

為替予約取引	買建		240,800	0.05
--------	----	--	---------	------

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	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 (%)
南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	278,090	208.68	58,034,602	204.58	56,894,433	12.46
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	318,700	182.45	58,147,126	175.29	55,865,592	12.24
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	39,810	1,163.58	46,322,120	1,187.36	47,268,802	10.35
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	543,480	89.54	48,665,373	83.14	45,189,275	9.90
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	25,260	884.04	22,330,901	872.48	22,038,845	4.83
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	79,200	186.01	14,732,057	191.99	15,206,020	3.33
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	82,800	183.25	15,173,828	182.40	15,103,341	3.31
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	201,290	76.15	15,329,019	67.94	13,676,448	3.00
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	79,610	164.00	13,056,040	164.00	13,056,040	2.86
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	168,500	74.30	12,520,224	75.33	12,694,116	2.78
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	84,600	132.50	11,210,283	131.03	11,085,299	2.43
タイ	投資証券	TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	182,700	60.88	11,124,237	59.85	10,935,691	2.40
南アフリカ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	266,110	40.83	10,866,868	38.37	10,212,237	2.24
マレーシア	投資証券	KLCCP STAPLED GROUP	36,900	215.79	7,962,850	214.15	7,902,142	1.73
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	35,800	226.24	8,099,593	216.89	7,764,988	1.70
南アフリカ	投資証券	EMIRA PROPERTY FUND LTD	55,170	109.38	6,034,936	108.56	5,989,697	1.31
台湾	投資証券	SHIN KONG NO 1 REIT	108,000	53.59	5,788,173	53.81	5,812,408	1.27
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	125,500	47.16	5,918,881	46.06	5,781,233	1.27
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	131,800	45.51	5,999,166	43.32	5,710,050	1.25
南アフリカ	投資証券	ARROWHEAD PROPERTIES LTD	105,000	68.38	7,180,740	51.98	5,458,740	1.20
南アフリカ	投資証券	REBOSIS PROPERTY FUND LTD	67,984	90.11	6,126,582	78.71	5,351,700	1.17
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	69,800	79.44	5,545,331	72.66	5,071,772	1.11
ギリシャ	投資証券	GRIVALIA PROPERTIES REIC	4,200	1,195.29	5,020,218	1,128.88	4,741,317	1.04
タイ	投資証券	SAMUI AIRPORT PROPERTY FUND	57,800	82.90	4,791,851	79.80	4,612,902	1.01
タイ	投資証券	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	74,700	49.19	3,674,642	49.19	3,674,642	0.80
タイ	投資証券	GOLDEN VENTURES LEASEHOLD RE	70,000	50.56	3,539,760	50.22	3,515,680	0.77
南アフリカ	投資証券	DELTA PROPERTY FUND LTD	58,437	59.94	3,502,830	54.11	3,162,610	0.69

マレーシア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	66,300	46.61	3,090,508	44.96	2,981,431	0.65
メキシコ	投資証券	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	40,800	70.12	2,861,072	69.82	2,848,958	0.62
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	66,100	43.04	2,845,566	40.03	2,646,195	0.58

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	94.70
合計	94.70

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	40,000.00	240,800	240,800	0.05

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

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

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：2014年11月28日

作成基準日：2017年11月30日

基準価額・純資産の推移



基準価額 10,398円

純資産総額 32.39億円

※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	2015年10月	2016年4月	2016年10月	2017年4月	2017年10月
分配金	0円	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
外国株式インデックスマザーファンド	25.0%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	0.6%
外国債券インデックスマザーファンド	22.4%	T 3.125% 05/15/19 T 2.5% 05/15/24	アメリカ	国債	-	3.125%	2019/05/15	0.3%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.7%	TENCENT HOLDINGS LTD. SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	ケイマン島 韓国	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.7%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.6%	COLOM 9.85% 06/28/27 COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
グローバル株式インデックスマザーファンド	11.4%	SIMON PROPERTY GROUP PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
新興国REITインデックスマザーファンド	5.8%	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	南アフリカ メキシコ	投資証券	-	-	-	0.7%
国内株式インデックスマザーファンド	4.4%	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%
国内債券インデックスマザーファンド	3.6%	第131日利付国債(5年) 第133日利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.1%
上REITインデックスマザーファンド	2.1%	日本ビルファンド投資法人 ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	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)



※2014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。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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 >

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。

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（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（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。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（平成26年11月28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4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。

ただし、第1計算期間は平成26年11月28日から平成27年4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30億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知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、）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6期計算期間(平成29年4月21日から平成29年10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】

【SMT インデックスバランス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (平成29年 4月20日現在)	第6期 (平成29年10月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,194,778	52,729,944
親投資信託受益証券	3,030,366,755	3,175,390,989
未収入金	-	3,000,000
流動資産合計	3,083,561,533	3,231,120,933
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,706,986	12,369,544
未払受託者報酬	791,189	860,188
未払委託者報酬	7,120,617	7,741,679
未払利息	128	85
その他未払費用	79,224	85,966
流動負債合計	11,698,144	21,057,462
負債合計	11,698,144	21,057,462
純資産の部		
元本等		
元本	3,287,676,732	3,090,849,179
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	215,813,343	119,214,292
(分配準備積立金)	109,044,524	282,451,136
元本等合計	3,071,863,389	3,210,063,471
純資産合計	3,071,863,389	3,210,063,471
負債純資産合計	3,083,561,533	3,231,120,933

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	平成28年10月21日 至 平成29年 4月20日	自	平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日
営業収益				
受取利息		34		23
有価証券売買等損益		197,580,800		342,924,234
営業収益合計		197,580,834		342,924,257
営業費用				
支払利息		17,776		18,789
受託者報酬		791,189		860,188
委託者報酬		7,120,617		7,741,679
その他費用		79,397		86,054
営業費用合計		8,008,979		8,706,710
営業利益又は営業損失（ ）		189,571,855		334,217,547
経常利益又は経常損失（ ）		189,571,855		334,217,547
当期純利益又は当期純損失（ ）		189,571,855		334,217,547
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（ ）		35,512,179		45,055,109
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		384,555,223		215,813,343
剰余金増加額又は欠損金減少額		72,258,780		47,887,729
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		72,258,780		47,887,729
剰余金減少額又は欠損金増加額		57,576,576		2,022,532
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		57,576,576		2,022,532
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		215,813,343		119,214,292

（ 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5期 (平成29年 4月20日現在)	第6期 (平成29年10月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,287,676,732口	3,090,849,179口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 215,813,343円	元本の欠損 - 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9344円 (1万口当たり純資産額) (9,344円)	1口当たり純資産額 1.0386円 (1万口当たり純資産額) (10,386円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第5期 自 平成28年10月21日 至 平成29年 4月20日			第6期 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10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	40,625,686円	費用控除後の配当等収益額	A	47,420,753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	149,474,000円
収益調整金額	C	91,278,890円	収益調整金額	C	103,955,317円
分配準備積立金額	D	68,418,838円	分配準備積立金額	D	85,556,383円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	200,323,414円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	386,406,453円
当ファンドの期末残存口数	F	3,287,676,732口	当ファンドの期末残存口数	F	3,090,849,179口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	609円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,250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6期 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (平成29年10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5期	第6期
	自 平成28年10月21日 至 平成29年 4月20日	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,025,061,973円	3,287,676,732円
期中追加設定元本額	856,851,109円	584,835,788円
期中一部解約元本額	594,236,350円	781,663,341円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期	第6期
	(平成29年 4月20日現在)	(平成29年10月20日現在)
	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	177,039,091	312,909,974
合計	177,039,091	312,909,974

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	44,420,329	66,199,616	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	207,852,808	365,841,727	
	新興国株式インデックス マザーファンド	135,298,033	401,902,807	
	国内株式インデックス マザーファンド	88,241,838	135,610,056	
	外国株式インデックス マザーファンド	330,702,494	795,372,568	
	国内債券インデックス マザーファンド	82,685,633	114,114,442	
	外国債券インデックス マザーファンド	259,675,268	723,766,906	
	新興国債券インデックス マザーファンド	218,586,423	381,061,711	
	新興国REITインデックス マザーファンド	222,984,231	191,521,156	
合計		1,590,447,057	3,175,390,989	

(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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成29年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,528,494,452
株式	178,081,347,580
派生商品評価勘定	93,688,140
未収入金	1,119,230,958
未収配当金	1,379,639,564
差入委託証拠金	51,387,600
流動資産合計	182,253,788,294
資産合計	182,253,788,294
負債の部	

	平成29年10月20日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	249,600
前受金	93,446,100
未払解約金	476,854,123
未払利息	2,479
流動負債合計	570,552,302
負債合計	570,552,302
純資産の部	
元本等	
元本	118,221,810,267
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	63,461,425,725
元本等合計	181,683,235,992
純資産合計	181,683,235,992
負債純資産合計	182,253,788,294

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10月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		118,221,810,267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)	1.5368円 (15,368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10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10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10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 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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	118,607,554,511円
期中追加設定元本額	11,146,990,634円
期中一部解約元本額	11,532,734,878円
期末元本額	118,221,810,267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）	743,562,912円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,875,365,069円
SBI資産設計オープン（分配型）	23,214,949円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,357,920,549円
世界経済インデックスファンド	1,803,085,961円
日本株式インデックス・オープン	6,969,612,953円
DCマイセレクション25	5,446,171,384円

区分	平成29年10月20日現在
DCマイセレクション50	16,551,915,670円
DCマイセレクション75	15,522,009,140円
DC日本株式インデックス・オープン	4,899,965,473円
DCマイセレクションS25	2,243,447,224円
DCマイセレクションS50	6,626,669,880円
DCマイセレクションS75	4,357,465,581円
DC日本株式インデックス・オープンS	4,372,283,671円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	411,676,988円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	562,010,976円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	326,173,128円
DC世界経済インデックスファンド	1,281,817,630円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	301,378,867円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	27,680,696円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	86,755,545円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	49,447,239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)	488,446,189円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,668,350円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	175,846,128円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	635,296,010円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	97,023,286円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	781,493,959円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,442,136,346円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	915,829,941円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,256,589,248円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	762,219,035円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	132,136,443円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	974,945,153円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,104,666,200円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	564,539,457円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	810,022,438円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	62,281,247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)	1,209,513,681円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,604,771,813円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,502,855,690円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	121,871,877円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	154,024,810円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,166,385円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,629,595円
SMT インデックスバランス・オープン	88,241,838円
SMT 世界経済インデックス・オープン	65,702円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	3,099,258円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	684,409円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	266,188円

区分	平成29年10月20日現在
F O F s 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）	10,261,848,106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10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		16,386,599,417
合計		16,386,599,417

(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10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	3,332,951,460	-	3,426,390,000	93,438,540
	合計	3,332,951,460	-	3,426,390,000	93,438,540

(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	3,675.00	11,392,500	
日本水産	102,900	677.00	69,663,300	
マルハニチロ	15,000	3,395.00	50,925,000	
カネコ種苗	2,700	1,589.00	4,290,300	
サカタのタネ	11,700	3,555.00	41,593,500	
ホクト	8,100	2,010.00	16,281,000	
ホクリヨウ	1,100	1,095.00	1,204,500	

住石ホールディングス	22,200	158.00	3,507,600
日鉄鉱業	2,200	8,090.00	17,798,000
三井松島産業	4,600	1,366.00	6,283,600
国際石油開発帝石	417,300	1,169.50	488,032,350
日本海洋掘削	2,800	2,133.00	5,972,400
石油資源開発	12,500	2,291.00	28,637,500
K&Oエナジーグループ	4,700	1,877.00	8,821,900
ショーボンドホールディングス	7,500	6,590.00	49,425,000
ミライト・ホールディングス	24,400	1,351.00	32,964,400
タマホーム	6,000	713.00	4,278,000
サンヨーホームズ	1,700	781.00	1,327,700
ファーストコーポレーション	1,800	1,119.00	2,014,200
インベスターズクラウド	1,400	6,710.00	9,394,000
ダイセキ環境ソリューション	2,200	1,380.00	3,036,000
安藤・間	57,000	847.00	48,279,000
東急建設	28,200	935.00	26,367,000
コムシスホールディングス	30,900	2,769.00	85,562,100
ミサワホーム	9,500	931.00	8,844,500
ピーアールホールディングス	7,900	399.00	3,152,100
高松コンストラクショングループ	6,000	3,015.00	18,090,000
東建コーポレーション	3,000	13,280.00	39,840,000
ソネック	1,000	855.00	855,000
ヤマウラ	3,800	948.00	3,602,400
大成建設	80,600	6,070.00	489,242,000
大林組	237,600	1,425.00	338,580,000
清水建設	242,400	1,284.00	311,241,600
飛鳥建設	77,200	162.00	12,506,400
長谷工コーポレーション	92,500	1,552.00	143,560,000
松井建設	8,800	978.00	8,606,400
銭高組	1,100	5,350.00	5,885,000
鹿島建設	348,000	1,142.00	397,416,000
不動テトラ	64,700	190.00	12,293,000
大末建設	2,900	982.00	2,847,800
鉄建建設	4,800	3,560.00	17,088,000
西松建設	18,300	3,315.00	60,664,500
三井住友建設	60,700	688.00	41,761,600
大豊建設	29,000	523.00	15,167,000
前田建設工業	52,200	1,349.00	70,417,800
佐田建設	5,500	472.00	2,596,000
ナカノフドー建設	6,200	624.00	3,868,800
奥村組	13,000	4,185.00	54,405,000
東鉄工業	9,500	3,610.00	34,295,000

イチケン	1,500	2,620.00	3,930,000	
浅沼組	28,000	365.00	10,220,000	
戸田建設	92,000	874.00	80,408,000	
熊谷組	12,400	3,460.00	42,904,000	
青木あすなろ建設	5,300	1,011.00	5,358,300	
北野建設	17,000	506.00	8,602,000	
植木組	1,000	2,709.00	2,709,000	
三井ホーム	10,000	680.00	6,800,000	
矢作建設工業	10,900	1,005.00	10,954,500	
ピーエス三菱	8,500	647.00	5,499,500	
日本ハウスホールディングス	15,100	660.00	9,966,000	
大東建託	28,700	20,595.00	591,076,500	
新日本建設	9,500	932.00	8,854,000	
N I P P O	18,000	2,286.00	41,148,000	
東亜道路工業	1,500	4,405.00	6,607,500	
前田道路	25,000	2,393.00	59,825,000	
日本道路	2,400	6,500.00	15,600,000	
東亜建設工業	6,400	2,182.00	13,964,800	
若築建設	4,600	1,846.00	8,491,600	
東洋建設	23,000	506.00	11,638,000	
五洋建設	87,900	722.00	63,463,800	
世紀東急工業	11,600	673.00	7,806,800	
福田組	2,600	6,550.00	17,030,000	
住友林業	54,600	1,852.00	101,119,200	
日本基礎技術	8,900	395.00	3,515,500	
日成ビルド工業	11,800	1,256.00	14,820,800	
巴コーポレーション	10,000	435.00	4,350,000	
大和ハウス工業	234,000	4,067.00	951,678,000	
ライト工業	15,200	1,113.00	16,917,600	
積水ハウス	242,600	2,008.50	487,262,100	
日特建設	6,800	605.00	4,114,000	
北陸電気工事	3,900	1,042.00	4,063,800	
ユアテック	12,600	853.00	10,747,800	
西部電気工業	1,300	2,496.00	3,244,800	
四電工	1,200	3,070.00	3,684,000	
中電工	8,900	3,335.00	29,681,500	
関電工	31,500	1,171.00	36,886,500	
きんでん	52,700	1,911.00	100,709,700	
東京エネシス	8,200	1,228.00	10,069,600	
トーエネック	2,200	3,390.00	7,458,000	
住友電設	5,500	2,143.00	11,786,500	
日本電設工業	12,200	2,406.00	29,353,200	

協和エクシオ	31,000	2,369.00	73,439,000
新日本空調	6,100	1,616.00	9,857,600
N D S	1,200	3,630.00	4,356,000
九電工	15,600	4,450.00	69,420,000
三機工業	16,800	1,260.00	21,168,000
日揮	74,000	1,851.00	136,974,000
中外炉工業	2,400	2,203.00	5,287,200
ヤマト	7,200	697.00	5,018,400
太平電業	5,400	2,647.00	14,293,800
高砂熱学工業	21,800	1,959.00	42,706,200
三晃金属工業	700	3,720.00	2,604,000
朝日工業社	1,800	3,400.00	6,120,000
明星工業	14,300	749.00	10,710,700
大気社	10,500	3,170.00	33,285,000
ダイダン	5,300	2,787.00	14,771,100
日比谷総合設備	8,800	2,481.00	21,832,800
東芝プラントシステム	12,900	1,955.00	25,219,500
O S J Bホールディングス	24,400	332.00	8,100,800
東洋エンジニアリング	9,400	1,318.00	12,389,200
千代田化工建設	57,200	637.00	36,436,400
新興プランテック	16,400	950.00	15,580,000
日本製粉	23,500	1,745.00	41,007,500
日清製粉グループ本社	86,800	2,018.00	175,162,400
日東富士製粉	500	4,020.00	2,010,000
昭和産業	6,500	2,929.00	19,038,500
鳥越製粉	6,400	883.00	5,651,200
中部飼料	8,700	2,018.00	17,556,600
フィード・ワン	48,100	288.00	13,852,800
東洋精糖	1,200	1,196.00	1,435,200
日本甜菜製糖	4,000	2,400.00	9,600,000
三井製糖	5,600	3,930.00	22,008,000
塩水港精糖	8,500	260.00	2,210,000
日新製糖	3,400	2,026.00	6,888,400
森永製菓	15,500	6,340.00	98,270,000
中村屋	1,800	5,060.00	9,108,000
江崎グリコ	19,800	6,300.00	124,740,000
名糖産業	3,400	1,499.00	5,096,600
不二家	4,500	2,526.00	11,367,000
山崎製パン	58,000	2,132.00	123,656,000
第一屋製パン	1,200	1,219.00	1,462,800
モロゾフ	1,200	7,340.00	8,808,000
亀田製菓	4,400	5,220.00	22,968,000

寿スピリッツ	7,500	4,295.00	32,212,500
カルビー	32,300	4,110.00	132,753,000
森永乳業	14,200	4,470.00	63,474,000
六甲バター	3,500	2,519.00	8,816,500
ヤクルト本社	42,500	9,110.00	387,175,000
明治ホールディングス	46,900	9,160.00	429,604,000
雪印メグミルク	17,100	3,195.00	54,634,500
プリマハム	50,000	748.00	37,400,000
日本ハム	56,000	3,280.00	183,680,000
林兼産業	2,600	929.00	2,415,400
丸大食品	38,000	553.00	21,014,000
S Foods	4,200	4,270.00	17,934,000
伊藤ハム米久ホールディングス	45,700	1,064.00	48,624,800
サッポロホールディングス	25,900	3,420.00	88,578,000
アサヒグループホールディングス	148,600	5,026.00	746,863,600
キリンホールディングス	341,100	2,747.00	937,001,700
宝ホールディングス	57,300	1,057.00	60,566,100
オエノンホールディングス	20,400	325.00	6,630,000
養命酒製造	2,400	2,189.00	5,253,600
コカ・コーラボトラーズジャパン	49,800	3,850.00	191,730,000
サントリー食品インターナショナル	54,300	5,190.00	281,817,000
ダイドーグループホールディングス	3,600	5,430.00	19,548,000
伊藤園	23,500	3,865.00	90,827,500
キーコーヒー	7,000	2,180.00	15,260,000
ユニカフェ	2,200	1,062.00	2,336,400
ジャパンフーズ	1,000	1,389.00	1,389,000
日清オイリオグループ	9,100	3,705.00	33,715,500
不二製油グループ本社	21,100	3,010.00	63,511,000
かどや製油	800	5,800.00	4,640,000
J - オイルミルズ	3,700	4,115.00	15,225,500
キッコーマン	55,400	3,710.00	205,534,000
味の素	163,200	2,260.00	368,832,000
キューピー	40,300	2,803.00	112,960,900
ハウス食品グループ本社	29,300	3,360.00	98,448,000
カゴメ	28,400	3,705.00	105,222,000
焼津水産化学工業	3,700	1,189.00	4,399,300
アリアケジャパン	6,500	8,710.00	56,615,000
ピエトロ	900	1,627.00	1,464,300
エバラ食品工業	1,700	2,097.00	3,564,900
ニチレイ	36,900	2,967.00	109,482,300
東洋水産	38,900	4,385.00	170,576,500
イトアンド	900	2,539.00	2,285,100

大冷	800	2,047.00	1,637,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	4,140.00	414,000
日清食品ホールディングス	30,900	7,130.00	220,317,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,323.00	10,584,000
一正蒲鉾	2,800	1,303.00	3,648,400
フジッコ	7,700	2,658.00	20,466,600
ロック・フィールド	7,600	1,994.00	15,154,400
日本たばこ産業	439,000	3,890.00	1,707,710,000
ケンコーマヨネーズ	4,300	2,900.00	12,470,000
わらべや日洋ホールディングス	4,600	2,818.00	12,962,800
なとり	4,000	1,974.00	7,896,000
イフジ産業	1,200	796.00	955,200
北の達人コーポレーション	3,400	1,182.00	4,018,800
ユーグレナ	27,400	1,160.00	31,784,000
ミヨシ油脂	2,700	1,466.00	3,958,200
理研ビタミン	2,300	4,340.00	9,982,000
片倉工業	8,600	1,398.00	12,022,800
ゲンゼ	5,500	5,250.00	28,875,000
東洋紡	29,400	2,076.00	61,034,400
ユニチカ	20,500	948.00	19,434,000
富士紡ホールディングス	3,600	3,895.00	14,022,000
倉敷紡績	75,000	316.00	23,700,000
シキボウ	4,000	1,568.00	6,272,000
日本毛織	21,100	992.00	20,931,200
トーア紡コーポレーション	3,200	603.00	1,929,600
ダイドーリミテッド	8,600	439.00	3,775,400
帝国繊維	7,800	2,340.00	18,252,000
帝人	60,600	2,331.00	141,258,600
東レ	537,200	1,092.50	586,891,000
サカイオーベックス	1,800	2,278.00	4,100,400
住江織物	20,000	314.00	6,280,000
日本フェルト	4,400	503.00	2,213,200
イチカワ	5,000	345.00	1,725,000
日東製網	800	1,869.00	1,495,200
アツギ	6,300	1,256.00	7,912,800
ダイニック	2,800	1,115.00	3,122,000
セーレン	18,500	1,931.00	35,723,500
ソトー	2,800	1,134.00	3,175,200
東海染工	1,100	1,538.00	1,691,800
小松精練	10,700	901.00	9,640,700
ワコールホールディングス	22,100	3,335.00	73,703,500
ホギメディカル	4,700	7,660.00	36,002,000

レナウン	20,200	199.00	4,019,800
クラウドシアホールディングス	2,100	575.00	1,207,500
T S Iホールディングス	30,800	978.00	30,122,400
三陽商会	4,000	1,864.00	7,456,000
オンワードホールディングス	48,000	951.00	45,648,000
ルック	13,000	404.00	5,252,000
ゴールドウイン	3,200	8,250.00	26,400,000
デサント	17,000	1,471.00	25,007,000
キング	4,000	496.00	1,984,000
ヤマトインターナショナル	5,000	426.00	2,130,000
特種東海製紙	4,300	4,525.00	19,457,500
王子ホールディングス	289,000	598.00	172,822,000
日本製紙	33,200	2,168.00	71,977,600
三菱製紙	10,600	744.00	7,886,400
北越紀州製紙	41,300	720.00	29,736,000
中越パルプ工業	2,900	2,133.00	6,185,700
巴川製紙所	11,000	288.00	3,168,000
大王製紙	29,500	1,393.00	41,093,500
阿波製紙	1,800	766.00	1,378,800
レンゴー	71,400	685.00	48,909,000
トーモク	4,700	1,958.00	9,202,600
ザ・パック	5,200	3,875.00	20,150,000
クラレ	124,600	2,172.00	270,631,200
旭化成	461,800	1,337.00	617,426,600
共和レザー	4,400	956.00	4,206,400
昭和電工	49,300	3,530.00	174,029,000
住友化学	545,000	705.00	384,225,000
住友精化	3,100	5,880.00	18,228,000
日産化学工業	39,800	4,050.00	161,190,000
ラサ工業	2,800	2,067.00	5,787,600
クレハ	5,600	6,500.00	36,400,000
多木化学	1,000	4,985.00	4,985,000
テイカ	5,500	2,611.00	14,360,500
石原産業	13,300	1,597.00	21,240,100
片倉コープアグリ	2,000	1,313.00	2,626,000
日東エフシー	4,400	859.00	3,779,600
日本曹達	44,000	674.00	29,656,000
東ソー	107,000	2,512.00	268,784,000
トクヤマ	23,000	2,617.00	60,191,000
セントラル硝子	15,100	2,479.00	37,432,900
東亜合成	43,500	1,516.00	65,946,000
大阪ソーダ	6,400	2,801.00	17,926,400

関東電化工業	15,300	1,155.00	17,671,500
デンカ	29,200	3,670.00	107,164,000
信越化学工業	132,800	10,965.00	1,456,152,000
日本カーバイド工業	2,500	2,237.00	5,592,500
堺化学工業	5,500	2,720.00	14,960,000
エア・ウォーター	61,100	2,134.00	130,387,400
大陽日酸	57,000	1,353.00	77,121,000
日本化学工業	2,700	2,533.00	6,839,100
東邦アセチレン	1,200	1,617.00	1,940,400
日本パーカラライジング	37,800	1,791.00	67,699,800
高压ガス工業	11,100	834.00	9,257,400
チタン工業	900	3,010.00	2,709,000
四国化成工業	10,700	1,749.00	18,714,300
戸田工業	1,500	4,660.00	6,990,000
ステラ ケミファ	3,600	4,330.00	15,588,000
保土谷化学工業	2,600	7,380.00	19,188,000
日本触媒	11,600	8,230.00	95,468,000
大日精化工業	6,100	5,080.00	30,988,000
カネカ	100,000	896.00	89,600,000
三菱瓦斯化学	69,000	2,673.00	184,437,000
三井化学	67,300	3,330.00	224,109,000
J S R	74,400	2,145.00	159,588,000
東京応化工業	13,900	4,255.00	59,144,500
大阪有機化学工業	4,800	1,306.00	6,268,800
三菱ケミカルホールディングス	498,900	1,124.00	560,763,600
K Hネオケム	11,300	2,565.00	28,984,500
ダイセル	99,900	1,389.00	138,761,100
住友ベークライト	65,000	881.00	57,265,000
積水化学工業	164,800	2,282.00	376,073,600
日本ゼオン	62,400	1,423.00	88,795,200
アイカ工業	23,800	3,710.00	88,298,000
宇部興産	37,300	3,250.00	121,225,000
積水樹脂	11,400	2,187.00	24,931,800
タキロンシーアイ	16,000	700.00	11,200,000
旭有機材	4,800	1,389.00	6,667,200
日立化成	41,200	3,035.00	125,042,000
ニチバン	3,500	2,441.00	8,543,500
リケンテクノス	16,100	691.00	11,125,100
大倉工業	18,000	767.00	13,806,000
積水化成品工業	10,300	1,377.00	14,183,100
群栄化学工業	1,800	3,870.00	6,966,000
タイガースポリマー	3,700	793.00	2,934,100

ミライアル	2,700	1,535.00	4,144,500
ダイキアクシス	2,500	1,233.00	3,082,500
ダイキョーニシカワ	13,000	1,834.00	23,842,000
竹本容器	800	1,911.00	1,528,800
日本化薬	48,100	1,769.00	85,088,900
カーリットホールディングス	6,900	749.00	5,168,100
日本精化	6,200	950.00	5,890,000
扶桑化学工業	5,300	3,475.00	18,417,500
A D E K A	31,800	1,972.00	62,709,600
日油	28,600	3,260.00	93,236,000
ハリマ化成グループ	6,300	992.00	6,249,600
花王	173,900	7,265.00	1,263,383,500
第一工業製薬	16,000	758.00	12,128,000
日華化学	2,400	1,121.00	2,690,400
ニイタカ	1,100	1,895.00	2,084,500
三洋化成工業	4,700	6,370.00	29,939,000
有機合成薬品工業	4,900	302.00	1,479,800
大日本塗料	8,500	1,663.00	14,135,500
日本ペイントホールディングス	57,100	3,880.00	221,548,000
関西ペイント	77,800	2,762.00	214,883,600
神東塗料	5,500	239.00	1,314,500
中国塗料	21,200	993.00	21,051,600
日本特殊塗料	5,200	1,901.00	9,885,200
藤倉化成	10,200	670.00	6,834,000
太陽ホールディングス	6,000	5,270.00	31,620,000
D I C	29,200	4,050.00	118,260,000
サカタインクス	15,100	2,047.00	30,909,700
東洋インキS Cホールディングス	73,000	642.00	46,866,000
T & K T O K A	5,400	1,265.00	6,831,000
富士フイルムホールディングス	146,900	4,526.00	664,869,400
資生堂	131,700	4,850.00	638,745,000
ライオン	98,500	2,160.00	212,760,000
高砂香料工業	4,900	3,915.00	19,183,500
マンダム	14,800	3,180.00	47,064,000
ミルボン	4,700	6,880.00	32,336,000
ファンケル	15,800	2,645.00	41,791,000
コーセー	12,000	14,620.00	175,440,000
コタ	3,100	1,371.00	4,250,100
シーズ・ホールディングス	9,600	4,130.00	39,648,000
シーボン	900	2,591.00	2,331,900
ポーラ・オルビスホールディングス	30,200	3,735.00	112,797,000
ノエビアホールディングス	4,700	6,600.00	31,020,000

アジュバンコスメジャパン	1,400	997.00	1,395,800
エステー	5,100	2,846.00	14,514,600
アグロ カネショウ	2,900	2,008.00	5,823,200
コニシ	11,600	1,962.00	22,759,200
長谷川香料	9,400	2,255.00	21,197,000
星光PMC	4,100	1,195.00	4,899,500
小林製薬	19,800	6,590.00	130,482,000
荒川化学工業	6,300	2,529.00	15,932,700
メック	5,800	1,693.00	9,819,400
日本高純度化学	2,100	2,692.00	5,653,200
タカラバイオ	21,200	1,488.00	31,545,600
JCU	4,700	4,660.00	21,902,000
新田ゼラチン	4,500	782.00	3,519,000
OATアグリオ	1,100	1,986.00	2,184,600
デクセリアルズ	19,500	1,326.00	25,857,000
アース製薬	5,300	5,140.00	27,242,000
北興化学工業	7,300	683.00	4,985,900
大成ラミック	2,300	3,090.00	7,107,000
クミアイ化学工業	32,200	790.00	25,438,000
日本農薬	18,400	637.00	11,720,800
アキレス	5,800	2,215.00	12,847,000
有沢製作所	12,700	984.00	12,496,800
日東電工	53,400	9,729.00	519,528,600
レック	4,600	2,747.00	12,636,200
きもと	13,400	260.00	3,484,000
藤森工業	5,500	3,680.00	20,240,000
前澤化成工業	4,800	1,258.00	6,038,400
JSP	3,500	3,655.00	12,792,500
エフピコ	6,600	5,920.00	39,072,000
天馬	4,900	2,379.00	11,657,100
信越ポリマー	14,500	1,037.00	15,036,500
東リ	17,800	388.00	6,906,400
ニフコ	13,000	7,000.00	91,000,000
日本バルカー工業	5,700	2,700.00	15,390,000
ユニ・チャーム	149,900	2,649.50	397,160,050
協和発酵キリン	88,600	2,022.00	179,149,200
武田薬品工業	277,700	6,326.00	1,756,730,200
アステラス製薬	726,600	1,524.50	1,107,701,700
大日本住友製薬	52,400	1,590.00	83,316,000
塩野義製薬	93,900	6,189.00	581,147,100
田辺三菱製薬	86,300	2,645.00	228,263,500
わかもと製薬	8,000	291.00	2,328,000

あすか製薬	8,100	1,913.00	15,495,300
日本新薬	17,000	7,890.00	134,130,000
ピオフェルミン製薬	1,200	3,030.00	3,636,000
中外製薬	73,700	5,310.00	391,347,000
科研製薬	13,800	5,910.00	81,558,000
エーザイ	91,100	6,025.00	548,877,500
ロート製薬	36,200	2,627.00	95,097,400
小野薬品工業	168,100	2,701.00	454,038,100
久光製薬	20,900	6,140.00	128,326,000
持田製薬	5,000	8,770.00	43,850,000
参天製薬	133,800	1,835.00	245,523,000
扶桑薬品工業	2,500	2,815.00	7,037,500
日本ケミファ	1,000	5,190.00	5,190,000
ツムラ	24,900	4,210.00	104,829,000
日医工	17,300	1,775.00	30,707,500
キッセイ薬品工業	13,100	3,135.00	41,068,500
生化学工業	13,700	2,073.00	28,400,100
栄研化学	6,200	4,410.00	27,342,000
日水製薬	3,000	1,469.00	4,407,000
鳥居薬品	4,400	3,180.00	13,992,000
JCRファーマ	5,700	3,685.00	21,004,500
東和薬品	3,400	5,700.00	19,380,000
富士製薬工業	2,400	3,900.00	9,360,000
沢井製薬	12,600	6,560.00	82,656,000
ゼリア新薬工業	15,200	1,959.00	29,776,800
第一三共	217,900	2,515.50	548,127,450
キョーリン製薬ホールディングス	18,100	2,350.00	42,535,000
大幸薬品	3,700	2,301.00	8,513,700
ダイト	4,400	2,777.00	12,218,800
大塚ホールディングス	146,900	4,772.00	701,006,800
大正製薬ホールディングス	15,800	8,950.00	141,410,000
ペプチドリーム	29,000	3,475.00	100,775,000
日本コークス工業	60,300	118.00	7,115,400
昭和シェル石油	66,200	1,270.00	84,074,000
ニチレキ	9,000	1,371.00	12,339,000
ユシロ化学工業	4,000	1,640.00	6,560,000
ビーピー・カストロール	3,000	1,986.00	5,958,000
富士石油	17,300	406.00	7,023,800
MORESCO	2,500	2,062.00	5,155,000
出光興産	45,700	3,105.00	141,898,500
JXTGホールディングス	1,128,900	574.00	647,988,600
コスモエネルギーホールディングス	22,300	2,490.00	55,527,000

横浜ゴム	40,900	2,485.00	101,636,500
東洋ゴム工業	41,900	2,595.00	108,730,500
ブリヂストン	249,900	5,514.00	1,377,948,600
住友ゴム工業	69,300	2,096.00	145,252,800
藤倉ゴム工業	6,200	870.00	5,394,000
オカモト	22,000	1,161.00	25,542,000
フコク	3,100	1,157.00	3,586,700
ニッタ	6,600	4,470.00	29,502,000
住友理工	13,700	1,171.00	16,042,700
三ツ星ベルト	17,000	1,352.00	22,984,000
バンドー化学	13,500	1,215.00	16,402,500
日東紡績	12,000	3,440.00	41,280,000
旭硝子	72,300	4,305.00	311,251,500
日本板硝子	33,700	899.00	30,296,300
石塚硝子	1,000	2,411.00	2,411,000
日本山村硝子	30,000	196.00	5,880,000
日本電気硝子	30,600	4,415.00	135,099,000
オハラ	2,800	2,089.00	5,849,200
住友大阪セメント	138,000	505.00	69,690,000
太平洋セメント	44,700	4,405.00	196,903,500
日本ヒューム	7,200	751.00	5,407,200
日本コンクリート工業	16,800	455.00	7,644,000
三谷セキサン	3,700	2,626.00	9,716,200
アジアパイルホールディングス	9,300	628.00	5,840,400
東海カーボン	64,300	1,061.00	68,222,300
日本カーボン	3,700	4,640.00	17,168,000
東洋炭素	4,600	2,711.00	12,470,600
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	5,260.00	22,092,000
TOTO	54,400	4,875.00	265,200,000
日本碍子	93,500	2,189.00	204,671,500
日本特殊陶業	60,700	2,494.00	151,385,800
MARUWA	2,700	6,370.00	17,199,000
品川リフラクトリーズ	1,900	3,640.00	6,916,000
黒崎播磨	1,600	5,210.00	8,336,000
ヨータイ	4,500	450.00	2,025,000
イソライト工業	3,700	797.00	2,948,900
東京窯業	9,200	372.00	3,422,400
ニッカトー	2,600	610.00	1,586,000
フジミインコーポレーテッド	6,300	2,574.00	16,216,200
ニチアス	39,000	1,390.00	54,210,000
ニチハ	9,900	4,355.00	43,114,500
新日鐵住金	333,800	2,676.50	893,415,700

神戸製鋼所	128,000	868.00	111,104,000
中山製鋼所	8,400	761.00	6,392,400
合同製鐵	4,100	2,235.00	9,163,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	202,300	2,313.00	467,919,900
日新製鋼	24,100	1,574.00	37,933,400
東京製鐵	37,400	937.00	35,043,800
共英製鋼	7,900	1,784.00	14,093,600
大和工業	14,900	3,055.00	45,519,500
東京鐵鋼	3,100	2,179.00	6,754,900
大阪製鐵	4,600	2,500.00	11,500,000
淀川製鋼所	10,200	3,195.00	32,589,000
東洋鋼鋳	17,900	508.00	9,093,200
丸一鋼管	24,800	3,340.00	82,832,000
モリ工業	2,300	2,775.00	6,382,500
大同特殊鋼	12,400	6,690.00	82,956,000
日本高周波鋼業	2,600	984.00	2,558,400
日本冶金工業	61,200	231.00	14,137,200
山陽特殊製鋼	8,800	2,898.00	25,502,400
愛知製鋼	4,400	4,495.00	19,778,000
日立金属	75,300	1,600.00	120,480,000
日本金属	1,800	3,015.00	5,427,000
大平洋金属	4,700	3,170.00	14,899,000
新日本電工	41,900	458.00	19,190,200
栗本鐵工所	3,500	2,320.00	8,120,000
虹技	1,000	2,239.00	2,239,000
日本鑄鉄管	7,000	186.00	1,302,000
三菱製鋼	5,200	2,902.00	15,090,400
日亜鋼業	10,300	321.00	3,306,300
日本精線	1,000	4,715.00	4,715,000
シンニッタン	6,100	734.00	4,477,400
新家工業	1,600	2,136.00	3,417,600
大紀アルミニウム工業所	12,700	856.00	10,871,200
日本輕金属ホールディングス	190,900	335.00	63,951,500
三井金属鋳業	20,100	5,530.00	111,153,000
東邦亜鉛	4,200	5,010.00	21,042,000
三菱マテリアル	46,200	4,100.00	189,420,000
住友金属鋳山	95,800	4,284.00	410,407,200
D O W A ホールディングス	16,400	4,545.00	74,538,000
古河機械金属	11,600	1,968.00	22,828,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,200	1,598.00	13,103,600
東邦チタニウム	12,700	870.00	11,049,000
U A C J	10,500	3,160.00	33,180,000

古河電気工業	24,800	6,510.00	161,448,000
住友電気工業	278,900	1,857.00	517,917,300
フジクラ	97,500	903.00	88,042,500
昭和電線ホールディングス	8,900	1,005.00	8,944,500
東京特殊電線	1,100	2,425.00	2,667,500
タツタ電線	14,100	792.00	11,167,200
沖電線	800	3,060.00	2,448,000
カナレ電気	1,200	2,523.00	3,027,600
平河ヒューテック	3,600	1,490.00	5,364,000
リョービ	8,600	3,110.00	26,746,000
アーレスティ	8,700	978.00	8,508,600
アサヒホールディングス	11,200	2,391.00	26,779,200
稲葉製作所	3,900	1,403.00	5,471,700
宮地エンジニアリンググループ	2,100	2,961.00	6,218,100
トーカロ	4,900	4,185.00	20,506,500
アルファC o	2,500	2,299.00	5,747,500
SUMCO	64,400	2,069.00	133,243,600
川田テクノロジーズ	1,400	6,280.00	8,792,000
RS Technologies	1,000	3,905.00	3,905,000
東洋製罐グループホールディングス	52,600	1,986.00	104,463,600
ホッカンホールディングス	19,000	416.00	7,904,000
コロナ	3,900	1,219.00	4,754,100
横河ブリッジホールディングス	13,000	2,087.00	27,131,000
駒井ハルテック	1,400	2,521.00	3,529,400
高田機工	600	3,220.00	1,932,000
三和ホールディングス	72,200	1,347.00	97,253,400
文化シャッター	20,600	903.00	18,601,800
三協立山	9,700	1,602.00	15,539,400
アルインコ	5,100	1,250.00	6,375,000
東洋シャッター	1,900	620.00	1,178,000
LIXILグループ	103,100	3,045.00	313,939,500
日本フィルコン	5,400	829.00	4,476,600
ノーリツ	15,600	2,034.00	31,730,400
長府製作所	7,900	2,762.00	21,819,800
リンナイ	12,500	9,710.00	121,375,000
ダイニチ工業	3,800	819.00	3,112,200
日東精工	9,800	651.00	6,379,800
三洋工業	900	2,193.00	1,973,700
岡部	14,300	1,049.00	15,000,700
ジーテクト	7,700	2,307.00	17,763,900
東プレ	14,200	3,430.00	48,706,000
高周波熱錬	13,600	1,106.00	15,041,600

東京製綱	5,000	1,680.00	8,400,000
サンコール	4,000	678.00	2,712,000
モリテック スチール	3,800	627.00	2,382,600
パイオラックス	11,200	3,070.00	34,384,000
エイチワン	5,600	1,241.00	6,949,600
日本発條	69,700	1,277.00	89,006,900
中央発條	800	3,710.00	2,968,000
アドバネクス	1,300	2,853.00	3,708,900
立川ブラインド工業	3,100	1,259.00	3,902,900
三益半導体工業	6,200	1,850.00	11,470,000
日本ドライケミカル	900	2,404.00	2,163,600
日本製鋼所	24,600	2,844.00	69,962,400
三浦工業	30,400	2,599.00	79,009,600
タクマ	23,900	1,391.00	33,244,900
ツガミ	20,000	1,069.00	21,380,000
オークマ	9,700	6,440.00	62,468,000
東芝機械	40,000	694.00	27,760,000
アマダホールディングス	99,800	1,290.00	128,742,000
アイダエンジニアリング	21,200	1,312.00	27,814,400
滝澤鉄工所	2,200	1,895.00	4,169,000
富士機械製造	22,500	2,134.00	48,015,000
牧野フライス製作所	37,000	996.00	36,852,000
オーエスジー	31,700	2,442.00	77,411,400
ダイジェット工業	1,000	1,893.00	1,893,000
旭ダイヤモンド工業	21,000	1,032.00	21,672,000
D M G 森精機	38,800	2,142.00	83,109,600
ソディック	18,800	1,469.00	27,617,200
ディスコ	8,700	24,380.00	212,106,000
日東工器	4,300	2,778.00	11,945,400
パンチ工業	2,700	1,865.00	5,035,500
富士ダイス	2,700	860.00	2,322,000
豊和工業	4,300	2,065.00	8,879,500
O K K	2,900	1,220.00	3,538,000
東洋機械金属	5,000	859.00	4,295,000
島精機製作所	9,700	6,050.00	58,685,000
N C ホールディングス	2,400	843.00	2,023,200
フリーー	4,400	1,148.00	5,051,200
ヤマシンフィルタ	1,900	3,755.00	7,134,500
日阪製作所	10,200	992.00	10,118,400
やまびこ	13,600	1,452.00	19,747,200
平田機工	2,500	11,720.00	29,300,000
ペガサスミシン製造	7,200	778.00	5,601,600

ナブテスコ	38,500	4,295.00	165,357,500
三井海洋開発	7,400	2,628.00	19,447,200
レオン自動機	6,200	1,635.00	10,137,000
S M C	22,200	40,700.00	903,540,000
新川	6,200	831.00	5,152,200
ホソカワミクロン	2,600	6,210.00	16,146,000
ユニオンツール	3,200	3,455.00	11,056,000
オイレス工業	9,000	2,170.00	19,530,000
日精エー・エス・ビー機械	2,400	4,575.00	10,980,000
サトーホールディングス	9,200	2,661.00	24,481,200
技研製作所	3,500	3,380.00	11,830,000
日本エアーテック	2,400	851.00	2,042,400
日精樹脂工業	6,100	1,418.00	8,649,800
オカダアイヨン	2,100	1,900.00	3,990,000
ワイエイシイホールディングス	2,800	1,094.00	3,063,200
小松製作所	341,400	3,500.00	1,194,900,000
住友重機械工業	43,200	4,715.00	203,688,000
日立建機	33,100	3,660.00	121,146,000
日工	2,300	2,191.00	5,039,300
巴工業	3,000	2,255.00	6,765,000
井関農機	7,200	2,373.00	17,085,600
T O W A	6,000	1,911.00	11,466,000
丸山製作所	1,700	1,872.00	3,182,400
北川鉄工所	3,400	2,874.00	9,771,600
ローツェ	3,500	2,815.00	9,852,500
タカキタ	2,500	639.00	1,597,500
クボタ	381,500	2,035.50	776,543,250
荏原実業	2,100	1,713.00	3,597,300
三菱化工機	2,500	2,401.00	6,002,500
月島機械	14,200	1,313.00	18,644,600
帝国電機製作所	5,400	1,176.00	6,350,400
新東工業	17,000	1,278.00	21,726,000
澁谷工業	6,300	4,055.00	25,546,500
アイチ コーポレーション	10,600	807.00	8,554,200
小森コーポレーション	18,000	1,448.00	26,064,000
鶴見製作所	5,600	1,927.00	10,791,200
住友精密工業	12,000	363.00	4,356,000
酒井重工業	1,500	3,550.00	5,325,000
荏原製作所	33,600	3,910.00	131,376,000
石井鐵工所	1,100	1,795.00	1,974,500
西島製作所	7,300	1,165.00	8,504,500
北越工業	8,000	1,075.00	8,600,000

ダイキン工業	96,500	11,955.00	1,153,657,500
オルガノ	2,800	2,782.00	7,789,600
トーヨーカネツ	3,300	4,015.00	13,249,500
栗田工業	40,900	3,335.00	136,401,500
椿本チエイン	42,000	911.00	38,262,000
大同工業	3,100	1,668.00	5,170,800
木村化工機	7,000	432.00	3,024,000
アネスト岩田	12,800	1,113.00	14,246,400
ダイフク	35,300	5,190.00	183,207,000
サムコ	2,000	1,039.00	2,078,000
加藤製作所	4,000	3,225.00	12,900,000
油研工業	1,500	2,591.00	3,886,500
タダノ	37,200	1,409.00	52,414,800
フジテック	20,600	1,528.00	31,476,800
C K D	21,200	2,372.00	50,286,400
キトー	8,900	1,372.00	12,210,800
平和	21,900	2,238.00	49,012,200
理想科学工業	7,000	2,074.00	14,518,000
S A N K Y O	19,700	3,770.00	74,269,000
日本金銭機械	6,600	1,183.00	7,807,800
マースエンジニアリング	4,000	2,316.00	9,264,000
福島工業	4,400	4,265.00	18,766,000
オーイズミ	3,000	553.00	1,659,000
ダイコク電機	2,900	1,773.00	5,141,700
竹内製作所	12,900	2,301.00	29,682,900
アマノ	21,900	2,709.00	59,327,100
J U K I	10,500	1,624.00	17,052,000
サンデンホールディングス	8,600	2,172.00	18,679,200
蛇の目ミシン工業	6,900	774.00	5,340,600
マックス	10,900	1,568.00	17,091,200
グローリー	22,600	4,260.00	96,276,000
新晃工業	6,600	1,744.00	11,510,400
大和冷機工業	11,400	1,240.00	14,136,000
セガサミーホールディングス	70,100	1,633.00	114,473,300
日本ピストンリング	2,800	2,450.00	6,860,000
リケン	3,300	5,920.00	19,536,000
T P R	7,900	3,880.00	30,652,000
ツバキ・ナカシマ	7,100	2,400.00	17,040,000
ホシザキ	22,300	10,330.00	230,359,000
大豊工業	5,700	1,700.00	9,690,000
日本精工	145,200	1,555.00	225,786,000
N T N	163,600	500.00	81,800,000

ジェイテクト	75,400	1,659.00	125,088,600
不二越	66,000	659.00	43,494,000
日本トムソン	22,600	627.00	14,170,200
T H K	49,900	3,950.00	197,105,000
ユーシン精機	3,100	3,160.00	9,796,000
前澤給装工業	2,600	1,833.00	4,765,800
イーグル工業	7,600	2,109.00	16,028,400
前澤工業	4,800	407.00	1,953,600
日本ピラー工業	7,100	1,680.00	11,928,000
キッツ	33,900	918.00	31,120,200
マキタ	92,200	4,495.00	414,439,000
日立造船	56,500	583.00	32,939,500
三菱重工業	118,500	4,523.00	535,975,500
I H I	54,400	3,905.00	212,432,000
スター精密	12,400	1,992.00	24,700,800
日清紡ホールディングス	44,800	1,310.00	58,688,000
イビデン	49,500	1,814.00	89,793,000
コニカミノルタ	165,600	975.00	161,460,000
ブラザー工業	86,400	2,765.00	238,896,000
ミネベアミツミ	128,700	1,921.00	247,232,700
日立製作所	1,698,000	857.60	1,456,204,800
三菱電機	754,100	1,908.00	1,438,822,800
富士電機	213,000	680.00	144,840,000
東洋電機製造	3,000	1,986.00	5,958,000
安川電機	82,000	4,035.00	330,870,000
シンフォニアテクノロジー	46,000	441.00	20,286,000
明電舎	65,000	440.00	28,600,000
オリジン電気	2,000	1,994.00	3,988,000
山洋電気	3,700	6,150.00	22,755,000
デンヨー	6,500	1,881.00	12,226,500
東芝テック	44,000	631.00	27,764,000
芝浦メカトロニクス	12,000	399.00	4,788,000
マブチモーター	19,700	5,840.00	115,048,000
日本電産	91,600	14,180.00	1,298,888,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,200	2,244.00	4,936,800
東光高岳	3,600	1,909.00	6,872,400
ダブル・スコープ	10,300	2,197.00	22,629,100
ダイヘン	39,000	979.00	38,181,000
ヤーマン	900	13,460.00	12,114,000
J V C ケンウッド	52,100	339.00	17,661,900
ミマキエンジニアリング	6,400	856.00	5,478,400
第一精工	3,300	2,518.00	8,309,400

日新電機	14,200	1,414.00	20,078,800
大崎電気工業	14,200	862.00	12,240,400
オムロン	75,100	6,210.00	466,371,000
日東工業	10,400	1,964.00	20,425,600
I D E C	8,300	2,291.00	19,015,300
不二電機工業	800	1,375.00	1,100,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	136,000	597.00	81,192,000
サクサホールディングス	1,800	2,076.00	3,736,800
メルコホールディングス	3,900	3,545.00	13,825,500
テクノメディカ	1,600	1,952.00	3,123,200
日本電気	97,200	3,090.00	300,348,000
富士通	682,000	896.90	611,685,800
沖電気工業	30,600	1,554.00	47,552,400
岩崎通信機	3,100	833.00	2,582,300
電気興業	4,000	2,886.00	11,544,000
サンケン電気	41,000	643.00	26,363,000
ナカヨ	1,400	1,914.00	2,679,600
アイホン	4,000	1,842.00	7,368,000
ルネサスエレクトロニクス	36,700	1,280.00	46,976,000
セイコーエプソン	105,300	2,828.00	297,788,400
ワコム	55,000	480.00	26,400,000
アルバック	11,900	7,350.00	87,465,000
アクセル	3,000	789.00	2,367,000
E I Z O	7,000	4,450.00	31,150,000
ジャパンディスプレイ	132,000	239.00	31,548,000
日本信号	19,500	1,210.00	23,595,000
京三製作所	17,000	640.00	10,880,000
能美防災	8,100	1,844.00	14,936,400
ホーチキ	5,200	2,176.00	11,315,200
エレコム	6,200	2,231.00	13,832,200
パナソニック	811,900	1,637.00	1,329,080,300
アンリツ	51,500	940.00	48,410,000
富士通ゼネラル	24,000	2,269.00	54,456,000
日立国際電気	18,500	3,090.00	57,165,000
ソニー	499,600	4,237.00	2,116,805,200
T D K	39,800	7,840.00	312,032,000
帝国通信工業	3,200	1,121.00	3,587,200
タムラ製作所	27,400	656.00	17,974,400
アルプス電気	65,300	3,120.00	203,736,000
池上通信機	22,000	165.00	3,630,000
パイオニア	106,200	218.00	23,151,600
日本電波工業	6,900	833.00	5,747,700

鈴木	2,800	974.00	2,727,200
日本トリム	1,700	4,845.00	8,236,500
ローランド ディー・ジー	3,600	2,958.00	10,648,800
フォスター電機	8,300	2,321.00	19,264,300
クラリオン	37,000	448.00	16,576,000
S M K	18,000	521.00	9,378,000
ヨコオ	5,100	1,381.00	7,043,100
ホシデン	20,900	1,763.00	36,846,700
ヒロセ電機	11,400	16,190.00	184,566,000
日本航空電子工業	20,000	1,777.00	35,540,000
T O A	8,400	1,168.00	9,811,200
マクセルホールディングス	10,600	2,600.00	27,560,000
古野電気	9,200	780.00	7,176,000
ユニデンホールディングス	21,000	347.00	7,287,000
アルパイン	16,800	2,162.00	36,321,600
スミダコーポレーション	7,300	1,973.00	14,402,900
アイコム	3,900	2,587.00	10,089,300
リオン	2,700	2,204.00	5,950,800
本多通信工業	3,100	1,726.00	5,350,600
船井電機	8,000	908.00	7,264,000
横河電機	76,700	2,031.00	155,777,700
新電元工業	2,700	7,130.00	19,251,000
アズビル	21,200	4,830.00	102,396,000
東亜ディーケーケー	3,600	859.00	3,092,400
日本光電工業	29,600	2,563.00	75,864,800
チノー	2,400	1,283.00	3,079,200
共和電業	8,100	440.00	3,564,000
日本電子材料	2,800	691.00	1,934,800
堀場製作所	14,000	6,510.00	91,140,000
アドバンテスト	48,200	2,408.00	116,065,600
小野測器	3,100	736.00	2,281,600
エスベック	6,300	2,224.00	14,011,200
キーエンス	32,000	60,710.00	1,942,720,000
日置電機	3,700	2,442.00	9,035,400
シスメックス	55,000	7,580.00	416,900,000
日本マイクロニクス	12,400	1,063.00	13,181,200
メガチップス	6,600	3,540.00	23,364,000
O B A R A G R O U P	4,100	6,410.00	26,281,000
澤藤電機	900	2,721.00	2,448,900
コーセル	9,900	1,492.00	14,770,800
イリソ電子工業	5,900	5,630.00	33,217,000
新日本無線	6,100	829.00	5,056,900

オブテックスグループ	5,800	4,360.00	25,288,000
千代田インテグレ	3,400	2,670.00	9,078,000
アイ・オー・データ機器	3,000	1,095.00	3,285,000
レーザーテック	15,600	2,343.00	36,550,800
スタンレー電気	50,300	4,085.00	205,475,500
岩崎電気	2,600	1,953.00	5,077,800
ウシオ電機	43,000	1,592.00	68,456,000
岡谷電機産業	3,900	516.00	2,012,400
ハリオス テクノ ホールディング	6,700	723.00	4,844,100
日本セラミック	7,200	3,045.00	21,924,000
遠藤照明	3,600	1,316.00	4,737,600
古河電池	5,000	1,220.00	6,100,000
双信電機	3,500	850.00	2,975,000
山一電機	6,700	2,032.00	13,614,400
図研	4,600	1,825.00	8,395,000
日本電子	26,000	555.00	14,430,000
カシオ計算機	56,900	1,678.00	95,478,200
ファナック	71,700	25,000.00	1,792,500,000
日本シイエムケイ	15,400	1,129.00	17,386,600
エンプラス	3,200	4,795.00	15,344,000
大真空	2,600	1,834.00	4,768,400
ローム	34,200	10,000.00	342,000,000
浜松ホトニクス	51,500	3,590.00	184,885,000
三井ハイテック	9,400	2,245.00	21,103,000
新光電気工業	26,800	806.00	21,600,800
京セラ	116,100	7,318.00	849,619,800
太陽誘電	34,400	1,764.00	60,681,600
村田製作所	74,200	16,990.00	1,260,658,000
ユーシン	10,100	788.00	7,958,800
双葉電子工業	11,600	2,098.00	24,336,800
北陸電気工業	2,900	1,514.00	4,390,600
ニチコン	22,300	1,391.00	31,019,300
日本ケミコン	6,100	3,845.00	23,454,500
K O A	9,800	2,181.00	21,373,800
市光工業	15,000	856.00	12,840,000
小糸製作所	42,400	7,530.00	319,272,000
ミツバ	13,100	1,794.00	23,501,400
S C R E E Nホールディングス	14,500	8,420.00	122,090,000
キャノン電子	6,500	2,310.00	15,015,000
キャノン	380,600	4,030.00	1,533,818,000
リコー	212,600	1,159.00	246,403,400
M U T O Hホールディングス	1,000	2,574.00	2,574,000

東京エレクトロン	47,100	18,715.00	881,476,500
トヨタ紡織	24,700	2,450.00	60,515,000
芦森工業	1,600	3,085.00	4,936,000
ユニプレス	13,700	3,070.00	42,059,000
豊田自動織機	64,400	6,960.00	448,224,000
モリタホールディングス	12,400	1,871.00	23,200,400
三櫻工業	9,100	964.00	8,772,400
デンソー	174,300	5,740.00	1,000,482,000
東海理化電機製作所	18,600	2,350.00	43,710,000
三井造船	25,900	1,433.00	37,114,700
川崎重工業	55,100	3,880.00	213,788,000
名村造船所	21,200	694.00	14,712,800
サノヤスホールディングス	8,700	337.00	2,931,900
三菱ロジスネクスト	9,000	794.00	7,146,000
近畿車輛	1,100	2,621.00	2,883,100
日産自動車	834,200	1,079.00	900,101,800
いすゞ自動車	205,200	1,580.50	324,318,600
トヨタ自動車	859,500	6,999.00	6,015,640,500
日野自動車	101,200	1,428.00	144,513,600
三菱自動車工業	259,600	896.00	232,601,600
エフテック	4,100	1,786.00	7,322,600
レシップホールディングス	2,300	929.00	2,136,700
G M B	1,100	1,512.00	1,663,200
ファルテック	1,200	1,390.00	1,668,000
武蔵精密工業	8,200	3,475.00	28,495,000
日産車体	31,400	1,241.00	38,967,400
新明和工業	29,000	1,029.00	29,841,000
極東開発工業	14,300	1,863.00	26,640,900
日信工業	15,800	2,039.00	32,216,200
トピー工業	5,800	3,670.00	21,286,000
ティラド	2,700	4,340.00	11,718,000
曙ブレーキ工業	32,800	363.00	11,906,400
タチエス	12,000	2,037.00	24,444,000
N O K	34,200	2,691.00	92,032,200
フタバ産業	21,500	1,195.00	25,692,500
K Y B	7,900	6,930.00	54,747,000
大同メタル工業	9,000	1,029.00	9,261,000
プレス工業	37,500	601.00	22,537,500
ミクニ	9,100	594.00	5,405,400
太平洋工業	16,000	1,404.00	22,464,000
ケーヒン	16,200	2,028.00	32,853,600
河西工業	9,500	1,614.00	15,333,000

アイシン精機	64,700	6,110.00	395,317,000
富士機工	7,200	737.00	5,306,400
マツダ	224,100	1,597.00	357,887,700
今仙電機製作所	6,500	1,420.00	9,230,000
本田技研工業	636,300	3,428.00	2,181,236,400
スズキ	140,200	5,928.00	831,105,600
S U B A R U	219,600	3,975.00	872,910,000
安永	3,400	3,410.00	11,594,000
ヤマハ発動機	100,000	3,290.00	329,000,000
ショーワ	18,400	1,395.00	25,668,000
T B K	9,100	509.00	4,631,900
エクセディ	9,600	3,345.00	32,112,000
豊田合成	22,800	2,835.00	64,638,000
愛三工業	12,500	1,074.00	13,425,000
盟和産業	1,100	1,300.00	1,430,000
ヨロズ	6,600	2,305.00	15,213,000
エフ・シー・シー	11,600	2,512.00	29,139,200
シマノ	28,500	15,050.00	428,925,000
テイ・エス テック	16,400	3,935.00	64,534,000
ジャムコ	4,100	2,246.00	9,208,600
テルモ	108,400	4,640.00	502,976,000
クリエートメディック	2,400	1,053.00	2,527,200
日機装	24,500	1,033.00	25,308,500
島津製作所	91,000	2,271.00	206,661,000
J M S	6,500	695.00	4,517,500
長野計器	5,600	1,181.00	6,613,600
ブイ・テクノロジー	1,400	19,030.00	26,642,000
東京計器	4,900	1,526.00	7,477,400
愛知時計電機	900	3,925.00	3,532,500
インターアクション	2,700	751.00	2,027,700
オーバル	7,100	383.00	2,719,300
東京精密	13,700	4,090.00	56,033,000
マニー	8,600	3,210.00	27,606,000
ニコン	123,200	2,026.00	249,603,200
トプコン	35,600	2,266.00	80,669,600
オリンパス	112,800	4,010.00	452,328,000
理研計器	6,200	2,392.00	14,830,400
タムロン	5,700	2,275.00	12,967,500
H O Y A	145,500	6,351.00	924,070,500
シード	900	3,765.00	3,388,500
ノーリツ鋼機	7,200	1,451.00	10,447,200
エー・アンド・デイ	6,600	522.00	3,445,200

シチズン時計	77,400	811.00	62,771,400
リズム時計工業	2,800	2,323.00	6,504,400
大研医器	6,400	777.00	4,972,800
メニコン	4,900	5,020.00	24,598,000
松風	3,700	1,331.00	4,924,700
セイコーホールディングス	10,000	2,494.00	24,940,000
ニプロ	48,900	1,651.00	80,733,900
スノーピーク	1,100	2,958.00	3,253,800
パラマウントベッドホールディングス	6,800	4,960.00	33,728,000
トランザクション	3,200	1,077.00	3,446,400
S H O - B I	2,400	440.00	1,056,000
ニホンフラッシュ	3,300	1,706.00	5,629,800
前田工織	7,100	1,858.00	13,191,800
永大産業	9,000	550.00	4,950,000
アートネイチャー	7,600	705.00	5,358,000
ダンロップスポーツ	4,500	1,633.00	7,348,500
バンダイナムコホールディングス	78,000	3,940.00	307,320,000
アイフィスジャパン	1,600	559.00	894,400
共立印刷	11,900	350.00	4,165,000
S H O E I	3,200	3,300.00	10,560,000
フランスベッドホールディングス	8,500	1,041.00	8,848,500
パイロットコーポレーション	12,300	5,560.00	68,388,000
萩原工業	2,000	3,875.00	7,750,000
トッパン・フォームズ	12,600	1,253.00	15,787,800
フジシールインターナショナル	15,800	3,465.00	54,747,000
タカラトミー	27,500	1,761.00	48,427,500
廣済堂	7,200	513.00	3,693,600
A s - m e エステール	1,900	736.00	1,398,400
アーク	30,000	109.00	3,270,000
タカノ	3,100	1,246.00	3,862,600
プロネクサス	6,600	1,341.00	8,850,600
ホクシン	5,000	214.00	1,070,000
ウッドワン	2,400	1,842.00	4,420,800
大建工業	5,000	2,970.00	14,850,000
凸版印刷	200,000	1,149.00	229,800,000
大日本印刷	99,600	2,681.00	267,027,600
図書印刷	4,700	1,096.00	5,151,200
共同印刷	2,200	3,695.00	8,129,000
N I S S H A	12,600	3,415.00	43,029,000
光村印刷	600	2,486.00	1,491,600
宝印刷	3,700	1,745.00	6,456,500
アシックス	70,200	1,724.00	121,024,800

ツツミ	2,600	1,987.00	5,166,200
小松ウオール工業	2,400	2,048.00	4,915,200
ヤマハ	47,600	4,290.00	204,204,000
河合楽器製作所	2,800	2,388.00	6,686,400
クリナップ	7,500	863.00	6,472,500
ピジョン	42,700	3,930.00	167,811,000
兼松サステック	700	2,298.00	1,608,600
キングジム	5,900	1,018.00	6,006,200
リンテック	16,800	2,970.00	49,896,000
イトーキ	15,000	932.00	13,980,000
任天堂	43,500	43,620.00	1,897,470,000
三菱鉛筆	11,600	2,834.00	32,874,400
タカラスタANDARD	14,600	1,951.00	28,484,600
コクヨ	33,900	1,949.00	66,071,100
ナカバヤシ	6,300	691.00	4,353,300
グローブライド	3,400	1,958.00	6,657,200
岡村製作所	24,700	1,253.00	30,949,100
美津濃	7,600	3,220.00	24,472,000
東京電力ホールディングス	599,700	466.00	279,460,200
中部電力	232,900	1,431.50	333,396,350
関西電力	288,500	1,552.00	447,752,000
中国電力	97,700	1,262.00	123,297,400
北陸電力	69,300	974.00	67,498,200
東北電力	176,600	1,508.00	266,312,800
四国電力	63,700	1,376.00	87,651,200
九州電力	156,100	1,278.00	199,495,800
北海道電力	66,200	825.00	54,615,000
沖縄電力	11,400	2,542.00	28,978,800
電源開発	56,300	2,843.00	160,060,900
エフオン	3,500	1,417.00	4,959,500
イーレックス	9,000	1,104.00	9,936,000
東京瓦斯	150,800	2,895.00	436,566,000
大阪瓦斯	137,200	2,199.00	301,702,800
東邦瓦斯	35,000	3,315.00	116,025,000
北海道瓦斯	19,000	293.00	5,567,000
広島ガス	14,700	359.00	5,277,300
西部瓦斯	8,000	2,914.00	23,312,000
静岡ガス	20,100	891.00	17,909,100
メタウォーター	4,000	2,966.00	11,864,000
SBSホールディングス	7,000	863.00	6,041,000
東武鉄道	75,500	3,275.00	247,262,500
相鉄ホールディングス	22,600	2,889.00	65,291,400

東京急行電鉄	192,000	1,708.00	327,936,000
京浜急行電鉄	96,800	2,331.00	225,640,800
小田急電鉄	113,200	2,193.00	248,247,600
京王電鉄	39,500	4,870.00	192,365,000
京成電鉄	53,000	3,370.00	178,610,000
富士急行	9,500	2,450.00	23,275,000
新京成電鉄	1,800	2,115.00	3,807,000
東日本旅客鉄道	135,400	10,980.00	1,486,692,000
西日本旅客鉄道	68,000	8,098.00	550,664,000
東海旅客鉄道	58,800	20,795.00	1,222,746,000
西武ホールディングス	97,600	1,990.00	194,224,000
鴻池運輸	10,000	1,686.00	16,860,000
西日本鉄道	17,000	2,887.00	49,079,000
ハマキョウレックス	4,600	3,315.00	15,249,000
サカイ引越センター	3,300	6,410.00	21,153,000
近鉄グループホールディングス	71,100	4,370.00	310,707,000
阪急阪神ホールディングス	89,300	4,445.00	396,938,500
南海電気鉄道	29,900	2,914.00	87,128,600
京阪ホールディングス	31,700	3,455.00	109,523,500
神戸電鉄	1,700	3,810.00	6,477,000
名古屋鉄道	51,500	2,541.00	130,861,500
山陽電気鉄道	5,100	2,869.00	14,631,900
日本通運	26,300	7,330.00	192,779,000
ヤマトホールディングス	126,400	2,241.00	283,262,400
山九	18,600	4,645.00	86,397,000
丸運	3,900	308.00	1,201,200
丸全昭和運輸	24,000	525.00	12,600,000
センコーグループホールディングス	33,600	802.00	26,947,200
トナミホールディングス	1,400	5,340.00	7,476,000
ニッコンホールディングス	24,000	2,848.00	68,352,000
日本石油輸送	800	3,490.00	2,792,000
福山通運	8,600	3,630.00	31,218,000
セイノーホールディングス	50,100	1,625.00	81,412,500
神奈川中央交通	1,600	3,755.00	6,008,000
日立物流	14,700	2,811.00	41,321,700
丸和運輸機関	3,500	2,239.00	7,836,500
C & F ロジホールディングス	7,300	1,484.00	10,833,200
九州旅客鉄道	70,200	3,595.00	252,369,000
日本郵船	60,000	2,296.00	137,760,000
商船三井	37,200	3,340.00	124,248,000
川崎汽船	27,000	2,964.00	80,028,000
N S ユナイテッド海運	3,300	2,363.00	7,797,900

飯野海運	37,700	521.00	19,641,700
共栄タンカー	800	2,182.00	1,745,600
乾汽船	5,200	832.00	4,326,400
日本航空	124,200	3,849.00	478,045,800
A N Aホールディングス	131,200	4,378.00	574,393,600
パスコ	6,000	347.00	2,082,000
トランコム	2,000	6,050.00	12,100,000
日新	5,800	2,924.00	16,959,200
三菱倉庫	23,200	2,894.00	67,140,800
三井倉庫ホールディングス	41,000	344.00	14,104,000
住友倉庫	48,000	780.00	37,440,000
澁澤倉庫	3,700	2,047.00	7,573,900
東陽倉庫	12,200	322.00	3,928,400
日本トランスシティ	16,000	488.00	7,808,000
ケイヒン	1,300	1,639.00	2,130,700
中央倉庫	4,100	1,189.00	4,874,900
川西倉庫	1,400	2,449.00	3,428,600
安田倉庫	5,600	932.00	5,219,200
東洋埠頭	2,000	1,884.00	3,768,000
宇徳	5,800	504.00	2,923,200
上組	42,200	2,563.00	108,158,600
サンリツ	1,700	789.00	1,341,300
キムラユニティー	1,800	1,154.00	2,077,200
キューソー流通システム	1,900	3,060.00	5,814,000
郵船ロジスティクス	6,600	1,026.00	6,771,600
近鉄エクスプレス	12,600	1,888.00	23,788,800
東海運	3,800	414.00	1,573,200
エーアイティー	4,300	1,249.00	5,370,700
内外トランスライン	2,300	1,702.00	3,914,600
日本コンセプト	1,300	1,238.00	1,609,400
N E C ネットエスアイ	7,700	2,610.00	20,097,000
システナ	5,600	2,709.00	15,170,400
デジタルアーツ	3,100	4,790.00	14,849,000
新日鉄住金ソリューションズ	11,000	2,582.00	28,402,000
キューブシステム	4,200	803.00	3,372,600
コア	3,000	1,797.00	5,391,000
ソフトクリエイイトホールディングス	3,400	1,582.00	5,378,800
T I S	23,200	3,285.00	76,212,000
ネオス	2,500	455.00	1,137,500
電算システム	2,500	2,115.00	5,287,500
グリー	42,600	791.00	33,696,600
コーエーテクモホールディングス	16,600	2,255.00	37,433,000

三菱総合研究所	3,000	3,250.00	9,750,000
ボルテージ	1,400	1,088.00	1,523,200
電算	800	2,345.00	1,876,000
A G S	1,800	2,012.00	3,621,600
ファインデックス	5,800	799.00	4,634,200
ヒト・コミュニケーションズ	1,600	1,961.00	3,137,600
ブレインパッド	1,600	1,207.00	1,931,200
K L a b	13,400	1,816.00	24,334,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,100	1,630.00	8,313,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,200	1,089.00	1,306,800
ネクソン	77,500	2,912.00	225,680,000
アイスタイル	16,200	745.00	12,069,000
エムアップ	2,100	1,310.00	2,751,000
エイチーム	4,700	2,820.00	13,254,000
テクノスジャパン	5,500	1,074.00	5,907,000
コロプラ	22,500	1,193.00	26,842,500
モバイルクリエイト	5,900	366.00	2,159,400
ブロードリーフ	17,300	917.00	15,864,100
ハーツユナイテッドグループ	3,700	1,582.00	5,853,400
メディアドゥホールディングス	2,000	2,578.00	5,156,000
ブイキューブ	4,300	638.00	2,743,400
サイバーリンクス	1,100	1,446.00	1,590,600
フィックスターズ	1,200	4,035.00	4,842,000
VOYAGE GROUP	3,600	1,436.00	5,169,600
オブティム	1,500	2,566.00	3,849,000
セレス	2,200	1,274.00	2,802,800
ベリサーブ	800	3,415.00	2,732,000
ティーガイア	7,000	2,160.00	15,120,000
日本アジアグループ	8,000	439.00	3,512,000
豆蔵ホールディングス	5,200	1,233.00	6,411,600
テクマトリックス	4,400	1,608.00	7,075,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	188,500	305.00	57,492,500
GMOペイメントゲートウェイ	4,900	8,120.00	39,788,000
ザッパラス	3,700	458.00	1,694,600
システムリサーチ	700	2,258.00	1,580,600
インターネットイニシアティブ	10,300	2,244.00	23,113,200
さくらインターネット	5,800	872.00	5,057,600
GMOクラウド	1,600	2,963.00	4,740,800
SRAホールディングス	3,700	3,145.00	11,636,500
Minor iソリューションズ	1,600	1,340.00	2,144,000
朝日ネット	6,400	546.00	3,494,400
アドソル日進	1,900	1,199.00	2,278,100

フリービット	5,300	903.00	4,785,900
コムチュア	3,600	2,065.00	7,434,000
サイバーコム	1,400	1,005.00	1,407,000
メディカル・データ・ビジョン	2,700	2,078.00	5,610,600
g u m i	8,100	1,099.00	8,901,900
ショーケース・ティービー	1,400	1,630.00	2,282,000
モバイルファクトリー	1,400	1,365.00	1,911,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,970.00	1,970,000
P C Iホールディングス	1,200	3,105.00	3,726,000
パイプドHD	1,400	1,111.00	1,555,400
アイビーシー	900	932.00	838,800
オープンドア	900	4,840.00	4,356,000
L I N E	19,400	4,125.00	80,025,000
オークネット	2,200	1,413.00	3,108,600
A O I T Y O H o l d i n g s	5,800	1,158.00	6,716,400
マクロミル	9,000	3,010.00	27,090,000
ソルクシーズ	2,800	834.00	2,335,200
フェイス	3,100	1,223.00	3,791,300
ハイマックス	900	1,615.00	1,453,500
野村総合研究所	52,200	4,365.00	227,853,000
サイバネットシステム	5,800	745.00	4,321,000
C Eホールディングス	2,000	619.00	1,238,000
日本システム技術	900	1,383.00	1,244,700
インテージホールディングス	8,000	1,404.00	11,232,000
東邦システムサイエンス	2,300	834.00	1,918,200
ソースネクスト	4,500	565.00	2,542,500
フォーカスシステムズ	3,700	902.00	3,337,400
クレスコ	1,600	4,175.00	6,680,000
フジ・メディア・ホールディングス	72,700	1,652.00	120,100,400
オービック	24,100	7,220.00	174,002,000
ジャストシステム	11,300	2,412.00	27,255,600
T D Cソフト	3,100	1,130.00	3,503,000
ヤフー	500,400	531.00	265,712,400
トレンドマイクロ	33,900	5,780.00	195,942,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,100	1,451.00	3,047,100
日本オラクル	11,200	9,300.00	104,160,000
アルファシステムズ	2,300	2,414.00	5,552,200
フューチャー	9,500	996.00	9,462,000
C A C H o l d i n g s	5,300	1,110.00	5,883,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	1,807.00	6,143,800
トーセ	1,900	2,622.00	4,981,800
オービックビジネスコンサルタント	3,600	5,750.00	20,700,000

伊藤忠テクノソリューションズ	15,800	4,185.00	66,123,000
アイティフォー	9,200	643.00	5,915,600
東計電算	1,300	3,295.00	4,283,500
エクスネット	1,300	910.00	1,183,000
大塚商会	20,900	7,340.00	153,406,000
サイボウズ	9,500	512.00	4,864,000
ソフトブレーン	5,800	428.00	2,482,400
電通国際情報サービス	4,300	2,805.00	12,061,500
デジタルガレージ	13,500	2,412.00	32,562,000
E Mシステムズ	2,400	2,058.00	4,939,200
ウェザーニューズ	2,400	3,615.00	8,676,000
C I J	6,000	726.00	4,356,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,737.00	1,215,900
日本エンタープライズ	7,300	255.00	1,861,500
WOWOW	3,400	3,625.00	12,325,000
スカラ	5,000	788.00	3,940,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,000	933.00	5,598,000
ネットワンシステムズ	30,300	1,305.00	39,541,500
システムソフト	17,100	142.00	2,428,200
アルゴグラフィックス	3,200	3,450.00	11,040,000
マーベラス	11,900	934.00	11,114,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,900	1,537.00	19,827,300
日本ユニシス	19,300	1,833.00	35,376,900
兼松エレクトロニクス	4,400	3,320.00	14,608,000
東京放送ホールディングス	46,000	2,237.00	102,902,000
日本テレビホールディングス	63,800	2,036.00	129,896,800
朝日放送	7,000	889.00	6,223,000
テレビ朝日ホールディングス	19,100	2,238.00	42,745,800
スカパーJ S A Tホールディングス	45,600	524.00	23,894,400
テレビ東京ホールディングス	5,700	2,331.00	13,286,700
日本BS放送	2,400	1,226.00	2,942,400
ビジョン	1,800	2,646.00	4,762,800
ワイヤレスゲート	3,300	1,241.00	4,095,300
コネクシオ	5,000	1,994.00	9,970,000
クロップス	1,600	1,399.00	2,238,400
日本電信電話	560,100	5,303.00	2,970,210,300
K D D I	681,500	3,047.00	2,076,530,500
光通信	8,400	14,680.00	123,312,000
N T T ドコモ	513,600	2,673.00	1,372,852,800
エムティーアイ	9,500	673.00	6,393,500
G M O インターネット	25,500	1,604.00	40,902,000
アイドママーケティングコミュニケーション	1,000	691.00	691,000

カドカワ	20,300	1,298.00	26,349,400
学研ホールディングス	2,400	3,325.00	7,980,000
ゼンリン	9,300	3,350.00	31,155,000
昭文社	4,100	728.00	2,984,800
インプレスホールディングス	5,800	153.00	887,400
アイネット	4,000	1,814.00	7,256,000
松竹	4,600	16,830.00	77,418,000
東宝	45,700	3,820.00	174,574,000
東映	2,600	12,550.00	32,630,000
エヌ・ティ・ティ・データ	215,600	1,281.00	276,183,600
ピー・シー・エー	1,000	1,683.00	1,683,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,300	1,440.00	1,872,000
D T S	7,200	3,155.00	22,716,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,900	4,370.00	117,553,000
シーイーシー	4,200	2,518.00	10,575,600
カプコン	16,400	2,752.00	45,132,800
アイ・エス・ピー	1,400	1,364.00	1,909,600
ジャステック	4,100	1,336.00	5,477,600
S C S K	19,000	4,810.00	91,390,000
日本システムウエア	2,300	2,183.00	5,020,900
アイネス	8,900	1,130.00	10,057,000
T K C	6,500	3,450.00	22,425,000
富士ソフト	9,700	3,250.00	31,525,000
N S D	14,600	1,994.00	29,112,400
コナミホールディングス	31,500	5,280.00	166,320,000
福井コンピュータホールディングス	2,000	2,809.00	5,618,000
J B C Cホールディングス	5,900	1,032.00	6,088,800
ミロク情報サービス	6,900	2,539.00	17,519,100
ソフトバンクグループ	314,100	9,972.00	3,132,205,200
ハウスイ	600	1,236.00	741,600
高千穂交易	2,700	1,123.00	3,032,100
伊藤忠食品	1,700	4,945.00	8,406,500
エレマテック	2,800	2,380.00	6,664,000
J A L U X	2,300	2,575.00	5,922,500
あらた	3,300	4,895.00	16,153,500
トーメンデバイス	1,100	2,973.00	3,270,300
東京エレクトロン デバイス	2,500	2,122.00	5,305,000
フィールズ	5,400	1,103.00	5,956,200
双日	412,100	320.00	131,872,000
アルフレッサ ホールディングス	82,500	2,203.00	181,747,500
横浜冷凍	16,400	1,087.00	17,826,800
神栄	1,000	1,622.00	1,622,000

山下医科器械	600	1,712.00	1,027,200
ラサ商事	3,000	1,099.00	3,297,000
ラクーン	4,500	606.00	2,727,000
アルコニックス	8,000	1,782.00	14,256,000
神戸物産	4,500	5,010.00	22,545,000
ペッパーフードサービス	3,700	5,400.00	19,980,000
あい ホールディングス	9,900	2,696.00	26,690,400
ディーブイエックス	2,500	1,385.00	3,462,500
ダイワボウホールディングス	5,900	4,555.00	26,874,500
マクニカ・富士エレホールディングス	12,900	2,184.00	28,173,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,100	934.00	12,235,400
八洲電機	5,500	942.00	5,181,000
メディアスホールディングス	1,100	2,767.00	3,043,700
U K Cホールディングス	4,500	1,966.00	8,847,000
大光	1,600	1,041.00	1,665,600
O C H Iホールディングス	2,000	1,394.00	2,788,000
T O K A Iホールディングス	30,700	890.00	27,323,000
大阪工機	1,100	1,021.00	1,123,100
三洋貿易	3,800	2,760.00	10,488,000
ビューティガレージ	900	1,868.00	1,681,200
ウイン・パートナーズ	5,000	1,391.00	6,955,000
ミタチ産業	1,600	1,610.00	2,576,000
シップヘルスケアホールディングス	13,400	3,560.00	47,704,000
明治電機工業	2,400	1,769.00	4,245,600
デリカフーズホールディングス	1,500	1,537.00	2,305,500
スターティア	1,600	614.00	982,400
コメダホールディングス	12,800	1,908.00	24,422,400
富士興産	2,600	598.00	1,554,800
協栄産業	800	2,307.00	1,845,600
小野建	6,100	1,890.00	11,529,000
佐島電機	5,200	1,012.00	5,262,400
エコートレーディング	1,600	699.00	1,118,400
伯東	4,800	1,687.00	8,097,600
コンドーテック	5,600	1,156.00	6,473,600
中山福	4,100	784.00	3,214,400
ナガイレーベン	9,200	2,810.00	25,852,000
三菱食品	7,700	3,375.00	25,987,500
松田産業	5,100	1,609.00	8,205,900
第一興商	11,300	5,350.00	60,455,000
メディバルホールディングス	69,800	2,161.00	150,837,800
S P K	1,500	3,185.00	4,777,500
萩原電気	2,400	3,300.00	7,920,000

アズワン	5,500	5,940.00	32,670,000
スズデン	2,500	1,383.00	3,457,500
尾家産業	2,200	1,254.00	2,758,800
シモジマ	4,300	1,177.00	5,061,100
ドウシシャ	8,200	2,483.00	20,360,600
小津産業	1,500	2,192.00	3,288,000
高速	4,200	1,199.00	5,035,800
たけびし	2,400	1,534.00	3,681,600
黒田電気	9,500	1,982.00	18,829,000
リックス	1,600	1,799.00	2,878,400
丸文	6,200	952.00	5,902,400
ハピネット	5,800	1,920.00	11,136,000
橋本総業ホールディングス	1,400	1,654.00	2,315,600
日本ライフライン	7,900	5,390.00	42,581,000
エクセル	3,000	2,528.00	7,584,000
マルカキカイ	2,300	2,151.00	4,947,300
I D O M	18,800	813.00	15,284,400
日本エム・ディ・エム	5,300	1,052.00	5,575,600
進和	4,100	2,338.00	9,585,800
エスケイジャパン	1,400	351.00	491,400
ダイترون	3,200	1,972.00	6,310,400
シークス	4,400	4,675.00	20,570,000
田中商事	2,200	768.00	1,689,600
オーハシテクニカ	3,900	1,642.00	6,403,800
白銅	1,800	2,200.00	3,960,000
伊藤忠商事	511,000	1,886.00	963,746,000
丸紅	686,700	743.40	510,492,780
高島	1,200	2,205.00	2,646,000
長瀬産業	42,000	1,890.00	79,380,000
蝶理	4,500	2,062.00	9,279,000
豊田通商	77,700	3,950.00	306,915,000
三共生興	10,700	473.00	5,061,100
兼松	29,700	1,445.00	42,916,500
ツカモトコーポレーション	1,300	1,260.00	1,638,000
三井物産	630,900	1,655.00	1,044,139,500
日本紙パルプ商事	3,600	4,555.00	16,398,000
日立ハイテクノロジーズ	24,200	4,495.00	108,779,000
カメイ	9,100	1,827.00	16,625,700
東都水産	1,100	2,019.00	2,220,900
O U G ホールディングス	1,100	2,718.00	2,989,800
スターゼン	2,900	5,310.00	15,399,000
山善	26,800	1,220.00	32,696,000

椿本興業	1,600	2,824.00	4,518,400
住友商事	439,200	1,594.00	700,084,800
内田洋行	3,200	3,520.00	11,264,000
三菱商事	523,500	2,578.50	1,349,844,750
第一実業	3,200	3,200.00	10,240,000
キャノンマーケティングジャパン	19,900	2,748.00	54,685,200
西華産業	4,300	2,823.00	12,138,900
佐藤商事	6,200	1,197.00	7,421,400
菱洋エレクトロ	6,500	2,071.00	13,461,500
東京産業	7,000	520.00	3,640,000
ユアサ商事	6,600	4,090.00	26,994,000
神鋼商事	1,800	2,870.00	5,166,000
小林産業	4,700	397.00	1,865,900
阪和興業	13,900	4,085.00	56,781,500
正栄食品工業	3,800	4,760.00	18,088,000
カナデン	6,700	1,245.00	8,341,500
菱電商事	5,500	1,721.00	9,465,500
フルサト工業	3,800	1,795.00	6,821,000
岩谷産業	15,500	3,425.00	53,087,500
すてきナイスグループ	3,000	1,562.00	4,686,000
昭光通商	25,000	113.00	2,825,000
ニチモウ	1,000	2,004.00	2,004,000
極東貿易	11,000	360.00	3,960,000
イワキ	10,000	449.00	4,490,000
三愛石油	18,700	1,301.00	24,328,700
稲畑産業	16,700	1,574.00	26,285,800
G S Iクレオス	1,700	1,652.00	2,808,400
明和産業	6,500	502.00	3,263,000
ワキタ	14,900	1,329.00	19,802,100
東邦ホールディングス	22,300	2,166.00	48,301,800
サンゲツ	23,700	2,075.00	49,177,500
ミツウロコグループホールディングス	11,200	813.00	9,105,600
シナネンホールディングス	3,000	2,506.00	7,518,000
伊藤忠エネクス	15,400	1,195.00	18,403,000
サンリオ	21,500	1,886.00	40,549,000
サンワテクノス	4,100	2,130.00	8,733,000
リョーサン	9,400	4,505.00	42,347,000
新光商事	7,600	2,012.00	15,291,200
トーホー	3,100	2,743.00	8,503,300
三信電気	7,700	1,699.00	13,082,300
東陽テクニカ	8,100	1,050.00	8,505,000
モスフードサービス	9,100	3,385.00	30,803,500

加賀電子	6,300	3,440.00	21,672,000
ソーダニッカ	7,300	576.00	4,204,800
立花エレテック	4,700	1,858.00	8,732,600
フォーバル	3,100	729.00	2,259,900
PALTAC	11,200	4,620.00	51,744,000
三谷産業	7,500	428.00	3,210,000
ヤマタネ	3,500	1,911.00	6,688,500
丸紅建材リース	7,000	243.00	1,701,000
日鉄住金物産	6,100	5,840.00	35,624,000
トラスコ中山	14,500	2,846.00	41,267,000
オートバックスセブン	25,800	1,950.00	50,310,000
モリト	5,700	1,065.00	6,070,500
加藤産業	10,900	3,450.00	37,605,000
イノテック	6,100	949.00	5,788,900
イエローハット	6,600	3,375.00	22,275,000
J Kホールディングス	7,100	876.00	6,219,600
日伝	5,800	2,366.00	13,722,800
北沢産業	5,900	220.00	1,298,000
杉本商事	4,000	1,693.00	6,772,000
因幡電機産業	9,800	4,755.00	46,599,000
バイテックホールディングス	2,900	1,803.00	5,228,700
ミスミグループ本社	80,400	2,930.00	235,572,000
アルテック	6,000	288.00	1,728,000
タキヒヨー	2,100	2,388.00	5,014,800
蔵王産業	1,100	1,656.00	1,821,600
スズケン	31,800	4,085.00	129,903,000
ジェコス	4,800	1,233.00	5,918,400
ルネサスイーストン	6,500	658.00	4,277,000
ローソン	22,000	7,620.00	167,640,000
サンエー	5,300	5,180.00	27,454,000
カワチ薬品	5,400	2,730.00	14,742,000
エービーシー・マート	12,700	5,710.00	72,517,000
ハードオフコーポレーション	3,200	1,143.00	3,657,600
アスクル	7,300	3,100.00	22,630,000
ゲオホールディングス	11,700	1,696.00	19,843,200
アダストリア	10,700	2,556.00	27,349,200
ジーフット	4,300	753.00	3,237,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	705.00	634,500
くらコーポレーション	4,100	5,250.00	21,525,000
キャンドウ	3,400	1,751.00	5,953,400
パルグループホールディングス	3,600	3,020.00	10,872,000
エディオン	27,100	1,085.00	29,403,500

サーラコーポレーション	12,100	823.00	9,958,300
ワッツ	2,800	1,154.00	3,231,200
ハローズ	2,300	2,552.00	5,869,600
あみやき亭	1,400	5,080.00	7,112,000
ひらまつ	9,800	624.00	6,115,200
ゲンキー	2,900	4,165.00	12,078,500
大黒天物産	1,700	5,190.00	8,823,000
ハニーズホールディングス	6,800	1,189.00	8,085,200
ファーマライズホールディングス	1,600	632.00	1,011,200
アルペン	5,400	2,248.00	12,139,200
クオール	7,900	1,988.00	15,705,200
ジーンズ	4,800	5,840.00	28,032,000
ビックカメラ	40,100	1,424.00	57,102,400
D C Mホールディングス	42,400	1,026.00	43,502,400
MonotaRO	24,800	3,105.00	77,004,000
東京一番フーズ	1,900	598.00	1,136,200
DDホールディングス	1,500	3,810.00	5,715,000
きちり	1,900	720.00	1,368,000
アークランドサービスホールディングス	5,900	2,265.00	13,363,500
J.フロント リテイリング	88,300	1,712.00	151,169,600
ドトール・日レスホールディングス	12,300	2,676.00	32,914,800
マツモトキヨシホールディングス	13,200	8,290.00	109,428,000
ブロンコビリー	3,700	2,919.00	10,800,300
スタートトゥデイ	61,600	3,435.00	211,596,000
トレジャー・ファクトリー	2,100	917.00	1,925,700
物語コーポレーション	2,000	7,420.00	14,840,000
ココカラファイン	7,300	6,350.00	46,355,000
三越伊勢丹ホールディングス	138,900	1,267.00	175,986,300
Hamee	2,200	1,623.00	3,570,600
ウエルシアホールディングス	18,400	4,290.00	78,936,000
クリエイティブSDホールディングス	10,300	2,785.00	28,685,500
丸善CHIホールディングス	8,200	347.00	2,845,400
ミサワ	1,300	473.00	614,900
ティーライフ	1,000	1,393.00	1,393,000
エー・ピーカンパニー	1,200	763.00	915,600
チムニー	2,200	2,812.00	6,186,400
シュッピン	2,700	2,757.00	7,443,900
ネクステージ	2,300	2,703.00	6,216,900
ジョイフル本田	11,400	2,971.00	33,869,400
鳥貴族	2,600	3,005.00	7,813,000
麒麟堂ホールディングス	2,300	1,444.00	3,321,200
ホットランド	4,100	1,485.00	6,088,500

すかいらーく	43,200	1,692.00	73,094,400
綿半ホールディングス	2,900	2,427.00	7,038,300
ヨシックス	900	2,510.00	2,259,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	23,200	1,092.00	25,334,400
ブックオフコーポレーション	4,000	814.00	3,256,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,900	968.00	2,807,200
B E E N O S	1,200	1,207.00	1,448,400
あさひ	5,300	1,374.00	7,282,200
日本調剤	2,500	3,625.00	9,062,500
コスモス薬品	3,500	23,890.00	83,615,000
トーエル	3,500	969.00	3,391,500
一六堂	1,700	419.00	712,300
オンリー	1,300	894.00	1,162,200
セブン&アイ・ホールディングス	292,000	4,701.00	1,372,692,000
薬王堂	3,500	3,300.00	11,550,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,800	1,179.00	22,165,200
ツルハホールディングス	14,000	14,070.00	196,980,000
サンマルクホールディングス	4,500	3,390.00	15,255,000
フェリシモ	2,000	1,316.00	2,632,000
トリドールホールディングス	8,600	3,510.00	30,186,000
T O K Y O B A S E	900	4,355.00	3,919,500
サツドラホールディングス	900	2,022.00	1,819,800
ダイユー・リックホールディングス	2,300	1,025.00	2,357,500
パロックジャパンリミテッド	5,800	959.00	5,562,200
クスリのアオキホールディングス	5,500	6,250.00	34,375,000
スシローグローバルホールディングス	6,400	3,575.00	22,880,000
L I X I L ビバ	6,700	1,810.00	12,127,000
メディカルシステムネットワーク	8,000	547.00	4,376,000
総合メディカル	3,400	5,060.00	17,204,000
はるやまホールディングス	3,300	997.00	3,290,100
ノジマ	11,000	2,391.00	26,301,000
カッパ・クリエイト	9,800	1,264.00	12,387,200
ライトオン	6,000	960.00	5,760,000
良品計画	9,200	32,700.00	300,840,000
三城ホールディングス	8,800	470.00	4,136,000
アドヴァン	7,200	1,039.00	7,480,800
アルビス	1,800	4,155.00	7,479,000
コナカ	9,100	609.00	5,541,900
ハウス オブ ローゼ	900	1,574.00	1,416,600
G - 7ホールディングス	2,100	2,293.00	4,815,300
イオン北海道	7,100	640.00	4,544,000

コジマ	12,200	376.00	4,587,200
ヒマラヤ	2,000	975.00	1,950,000
コーナン商事	9,900	2,292.00	22,690,800
エコス	2,900	1,252.00	3,630,800
マルシェ	1,600	825.00	1,320,000
ドンキホーテホールディングス	45,200	4,585.00	207,242,000
西松屋チェーン	12,300	1,237.00	15,215,100
ゼンショーホールディングス	36,200	2,064.00	74,716,800
幸楽苑ホールディングス	4,500	1,742.00	7,839,000
ハークスレイ	1,800	1,159.00	2,086,200
サイゼリヤ	10,400	3,500.00	36,400,000
V Tホールディングス	23,700	646.00	15,310,200
魚力	2,200	1,189.00	2,615,800
ポブラ	1,800	615.00	1,107,000
フジ・コーポレーション	1,200	2,100.00	2,520,000
ユナイテッドアローズ	9,300	4,095.00	38,083,500
ハイデイ日高	7,600	3,170.00	24,092,000
京都きもの友禅	4,500	834.00	3,753,000
コロワイド	23,200	2,105.00	48,836,000
ピーシーデポコーポレーション	9,400	808.00	7,595,200
壱番屋	4,900	4,375.00	21,437,500
トップカルチャー	2,600	537.00	1,396,200
P L A N T	1,600	1,324.00	2,118,400
スギホールディングス	15,300	5,880.00	89,964,000
ヴィア・ホールディングス	5,400	824.00	4,449,600
スクロール	10,900	388.00	4,229,200
ヨンドシーホールディングス	7,100	3,095.00	21,974,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	30,600	6,410.00	196,146,000
木曽路	8,600	2,661.00	22,884,600
S R Sホールディングス	8,300	927.00	7,694,100
千趣会	12,700	695.00	8,826,500
タカキュー	5,800	213.00	1,235,400
ケーヨー	11,900	768.00	9,139,200
上新電機	8,200	3,835.00	31,447,000
日本瓦斯	12,800	3,705.00	47,424,000
ロイヤルホールディングス	12,400	2,923.00	36,245,200
いなげや	7,800	1,838.00	14,336,400
島忠	18,100	3,205.00	58,010,500
チヨダ	8,300	2,862.00	23,754,600
ライフコーポレーション	5,300	2,981.00	15,799,300
リンガーハット	7,900	2,426.00	19,165,400
Mr M a x H D	8,900	704.00	6,265,600

テンアライド	6,500	426.00	2,769,000
AOKIホールディングス	14,000	1,525.00	21,350,000
オークワ	10,000	1,110.00	11,100,000
コメリ	10,800	3,390.00	36,612,000
青山商事	14,600	4,135.00	60,371,000
しまむら	8,100	12,820.00	103,842,000
はせがわ	3,800	503.00	1,911,400
高島屋	117,000	1,073.00	125,541,000
松屋	15,300	1,174.00	17,962,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,800	2,140.00	76,612,000
近鉄百貨店	2,700	3,690.00	9,963,000
パルコ	6,700	1,510.00	10,117,000
丸井グループ	73,500	1,707.00	125,464,500
アクシアル リテイリング	5,400	4,565.00	24,651,000
イオン	287,100	1,743.00	500,415,300
イズミ	12,600	5,990.00	75,474,000
東武ストア	900	3,070.00	2,763,000
平和堂	14,200	2,497.00	35,457,400
フジ	7,800	3,065.00	23,907,000
ヤオコー	7,900	5,520.00	43,608,000
ゼビオホールディングス	9,500	2,200.00	20,900,000
ケーズホールディングス	29,600	2,590.00	76,664,000
Olympicグループ	4,200	595.00	2,499,000
日産東京販売ホールディングス	10,500	404.00	4,242,000
アインホールディングス	9,900	7,520.00	74,448,000
元気寿司	1,800	2,716.00	4,888,800
ヤマダ電機	239,800	606.00	145,318,800
アークランドサカモト	11,900	1,802.00	21,443,800
ニトリホールディングス	30,200	16,860.00	509,172,000
グルメ杵屋	5,000	1,115.00	5,575,000
愛眼	5,100	299.00	1,524,900
ケーユーホールディングス	3,700	999.00	3,696,300
吉野家ホールディングス	24,400	1,872.00	45,676,800
松屋フーズ	3,400	4,250.00	14,450,000
サガミチェーン	8,800	1,396.00	12,284,800
関西スーパーマーケット	5,700	1,393.00	7,940,100
王将フードサービス	5,100	4,525.00	23,077,500
プレナス	7,800	2,295.00	17,901,000
ミニストップ	5,200	2,266.00	11,783,200
アークス	13,100	2,540.00	33,274,000
パローホールディングス	15,100	2,581.00	38,973,100
藤久	600	1,740.00	1,044,000

ベルク	3,100	6,450.00	19,995,000
大庄	3,800	1,742.00	6,619,600
ファーストリテイリング	11,600	36,520.00	423,632,000
サンドラッグ	26,600	4,910.00	130,606,000
サクスパー ホールディングス	6,600	1,372.00	9,055,200
ヤマザワ	1,500	1,727.00	2,590,500
やまや	1,500	1,691.00	2,536,500
ペルーナ	15,000	1,252.00	18,780,000
島根銀行	1,500	1,330.00	1,995,000
じもとホールディングス	50,600	211.00	10,676,600
めぶきフィナンシャルグループ	336,400	452.00	152,052,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	10,100	2,946.00	29,754,600
九州フィナンシャルグループ	114,400	688.00	78,707,200
ゆうちょ銀行	197,500	1,401.00	276,697,500
富山第一銀行	17,900	545.00	9,755,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	452,200	585.00	264,537,000
西日本フィナンシャルホールディングス	47,300	1,274.00	60,260,200
新生銀行	66,400	1,813.00	120,383,200
あおぞら銀行	44,100	4,320.00	190,512,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,234,400	727.80	3,809,596,320
りそなホールディングス	816,200	585.80	478,129,960
三井住友トラスト・ホールディングス	145,700	4,249.00	619,079,300
三井住友フィナンシャルグループ	558,700	4,387.00	2,451,016,900
第四銀行	8,600	5,320.00	45,752,000
北越銀行	7,500	2,552.00	19,140,000
千葉銀行	269,000	816.00	219,504,000
群馬銀行	151,700	710.00	107,707,000
武蔵野銀行	11,100	3,525.00	39,127,500
千葉興業銀行	19,100	603.00	11,517,300
筑波銀行	29,300	381.00	11,163,300
七十七銀行	21,900	2,807.00	61,473,300
青森銀行	5,400	3,600.00	19,440,000
秋田銀行	4,500	3,410.00	15,345,000
山形銀行	7,800	2,575.00	20,085,000
岩手銀行	4,600	4,655.00	21,413,000
東邦銀行	62,400	423.00	26,395,200
東北銀行	3,500	1,501.00	5,253,500
みちのく銀行	4,200	1,913.00	8,034,600
ふくおかフィナンシャルグループ	283,000	542.00	153,386,000
静岡銀行	184,000	1,053.00	193,752,000
十六銀行	9,400	3,900.00	36,660,000
スルガ銀行	71,300	2,438.00	173,829,400

八十二銀行	134,600	692.00	93,143,200
山梨中央銀行	43,000	466.00	20,038,000
大垣共立銀行	10,800	3,165.00	34,182,000
福井銀行	6,000	2,864.00	17,184,000
北國銀行	7,400	4,820.00	35,668,000
清水銀行	2,400	3,675.00	8,820,000
富山銀行	1,300	4,275.00	5,557,500
滋賀銀行	66,000	621.00	40,986,000
南都銀行	8,000	3,075.00	24,600,000
百五銀行	62,800	505.00	31,714,000
京都銀行	25,000	5,840.00	146,000,000
紀陽銀行	26,200	1,882.00	49,308,400
三重銀行	3,100	2,639.00	8,180,900
ほくほくフィナンシャルグループ	46,400	1,806.00	83,798,400
広島銀行	102,900	917.00	94,359,300
山陰合同銀行	41,300	993.00	41,010,900
中国銀行	48,200	1,580.00	76,156,000
鳥取銀行	2,200	1,786.00	3,929,200
伊予銀行	99,500	922.00	91,739,000
百十四銀行	74,000	393.00	29,082,000
四国銀行	10,700	1,720.00	18,404,000
阿波銀行	60,000	705.00	42,300,000
大分銀行	4,000	4,445.00	17,780,000
宮崎銀行	4,600	3,745.00	17,227,000
佐賀銀行	4,200	2,692.00	11,306,400
十八銀行	43,000	283.00	12,169,000
沖縄銀行	6,800	4,445.00	30,226,000
琉球銀行	14,400	1,662.00	23,932,800
セブン銀行	261,500	417.00	109,045,500
みずほフィナンシャルグループ	9,474,100	198.80	1,883,451,080
高知銀行	2,500	1,295.00	3,237,500
山口フィナンシャルグループ	65,000	1,331.00	86,515,000
長野銀行	2,300	1,978.00	4,549,400
名古屋銀行	5,600	4,315.00	24,164,000
北洋銀行	113,900	353.00	40,206,700
愛知銀行	2,300	6,890.00	15,847,000
第三銀行	3,900	1,852.00	7,222,800
中京銀行	2,900	2,324.00	6,739,600
大光銀行	2,400	2,469.00	5,925,600
愛媛銀行	8,900	1,411.00	12,557,900
トマト銀行	2,700	1,550.00	4,185,000
みなと銀行	6,400	2,092.00	13,388,800

京葉銀行	57,000	538.00	30,666,000
関西アーバン銀行	9,800	1,417.00	13,886,600
栃木銀行	38,500	495.00	19,057,500
北日本銀行	2,200	3,285.00	7,227,000
東和銀行	13,200	1,133.00	14,955,600
福島銀行	7,600	891.00	6,771,600
大東銀行	3,600	1,656.00	5,961,600
トモニホールディングス	57,500	520.00	29,900,000
フィデアホールディングス	67,700	203.00	13,743,100
池田泉州ホールディングス	74,000	435.00	32,190,000
F P G	25,100	1,203.00	30,195,300
S B Iホールディングス	79,000	1,753.00	138,487,000
ジャフコ	11,700	5,650.00	66,105,000
大和証券グループ本社	634,000	667.20	423,004,800
野村ホールディングス	1,426,600	655.90	935,706,940
岡三証券グループ	60,000	699.00	41,940,000
丸三証券	22,400	1,002.00	22,444,800
東洋証券	25,000	297.00	7,425,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	80,300	708.00	56,852,400
光世証券	1,800	1,748.00	3,146,400
水戸証券	21,900	378.00	8,278,200
いちよし証券	15,700	1,240.00	19,468,000
松井証券	40,000	905.00	36,200,000
だいこう証券ビジネス	3,600	730.00	2,628,000
マネックスグループ	74,400	310.00	23,064,000
カブドットコム証券	52,600	351.00	18,462,600
極東証券	9,500	1,646.00	15,637,000
岩井コスモホールディングス	6,700	1,413.00	9,467,100
藍澤證券	13,200	796.00	10,507,200
マネーパートナーズグループ	9,300	470.00	4,371,000
かんぽ生命保険	26,300	2,415.00	63,514,500
S O M P Oホールディングス	145,900	4,350.00	634,665,000
アニコム ホールディングス	4,700	2,957.00	13,897,900
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	195,300	3,779.00	738,038,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	66,800	1,868.00	124,782,400
第一生命ホールディングス	420,700	2,094.50	881,156,150
東京海上ホールディングス	281,000	4,733.00	1,329,973,000
T & Dホールディングス	244,400	1,708.50	417,557,400
アドバンスクリエイト	1,600	1,901.00	3,041,600
全国保証	19,600	4,530.00	88,788,000
クレディセゾン	52,900	2,315.00	122,463,500
アクリーティブ	5,800	371.00	2,151,800

芙蓉総合リース	8,000	7,400.00	59,200,000
興銀リース	13,100	2,935.00	38,448,500
東京センチュリー	14,000	5,050.00	70,700,000
日本証券金融	30,700	612.00	18,788,400
アイフル	117,000	393.00	45,981,000
ポケットカード	5,300	1,070.00	5,671,000
リコーリース	5,500	4,130.00	22,715,000
イオンフィナンシャルサービス	44,500	2,443.00	108,713,500
アコム	140,200	468.00	65,613,600
ジャックス	7,700	2,817.00	21,690,900
オリエントコーポレーション	150,900	184.00	27,765,600
日立キャピタル	16,400	2,769.00	45,411,600
アプラスフィナンシャル	33,800	108.00	3,650,400
オリックス	494,100	1,914.50	945,954,450
三菱UFJリース	177,000	610.00	107,970,000
日本取引所グループ	216,900	2,111.00	457,875,900
イー・ギャランティ	2,100	3,145.00	6,604,500
アサックス	1,200	1,746.00	2,095,200
NECキャピタルソリューション	2,800	2,274.00	6,367,200
いちご	66,400	389.00	25,829,600
日本駐車場開発	85,000	166.00	14,110,000
ヒューリック	145,600	1,176.00	171,225,600
三栄建築設計	2,800	2,540.00	7,112,000
スター・マイカ	2,600	1,566.00	4,071,600
野村不動産ホールディングス	46,400	2,395.00	111,128,000
三重交通グループホールディングス	12,500	469.00	5,862,500
サムティ	5,900	1,493.00	8,808,700
ディア・ライフ	6,600	426.00	2,811,600
エー・ディー・ワークス	129,100	40.00	5,164,000
日本商業開発	3,900	1,657.00	6,462,300
プレサンスコーポレーション	10,900	1,448.00	15,783,200
ユニゾホールディングス	6,700	2,738.00	18,344,600
THEグローバル社	3,300	798.00	2,633,400
日本管理センター	4,600	1,530.00	7,038,000
サンセイランディック	2,000	909.00	1,818,000
エストラスト	1,200	791.00	949,200
フージャースホールディングス	9,100	1,044.00	9,500,400
オープンハウス	11,400	4,045.00	46,113,000
東急不動産ホールディングス	168,800	720.00	121,536,000
飯田グループホールディングス	58,200	2,063.00	120,066,600
ムゲンエステート	4,300	1,111.00	4,777,300
ファーストブラザーズ	1,900	1,048.00	1,991,200

ハウスドゥ	1,100	1,821.00	2,003,100
シーアールイー	1,100	1,546.00	1,700,600
ケイアイスター不動産	1,900	2,123.00	4,033,700
パーク24	38,600	2,668.00	102,984,800
パラカ	2,200	2,460.00	5,412,000
三井不動産	370,000	2,602.50	962,925,000
三菱地所	519,000	2,026.50	1,051,753,500
平和不動産	13,200	1,960.00	25,872,000
東京建物	76,200	1,524.00	116,128,800
ダイビル	18,000	1,285.00	23,130,000
京阪神ビルディング	11,700	771.00	9,020,700
住友不動産	167,000	3,646.00	608,882,000
大京	13,000	2,245.00	29,185,000
テーオーシー	27,100	989.00	26,801,900
東京楽天地	1,100	5,760.00	6,336,000
レオパレス21	86,800	799.00	69,353,200
スターツコーポレーション	9,500	2,945.00	27,977,500
フジ住宅	9,000	877.00	7,893,000
空港施設	8,500	620.00	5,270,000
明和地所	3,900	920.00	3,588,000
ゴールドクレスト	6,300	2,683.00	16,902,900
日本エスリード	2,700	2,093.00	5,651,100
日神不動産	8,300	753.00	6,249,900
日本エスコン	12,300	513.00	6,309,900
タカラレーベン	30,000	525.00	15,750,000
サンヨーハウジング名古屋	3,600	1,202.00	4,327,200
イオンモール	44,900	2,023.00	90,832,700
ファースト住建	2,600	1,825.00	4,745,000
トーセイ	8,600	1,083.00	9,313,800
穴吹興産	800	2,994.00	2,395,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	43,400	1,180.00	51,212,000
サンフロンティア不動産	7,500	1,299.00	9,742,500
エフ・ジェー・ネクスト	6,100	952.00	5,807,200
インテリックス	2,200	1,012.00	2,226,400
ランドビジネス	4,200	318.00	1,335,600
グランディハウス	6,200	453.00	2,808,600
日本空港ビルデング	22,300	4,080.00	90,984,000
日本工営	4,600	4,085.00	18,791,000
LIFULL	18,500	903.00	16,705,500
ジェイエイシーリクルートメント	5,500	2,003.00	11,016,500
日本M&Aセンター	21,600	5,500.00	118,800,000
メンバーズ	1,900	701.00	1,331,900

中広	900	750.00	675,000
タケエイ	6,600	1,146.00	7,563,600
トラスト・テック	3,000	3,125.00	9,375,000
コシダカホールディングス	3,600	4,400.00	15,840,000
パソナグループ	5,600	1,545.00	8,652,000
C D S	1,900	1,330.00	2,527,000
リンクアンドモチベーション	12,600	710.00	8,946,000
G C A	7,800	998.00	7,784,400
エス・エム・エス	10,500	3,575.00	37,537,500
パーソルホールディングス	57,200	2,731.00	156,213,200
リニカル	4,400	1,508.00	6,635,200
クックパッド	21,400	758.00	16,221,200
エスクリ	2,700	885.00	2,389,500
アイ・ケイ・ケイ	4,200	891.00	3,742,200
学情	3,100	1,367.00	4,237,700
スタジオアリス	3,400	2,611.00	8,877,400
シミックホールディングス	3,800	1,564.00	5,943,200
N J S	1,700	1,421.00	2,415,700
総合警備保障	26,900	5,330.00	143,377,000
カカクコム	52,000	1,562.00	81,224,000
アイロムグループ	2,300	1,638.00	3,767,400
セントケア・ホールディング	1,000	2,680.00	2,680,000
サイネックス	800	996.00	796,800
ルネサンス	3,800	1,670.00	6,346,000
ディップ	9,600	2,757.00	26,467,200
オプトホールディング	4,800	1,169.00	5,611,200
ツクイ	17,700	775.00	13,717,500
キャリアデザインセンター	1,600	1,641.00	2,625,600
エムスリー	64,000	3,285.00	210,240,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,800	574.00	3,329,200
ブラス	500	1,088.00	544,000
アウトソーシング	20,200	1,482.00	29,936,400
ウェルネット	5,600	1,192.00	6,675,200
ワールドホールディングス	2,300	3,345.00	7,693,500
ディー・エヌ・エー	33,100	2,485.00	82,253,500
博報堂D Yホールディングス	102,400	1,571.00	160,870,400
ぐるなび	10,700	1,725.00	18,457,500
エスアールジータカミヤ	8,100	665.00	5,386,500
ジャパンベストレスキューシステム	8,500	468.00	3,978,000
ファンコミュニケーションズ	19,000	1,151.00	21,869,000
ライク	2,700	2,112.00	5,702,400
ビジネス・ブレークスルー	3,400	568.00	1,931,200

WDBホールディングス	2,700	2,583.00	6,974,100
ティア	3,800	911.00	3,461,800
CDG	600	1,839.00	1,103,400
バリューコマース	6,200	842.00	5,220,400
インフォマート	34,300	810.00	27,783,000
JPホールディングス	21,500	396.00	8,514,000
EPSホールディングス	10,200	2,115.00	21,573,000
レッグス	1,900	841.00	1,597,900
プレステージ・インターナショナル	14,200	1,135.00	16,117,000
アミューズ	4,100	2,893.00	11,861,300
ドリームインキュベータ	2,300	2,202.00	5,064,600
クイック	3,800	1,882.00	7,151,600
TAC	4,400	290.00	1,276,000
ケネディクス	93,800	651.00	61,063,800
電通	82,300	5,110.00	420,553,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	836.00	3,093,200
ぴあ	2,300	5,550.00	12,765,000
イオンファンタジー	2,200	4,035.00	8,877,000
シーティーエス	8,100	741.00	6,002,100
ネクシィーズグループ	2,700	2,104.00	5,680,800
みらかホールディングス	18,900	5,300.00	100,170,000
アルプス技研	3,000	3,765.00	11,295,000
ダイオーズ	1,400	1,384.00	1,937,600
日本空調サービス	7,200	724.00	5,212,800
オリエンタルランド	79,800	9,130.00	728,574,000
ダスキン	18,200	3,150.00	57,330,000
明光ネットワークジャパン	8,600	1,346.00	11,575,600
ファルコホールディングス	3,500	1,770.00	6,195,000
ラウンドワン	23,100	1,442.00	33,310,200
リゾートトラスト	28,600	2,204.00	63,034,400
ビー・エム・エル	9,700	2,491.00	24,162,700
ワタベウェディング	1,300	794.00	1,032,200
りらいあコミュニケーションズ	12,300	1,318.00	16,211,400
リソー教育	12,800	881.00	11,276,800
早稲田アカデミー	1,000	1,709.00	1,709,000
ユー・エス・エス	89,400	2,310.00	206,514,000
東京個別指導学院	2,400	981.00	2,354,400
サイバーエージェント	44,400	3,300.00	146,520,000
楽天	346,400	1,237.00	428,496,800
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,118.00	3,913,000
テー・オー・ダブリュー	6,100	868.00	5,294,800
セントラルスポーツ	2,500	3,925.00	9,812,500

フルキャストホールディングス	6,000	2,020.00	12,120,000
リソルホールディングス	800	4,040.00	3,232,000
テクノプロ・ホールディングス	12,000	5,080.00	60,960,000
アトラ	1,400	640.00	896,000
インターワークス	1,600	1,095.00	1,752,000
K e e P e r 技研	2,200	1,307.00	2,875,400
ファーストロジック	500	2,598.00	1,299,000
三機サービス	800	1,346.00	1,076,800
デザインワン・ジャパン	1,400	1,299.00	1,818,600
イー・ガーディアン	3,500	2,207.00	7,724,500
リブセンス	4,400	533.00	2,345,200
ジャパンマテリアル	5,400	2,869.00	15,492,600
ベクトル	6,100	1,485.00	9,058,500
ウチヤマホールディングス	3,500	539.00	1,886,500
ライクキッズネクスト	700	2,393.00	1,675,100
キャリアリンク	1,800	567.00	1,020,600
I B J	5,100	862.00	4,396,200
アサンテ	2,800	1,977.00	5,535,600
N・フィールド	3,800	2,076.00	7,888,800
バリューHR	800	4,340.00	3,472,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	5,870.00	7,631,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,900	1,051.00	1,996,900
E R Iホールディングス	2,100	926.00	1,944,600
アビスト	1,000	4,245.00	4,245,000
ウィルグループ	3,400	1,256.00	4,270,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,700	2,933.00	4,986,100
日本ビューホテル	1,600	1,407.00	2,251,200
リクルートホールディングス	484,000	2,709.00	1,311,156,000
エラン	1,600	1,528.00	2,444,800
土木管理総合試験所	2,000	786.00	1,572,000
日本郵政	393,600	1,300.00	511,680,000
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,217.00	13,752,100
鎌倉新書	800	1,576.00	1,260,800
一蔵	900	1,115.00	1,003,500
L I T A L I C O	900	1,579.00	1,421,100
エボラブルアジア	1,400	2,423.00	3,392,200
ストライク	700	4,815.00	3,370,500
ソラスト	4,700	2,207.00	10,372,900
インソース	800	1,884.00	1,507,200
リログループ	37,000	2,721.00	100,677,000
東祥	4,200	2,950.00	12,390,000
エイチ・アイ・エス	10,600	3,775.00	40,015,000

ラックランド	1,300	2,124.00	2,761,200	
共立メンテナンス	12,000	3,330.00	39,960,000	
イチネンホールディングス	7,600	1,578.00	11,992,800	
建設技術研究所	4,800	1,054.00	5,059,200	
スペース	4,000	1,689.00	6,756,000	
燦ホールディングス	1,500	2,864.00	4,296,000	
スバル興業	500	7,440.00	3,720,000	
東京テアトル	2,900	1,463.00	4,242,700	
タナベ経営	1,500	1,417.00	2,125,500	
ナガワ	1,400	4,520.00	6,328,000	
よみうりランド	1,500	4,710.00	7,065,000	
東京都競馬	5,100	3,365.00	17,161,500	
カナモト	10,300	3,750.00	38,625,000	
東京ドーム	29,600	1,036.00	30,665,600	
西尾レントオール	6,000	3,925.00	23,550,000	
トランス・コスモス	8,600	2,526.00	21,723,600	
乃村工藝社	15,800	2,293.00	36,229,400	
藤田観光	2,700	3,555.00	9,598,500	
KNT-CTホールディングス	4,200	1,927.00	8,093,400	
日本管財	6,400	2,020.00	12,928,000	
トーカイ	3,300	5,140.00	16,962,000	
白洋舎	800	3,455.00	2,764,000	
セコム	76,800	8,544.00	656,179,200	
セントラル警備保障	3,300	1,977.00	6,524,100	
丹青社	12,800	1,321.00	16,908,800	
メイテック	8,600	5,440.00	46,784,000	
アサツー ディ・ケイ	12,900	3,750.00	48,375,000	
応用地質	7,700	1,716.00	13,213,200	
船井総研ホールディングス	9,400	3,755.00	35,297,000	
進学会ホールディングス	3,200	662.00	2,118,400	
オオバ	5,900	512.00	3,020,800	
いであ	1,400	1,169.00	1,636,600	
学究社	2,000	1,586.00	3,172,000	
ベネッセホールディングス	24,800	3,940.00	97,712,000	
イオンディライト	8,300	4,165.00	34,569,500	
ナック	4,600	970.00	4,462,000	
ニチイ学館	13,000	1,141.00	14,833,000	
ダイセキ	12,900	2,697.00	34,791,300	
ステップ	2,500	1,526.00	3,815,000	
合計	86,665,700		178,081,347,580	

(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。

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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,011,869,057
国債証券	268,599,210,850
地方債証券	18,404,038,794
特殊債券	23,388,707,341
社債券	13,697,010,390
未収利息	536,250,588
前払費用	16,211,584
流動資産合計	325,653,298,604
資産合計	325,653,298,604
負債の部	
流動負債	
未払金	696,005,544
未払解約金	98,687,355
未払利息	1,641
流動負債合計	794,694,540
負債合計	794,694,540
純資産の部	
元本等	
元本	235,385,351,927
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,473,252,137
元本等合計	324,858,604,064
純資産合計	324,858,604,064
負債純資産合計	325,653,298,604

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10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

	平成29年10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(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> <p>先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</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 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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	235,385,351,927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 104,132,000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 1.3801円 (1万口当たり純資産額) (13,801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10月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>

	平成29年10月20日現在
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10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ぬ。
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)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	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つた場合、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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	214,922,505,059円
期中追加設定元本額	27,054,327,735円
期中一部解約元本額	6,591,480,867円
期末元本額	235,385,351,927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）	3,023,466,410円
S B I 資産設計オープン（分配型）	21,339,435円
S M T 国内債券インデックス・オープン	10,497,925,492円
世界経済インデックスファンド	1,425,023,650円
D C マイセレクション 2 5	16,593,574,029円
D C マイセレクション 5 0	19,295,670,936円
D C マイセレクション 7 5	5,318,991,917円
D C 日本債券インデックス・オープン	453,231,966円
D C 日本債券インデックス・オープン S	71,575,848,437円
D C 日本債券インデックス・オープン P	32,248,104,430円
D C マイセレクション S 2 5	6,800,662,302円
D C マイセレクション S 5 0	7,726,438,111円
D C マイセレクション S 7 5	1,505,984,617円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,250,449,613円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	979,067,180円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	287,780,686円
D C 世界経済インデックスファンド	980,224,801円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	146,458,381円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	10,080,112円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	100,162,501円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	16,188,882円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	973,098円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	363,570,065円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	566,135,170円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	100,476,393円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	235,999,774円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,887,216,933円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,187,915,357円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,435,918,111円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	986,579,764円

区分	平成29年10月20日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	313,477,067円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,659,182,506円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,607,951,104円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,770,875,117円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,486,677,858円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	190,784,945円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,818,192,393円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,818,635,881円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	35,485,045円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	460,763,063円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	63,142,536円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,205,784円
SMT インデックスバランス・オープン	82,685,633円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	2,840,146円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,091円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,092,665円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	2,235,065円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	259,638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）	17,011,132,597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10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	1,512,144,050
地方債証券	80,323,192
特殊債券	93,645,564
社債券	39,777,870
合計	1,725,890,676

(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370回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,343,551,000	
	第371回利付国債(2年)	760,000,000	762,173,600	
	第372回利付国債(2年)	920,000,000	922,824,400	
	第373回利付国債(2年)	140,000,000	140,450,800	
	第374回利付国債(2年)	620,000,000	622,114,200	
	第375回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,344,837,400	
	第376回利付国債(2年)	1,840,000,000	1,847,028,800	
	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	3,062,291,500	
	第378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,687,106,400	
	第379回利付国債(2年)	2,490,000,000	2,501,055,600	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,788,277,000	
	第381回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,476,982,500	
	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	3,785,268,500	
	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,315,972,000	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,530,077,200	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,060,000	
	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,576,870,400	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	632,948,400	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,537,494,400	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,157,018,800	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,961,407,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,632,634,700	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,979,210,400	
	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	3,815,847,800	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,621,801,300	
	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,224,448,000	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,370,771,200	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,585,261,800	
	第132回利付国債(5年)	3,350,000,000	3,379,748,000	
	第133回利付国債(5年)	1,830,000,000	1,846,671,300	
	第1回利付国債(40年)	150,000,000	209,974,500	
	第2回利付国債(40年)	420,000,000	567,571,200	
	第3回利付国債(40年)	420,000,000	568,377,600	
第4回利付国債(40年)	630,000,000	854,601,300		

第5回利付国債(40年)	490,000,000	637,450,800	
第6回利付国債(40年)	390,000,000	496,037,100	
第7回利付国債(40年)	690,000,000	835,624,500	
第8回利付国債(40年)	670,000,000	748,041,600	
第9回利付国債(40年)	970,000,000	772,090,900	
第10回利付国債(40年)	950,000,000	899,004,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	570,052,000	
第298回利付国債(10年)	550,000,000	559,234,500	
第299回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,265,184,400	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	849,189,600	
第301回利付国債(10年)	340,000,000	349,275,200	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	205,124,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,431,060,600	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	493,262,400	
第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,969,267,300	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,212,997,500	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	724,038,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,027,303,200	
第309回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,662,083,500	
第310回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,125,272,400	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	626,183,300	
第312回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,843,136,400	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	240,000,000	251,472,000	
第314回利付国債(10年)	310,000,000	322,700,700	
第315回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,748,991,000	
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,137,556,700	
第317回利付国債(10年)	710,000,000	743,121,500	
第318回利付国債(10年)	950,000,000	990,593,500	
第319回利付国債(10年)	680,000,000	713,605,600	
第320回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,170,680,000	
第321回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,540,471,800	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	782,640,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,014,173,800	
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,332,313,600	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,388,676,100	
第326回利付国債(10年)	420,000,000	436,846,200	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	773,514,600	
第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,782,006,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,359,777,500	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,512,950,400	
第331回利付国債(10年)	580,000,000	602,509,800	
第332回利付国債(10年)	2,230,000,000	2,318,776,300	

第333回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,176,420,400	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,908,156,500	
第335回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,488,032,000	
第336回利付国債(10年)	610,000,000	632,954,300	
第337回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,381,441,500	
第338回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,855,350,000	
第339回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,794,116,800	
第340回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,011,133,200	
第341回利付国債(10年)	2,820,000,000	2,886,636,600	
第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,618,538,000	
第343回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,546,369,100	
第344回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,508,655,000	
第345回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,020,070,100	
第346回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,420,548,000	
第347回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,539,689,900	
第348回利付国債(10年)	680,000,000	682,006,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,399,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	203,075,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	151,269,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	147,933,500	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	63,044,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	245,704,200	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	231,222,600	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,776,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	277,668,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,926,400	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,272,700	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	240,281,600	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	362,613,100	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	394,482,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	453,254,000	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	493,824,200	
第17回利付国債(30年)	330,000,000	435,606,600	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	450,549,300	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	366,517,200	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	564,551,400	
第21回利付国債(30年)	270,000,000	353,837,700	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	538,900,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	579,708,800	
第24回利付国債(30年)	260,000,000	351,036,400	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	381,254,300	
第26回利付国債(30年)	410,000,000	546,812,900	

第27回利付国債(30年)	600,000,000	812,838,000
第28回利付国債(30年)	930,000,000	1,262,670,300
第29回利付国債(30年)	890,000,000	1,194,246,500
第30回利付国債(30年)	640,000,000	848,774,400
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,177,668,000
第32回利付国債(30年)	880,000,000	1,171,957,600
第33回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,410,177,300
第34回利付国債(30年)	875,000,000	1,150,485,000
第35回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,477,909,600
第36回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,276,270,000
第37回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,331,190,400
第38回利付国債(30年)	670,000,000	826,277,500
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,055,779,200
第40回利付国債(30年)	600,000,000	740,676,000
第41回利付国債(30年)	590,000,000	714,903,000
第42回利付国債(30年)	750,000,000	910,027,500
第43回利付国債(30年)	750,000,000	910,290,000
第44回利付国債(30年)	810,000,000	982,278,900
第45回利付国債(30年)	690,000,000	803,125,500
第46回利付国債(30年)	840,000,000	977,642,400
第47回利付国債(30年)	900,000,000	1,070,307,000
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,253,428,000
第49回利付国債(30年)	740,000,000	842,993,200
第50回利付国債(30年)	520,000,000	513,463,600
第51回利付国債(30年)	790,000,000	678,926,000
第52回利付国債(30年)	770,000,000	700,145,600
第53回利付国債(30年)	930,000,000	867,559,800
第54回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,257,548,800
第55回利付国債(30年)	970,000,000	951,744,600
第56回利付国債(30年)	340,000,000	333,162,600
第41回利付国債(20年)	330,000,000	337,629,600
第42回利付国債(20年)	80,000,000	83,086,400
第43回利付国債(20年)	140,000,000	148,150,800
第44回利付国債(20年)	170,000,000	180,732,100
第45回利付国債(20年)	290,000,000	307,608,800
第46回利付国債(20年)	170,000,000	180,500,900
第47回利付国債(20年)	90,000,000	96,067,800
第48回利付国債(20年)	130,000,000	140,710,700
第49回利付国債(20年)	140,000,000	150,507,000
第50回利付国債(20年)	220,000,000	235,006,200
第51回利付国債(20年)	100,000,000	107,669,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	119,427,000
第53回利付国債(20年)	80,000,000	87,272,000

第54回利付国債(20年)	200,000,000	219,060,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	152,906,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	164,538,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	262,140,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	329,097,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	218,318,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	376,624,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	253,857,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	335,612,800	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	221,106,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	357,072,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	246,415,400	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	367,583,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	146,188,900	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	217,318,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	443,574,300	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	464,812,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	229,738,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	722,622,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	412,113,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	230,384,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	150,320,300	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	308,202,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	333,181,000	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	194,797,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	311,453,100	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	255,461,800	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	451,491,300	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	699,348,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	339,253,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	545,999,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	340,741,300	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	250,269,600	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	650,848,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	502,517,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	415,740,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	751,104,900	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	540,499,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,044,894,400	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	484,820,900	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	727,028,500	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	741,516,000	

第96回利付国債(20年)	320,000,000	382,844,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	484,060,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	528,136,400
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,384,025,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	584,380,800
第101回利付国債(20年)	415,000,000	513,799,050
第102回利付国債(20年)	320,000,000	397,590,400
第103回利付国債(20年)	160,000,000	197,108,800
第104回利付国債(20年)	360,000,000	435,902,400
第105回利付国債(20年)	680,000,000	825,839,600
第106回利付国債(20年)	380,000,000	465,595,000
第107回利付国債(20年)	150,000,000	182,695,500
第108回利付国債(20年)	610,000,000	729,529,500
第109回利付国債(20年)	180,000,000	215,798,400
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,160,282,500
第111回利付国債(20年)	390,000,000	482,406,600
第112回利付国債(20年)	630,000,000	771,598,800
第113回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,510,563,000
第114回利付国債(20年)	710,000,000	874,244,300
第115回利付国債(20年)	510,000,000	634,057,500
第116回利付国債(20年)	660,000,000	822,241,200
第117回利付国債(20年)	720,000,000	888,249,600
第118回利付国債(20年)	690,000,000	844,856,700
第119回利付国債(20年)	270,000,000	323,916,300
第120回利付国債(20年)	680,000,000	798,483,200
第121回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,480,945,800
第122回利付国債(20年)	200,000,000	240,262,000
第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,242,760,000
第124回利付国債(20年)	390,000,000	479,680,500
第125回利付国債(20年)	310,000,000	390,162,900
第126回利付国債(20年)	570,000,000	702,086,100
第127回利付国債(20年)	580,000,000	706,851,800
第128回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,244,685,600
第129回利付国債(20年)	100,000,000	120,705,000
第130回利付国債(20年)	750,000,000	906,840,000
第131回利付国債(20年)	380,000,000	454,354,600
第132回利付国債(20年)	690,000,000	825,660,900
第133回利付国債(20年)	600,000,000	726,156,000
第134回利付国債(20年)	560,000,000	678,781,600
第135回利付国債(20年)	420,000,000	503,260,800
第136回利付国債(20年)	410,000,000	485,595,800
第137回利付国債(20年)	380,000,000	455,639,000
第138回利付国債(20年)	310,000,000	362,982,100

	第139回利付国債(20年)	510,000,000	604,339,800
	第140回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,692,860,100
	第141回利付国債(20年)	690,000,000	828,834,900
	第142回利付国債(20年)	460,000,000	559,217,400
	第143回利付国債(20年)	890,000,000	1,056,447,800
	第144回利付国債(20年)	740,000,000	867,539,000
	第145回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,888,757,100
	第146回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,708,842,200
	第147回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,640,005,800
	第148回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,489,621,100
	第149回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,782,458,400
	第150回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,549,736,800
	第151回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,494,813,600
	第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,527,076,000
	第153回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,890,773,200
	第154回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,334,573,100
	第155回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,694,050,800
	第156回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,116,082,800
	第157回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,505,248,000
	第158回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,308,687,600
	第159回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,520,449,200
	第160回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,697,698,600
	第161回利付国債(20年)	1,110,000,000	1,111,953,600
	第162回利付国債(20年)	410,000,000	410,000,000
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	200,462,000
	国債証券合計	248,075,000,000	268,599,210,850
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,979,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,063,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	129,531,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,435,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,656,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,699,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,804,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,086,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	104,004,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	104,260,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	103,886,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	208,450,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,764,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,154,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,633,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,562,000

平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	104,237,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	208,214,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,865,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,370,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,202,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	133,798,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,191,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,603,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	206,344,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,850,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,281,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	236,600,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,909,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,707,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,996,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,770,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,369,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,893,000	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,862,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,582,000	
第410回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,326,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,320,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	118,101,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,266,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,248,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	106,603,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	103,189,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,567,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	103,568,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,290,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,441,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	112,534,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	107,583,765	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,968,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,305,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	122,322,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,748,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,232,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,966,000	

平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,104,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,731,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,754,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,116,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,417,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	121,957,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,494,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,818,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,393,309	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,683,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,040,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	201,109,860	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,505,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,126,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,612,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,495,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,449,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,094,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	120,797,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	208,434,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	125,598,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,455,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,235,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	103,324,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	123,621,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,451,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,289,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,226,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,629,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,893,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,965,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,202,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	372,835,240	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,110,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,856,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,241,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,502,000	

第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,827,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,728,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,403,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,826,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,335,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,577,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,464,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,376,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,929,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,467,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,166,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,818,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,258,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,512,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,177,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,756,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,733,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,714,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	207,454,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,043,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	242,056,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,415,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	131,861,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	119,829,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,283,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,523,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	105,152,820	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,278,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,722,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,178,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,574,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,500,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	204,948,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,194,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,121,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,812,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,275,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	118,299,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,428,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	198,492,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	144,607,050	

	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	206,050,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	104,237,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,475,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,465,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,667,150	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	208,348,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,176,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,761,000	
	地方債券合計	17,349,520,000	18,404,038,794	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,271,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,518,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,333,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,391,000	
	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	106,461,000	
	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	213,216,000	
	第14回道路債券	100,000,000	109,502,000	
	第17回道路債券	100,000,000	107,596,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	475,524,000	
	第21回道路債券	100,000,000	132,986,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,393,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,911,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,159,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,313,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,627,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,054,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,392,000	
	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	135,156,000	
	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	242,204,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,241,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,306,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,045,000	

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	142,785,840	
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	127,790,000	
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	103,584,000	
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	102,950,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,689,000	
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	206,068,000	
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	205,792,000	
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	207,852,000	
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	122,358,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,034,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,657,000	
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	104,231,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,348,000	
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	312,261,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,062,000	
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	312,732,980	
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	208,308,000	
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	104,200,000	
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	103,895,000	
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	311,265,000	
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	117,199,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,321,000	
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	312,840,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,042,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,740,000	
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	309,831,000	
	200,000,000	209,804,000	

第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	154,806,520	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,885,000	
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	228,934,000	
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	106,141,200	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,994,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,722,000	
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	103,389,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,905,000	
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	305,544,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	314,420,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,994,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,793,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,133,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	323,883,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,507,700	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,300,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,251,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	133,606,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,428,000	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,269,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,427,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,654,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,150,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,891,630	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,878,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,542,980	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,652,060	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,863,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,201,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,883,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,555,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,746,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,256,000	

第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,859,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,253,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,703,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,802,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,920,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,238,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,254,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,292,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,814,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,503,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	103,710,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,873,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,118,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,101,200	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,723,000	19,750,331	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,234,000	19,358,673	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,702,000	19,986,640	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,955,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,817,000	21,085,882	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,068,000	21,338,304	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,057,000	16,734,284	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,674,000	35,775,594	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,491,000	20,609,198	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,711,000	18,785,172	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,615,000	21,861,589	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,696,000	18,781,118	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,396,000	21,525,734	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,881,000	23,616,395	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,234,000	23,951,698	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,645,000	29,906,361	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,689,000	31,135,024	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,860,000	33,524,452	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,485,000	37,003,784	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,597,000	39,208,561	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,713,000	40,281,255	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,431,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,604,000	84,991,598	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,543,000	19,405,805	

第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,532,000	44,088,294	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,621,000	19,477,007	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,217,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,281,000	19,431,606	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,287,000	48,210,728	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,071,000	18,091,504	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,525,000	48,582,459	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,980,000	45,970,978	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,844,000	20,084,312	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,934,000	89,993,518	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,379,000	49,170,088	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,278,000	20,431,209	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,974,000	61,036,766	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,780,000	58,731,877	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,299,000	58,272,427	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,982,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,236,000	124,056,758	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,090,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,178,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,342,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,366,000	132,380,399	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,306,000	66,739,982	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,479,000	67,521,764	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,878,000	69,078,353	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,946,000	61,728,840	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,262,000	62,600,768	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,164,000	68,530,372	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	181,971,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,377,000	61,747,329	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,785,000	69,290,773	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,240,000	70,846,768	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,193,000	69,541,395	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,784,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,734,000	147,658,323	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,593,000	74,759,901	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,760,000	153,041,241	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,474,000	83,554,845	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,097,000	86,954,667	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,305,000	86,632,661	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,950,000	177,230,584	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,473,000	87,924,365	
	90,263,000	92,893,263	

第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,004,000	95,732,308	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,258,000	95,724,730	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,939,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,626,000	96,543,867	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,109,000	97,582,891	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,387,000	97,675,265	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,992,000	99,104,850	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,401,000	99,637,574	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,838,000	99,733,170	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,877,000	
第126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	125,184,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,458,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	118,792,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	114,282,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,213,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,507,000	
い第795号商工債	200,000,000	198,966,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,399,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,545,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,788,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,410,000	
第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,261,000	
第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,975,000	
第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,423,000	
第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,511,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,824,000	
第201号商工債（3年）	300,000,000	299,244,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	208,028,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,888,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,471,000	
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,570,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,378,000	

特殊債券合計		22,108,716,000	23,388,707,341	
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	99,869,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,990,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,066,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,956,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,408,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,051,000	
	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	100,357,000	
	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	100,243,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,737,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリパ円貨社債	100,000,000	100,463,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,366,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,201,000	
	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	100,271,000	
	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	100,380,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,134,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,905,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,353,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,499,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,745,000	
	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	103,136,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,882,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,162,000	
	第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,014,000	
	第11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	99,732,000	
	第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,337,000	
	第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,000,000	
	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	102,091,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,799,000	
	第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,680,000	
	第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,692,000	

第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,015,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,725,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,287,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,927,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,409,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,842,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,616,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,661,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,008,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,494,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,947,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,609,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,041,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,171,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,258,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,398,000	
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	100,482,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,482,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,545,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,651,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,225,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,923,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,680,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,922,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,199,000	
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	125,771,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,315,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,747,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	119,156,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	102,197,000	
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	104,378,000	
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	104,008,000	

第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,293,000	
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	102,839,000	
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	103,530,000	
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	103,540,000	
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	105,067,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,815,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,500,000	
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	100,602,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,289,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,399,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,032,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,753,000	
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	100,539,000	
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	102,597,000	
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	100,449,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,251,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,978,000	
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	103,577,000	
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	104,099,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,836,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,941,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,849,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,455,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,743,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	244,764,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,627,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,816,590	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,768,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,917,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,364,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,889,000	

第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,546,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,770,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,145,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,128,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,710,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,925,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	122,346,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,323,600	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,789,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,453,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,748,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,277,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,245,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,252,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,952,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,432,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,924,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,595,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,890,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,090,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,247,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,583,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,599,880	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,353,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,313,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,683,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,547,320	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,836,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,365,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,207,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,747,000	
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	101,155,000	
社債券合計	13,296,000,000	13,697,010,390	
合計		324,088,967,375	

(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。

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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,238,714,640
コール・ローン	436,631,407
株式	313,213,891,627
投資信託受益証券	272,770,651
投資証券	7,781,860,905
派生商品評価勘定	159,676,653
未収入金	2,987,932
未収配当金	270,606,928
差入委託証拠金	1,822,751,571
流動資産合計	330,199,892,314
資産合計	330,199,892,314
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	524,720
前受金	158,913,263
未払解約金	619,396,447
未払利息	708
流動負債合計	778,835,138
負債合計	778,835,138
純資産の部	
元本等	
元本	136,967,351,508
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	192,453,705,668
元本等合計	329,421,057,176
純資産合計	329,421,057,176
負債純資産合計	330,199,892,314

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10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	平成29年10月20日現在
	<p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)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、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>

	平成29年10月20日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,967,351,508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 2.4051円 (1万口当たり純資産額) (24,051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10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10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>

(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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	138,400,239,989円
期中追加設定元本額	11,375,512,154円
期中一部解約元本額	12,808,400,635円

区分	平成29年10月20日現在
期末元本額	136,967,351,508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）	2,466,293,872円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,636,352円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,374,299,141円
世界経済インデックスファンド	6,814,393,569円
外国株式インデックス・オープン	838,767,481円
D C マイセレクション 2 5	915,139,848円
D C マイセレクション 5 0	4,613,928,222円
D C マイセレクション 7 5	4,999,437,652円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,038,343,631円
D C マイセレクション S 2 5	374,576,550円
D C マイセレクション S 5 0	1,829,293,770円
D C マイセレクション S 7 5	1,403,991,013円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	130,032,931円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	179,113,674円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	103,894,100円
D C 世界経済インデックスファンド	4,840,892,674円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,717,198,678円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,472,030円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,817,085円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	72,575,397円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	110,856,524円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	399,321,172円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	61,241,166円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	493,145,324円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,057,132,245円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	511,360,893円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	3,339,152,852円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,407,581,961円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	250,217,007円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	464,129,065円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	530,695,544円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	161,483,698円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,510,478,133円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,766,085,332円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,539,044,029円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,830,961,646円
コア投資戦略ファンド（成長型）	8,909,279,860円
分散投資コア戦略ファンド A	1,813,763,586円
分散投資コア戦略ファンド S	3,580,985,511円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	460,919,534円

区分	平成29年10月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	600,280,942円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,529,146,609円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	822,902,086円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,157,791円
S M T インデックスバランス・オープン	330,702,494円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,657,777,969円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	28,543,655,955円
S M T 世界経済インデックス・オープン	380,196円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	18,088,536円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	3,996,402円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	167,216円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	1,903,890,118円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,544,272,442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10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	13,578,814,761
投資信託受益証券	9,835,546
投資証券	61,102,633
合計	13,630,081,848

(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10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	7,795,326,158		7,954,239,421	158,913,263
	買建				
合計		7,795,326,158	-	7,954,239,421	158,913,263

(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10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	353,996,870	-	353,758,200	238,670
	アメリカドル	209,904,200	-	209,715,000	189,200
	カナダドル	16,248,780	-	16,248,600	180
	ユーロ	72,075,960	-	72,138,600	62,640
	イギリスポンド	23,810,720	-	23,724,800	85,920
	スイスフラン	15,010,190	-	15,009,800	390
	スウェーデンクローナ	16,947,020	-	16,921,400	25,620
合計		353,996,870	-	353,758,200	238,670

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	48.67	2,159,974.60	
	ANDEAVOR	11,677	104.95	1,225,501.15	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	19.59	365,079.24	
	APACHE CORP	29,810	42.15	1,256,491.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	31,676	33.15	1,050,059.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	39,315	25.48	1,001,746.20	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	46.81	734,495.71	
	CHEVRON CORP	152,531	118.20	18,029,164.20	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	115.32	876,316.68	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	132.26	1,559,742.18	
	CONOCOPHILLIPS	99,645	49.71	4,953,352.95	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	36.77	281,180.19	

CORE LABORATORIES N.V.	3,346	89.31	298,831.26
DEVON ENERGY CORPORATION	40,715	34.95	1,422,989.25
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,511	101.59	763,042.49
EOG RESOURCES INC	46,361	95.76	4,439,529.36
EQT CORPORATION	13,878	63.06	875,146.68
EXXON MOBIL	341,013	82.74	28,215,415.62
HALLIBURTON CO	69,072	43.42	2,999,106.24
HELMERICH & PAYNE	8,315	50.94	423,566.10
HESS CORP	23,898	45.05	1,076,604.90
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	36.13	449,746.24
KINDER MORGAN INC	162,488	18.65	3,030,401.20
MARATHON OIL CORP	71,172	13.74	977,903.28
MARATHON PETROLEUM CORP	41,702	57.10	2,381,184.20
MURPHY OIL CORP	13,898	25.76	358,012.48
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	34.08	1,032,998.88
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	29.27	470,456.71
NOBLE ENERGY INC	38,291	27.37	1,048,024.67
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,334	64.84	3,976,896.56
ONEOK INC	30,874	55.81	1,723,077.94
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	26.11	421,258.74
PHILLIPS 66	34,624	90.39	3,129,663.36
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	142.98	1,923,081.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	21.25	210,162.50
RANGE RESOURCES CORP	20,891	19.00	396,929.00
SCHLUMBERGER	112,019	64.50	7,225,225.50
TARGA RESOURCES CORP	16,467	44.49	732,616.83
TECHNIPFMC PLC	36,005	25.10	903,725.50
VALERO ENERGY CORP	35,848	77.63	2,782,880.24
WILLIAMS COS	67,038	29.60	1,984,324.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,586	152.86	2,688,195.96
ALBEMARLE CORP	8,647	139.49	1,206,170.03
AVERY DENNISON CORP	7,457	98.79	736,677.03
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	29.20	514,095.20
BALL CORP	27,142	41.94	1,138,335.48
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	105.29	1,163,770.37
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,559	36.33	746,908.47
CROWN HOLDINGS INC	12,217	60.68	741,327.56
DOWDUPONT INC	183,235	70.89	12,989,529.15
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	88.79	1,052,871.82
ECOLAB INC	20,812	131.74	2,741,772.88
FMC CORP	10,402	94.12	979,036.24
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	14.81	1,649,774.76

INT'L PAPER CO	30,605	57.61	1,763,154.05
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	148.12	899,088.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,660	99.39	2,749,127.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	209.50	1,045,195.50
MONSANTO CO	34,984	122.03	4,269,097.52
MOSAIC CO/THE	27,677	21.10	583,984.70
NEWMONT MINING CORP	42,952	37.84	1,625,303.68
NUCOR CORP	24,915	58.62	1,460,517.30
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,070	116.60	940,962.00
PPG INDUSTRIES INC	21,022	114.31	2,403,024.82
PRAXAIR INC	22,656	140.41	3,181,128.96
SEALED AIR CORP	14,689	44.16	648,666.24
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,776	387.57	2,626,174.32
STEEL DYNAMICS INC	18,273	37.78	690,353.94
VULCAN MATERIALS CO	10,740	120.04	1,289,229.60
WESTROCK CO	20,913	59.60	1,246,414.80
WR GRACE & CO	5,635	71.06	400,423.10
3 M COMPANY	48,002	219.24	10,523,958.48
ACUITY BRANDS INC	3,505	160.94	564,094.70
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	52.26	592,105.80
AGCO CORP	5,969	71.74	428,216.06
ALLEGION PLC	7,168	87.74	628,920.32
AMETEK INC	18,866	68.40	1,290,434.40
ARCONIC INC	30,141	26.68	804,161.88
BOEING CO	46,016	259.04	11,919,984.64
CATERPILLAR	46,823	131.55	6,159,565.65
CUMMINS INC	12,985	175.31	2,276,400.35
DEERE&CO	21,853	128.52	2,808,547.56
DOVER CORP	13,056	89.50	1,168,512.00
EATON CORP	35,279	78.02	2,752,467.58
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	65.16	3,318,403.32
FASTENAL CO	23,228	48.26	1,120,983.28
FLOWSERVE CORP	10,826	44.49	481,648.74
FLUOR CORP	11,267	43.06	485,157.02
FORTIVE CORP	24,294	71.10	1,727,303.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	65.58	840,079.80
GENERAL DYNAMICS CORP	20,743	211.64	4,390,048.52
GENERAL ELECTRIC CO	697,433	23.58	16,445,470.14
GRAINGER (WW) INC	4,749	204.65	971,882.85
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	36.24	551,790.24
HONEYWELL INTL INC	58,230	143.62	8,362,992.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,963	234.81	930,552.03

IDEX CORP	5,756	124.64	717,427.84
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	153.48	3,764,557.44
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	91.08	1,844,278.92
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	58.30	565,101.90
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	66.98	1,111,868.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	43.78	722,370.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	41.24	3,071,885.12
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	187.57	1,147,365.69
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	179.39	517,540.15
LOCKHEED MARTIN CORP	20,956	316.84	6,639,699.04
MASCO CORP	24,547	39.06	958,805.82
MIDDLEBY CORP	4,364	119.45	521,279.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,276	292.65	3,885,221.40
PACCAR INC	27,548	73.77	2,032,215.96
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	182.01	1,991,553.42
PENTAIR PLC	13,583	70.71	960,453.93
RAYTHEON COMPANY	23,550	186.95	4,402,672.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	186.44	1,939,908.20
ROCKWELL COLLIN	13,112	134.57	1,764,481.84
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	251.96	2,040,876.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	49.60	685,868.80
SMITH (A.O.) CORP	12,146	60.80	738,476.80
SNAP-ON INC	4,900	156.19	765,331.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	157.16	1,888,277.40
TEXTRON	21,877	53.10	1,161,668.70
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	264.50	1,077,044.00
UNITED RENTALS INC	6,446	144.40	930,802.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,214	119.49	7,314,460.86
WABCO HOLDINGS INC	3,841	155.08	595,662.28
WABTEC CORP	7,158	75.66	541,574.28
XYLEM INC	13,941	63.89	890,690.49
CINTAS CORP	7,034	150.95	1,061,782.30
EQUIFAX INC	9,276	110.51	1,025,090.76
IHS MARKIT LTD	33,011	43.52	1,436,638.72
MANPOWER GROUP	5,123	122.69	628,540.87
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,941	41.31	1,236,862.71
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	63.65	1,175,042.65
ROBERT HALF INTL INC	11,558	50.92	588,533.36
ROLLINS INC	7,031	47.66	335,097.46
STERICYCLE INC	6,767	71.90	486,547.30
VERISK ANALYTICS INC	12,301	84.91	1,044,477.91
WASTE CONNECTIONS INC	21,610	70.78	1,529,555.80

WASTE MANAGEMENT INC	34,931	77.37	2,702,611.47
AMERCO	602	373.13	224,624.26
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	51.51	510,979.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	77.98	892,715.04
CSX CORP	72,941	54.06	3,943,190.46
DELTA AIR LINES INC	15,095	52.27	789,015.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,281	58.91	900,203.71
FEDEX CORP	20,171	223.97	4,517,698.87
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	104.79	747,571.86
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	103.78	907,348.54
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	39.35	421,045.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	71.26	413,949.34
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	130.24	2,969,341.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	58.63	774,736.82
UNION PACIFIC CORP	64,308	112.01	7,203,139.08
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	59.78	358,859.34
UNITED PARCEL SERVICE B	55,410	119.42	6,617,062.20
AUTOLIV INC	7,451	124.50	927,649.50
BORGWARNER INC	18,147	52.05	944,551.35
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	97.64	2,045,948.56
FORD MOTOR COMPANY	295,438	12.23	3,613,206.74
GENERAL MOTORS CO	109,241	45.35	4,954,079.35
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	33.60	726,667.20
HARLEY-DAVIDSON	14,677	48.09	705,816.93
LEAR CORP	5,287	172.54	912,218.98
TESLA INC	10,571	351.81	3,718,983.51
COACH INC	22,032	39.47	869,603.04
DR HORTON INC	28,586	42.53	1,215,762.58
GARMIN LTD	9,564	55.45	530,323.80
HANESBRANDS INC	31,136	23.15	720,798.40
HASBRO INC	9,007	96.67	870,706.69
LEGGETT & PLATT INC	10,594	48.43	513,067.42
LENNAR CORP-CL A	16,492	56.75	935,921.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	60.09	509,082.48
MATTEL INC	27,399	15.81	433,178.19
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	48.84	679,852.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	261.04	1,321,384.48
NEWELL BRANDS INC	37,563	40.59	1,524,682.17
NIKE B	106,351	52.69	5,603,634.19
NVR INC	264	3,127.53	825,667.92
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	105.36	494,243.76
PULTE GROUP INC	24,602	27.78	683,443.56

PVH CORP	6,800	125.74	855,032.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	86.38	395,447.64
TOLL BROTHERS INC	11,211	43.96	492,835.56
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	16.45	262,377.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	15.02	244,570.66
VF CORP	26,718	65.35	1,746,021.30
WHIRLPOOL CORP	6,165	177.96	1,097,123.40
ARAMARK	19,980	42.83	855,743.40
BLOCK H & R INC	16,984	25.55	433,941.20
CARNIVAL CORPORATION	27,162	65.79	1,786,987.98
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	325.27	642,408.25
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	81.97	822,241.07
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	186.12	760,858.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,573	71.10	1,178,340.30
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	62.34	1,922,877.30
MARRIOTT INTL A	26,066	115.20	3,002,803.20
MCDONALD'S CORP	65,456	166.50	10,898,424.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	23.18	409,405.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	30.48	1,101,669.12
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	14,813	54.17	802,420.21
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	121.12	1,681,751.20
STARBUCKS CORP	115,910	55.40	6,421,414.00
VAIL RESORTS INC	2,987	222.50	664,607.50
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	109.30	868,169.90
WYNN RESORTS LTD	6,619	145.53	963,263.07
YUM BRANDS INC	27,230	75.82	2,064,578.60
CBS CORP-CL B	28,894	57.83	1,670,940.02
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,330	351.67	6,094,441.10
COMCAST CORP-CL A	380,023	36.90	14,022,848.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	20.09	257,232.36
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	18.97	321,446.65
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	49.32	898,511.76
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	20.80	703,747.20
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	93.05	806,092.15
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19,082	31.74	605,662.68
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	30.77	1,423,758.67
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	43.69	665,529.77
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.72	279,108.48
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.62	455,983.98
OMNICOM GROUP	19,057	72.96	1,390,398.72
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	84.50	537,082.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.74	743,358.70

THE WALT DISNEY CO	125,167	99.01	12,392,784.67
TIME WARNER INC	62,319	102.20	6,369,001.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	27.37	2,276,800.82
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,931	26.70	986,057.70
VIACOM INC-CLASS B	26,755	26.53	709,810.15
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	86.92	537,687.12
AMAZON.COM	32,607	986.61	32,170,392.27
AUTONATION INC	5,015	44.52	223,267.80
AUTOZONE INC	2,370	595.27	1,410,789.90
BED BATH & BEYOND INC	12,615	21.20	267,438.00
BEST BUY COMPANY INC	21,836	55.46	1,211,024.56
CARMAX INC	14,253	74.84	1,066,694.52
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	26.00	204,126.00
DOLLAR GENERAL CORP	22,756	82.91	1,886,699.96
DOLLAR TREE INC	18,300	91.41	1,672,803.00
EXPEDIA INC	9,800	153.40	1,503,320.00
FOOT LOCKER INC	11,410	30.99	353,595.90
GAP	20,859	26.61	555,057.99
GENUINE PARTS CO	12,484	89.71	1,119,939.64
HOME DEPOT	96,452	163.24	15,744,824.48
KOHL'S CORP	15,495	43.86	679,610.70
L BRANDS INC	19,499	42.00	818,958.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	23.09	809,789.39
LKQ CORP	24,693	37.23	919,320.39
LOWES COMPANIES	69,142	81.27	5,619,170.34
MACY'S INC	25,926	20.19	523,445.94
NETFLIX INC	34,325	195.13	6,697,837.25
NORDSTROM INC	10,094	41.73	421,222.62
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,397	209.30	1,548,192.10
PRICELINE GROUP INC/THE	3,948	1,927.86	7,611,191.28
ROSS STORES INC	32,319	63.39	2,048,701.41
SIGNET JEWELERS LTD	5,407	62.91	340,154.37
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,075	60.43	2,542,592.25
TIFFANY & CO	10,306	93.60	964,641.60
TJX COMPANIES INC	52,399	71.41	3,741,812.59
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,274	58.43	658,739.82
TRIPADVISOR INC	10,393	40.48	420,708.64
ULTA BEAUTY INC	4,911	204.62	1,004,888.82
COSTCO WHOLESALE CORP	35,300	158.46	5,593,638.00
CVS HEALTH CORP	80,999	74.63	6,044,955.37
KROGER CO	73,364	20.89	1,532,573.96
SYSCO CORP	40,957	54.74	2,241,986.18

WAL-MART STORES	121,565	86.40	10,503,216.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	73,927	67.20	4,967,894.40
ALTRIA GROUP INC	155,248	64.37	9,993,313.76
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	43.31	1,930,196.77
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,638	55.76	871,974.88
BUNGE LIMITED	11,767	70.83	833,456.61
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	45.37	638,446.64
COCA-COLA CO	326,033	46.59	15,189,877.47
CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.76	1,122,283.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,015	211.98	2,970,899.70
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	89.31	1,326,700.05
GENERAL MILLS INC	46,814	52.03	2,435,732.42
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	109.35	1,224,720.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	30.62	718,498.30
INGREDION INC	5,835	123.16	718,638.60
JM SMUCKER CO	9,562	104.00	994,448.00
KELLOGG CO	21,051	61.70	1,298,846.70
KRAFT HEINZ CO/THE	48,860	76.47	3,736,324.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	99.37	921,756.12
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	83.58	1,262,058.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,487	40.73	4,907,435.51
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	55.99	1,740,897.07
PEPSICO INC	114,759	112.67	12,929,896.53
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,759	108.15	13,492,685.85
TYSON FOODS INC	22,220	71.41	1,586,730.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	47.28	998,837.28
CLOROX COMPANY	10,045	130.12	1,307,055.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,564	73.14	4,941,630.96
COTY INC-CL A	39,000	15.83	617,370.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	109.70	1,955,073.40
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	115.55	3,234,244.50
PROCTER & GAMBLE CO	205,388	91.59	18,811,486.92
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	110.04	208,415.76
ABBOTT LABORATORIES	138,584	56.00	7,760,704.00
AETNA INC	26,760	157.64	4,218,446.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,229	196.85	1,226,178.65
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	82.20	1,056,023.40
ANTHEM INC	21,018	193.20	4,060,677.60
BARD C R INC	5,875	327.30	1,922,887.50
BAXTER INTERNATIONAL	39,728	63.47	2,521,536.16
BECTON DICKINSON & CO	18,352	209.36	3,842,174.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	29.57	3,189,834.18

CARDINAL HEALTH	25,252	66.15	1,670,419.80
CENTENE CORP	13,787	94.70	1,305,628.90
CERNER CORP	23,088	72.80	1,680,806.40
CIGNA CORP	20,371	188.22	3,834,229.62
DANAHER CORP	49,843	90.10	4,490,854.30
DAVITA INC	13,384	58.70	785,640.80
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	60.67	1,081,988.78
DEXCOM INC	6,289	44.98	282,879.22
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	112.03	1,879,415.28
ENVISION HEALTHCARE	9,978	45.08	449,808.24
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	49,016	58.75	2,879,690.00
HCA HEALTHCARE INC	23,646	79.79	1,886,714.34
HENRY SCHEIN INC	12,492	83.09	1,037,960.28
HOLOGIC INC	21,094	37.08	782,165.52
HUMANA INC	11,797	242.69	2,863,013.93
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	161.58	1,178,079.78
INTUITIVE SURGICAL INC	9,186	357.46	3,283,627.56
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	151.32	1,203,447.96
MCKESSON CORP	16,655	149.96	2,497,583.80
MEDNAX INC	8,151	44.51	362,801.01
MEDTRONIC PLC	110,198	78.48	8,648,339.04
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	38.80	274,781.60
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	93.23	1,066,457.97
RESMED INC	11,925	78.79	939,570.75
STRYKER CORP	26,917	149.32	4,019,246.44
TELEFLEX INC	3,697	241.99	894,637.03
THE COOPER COS INC	4,109	236.08	970,052.72
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,513	203.25	15,754,517.25
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	110.54	801,193.92
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	105.60	826,003.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,988	59.60	476,084.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	121.88	1,957,758.44
ABBVIE INC	128,104	96.48	12,359,473.92
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	66.88	1,693,602.24
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	140.46	2,490,215.34
ALKERMES PLC	12,547	50.56	634,376.32
ALLERGAN PLC	27,062	189.27	5,122,024.74
AMGEN	59,185	184.12	10,897,142.20
BIOGEN INC	17,038	342.42	5,834,151.96
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	88.13	1,263,872.33
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,369	64.67	8,560,303.23
CELGENE CORP	62,865	135.96	8,547,125.40

GILEAD SCIENCES INC	105,215	81.59	8,584,491.85
ILLUMINA INC	11,836	205.18	2,428,510.48
INCYTE CORP	14,121	114.27	1,613,606.67
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	145.00	720,795.00
JOHNSON & JOHNSON	216,568	142.04	30,761,318.72
LILLY (ELI) & CO	80,004	86.36	6,909,145.44
MALLINCKRODT PLC	9,552	32.82	313,496.64
MERCK & CO	220,029	63.75	14,026,848.75
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	661.19	1,326,347.14
MYLAN NV	36,548	38.29	1,399,422.92
PERRIGO CO PLC	9,792	87.53	857,093.76
PFIZER	480,001	36.24	17,395,236.24
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,874	101.82	1,107,190.68
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,325	440.94	2,788,945.50
SEATTLE GENETICS INC	7,471	64.01	478,218.71
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	107.89	157,303.62
TESARO INC	2,771	115.51	320,078.21
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	14.93	1,073,108.68
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,681	192.44	6,096,691.64
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	119.06	386,587.82
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	154.60	3,074,066.40
WATERS CORP	6,513	185.45	1,207,835.85
ZOETIS INC	39,710	65.58	2,604,181.80
BANK OF AMERICA CORP	799,189	26.58	21,242,443.62
BB&T CORP	64,293	46.74	3,005,054.82
CIT GROUP INC	10,713	49.28	527,936.64
CITIGROUP	221,153	72.88	16,117,630.64
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	37.43	1,497,574.30
COMERICA INC	14,625	77.48	1,133,145.00
EAST WEST BANCORP INC	10,794	59.47	641,919.18
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	28.28	1,760,571.40
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	97.45	1,225,726.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	13.98	1,222,103.64
JPMORGAN CHASE & CO	285,238	98.11	27,984,700.18
KEY CORP	87,033	18.25	1,588,352.25
M & T BANK CORP	10,792	162.26	1,751,109.92
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	12.76	498,852.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	18.36	502,770.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,959	135.30	5,271,152.70
REGIONS FINL CORP	96,209	14.97	1,440,248.73
SIGNATURE BANK	4,354	126.12	549,126.48
SUNTRUST BANKS	38,353	59.11	2,267,045.83

SVB FINANCIAL GROUP	3,954	185.18	732,201.72
US BANCORP	135,655	53.59	7,269,751.45
WELLS FARGO & CO	381,231	53.75	20,491,166.25
ZIONS BANCORPORATION	15,186	46.05	699,315.30
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	195.72	867,626.76
ALLY FINANCIAL INC	36,028	24.52	883,406.56
AMERICAN EXPRESS	60,354	91.90	5,546,532.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,382	152.45	1,887,635.90
BANK NEW YORK CO	83,759	52.85	4,426,663.15
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100,212	187.21	18,760,688.52
BLACKROCK INC	9,743	476.79	4,645,364.97
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	87.48	3,348,297.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,588	108.93	826,560.84
CME GROUP INC	27,024	134.95	3,646,888.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	31,098	65.66	2,041,894.68
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,110	43.69	1,009,675.90
EATON VANCE CORP	10,061	51.51	518,242.11
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	44.87	1,169,760.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,555	239.99	6,852,914.45
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,132	66.85	3,150,774.20
INVESCO LTD	30,943	36.88	1,141,177.84
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	25.79	662,957.74
MOODY'S CORP	13,995	144.19	2,017,939.05
MORGAN STANLEY	111,836	49.79	5,568,314.44
MSCI INC	7,670	122.00	935,740.00
NASDAQ INC	9,070	72.94	661,565.80
NAVIENT CORP	23,616	12.31	290,712.96
NORTHERN TRUST CORP	17,320	94.98	1,645,053.60
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	95.63	1,816,204.96
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	85.72	851,371.04
S&P GLOBAL INC	20,491	159.44	3,267,085.04
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	43.27	4,121,424.23
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	63.19	682,578.38
STATE STREET CORP	30,456	97.48	2,968,850.88
SYNCHRONY FINANCIAL	65,163	31.71	2,066,318.73
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,142	47.39	1,049,309.38
VOYA FINANCIAL INC	16,094	39.85	641,345.90
AFLAC	32,201	84.45	2,719,374.45
ALLEGHANY CORP	1,276	560.92	715,733.92
ALLSTATE CORP	29,434	92.73	2,729,414.82
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	105.57	585,807.93
AMERICAN INT'L GROUP	74,267	65.07	4,832,553.69

AON PLC	20,775	150.82	3,133,285.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	101.16	1,021,918.32
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	62.64	937,846.08
ASSURANT INC	4,769	101.14	482,336.66
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,893	54.41	483,868.13
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.71	421,398.42
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	61.20	415,915.20
CHUBB LTD	37,318	153.98	5,746,225.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	76.19	945,746.47
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	237.25	795,499.25
FNF GROUP	20,786	35.59	739,773.74
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	56.47	1,618,543.14
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	75.00	1,334,250.00
LOEWS CORP	24,048	48.98	1,177,871.04
MARKEL CORP	1,132	1,063.35	1,203,712.20
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	84.29	3,442,235.02
METLIFE INC	74,757	52.99	3,961,373.43
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	68.17	1,578,476.35
PROGRESSIVE CORP	46,702	48.69	2,273,920.38
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,588	109.60	3,790,844.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	145.44	789,884.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	139.44	453,040.56
TORCHMARK CORP	9,592	82.53	791,627.76
TRAVELERS COS INC/THE	22,473	133.17	2,992,729.41
UNUM GROUP	18,574	52.28	971,048.72
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,506	161.17	1,693,252.02
WR BERKLEY CORP	8,610	69.44	597,878.40
XL GROUP LTD	20,644	42.46	876,544.24
CBRE GROUP INC-A	24,306	40.01	972,483.06
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.63	753,081.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	131.66	483,587.18
WEYERHAEUSER CO	58,857	35.18	2,070,589.26
ACCENTURE PLC-CL A	49,926	138.62	6,920,742.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,763	61.99	3,580,728.37
ADOBE SYSTEMS INC	39,838	171.73	6,841,379.74
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	51.65	732,293.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	232.80	934,924.80
ALPHABET INC-CL A	23,919	1,001.84	23,963,010.96
ALPHABET INC-CL C	25,095	984.45	24,704,772.75
ANSYS INC	6,865	129.89	891,694.85
AUTODESK INC	15,592	119.29	1,859,969.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,479	114.62	4,066,602.98

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	83.67	807,415.50
CA INC	26,520	33.93	899,823.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	41.81	902,468.85
CDK GLOBAL INC	10,687	65.24	697,219.88
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	117.90	1,273,437.90
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	82.74	1,035,160.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,060	74.27	3,569,416.20
COSTAR GROUP INC	2,453	280.47	688,005.17
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	16,887	81.64	1,378,654.68
DXC TECHNOLOGY CO	23,243	91.03	2,115,810.29
EBAY	81,500	37.29	3,039,135.00
ELECTRONIC ARTS INC	25,039	113.07	2,831,159.73
FACEBOOK INC-A	190,001	174.56	33,166,574.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	26,732	95.15	2,543,549.80
FIRST DATA CORP- CLASS A	29,535	18.45	544,920.75
FISERV INC	16,892	127.55	2,154,574.60
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	164.04	1,175,018.52
FORTINET INC	10,871	40.22	437,231.62
GARTNER INC	7,002	123.24	862,926.48
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	96.81	1,211,383.53
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,658	160.90	11,529,772.20
INTUIT INC	19,275	146.62	2,826,100.50
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	105.47	630,605.13
LEIDOS HOLDINGS	10,999	61.52	676,658.48
MASTERCARD INC-CLASS A	76,297	144.98	11,061,539.06
MERCADOLIBRE INC	3,264	236.00	770,304.00
MICROSOFT CORP	589,215	77.91	45,905,740.65
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,427	15.32	358,901.64
ORACLE CORP	248,161	49.35	12,246,745.35
PAYCHEX INC	25,506	63.51	1,619,886.06
PAYPAL HOLDINGS INC	90,782	67.25	6,105,089.50
RED HAT INC	13,963	121.60	1,697,900.80
SABRE CORP	17,243	18.43	317,788.49
SALESFORCE.COM INC	54,514	97.19	5,298,215.66
SERVICENOW INC	13,794	120.81	1,666,453.14
SPLUNK INC	10,741	63.58	682,912.78
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	41.86	554,184.54
SYMANTEC CORP	48,508	32.33	1,568,263.64
SYNOPSYS INC	12,264	83.38	1,022,572.32
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	67.33	849,031.30
TWITTER INC	47,756	17.89	854,354.84
VANTIV INC - CL A	12,864	69.11	889,031.04

VERISIGN INC	7,289	108.19	788,596.91
VISA INC-CLASS A SHARES	148,424	107.02	15,884,336.48
VMWARE INC-CLASS A	5,821	117.40	683,385.40
WESTERN UNION CO	38,757	19.86	769,714.02
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	106.77	1,141,478.07
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	41.19	320,705.34
AMPHENOL CORPORATION	24,215	86.10	2,084,911.50
APPLE INC	418,792	155.98	65,323,176.16
ARISTA NETWORKS INC	3,532	190.13	671,539.16
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	82.68	551,144.88
AVNET INC	10,936	40.47	442,579.92
CDW CORP/DE	12,482	68.39	853,643.98
CISCO SYSTEMS	402,060	33.75	13,569,525.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	31.87	475,914.71
CORNING	74,974	30.06	2,253,718.44
F5 NETWORKS INC	5,350	117.39	628,036.50
FLEX LTD	45,803	17.71	811,171.13
FLIR SYSTEMS INC	11,686	43.25	505,419.50
HARRIS CORP	9,931	135.61	1,346,742.91
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	132,071	13.86	1,830,504.06
HP INC	135,166	21.96	2,968,245.36
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	25.82	808,269.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	89.65	1,131,383.00
NETAPP INC	23,085	44.26	1,021,742.10
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	149.33	1,076,818.63
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	34.34	784,188.24
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	87.44	2,449,106.96
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	40.92	843,852.24
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	85.48	2,015,361.96
XEROX CORP	16,718	33.10	553,365.80
AT&T INC	493,720	35.69	17,620,866.80
CENTURYLINK INC	45,847	18.49	847,711.03
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	52.78	1,293,162.78
SPRINT CORP	64,825	7.07	458,312.75
T-MOBILE US INC	22,516	61.51	1,384,959.16
VERIZON COMMUNICATIONS	327,649	49.21	16,123,607.29
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	36.06	551,321.34
AES CORP	52,646	11.29	594,373.34
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	43.85	844,375.60
AMEREN CORPORATION	20,393	61.56	1,255,393.08
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	73.83	2,869,919.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	87.24	1,246,048.92

ATMOS ENERGY CORP	8,018	87.08	698,207.44
CENTERPOINT ENERGY INC	34,527	29.75	1,027,178.25
CMS ENERGY CORP	23,551	48.19	1,134,922.69
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	84.84	2,031,239.28
DOMINION ENERGY INC	50,217	79.95	4,014,849.15
DTE ENERGY COMPANY	14,355	112.14	1,609,769.70
DUKE ENERGY CORP	56,348	87.85	4,950,171.80
EDISON INTL	26,184	79.47	2,080,842.48
ENTERGY CORP	15,032	85.36	1,283,131.52
EVERSOURCE ENERGY	25,381	62.06	1,575,144.86
EXELON CORP	73,029	39.77	2,904,363.33
FIRSTENERGY CORP	35,696	32.30	1,152,980.80
NEXTERA ENERGY INC	37,675	153.87	5,797,052.25
NISOURCE INC	26,021	26.76	696,321.96
OGE ENERGY CORP	15,686	36.92	579,127.12
PG&E CORP	41,241	57.00	2,350,737.00
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	88.57	833,975.12
PPL CORPORATION	53,473	37.81	2,021,814.13
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	48.94	1,987,257.64
SCANA CORP	11,459	48.65	557,480.35
SEMPRA ENERGY	18,704	114.09	2,133,939.36
SOUTHERN CO	80,152	52.00	4,167,904.00
UGI CORP	13,950	48.34	674,343.00
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	66.59	1,683,861.33
WESTAR ENERGY INC	11,492	52.94	608,386.48
XCEL ENERGY INC	40,763	49.25	2,007,577.75
ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	13.95	843,458.85
ANALOG DEVICES	28,935	88.80	2,569,428.00
APPLIED MATERIALS	85,715	55.33	4,742,610.95
BROADCOM LTD	32,301	244.29	7,890,811.29
INTEL CORP	378,637	40.09	15,179,557.33
KLA-TENCOR CORP	12,266	108.05	1,325,341.30
LAM RESEARCH CORP	12,814	200.98	2,575,357.72
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	18.41	659,703.94
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	50.09	1,175,512.12
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	93.05	1,732,963.20
MICRON TECHNOLOGY	84,938	41.31	3,508,788.78
NVIDIA CORP	47,884	197.80	9,471,455.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	115.49	3,150,913.67
QORVO INC	10,609	69.68	739,235.12
QUALCOMM	118,971	52.29	6,220,993.59
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	103.32	1,499,173.20

	TEXAS INSTRUMENTS	80,218	93.45	7,496,372.10
	XILINX INC	20,299	72.42	1,470,053.58
	アメリカドル 小計	24,623,885		1,797,156,913.50 (202,665,385,135)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	29.54	351,112.44
	ARC RESOURCES LTD	27,117	15.48	419,771.16
	CAMECO CORP	28,709	11.29	324,124.61
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,413	41.31	3,693,651.03
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	12.51	973,315.53
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	9.15	395,682.60
	ENBRIDGE	132,496	50.36	6,672,498.56
	ENCANA CORP	76,271	14.40	1,098,302.40
	HUSKY ENERGY INC	31,439	15.70	493,592.30
	IMPERIAL OIL	24,763	39.61	980,862.43
	INTER PIPELINE LTD	30,317	25.88	784,603.96
	KEYERA CORP	14,929	37.19	555,209.51
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,784	41.63	1,572,947.92
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	18.54	234,215.82
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	31.87	584,814.50
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	18.47	369,584.70
	SUNCOR ENERGY	135,128	41.95	5,668,619.60
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	22.70	453,205.50
	TRANSCANADA CORP	69,465	62.31	4,328,364.15
	VERMILION ENERGY INC	10,067	43.23	435,196.41
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	55.75	984,600.75
	AGRIUM INC	10,925	134.55	1,469,958.75
	BARRICK GOLD CORP	94,395	20.11	1,898,283.45
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	63.95	671,475.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	15.03	855,207.00
	FRANCO-NEVADA CORP	14,257	99.51	1,418,714.07
	GOLDCORP INC	68,688	16.57	1,138,160.16
	KINROSS GOLD CORP	107,615	5.38	578,968.70
	METHANEX CORP	7,099	62.53	443,900.47
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	67,665	24.04	1,626,666.60
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	27.80	1,269,820.60
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	4.03	286,130.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	75.03	324,654.81
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	25.80	950,420.40
	YAMANA GOLD INC	85,214	3.41	290,579.74
	BOMBARDIER B	157,835	2.78	438,781.30
	CAE INC	18,372	21.73	399,223.56
	FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	30.41	357,743.24

SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	57.68	848,645.84
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,851	102.64	6,245,746.64
CP RAILWAY LIMITED	11,952	220.90	2,640,196.80
LINAMAR CORP	3,889	79.08	307,542.12
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	68.25	1,909,498.50
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.19	692,056.21
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	84.39	1,550,413.08
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.25	979,555.75
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	157.30	850,835.70
DOLLARAMA INC	9,011	141.40	1,274,155.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	59.21	2,016,870.23
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	23.00	264,477.00
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	24.44	134,762.16
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	68.59	1,258,832.27
METRO INC	19,179	40.61	778,859.19
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	110.35	526,921.25
SAPUTO INC	15,941	44.06	702,360.46
BANK MONTREAL	52,268	98.45	5,145,784.60
BANK NOVA SCOTIA	96,884	80.92	7,839,853.28
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,855	112.73	3,929,204.15
NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	61.71	1,737,938.73
ROYAL BANK OF CANADA	116,630	100.82	11,758,636.60
TORONTO-DOMINION BANK	148,114	71.96	10,658,283.44
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	72,078	53.51	3,856,893.78
CI FINANCIAL CORP	18,671	28.30	528,389.30
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	9.36	271,308.96
IGM FINANCIAL INC	7,685	43.61	335,142.85
ONEX CORP	6,603	97.19	641,745.57
THOMSON REUTERS CORP	22,284	59.80	1,332,583.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	647.54	1,492,579.70
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.20	861,125.60
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	57.25	471,167.50
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	103.90	1,087,417.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	159,761	25.98	4,150,590.78
POWER CORP OF CANADA	29,774	32.44	965,868.56
POWER FINANCIAL CORP	20,740	35.70	740,418.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	49.84	2,468,874.24
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.14	251,045.10
CGI GROUP INC - CL A	17,309	66.91	1,158,145.19
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	748.99	1,141,460.76
OPEN TEXT CORP	19,994	42.25	844,746.50
SHOPIFY INC - CLASS A	6,105	122.71	749,144.55

	BCE INC	12,539	59.11	741,180.29
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	66.05	1,907,590.05
	TELUS CORP	16,454	44.97	739,936.38
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	46.79	245,226.39
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.61	408,933.64
	EMERA INC	4,086	48.47	198,048.42
	FORTIS INC	34,128	46.78	1,596,507.84
	HYDRO ONE LTD	21,742	22.59	491,151.78
	カナダドル 小計	3,242,239		139,521,615.46 (12,597,406,659)
ユーロ	ENAGAS	18,299	24.13	441,554.87
	ENI	202,686	13.77	2,790,986.22
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	15.72	626,908.57
	NESTE OIL OYJ	11,490	40.40	464,196.00
	OMV AG	12,139	50.80	616,661.20
	REPSOL SA	95,819	15.28	1,464,593.41
	SAIPEM SPA	59,023	3.32	195,956.36
	SNAM SPA	173,485	4.23	734,882.46
	TENARIS SA	40,648	11.22	456,070.56
	TOTAL SA	189,598	45.84	8,692,120.31
	VOPAK	6,360	36.19	230,200.20
	AIR LIQUIDE	34,122	103.90	3,545,275.80
	AKZO NOBEL	19,791	78.14	1,546,468.74
	ARCELORMITTAL	53,985	24.67	1,331,809.95
	ARKEMA	5,896	104.10	613,773.60
	BASF SE	73,878	90.05	6,652,713.90
	COVESTRO AG	9,162	71.01	650,593.62
	CRH PLC	67,624	30.64	2,071,999.36
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	30.10	405,032.67
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	50.09	288,618.58
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	83.94	957,503.58
	IMERYS SA	3,000	76.64	229,920.00
	K+S AG	14,355	20.66	296,574.30
	KONINKLIJKE DSM NV	13,812	72.02	994,740.24
	LANXESS	7,293	66.45	484,619.85
	LINDE AG	14,602	173.35	2,531,256.70
	SOLVAY SA	6,365	124.00	789,260.00
	STORA ENSO OYJ R	48,306	12.55	606,240.30
	SYMRISE AG	10,667	64.77	690,901.59
	THYSSEN KRUPP	29,964	23.42	701,906.70
	UMICORE	17,032	37.71	642,361.88
	UPM KYMMENE OYJ	44,370	24.23	1,075,085.10

VOESTALPINE AG	10,429	45.13	470,660.77
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,813	33.45	662,744.85
AIRBUS SE	46,178	80.72	3,727,488.16
ALSTOM	11,216	35.18	394,634.96
ANDRITZ AG	5,242	48.50	254,237.00
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	30.85	257,238.13
BOUYGUES ORD	16,815	40.27	677,140.05
BRENTAG AG	13,290	48.02	638,185.80
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	10.05	863,395.50
DASSAULT AVIATION SA	213	1,334.50	284,248.50
EIFFAGE	6,079	88.06	535,316.74
FERROVIAL SA	36,974	18.75	693,262.50
GEA GROUP AG	15,822	40.06	633,829.32
HOCHTIEF AG	1,354	149.05	201,813.70
KION GROUP AG	5,887	66.90	393,840.30
KONE OYJ-B	26,924	45.42	1,222,888.08
LEGRAND SA	21,312	62.15	1,324,540.80
LEONARDO SPA	35,425	14.71	521,101.75
MAN SE	3,262	94.20	307,280.40
METSO OYJ	9,561	30.97	296,104.17
OSRAM LICHT AG	6,216	63.82	396,705.12
PRYSMIAN SPA	14,715	29.14	428,795.10
REXEL SA	24,339	14.66	356,931.43
SAFRAN SA	25,281	85.51	2,161,778.31
SAINT-GOBAIN	39,044	50.38	1,967,036.72
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	73.10	3,275,903.40
SIEMENS	61,516	117.40	7,221,978.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	11.78	206,131.43
THALES SA	8,109	94.10	763,056.90
VINCI S.A.	40,049	80.90	3,239,964.10
WARTSILA OYJ	11,462	60.60	694,597.20
ZODIAC AEROSPACE	17,832	24.31	433,585.08
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.31	436,338.98
EDENRED	18,941	23.92	453,068.72
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	53.98	517,560.24
RELX NV	79,547	18.59	1,478,778.73
SOCIETE BIC SA	2,424	91.72	222,329.28
WOLTERS KLUWER	23,031	40.65	936,325.30
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	53,260	18.78	1,000,222.80
ADP	2,382	140.00	333,480.00
AENA SME SA	5,610	153.15	859,171.50
ATLANTIA SPA	37,004	27.08	1,002,068.32

BOLLORE	61,805	4.03	249,197.76
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	25.44	538,874.21
DEUTSCHE POST AG-REG	78,336	38.07	2,982,251.52
FRAPORT AG	3,561	81.37	289,758.57
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	10.73	391,591.33
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.25	336,303.89
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,678	87.41	2,331,923.98
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.17	375,173.47
CONTINENTAL AG	8,828	213.05	1,880,805.40
DAIMLER AG	77,275	68.94	5,327,338.50
FERRARI NV	9,947	97.75	972,319.25
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	13.99	1,210,736.57
MICHELIN	13,802	119.95	1,655,549.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	38.55	396,756.60
PEUGEOT SA	40,815	20.17	823,442.62
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	57.93	744,921.87
RENAULT SA	13,675	84.70	1,158,272.50
SCHAEFFLER AG	15,247	13.45	205,148.38
VALEO SA	19,350	61.50	1,190,025.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	143.20	2,116,496.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	148.70	385,727.80
ADIDAS AG	14,964	186.85	2,796,023.40
HERMES INTERNATIONAL	2,561	431.45	1,104,943.45
HUGO BOSS AG	4,852	75.12	364,482.24
KERING	6,060	357.80	2,168,268.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	45.65	608,012.35
LVMH	22,335	239.95	5,359,283.25
SEB SA	2,075	163.65	339,573.75
ACCOR	14,931	43.00	642,033.00
PADDY POWER PLC	6,543	86.90	568,586.70
SODEXO	7,035	105.00	738,675.00
ALTICE NV -A	38,810	17.20	667,726.05
ALTICE NV -B	5,879	17.18	101,030.61
AXEL SPRINGER SE	3,827	57.78	221,124.06
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	22.91	274,370.16
JC DECAUX SA	4,674	32.60	152,395.77
LAGADERE S.C.A	9,057	28.10	254,501.70
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	30.23	579,725.89
PUBLICIS GROUPE	15,618	58.10	907,405.80
RTL GROUP	3,513	64.75	227,498.36
SES	31,369	16.58	520,254.86
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	58.60	292,882.80

VIVENDI	83,098	21.28	1,768,325.44
INDITEX	86,470	30.89	2,671,490.65
ZALANDO SE	9,155	41.67	381,488.85
CARREFOUR	43,442	17.71	769,357.82
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	49.78	183,538.86
COLRUYT SA	4,160	44.58	185,452.80
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.37	202,186.25
JERONIMO MARTINS	20,234	15.67	317,066.78
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	16.26	1,635,201.77
METRO AG	13,712	17.92	245,787.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	61,288	106.30	6,514,914.40
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	35.51	606,454.14
DANONE (GROUPE)	46,629	70.50	3,287,344.50
HEINEKEN HOLDING NV	7,650	82.13	628,294.50
HEINEKEN NV	18,465	86.28	1,593,160.20
KERRY GROUP PLC-A	12,346	82.20	1,014,841.20
PERNOD-RICARD	17,080	126.30	2,157,204.00
REMY COINTREAU	1,575	106.65	167,973.75
BEIERSDORF AG	7,693	93.08	716,064.44
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	105.85	912,215.30
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	117.60	1,683,326.40
LOREAL	20,170	186.90	3,769,773.00
UNILEVER NV-CVA	131,000	49.20	6,445,200.00
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	101.50	1,644,604.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	82.58	1,448,453.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,527	70.58	2,366,335.66
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	34.88	2,597,537.10
BAYER	66,488	118.70	7,892,125.60
EUROFINS SCIENTIFIC	971	536.00	520,456.00
GRIFOLS SA	22,128	24.28	537,378.48
IPSEN	2,722	114.05	310,444.10
MERCK KGAA	10,480	94.50	990,360.00
ORION OYJ-CLASS B	7,975	38.32	305,602.00
QIAGEN N.V.	17,548	28.92	507,575.90
RECORDATI SPA	7,493	39.53	296,198.29
SANOFI	91,978	84.26	7,750,066.28
UCB (GROUPE)	10,465	60.07	628,632.55
ABN AMRO GROUP NV-CVA	30,932	26.28	812,892.96
BANCO BILBAO VIZCAYA	540,507	7.22	3,902,460.54
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.64	727,341.96
BANCO SANTANDER SA	1,294,930	5.57	7,214,055.03
BANCO SANTANDER SA-RTS	1,294,930	0.03	50,502.27

BANKIA SA	78,000	4.03	315,042.00
BANKINTER SA	58,881	8.03	472,814.43
BNP PARIBAS	90,643	67.32	6,102,086.76
CAIXABANK	277,342	3.88	1,077,751.01
COMMERZBANK AG	89,792	11.67	1,048,321.60
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	14.91	1,384,154.94
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	37.55	867,820.94
ING GROEP NV-CVA	313,872	15.72	4,935,637.20
INTESA SANPAOLO	1,004,854	2.85	2,863,833.90
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.68	174,330.00
KBC GROEP NV	20,232	71.87	1,454,073.84
MEDIOBANCA	41,923	9.06	380,031.99
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	28.39	354,591.10
SOCIETE GENERALE	61,696	47.97	2,959,865.60
UNICREDIT SPA	162,227	16.74	2,715,679.98
DEUTSCHE BANK NAMEN	167,110	14.18	2,369,619.80
DEUTSCHE BOERSE	15,552	91.05	1,416,009.60
EURAZEO SA	3,046	77.29	235,425.34
EXOR NV	9,778	52.35	511,878.30
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	90.36	564,478.92
NATIXIS	69,996	6.62	463,583.50
WENDEL	2,023	137.80	278,769.40
AEGON	133,499	5.01	669,230.48
AGEAS	16,065	40.96	658,022.40
ALLIANZ SE-REG	36,898	195.95	7,230,163.10
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	15.32	1,557,262.68
AXA	156,617	25.31	3,964,759.35
CNP ASSURANCES	11,830	19.87	235,121.25
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	106.15	499,541.90
MAPFRE SA	90,939	2.66	242,261.49
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,779	186.70	2,385,839.30
NN GROUP NV	25,728	36.45	937,785.60
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.24	287,258.40
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	45.50	1,647,691.50
SCOR SE	13,354	35.33	471,796.82
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.97	187,497.76
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	36.72	1,011,746.16
VONOVIA SE	37,270	37.77	1,407,687.90
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	57.06	2,009,082.60
ATOS SE	7,634	131.55	1,004,252.70
CAPGEMINI SA	13,366	100.50	1,343,283.00
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	86.83	909,023.27

	GEMALTO	6,158	31.90	196,440.20
	SAP SE	79,025	95.60	7,554,790.00
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	53.41	508,089.33
	INGENICO GROUP	4,681	82.29	385,199.49
	NOKIA OYJ	458,694	4.96	2,278,791.79
	DEUTSCHE TELEKOM	262,460	15.35	4,028,761.00
	ELISA A	12,839	34.59	444,101.01
	ILIAD SA	2,053	210.85	432,875.05
	KPN (KON.)	261,596	2.98	779,556.08
	ORANGE	156,887	13.65	2,141,507.55
	PROXIMUS	13,141	28.43	373,664.33
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.76	649,218.34
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.61	291,256.06
	TELEFONICA	359,839	8.82	3,175,939.01
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.59	307,646.39
	E.ON SE	178,193	9.99	1,781,395.42
	ELECTRICITE DE FRANCE	40,498	11.19	453,172.62
	ENDESA	24,774	19.10	473,183.40
	ENEL	655,540	5.15	3,379,308.70
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.02	583,590.84
	ENGIE	137,841	14.43	1,989,045.63
	FORTUM OYJ	38,513	18.00	693,234.00
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	18.45	480,327.30
	IBERDROLA SA	467,107	6.68	3,122,143.18
	INNOGY SE	11,000	39.43	433,785.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.18	597,959.17
	RWE STAMM	42,828	21.37	915,234.36
	SUEZ	28,043	15.49	434,526.28
	TERNA SPA	105,905	5.03	533,231.67
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	20.11	740,430.09
	ASML HOLDING NV	30,069	148.50	4,465,246.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	22.30	2,024,022.61
	STMICROELECTRONICS	53,368	16.70	891,512.44
	ユーロ 小計	16,693,803		318,521,935.20 (42,551,345,323)
イギリスポンド	BP PLC	1,580,851	4.92	7,780,158.19
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	359,572	23.11	8,311,506.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	300,901	23.46	7,059,137.46
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	6.92	373,950.00
	ANGLO AMERICAN PLC	108,396	14.31	1,551,146.76
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.87	354,078.00
	BHP BILLITTON PLC	168,203	13.96	2,348,954.89

CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	38.75	396,916.25
FRESNILLO PLC	17,743	14.18	251,595.74
GLENCORE PLC	979,109	3.77	3,697,115.58
JOHNSON MATTHEY PLC	16,720	33.96	567,811.20
MONDI PLC	27,192	19.00	516,648.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	74.90	546,320.60
RIO TINTO PLC REG	99,109	36.00	3,568,419.54
ASHTED GROUP PLC	42,818	18.85	807,119.30
BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.00	1,541,304.00
BUNZL PLC	27,712	22.55	624,905.60
COBHAM PLC	197,992	1.41	279,168.72
DCC PLC	7,320	71.85	525,942.00
FERGUSON PLC	20,276	52.70	1,068,545.20
IMI PLC	23,923	12.26	293,295.98
MEGGITT PLC	66,268	5.04	334,322.06
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	9.27	1,240,446.51
SMITHS GROUP PLC	34,243	15.37	526,314.91
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	15.05	279,252.75
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	20.24	376,180.64
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.23	162,073.39
CAPITA GROUP PLC	53,334	5.33	284,536.89
EXPERIAN PLC	76,879	15.62	1,200,849.98
G4S PLC	132,555	2.75	364,923.91
INTERTEK GROUP PLC	12,430	51.65	642,009.50
RELX PLC	87,723	16.97	1,488,659.31
EASYJET PLC	11,633	12.95	150,647.35
ROYAL MAIL PLC	75,133	3.90	293,394.36
NEW GKN	148,431	3.02	448,410.05
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	87,767	6.92	607,347.64
BURBERRY GROUP PLC	35,328	18.93	668,759.04
PERSIMMON PLC	22,676	28.33	642,411.08
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	2.03	550,392.26
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	39.07	414,102.93
CARNIVAL PLC	15,765	49.45	779,579.25
COMPASS GROUP PLC	127,044	16.06	2,040,326.64
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	40.99	572,384.36
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.74	243,661.81
TUI AG-DI	31,155	13.35	415,919.25
WHITBREAD PLC	14,664	39.79	583,480.56
ITV PLC	295,435	1.76	521,147.34
PEARSON	66,305	6.91	458,167.55
SKY PLC	83,042	9.40	780,594.80

WPP PLC	103,971	13.66	1,420,243.86
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	1.84	153,244.84
KINGFISHER PLC	187,310	3.03	567,923.92
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.46	468,956.82
NEXT PLC	11,202	48.98	548,673.96
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.34	394,925.62
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.46	365,497.44
TESCO	656,079	1.87	1,229,164.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	33.60	969,192.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	184,683	48.28	8,916,495.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	25.93	362,994.07
DIAGEO	202,311	25.71	5,201,415.81
IMPERIAL BRANDS PLC	76,724	31.47	2,414,504.28
TATE & LYLE	40,576	6.41	260,295.04
RECKITT BENCKISER PLC	53,694	67.90	3,645,822.60
UNILEVER PLC	102,945	42.99	4,425,605.55
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.12	239,538.32
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	6.44	193,373.88
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	14.13	1,003,611.51
ASTRAZENECA	101,741	51.75	5,265,096.75
GLAXOSMITHKLINE	392,835	15.36	6,033,945.60
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	11.90	145,263.30
SHIRE PLC	72,022	37.48	2,699,744.67
BARCLAYS	1,365,547	1.92	2,621,850.24
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,616,258	7.42	12,007,180.68
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,793,747	0.66	3,881,231.11
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.80	827,762.72
STANDARD CHARTERED PLC	258,738	7.48	1,937,171.40
3I GROUP PLC	79,251	9.35	740,996.85
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	15.43	315,836.67
INVESTEC PLC	54,280	5.56	301,796.80
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	38.78	1,008,978.04
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	8.91	99,025.74
SCHRODERS PLC	8,614	34.72	299,078.08
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.67	522,232.50
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	4.33	958,832.68
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.08	310,145.40
AVIVA PIC	318,261	5.01	1,596,078.91
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.77	429,046.69
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.66	1,292,670.79
OLD MUTUAL PLC	397,509	1.96	781,900.20
PRUDENTIAL	208,409	18.36	3,826,389.24

	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.26	541,727.88	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.62	289,636.20	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	24.74	866,790.64	
	SAGE GROUP PLC	89,321	7.28	650,703.48	
	WORLDPAY GROUP PLC	157,060	4.02	632,009.44	
	BT GROUP PLC	663,615	2.72	1,809,678.10	
	INMARSAT PLC	33,632	6.20	208,518.40	
	VODAFONE GROUP PLC	2,139,989	2.17	4,644,846.12	
	CENTRICA PLC	440,558	1.72	757,759.76	
	NATIONAL GRID PLC	275,549	9.34	2,575,832.05	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	21.43	388,140.16	
	SSE PLC	80,824	13.92	1,125,070.08	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.43	496,737.15	
	イギリスポンド 小計	24,854,699		155,205,519.19 (23,015,426,440)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	623.50	418,992.00	
	GIVAUDAN-REG	740	2,154.00	1,593,960.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	56.45	2,066,295.80	
	SIKA AG-BR	175	7,080.00	1,239,000.00	
	ABB LTD	160,712	24.75	3,977,622.00	
	GEBERIT AG-REG	3,021	464.40	1,402,952.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	214.50	403,474.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,528	219.30	773,690.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	76.10	1,006,346.40	
	SGS SA	437	2,330.00	1,018,210.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,674	167.40	782,427.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	88.25	3,661,933.75	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	389.10	966,135.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	74.85	294,759.30	
	DUFREY AG-REG	2,548	150.00	382,200.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,501.00	312,208.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	68,505.00	548,040.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,740.00	430,500.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	249,909	83.90	20,967,365.10	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	173.30	717,462.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	697	647.50	451,307.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	256.00	1,473,792.00	
	NOVARTIS	178,679	84.35	15,071,573.65	
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,439	238.60	13,466,345.40	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	119.60	430,679.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	196,823	15.55	3,060,597.65	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	57.50	1,081,172.50	

	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	80.85	274,647.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	671.50	995,163.00	
	UBS GROUP AG	296,299	16.86	4,995,601.14	
	BALOISE HOLDING AG	3,877	153.80	596,282.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	342.40	840,934.40	
	SWISS RE LTD	25,692	90.55	2,326,410.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,137	294.30	3,571,919.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	85.75	538,252.75	
	SWISSCOM	2,064	496.50	1,024,776.00	
	スイスフラン 小計	1,344,952		93,163,029.89 (10,756,603,431)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	182.00	2,582,762.00	
	BOLIDEN AB	23,656	296.90	7,023,466.40	
	ALFA LAVAL AB	25,732	204.50	5,262,194.00	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	180.20	14,469,159.00	
	ATLAS COPCO A	53,833	355.20	19,121,481.60	
	ATLAS COPCO B	29,972	321.80	9,644,989.60	
	SANDVIK AB	87,313	147.10	12,843,742.30	
	SKANSKA B	28,530	183.60	5,238,108.00	
	SKF AB-B	28,335	179.50	5,086,132.50	
	VOLVO B	123,214	155.10	19,110,491.40	
	SECURITAS B	22,844	136.50	3,118,206.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	281.70	5,118,489.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	79.95	3,095,024.40	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	214.20	15,842,660.40	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	311.70	1,786,041.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	297.00	4,499,253.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	229.70	11,156,758.70	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	155.00	2,455,975.00	
	NORDEA BANK AB	244,135	109.00	26,610,715.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	103.40	12,664,845.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	121.50	14,601,505.50	
	SWEDBANK AB-A	71,353	211.60	15,098,294.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	208.60	2,668,411.20	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	409.10	15,035,243.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	269.40	4,877,217.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	643.00	2,340,520.00	
ERICSSON (LM) B	248,169	48.77	12,103,202.13		
HEXAGON AB-B SHS	21,517	406.10	8,738,053.70		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	530.50	3,285,917.00		
TELE2 AB-B SHS	33,524	100.30	3,362,457.20		
TELIA CO AB	199,107	38.95	7,755,217.65		

	スウェーデンクローナ 小計	1,872,002		276,596,534.88 (3,836,393,938)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	92,696	160.60	14,886,977.60
	NORSK HYDRO	106,150	60.50	6,422,075.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	359.00	4,835,730.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	189.50	1,321,004.50
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	205.70	1,233,171.50
	MARINE HARVEST	32,238	166.00	5,351,508.00
	ORKLA	70,520	84.50	5,958,940.00
	DNB ASA	80,217	156.50	12,553,960.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	145.50	2,702,517.00
	TELENOR ASA	60,821	165.60	10,071,957.60
	ノルウェークローネ 小計	487,652		65,337,841.70 (929,104,108)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	540.00	3,996,540.00
	NOVOZYMES A/S	17,687	326.60	5,776,574.20
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	536.00	9,497,920.00
	ISS A/S	14,253	269.00	3,834,057.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	11,290.00	3,375,710.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	11,730.00	5,958,840.00
	DSV A/S	14,599	463.50	6,766,636.50
	PANDORA A/S	8,431	590.50	4,978,505.50
	CARLSBERG AS-B	8,236	732.00	6,028,752.00
	COLOPLAST-B	10,121	544.50	5,510,884.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	177.00	1,313,340.00
	GENMAB A/S	4,512	1,320.00	5,955,840.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	380.40	1,852,928.40
	NOVO NORDISK A/S-B	149,975	319.50	47,917,012.50
	DANSKE BANK A/S	60,834	248.50	15,117,249.00
	TRYG A/S	9,828	149.80	1,472,234.40
	TDC A/S	72,376	37.92	2,744,497.92
DONG ENERGY A/S	13,830	373.00	5,158,590.00	
	デンマーククローネ 小計	422,901		137,256,111.92 (2,463,747,208)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	33.48	690,658.92
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.15	849,284.15
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	7.56	1,014,567.12
	SANTOS	156,437	4.28	669,550.36
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	29.25	1,774,597.50
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.32	395,462.56
	AMCOR	88,486	15.88	1,405,157.68
	BHP BILLITON LTD	257,888	26.56	6,849,505.28

BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	12.60	493,970.40
BORAL LIMITED	104,098	7.25	754,710.50
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.85	653,178.60
INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.75	564,746.25
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	18.83	703,545.29
NEWCREST MINING LIMITED	61,159	21.79	1,332,654.61
ORICA LTD	29,211	21.07	615,475.77
RIO TINTO LTD	34,814	69.12	2,406,343.68
SOUTH32 LTD	408,172	3.15	1,285,741.80
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	46.19	425,871.80
BRAMBLES LTD	129,297	9.39	1,214,098.83
SEEK LTD	26,358	18.18	479,188.44
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.06	807,004.22
QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	6.40	218,592.00
TRANSURBAN GROUP	162,844	12.30	2,002,981.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	22.53	985,124.25
CROWN RESORTS LTD	30,328	10.92	331,181.76
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	49.35	272,560.05
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.44	148,270.72
TABCORP HOLDINGS	62,731	4.32	270,997.92
TATTS GROUP LTD	124,218	4.06	504,325.08
REA GROUP LTD	3,593	72.75	261,390.75
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.95	178,393.85
WESFARMERS LTD	89,270	42.91	3,830,575.70
WOOLWORTHS LTD	102,821	25.61	2,633,245.81
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.02	369,962.60
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	14.75	861,031.25
COCHLEAR LIMITED	5,007	171.99	861,153.93
HEALTHSCOPE LTD	140,279	1.92	270,037.07
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	64.78	793,425.44
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	21.55	684,794.35
CSL LIMITED	36,350	140.95	5,123,532.50
AUST AND NZ BANKING GROUP	235,060	30.60	7,192,836.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	13.51	480,956.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.87	503,691.58
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,090	78.74	10,951,946.60
NATIONAL AUSTRALIA BANK	215,407	32.38	6,974,878.66
WESTPAC BANKING	270,036	33.45	9,032,704.20
AMP LTD	244,230	5.07	1,238,246.10
ASX LTD	15,814	54.32	859,016.48
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	13.60	599,324.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,204	93.72	2,455,838.88

	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	6.57	1,199,392.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.11	667,132.32	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	10.91	1,233,844.63	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.54	1,393,550.34	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	14.97	487,483.08	
	TELSTRA CORP	342,339	3.51	1,201,609.89	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.15	162,096.25	
	AGL ENERGY LTD	51,344	24.42	1,253,820.48	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.73	208,599.05	
	オーストラリアドル 小計	5,827,986		94,083,858.25 (8,350,883,258)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	7.95	497,725.65	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.25	530,937.50	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.58	347,916.86	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.76	546,888.24	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.55	327,244.65	
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.48	214,858.68	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.89	319,472.16	
	ニュージーランドドル 小計	560,571		2,785,043.74 (219,962,754)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	100.80	21,469,996.80	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.12	1,496,880.00	
	MTR CORP	114,000	44.95	5,124,300.00	
	LI & FUNG	554,800	3.98	2,208,104.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	43.70	5,200,300.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	30.85	2,113,225.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	51.40	9,252,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	17.32	1,163,904.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	36.85	7,473,180.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	14.82	1,452,360.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.70	884,400.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	19.82	2,037,496.00	
	I-CABLE COMMUNICATION LTD	45,355	0.23	10,522.36	
	WH GROUP LTD	699,000	7.77	5,431,230.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	34.80	3,798,768.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	38.15	11,521,300.00	
	HANG SENG BANK	61,100	190.00	11,609,000.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	6.10	780,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	217.60	19,910,400.00	
	AIA GROUP LTD	971,200	61.10	59,340,320.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	216,496	66.95	14,494,407.20		
HANG LUNG GROUP LTD	81,000	28.40	2,300,400.00		

	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.66	3,228,180.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	104,495	52.00	5,433,740.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	37.55	2,215,450.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	34.75	1,337,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.86	5,829,190.00	
	SINO LAND CO	235,400	13.90	3,272,060.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	130.50	15,268,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	76.00	3,078,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	27.40	2,635,880.00	
	WHARF HOLDINGS	104,000	71.75	7,462,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	55.75	3,623,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.31	1,538,670.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	68.80	3,440,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	79.70	10,639,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	670,830	14.84	9,955,117.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	67.55	7,498,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	114.10	2,704,170.00	
	香港ドル 小計	7,526,532		278,233,875.56 (4,023,261,840)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	7.02	788,346.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.18	181,260.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.36	366,240.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.53	305,847.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.02	336,330.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	10.20	441,996.60	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.61	236,032.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.19	507,875.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.69	341,899.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	40.39	399,861.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.38	161,315.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.33	382,284.00	
	DBS GROUP	139,600	21.70	3,029,320.00	
	OCBC BANK	245,300	11.44	2,806,232.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	24.33	2,525,454.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.68	478,464.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.72	696,012.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	13.00	405,600.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	189,100	3.29	622,139.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	8.98	291,850.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.76	2,409,945.68	
	STARHUB LTD	38,000	2.68	101,840.00	
		3,504,876		17,816,142.28	

シンガポールドル 小計				(1,481,055,907)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,247	280.10	629,384.70
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	14.65	479,875.40
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	522.10	762,266.00
	BANK HAPOALIM BM	93,717	24.50	2,296,066.50
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	19.46	2,253,351.24
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	63.17	517,994.00
	AZRIELI GROUP	4,323	198.10	856,386.30
	NICE LTD	4,894	284.10	1,390,385.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	5.25	811,681.50
イスラエルシェケル 小計		417,997		9,997,391.04 (323,315,626)
合 計		91,380,095		313,213,891,627 (313,213,891,627)

(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	212,805.00	
		アメリカドル 小計		472,900	212,805.00 (23,998,019)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	760,457.79	
		LENDLEASE GROUP	44,009	720,867.42	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	648,789.20	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,130,114.41 (189,068,955)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,572,165.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,556,720.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,128,885.00 (59,703,677)	
	投資信託受益証券合計			1,184,840	272,770,651 (272,770,651)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	590,683.32	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,450	919,032.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,878	4,688,376.42	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	1,014,302.89	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,951,563.60	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,520,896.26	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	459,004.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	656,506.44	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	550,000.00	

CROWN CASTLE INTL CORP		32,462	3,350,727.64	
DIGITAL REALTY TRUST INC		12,392	1,535,120.96	
DUKE REALTY CORP		29,929	864,349.52	
EQUINIX INC		6,288	2,958,818.40	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		28,719	1,897,177.14	
ESSEX PROPERTY TRUST		5,077	1,319,715.38	
EXTRA SPACE STORAGE INC		10,092	824,516.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6,029	767,069.67	
GGP INC		48,203	1,024,795.78	
HCP INC		39,255	1,034,761.80	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		59,388	1,177,664.04	
IRON MOUNTAIN INC		20,489	839,229.44	
KIMCO REALTY CORP		35,407	675,211.49	
LIBERTY PROPERTY TRUST		11,822	488,366.82	
MACERICH CO/THE		10,128	578,511.36	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		9,565	1,005,185.85	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		11,020	462,729.80	
PROLOGIS INC		41,651	2,688,572.05	
PUBLIC STORAGE		12,636	2,719,393.56	
REALTY INCOME CORP		21,691	1,219,251.11	
REGENCY CENTERS CORP		11,717	754,340.46	
SBA COMMUNICATIONS CORP		9,366	1,386,168.00	
SIMON PROPERTY GROUP		25,139	4,161,007.28	
SL GREEN REALTY CORP		8,067	795,890.22	
UDR INC		20,960	807,379.20	
VENTAS INC		27,813	1,752,775.26	
VEREIT INC		77,798	630,941.78	
VORNADO REALTY TRUST		13,295	995,130.75	
WELLTOWER INC		29,615	2,019,150.70	
アメリカドル 小計		925,218	53,084,317.75	(5,986,318,512)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	204,038.90	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	381,363.80	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	167,747.49	
カナダドル 小計		30,576	753,150.19	(68,001,930)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	198,544.50	
	GECINA SA	3,549	478,405.20	
	ICADE	2,845	211,668.00	
	KLEPIERRE	18,936	626,308.20	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,071	1,678,364.45	
		35,711	3,193,290.35	

ユーロ 小計			(426,591,657)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	84,399	515,255.89	
	HAMMERSON PLC	61,184	329,475.84	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	163,072.09	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	578,474.00	
	SEGRO PLC	81,695	450,547.92	
イギリスポンド 小計		359,317	2,036,825.74	(302,040,888)
オーストラ リアドル	DEXUS	74,090	712,004.90	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,172,665.56	
	GPT GROUP	136,015	682,795.30	
	MIRVAC GROUP	306,089	713,187.37	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,723,718.52	
	STOCKLAND	207,412	906,390.44	
	VICINITY CENTERS	291,115	765,632.45	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,270,540.67	
オーストラリアドル 小計		1,743,096	7,946,935.21	(705,369,969)
香港ドル	LINK REIT	179,500	11,586,725.00	
香港ドル 小計		179,500	11,586,725.00	(167,544,043)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	537,200.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	237,380.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	410,615.00	
	SUNTEC REIT	173,000	330,430.00	
シンガポールドル 小計		713,800	1,515,625.00	(125,993,906)
投資証券合計		3,987,218	7,781,860,905	(7,781,860,905)
合計			8,054,631,556	(8,054,631,556)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 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 602銘柄	97.1%			63.1%

	投資信託受 益証券	1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券	38銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式	88銘柄	99.5%			3.9%
	投資証券	3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式	233銘柄	99.0%			13.2%
	投資証券	5銘柄			1.0%	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	36銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	90.3%			2.6%
	投資信託受 益証券	3銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券	8銘柄			7.6%	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	94.7%			1.3%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.9%	0.1%
シンガポールドル	株式	22銘柄	92.2%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成29年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	平成29年10月20日現在
項目	金額（円）
預金	54,745,131
コール・ローン	3,757,225,358
国債証券	248,271,928,128
派生商品評価勘定	15,157,197
未収入金	253,040
未収利息	2,078,450,193
前払費用	194,547,671
差入委託証拠金	155,906,601
流動資産合計	254,528,213,319
資産合計	254,528,213,319
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,342,903
前受金	6,998,414
未払金	2,556,230
未払解約金	339,290,782
未払利息	6,094
流動負債合計	351,194,423
負債合計	351,194,423
純資産の部	
元本等	
元本	91,195,637,143
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,981,381,753
元本等合計	254,177,018,896
純資産合計	254,177,018,896
負債純資産合計	254,528,213,319

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10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、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	平成29年10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) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,195,637,143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 2.7872円 (1万口当たり純資産額) (27,872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10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10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債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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10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>

（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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	81,829,523,065円
期中追加設定元本額	15,809,227,105円
期中一部解約元本額	6,443,113,027円
期末元本額	91,195,637,143円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,255,807,377円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	873,302,673円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	598,142,557円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,845,502,061円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,220,484円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,651,738,939円
世界経済インデックスファンド	5,600,729,545円
D C マイセレクション 2 5	1,392,752,497円
D C マイセレクション 5 0	1,184,613,020円
D C マイセレクション 7 5	750,324,801円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,633,563,280円
D C マイセレクション S 2 5	570,361,434円
D C マイセレクション S 5 0	469,859,703円
D C マイセレクション S 7 5	207,494,472円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	53,505,872円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	52,256,634円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	22,339,668円
D C 世界経済インデックスファンド	3,937,397,547円
外国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	559,039,576円

区分	平成29年10月20日現在
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	61,744,015円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,416,779円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,481,290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)	70,273,292円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	211,080,441円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	335,888,205円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	249,849,771円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	670,742,642円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,912,492,443円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	772,522,138円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,730,054,442円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,022,242,554円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	247,990,212円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	800,919,038円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,007,641,567円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	287,298,256円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	415,602,216円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,316,973,593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)	809,665,269円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	648,497,534円
外国債券ファンド・シリーズ1	645,087,272円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,940,576,381円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,593,319,918円
分散投資コア戦略ファンドA	941,634,593円
分散投資コア戦略ファンドS	2,213,221,497円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	121,055,328円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,426,264,147円
コア投資戦略ファンド(切替型)	961,379,211円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,527,269円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	114,857,646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)	724,590,455円
SMT インデックスバランス・オープン	259,675,268円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	21,737,235,328円
SMT 世界経済インデックス・オープン	322,713円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	4,989,922円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	10,207,891円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	141,046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)	1,103,991,427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)	2,361,277,113円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	7,576,954,881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10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		1,488,024,638
合計		1,488,024,638

(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10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	2,467,526,939	-	2,474,525,353	6,998,414
	合計	2,467,526,939	-	2,474,525,353	6,998,414

(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10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	3,402,411,820	-	3,408,227,700	5,815,880
	アメリカドル	1,525,823,460	-	1,530,777,600	4,954,140
	カナダドル	155,172,300	-	155,144,000	28,300
	ユーロ	1,475,816,160	-	1,477,726,600	1,910,440
	イギリスポンド	245,599,900	-	244,579,500	1,020,400
	合計	3,402,411,820	-	3,408,227,700	5,815,880

(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 0.75% 10/31/18	3,300,000.00	3,276,994.64	
		T 0.875% 04/15/19	10,000,000.00	9,909,469.40	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,437,992.06	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	3,978,677.80	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,775,495.11	
		T 1.125% 01/31/19	2,850,000.00	2,837,456.63	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,950,874.12	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,561,078.15	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,873,239.80	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,981,890.65	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	897,442.72	
		T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,309,775.05	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,372,199.39	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,438,751.64	
		T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,447,937.43	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,347,728.79	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,487,847.34	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,466,473.48	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,764,032.10	
		T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,535,510.54	
		T 1.25% 12/15/18	2,520,000.00	2,514,297.69	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,976,263.45	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,975,494.50	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,743,522.76	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,097,170.92	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,973,274.55	
		T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,851,438.43	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	993,708.93	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,366,812.85	

T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,539,623.12	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,815,960.40	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,403,439.62	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,898,505.09	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,965,154.92	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,685,036.16	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,943,771.48	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,616,541.80	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	2,996,672.49	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,000,478.48	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,426,898.98	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,000,666.12	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,336,048.97	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,401,230.06	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,890,174.32	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,249,764.79	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,169,616.93	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,955,076.40	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,370,782.73	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,546,199.29	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,992,282.15	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,550,910.17	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,704,312.89	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,005,845.08	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,009,473.90	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,849,372.83	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,886,972.55	
T 1.625% 06/30/19	10,000,000.00	10,017,506.20	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,997,987.63	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,995,183.30	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,464,237.87	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,512,845.55	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,766,787.05	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,027,551.38	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,041,936.83	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,449,075.52	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,484,102.85	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,481,365.48	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,113,234.26	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,773,386.35	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,228,503.07	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,471,444.94	

T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,937,629.09
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	5,019,545.35
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	1,978,617.22
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,006,934.08
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,204,615.28
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,496,420.02
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,772,564.95
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,965,313.28
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,983,262.20
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,134,693.07
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,404,264.43
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,924,034.06
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,427,313.90
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,958,595.64
T 1% 11/30/18	5,200,000.00	5,174,357.08
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,226,075.98
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,036,728.37
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,396,249.68
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,640,537.67
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,585,220.47
T 2.125% 06/30/22	800,000.00	806,329.66
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,789,654.41
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,167,333.50
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,582,247.94
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,021,031.62
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	2,004,161.10
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,543,513.38
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,904,022.32
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,098,375.40
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,555,929.65
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,046,474.23
T 2.25% 08/15/27	4,950,000.00	4,918,850.88
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,517,675.17
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,195,609.63
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,899,369.30
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	2,016,743.12
T 2.375% 05/15/27	6,500,000.00	6,532,428.95
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,615,290.09
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,346,325.33
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,905,135.84
T 2.5% 02/15/46	17,050,000.00	15,930,125.13
T 2.5% 05/15/24	16,900,000.00	17,267,475.79
T 2.5% 05/15/46	1,050,000.00	980,511.70

T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,659,905.93	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,645,685.37	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,301,211.90	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,676,440.59	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,112,143.72	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,979,259.02	
T 2.75% 08/15/47	5,100,000.00	5,011,460.98	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,162,429.77	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,165,953.41	
T 2.875% 05/15/43	14,150,000.00	14,335,431.78	
T 2.875% 08/15/45	9,900,000.00	9,992,161.87	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,511,764.77	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,597,850.11	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,282,148.16	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,032,709.40	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,826,817.17	
T 2% 06/30/24	2,000,000.00	1,980,530.92	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,248,074.98	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,006,300.27	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,088,933.23	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,840,983.12	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,045,972.95	
T 2% 10/31/21	400,000.00	402,240.79	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,414,506.36	
T 2% 11/15/26	6,750,000.00	6,583,561.66	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,547,528.85	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,000,703.40	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,209,727.43	
T 3.125% 02/15/42	1,600,000.00	1,700,040.14	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,059,798.85	
T 3.125% 05/15/19	30,000,000.00	30,756,816.00	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,547,420.96	
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	12,715,423.31	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,550,841.53	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,211,480.91	
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	9,073,062.42	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,402,735.48	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,323,557.01	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	5,834,914.03	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,770,520.25	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,801,653.54	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,304,731.40	

	T 3.75% 08/15/41	3,900,000.00	4,579,234.53	
	T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,121,903.05	
	T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,706,870.62	
	T 3.875% 08/15/40	1,650,000.00	1,970,072.85	
	T 3% 05/15/42	1,950,000.00	2,027,017.08	
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,620,689.76	
	T 3% 11/15/44	2,300,000.00	2,381,071.75	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,130,312.22	
	T 4.25% 11/15/40	1,450,000.00	1,826,558.38	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,275,043.52	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,430,719.32	
	T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	5,327,974.29	
	T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,450,390.18	
	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,372,953.71	
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,296,345.91	
	T 4.5% 08/15/39	250,000.00	324,544.58	
	T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	5,151,782.72	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,507,867.00	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,610,581.06	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,669,040.71	
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,144,892.49	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,563,988.69	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,188,398.69	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,950,333.53	
	T 6.25% 05/15/30	400,000.00	568,437.13	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,031,101.45	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,111,686.48	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,349,774.04	
	アメリカドル 小計	936,740,000.00	946,501,416.36 (106,736,964,722)	
カナダドル	CAN 0.5% 02/01/19	3,200,000.00	3,164,064.00	
	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,949,030.00	
	CAN 0.5% 11/01/18	2,050,000.00	2,031,662.75	
	CAN 0.75% 03/01/21	1,250,000.00	1,216,725.00	
	CAN 0.75% 08/01/19	2,770,000.00	2,735,652.00	
	CAN 0.75% 09/01/20	1,350,000.00	1,320,651.00	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,578,003.00	
	CAN 1.5% 03/01/20	3,900,000.00	3,901,111.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,366,076.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,216,901.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,406,741.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	2,250,000.00	2,261,767.50	
	CAN 1% 06/01/27	1,890,000.00	1,723,954.05	

	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,451,130.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,588,920.50	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,850,000.00	1,926,386.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,671,380.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,450,000.00	1,575,135.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	470,124.90	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,681,639.65	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,891,323.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,620,000.00	3,223,333.60	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,316,720.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,850,430.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,700,000.00	2,334,746.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,343,768.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,277,008.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	547,682.40	
	カナダドル 小計	55,480,000.00	59,022,066.35	(5,329,102,370)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	10,650,000.00	13,544,457.00	
	MBONO 10% 12/05/24	35,250,000.00	41,254,837.50	
	MBONO 5.75% 03/05/26	17,350,000.00	15,994,357.75	
	MBONO 5% 12/11/19	31,100,000.00	29,907,470.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	38,000,000.00	37,356,660.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,700,000.00	35,214,123.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	15,158,713.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	17,925,673.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	25,422,865.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,850,000.00	5,075,355.25	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	17,276,064.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,200,000.00	18,148,293.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	25,300,000.00	25,693,668.00	
	MBONO 8% 06/11/20	26,750,000.00	27,432,660.00	
	MBONO 8% 11/07/47	4,750,000.00	5,084,471.25	
	MBONO 8% 12/07/23	19,450,000.00	20,475,598.50	
	メキシコペソ 小計	337,200,000.00	350,965,268.25	(2,105,791,609)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	750,000.00	758,677.50	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,650,000.00	2,744,048.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,710,000.00	1,732,366.80	
	BGB 1.45% 06/22/37	550,000.00	554,413.75	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,250,000.00	1,207,793.75	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,191,998.50	
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,192,904.00	

BGB 1% 06/22/31	1,600,000.00	1,588,056.00
BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	366,525.25
BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,699,035.00
BGB 2.25% 06/22/57	400,000.00	436,780.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,150,000.00	2,503,599.75
BGB 3.75% 06/22/45	1,150,000.00	1,688,654.25
BGB 3.75% 09/28/20	2,350,000.00	2,647,933.00
BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,349,278.00
BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,139,880.00
BGB 4.0% 03/28/19	1,690,000.00	1,802,494.85
BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,295,844.85
BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,488,857.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,750,591.25
BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,479,269.00
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,684,700.00
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,440,830.95
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,371,264.60
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,575,404.30
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,005,215.00
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,006,115.00
BTPS 0.35% 06/15/20	2,550,000.00	2,571,445.50
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,791,963.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,408,855.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,267,311.50
BTPS 0.65% 11/01/20	3,900,000.00	3,962,107.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,036,080.00
BTPS 0.9% 08/01/22	2,100,000.00	2,117,209.50
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,504,402.50
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,457,727.75
BTPS 1.25% 12/01/26	2,100,000.00	1,998,948.00
BTPS 1.35% 04/15/22	650,000.00	671,131.50
BTPS 1.45% 09/15/22	850,000.00	879,295.25
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	3,181,840.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,473,140.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,578,368.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,828,068.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,069,260.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,000,000.00	1,003,285.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,672,312.50
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,838,727.00
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	1,961,977.50
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,283,399.00
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,604,412.50

BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,623,913.25	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,220,000.00	2,033,952.90	
BTPS 2.8% 03/01/67	800,000.00	693,388.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,300,000.00	3,380,982.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,590,625.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,050,000.00	1,095,370.50	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,760,000.00	3,115,101.60	
BTPS 3.5% 12/01/18	4,000,000.00	4,168,320.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,635,726.25	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,739,898.25	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,514,200.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,800,000.00	2,079,207.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,019,260.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,959,135.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,868,611.75	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,822,383.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,821,428.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	4,380,821.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	5,175,182.50	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,642,072.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	5,087,607.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,612,810.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,450,000.00	4,318,796.25	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	3,114,732.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,300,000.00	3,915,747.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,558,278.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,808,839.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,810,097.75	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,175,846.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,350,000.00	2,893,978.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,811,630.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,600,000.00	3,099,720.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,294,692.00	
BTPS 5% 08/01/34	2,950,000.00	3,902,392.75	
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,777,632.25	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,442,586.75	
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,540,925.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,037,966.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,169,548.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,423,900.75	
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,316,336.00	
DBR 0.5% 02/15/26	4,450,000.00	4,579,539.50	

DBR 0.5% 08/15/27	1,450,000.00	1,464,898.75
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,057,118.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,000,000.00	2,190,450.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,237,049.75
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,868,506.25
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,582,283.50
DBR 1.75% 02/15/24	450,000.00	503,894.25
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,405,580.00
DBR 1% 08/15/24	3,080,000.00	3,304,932.40
DBR 1% 08/15/25	2,450,000.00	2,628,127.25
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,711,350.00
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,217,130.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,678,463.75
DBR 2.5% 07/04/44	2,900,000.00	3,793,823.50
DBR 2.5% 08/15/46	3,050,000.00	4,019,076.50
DBR 2% 01/04/22	5,200,000.00	5,743,920.00
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,370,280.50
DBR 3.25% 01/04/20	3,000,000.00	3,266,295.00
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,883,633.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	3,080,910.00
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,224,995.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,379,557.25
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,852,030.00
DBR 4.0% 01/04/37	3,150,000.00	4,855,126.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,025,083.00
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,525,984.10
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	4,036,587.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	3,516,500.00
DBR 5.5% 01/04/31	1,950,000.00	3,154,388.25
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,368,004.75
DBR 6.25% 01/04/24	2,600,000.00	3,636,737.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,450,000.00	2,426,560.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,911,222.00
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,577,070.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,711,387.00
FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,265,142.00
FRTR 0.5% 05/25/26	5,580,000.00	5,589,402.30
FRTR 0.5% 11/25/19	5,950,000.00	6,087,950.75
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,041,985.00
FRTR 0% 05/25/22	4,500,000.00	4,545,090.00
FRTR 1.25% 05/25/36	3,350,000.00	3,278,527.75
FRTR 1.5% 05/25/31	4,350,000.00	4,591,490.25
FRTR 1.75% 05/25/23	5,650,000.00	6,225,085.25

FRTR 1.75% 05/25/66	950,000.00	896,078.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	1,650,000.00	1,733,778.75	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,550,000.00	5,046,041.00	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,335,296.25	
FRTR 1% 05/25/27	2,750,000.00	2,837,615.00	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,544,225.00	
FRTR 1% 11/25/25	4,250,000.00	4,460,800.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,950,000.00	5,651,365.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,597,043.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,250,000.00	5,021,778.75	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,945,214.25	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,950,000.00	5,937,525.00	
FRTR 2% 05/25/48	1,600,000.00	1,684,976.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,108,899.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,350,000.00	6,127,863.25	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	12,120,295.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,319,076.95	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,950,000.00	4,533,336.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,441,855.20	
FRTR 3% 04/25/22	4,800,000.00	5,512,752.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,250,000.00	5,639,996.25	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,092,055.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,475,017.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,010,000.00	6,390,115.45	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,250,000.00	5,048,273.75	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,247,794.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,550,000.00	2,510,279.25	
FRTR 4% 10/25/38	3,250,000.00	4,788,598.75	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,132,267.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,747,226.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,762,552.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,475,755.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,326,824.80	
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	783,157.50	
IRISH 1.7% 05/15/37	540,000.00	553,845.60	
IRISH 1% 05/15/26	1,360,000.00	1,403,193.60	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,240,000.00	1,431,852.80	
IRISH 2% 02/18/45	960,000.00	1,009,900.80	
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,386,330.75	
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,090,066.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,050,000.00	1,137,060.75	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,339,532.00	

IRISH 4.5% 10/18/18	780,000.00	819,417.30
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,910,531.00
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	903,112.00
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	920,626.50
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,939,824.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,697,343.05
NETHER 0.5% 07/15/26	2,350,000.00	2,381,243.25
NETHER 0.75% 07/15/27	1,290,000.00	1,320,173.10
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,827,162.00
NETHER 1.25% 01/15/19	1,400,000.00	1,434,916.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,662,375.00
NETHER 2.25% 07/15/22	2,970,000.00	3,330,186.75
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,287,423.25
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,362,721.55
NETHER 2% 07/15/24	1,750,000.00	1,981,708.75
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,337,932.75
NETHER 3.5% 07/15/20	3,270,000.00	3,642,714.60
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,660,218.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,020,000.00	3,146,604.50
NETHER 4% 01/15/37	1,880,000.00	2,882,256.20
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,190,893.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,389,277.10
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	281,241.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,396,318.50
OBL 0.25% 10/16/20	2,750,000.00	2,823,535.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,940,000.00	1,977,141.30
OBL 0% 04/17/20	1,600,000.00	1,627,912.00
OBL 0% 10/07/22	1,650,000.00	1,675,847.25
OBL 0% 10/08/21	2,350,000.00	2,396,118.75
OBL 1% 02/22/19	1,450,000.00	1,485,104.50
OBL 1% 10/12/18	3,800,000.00	3,866,025.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,068,453.75
RAGB 0.5% 04/20/27	700,000.00	695,663.50
RAGB 0.75% 10/20/26	2,300,000.00	2,354,498.50
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	501,102.50
RAGB 0% 09/20/22	560,000.00	565,572.00
RAGB 1.15% 10/19/18	400,000.00	407,084.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,600,000.00	1,714,120.00
RAGB 1.5% 02/20/47	410,000.00	406,765.10
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	172,736.00
RAGB 1.65% 10/21/24	1,200,000.00	1,326,168.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,938,370.00
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	991,296.50

RAGB 2.1% 09/20/17	600,000.00	625,476.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	880,000.00	1,057,817.20	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,180,000.00	1,633,745.40	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,539,850.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,504,494.65	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,296,856.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	697,739.70	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,720,000.00	1,930,562.40	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,500,000.00	2,279,047.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,100,000.00	2,247,451.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	850,000.00	1,172,328.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,320,441.00	
RFGB 0.375% 09/15/20	650,000.00	666,987.75	
RFGB 0.5% 04/15/26	650,000.00	658,008.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	348,239.50	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	533,436.30	
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	575,982.00	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	546,528.60	
RFGB 0% 09/15/23	600,000.00	599,955.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	900,000.00	978,975.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	643,241.60	
RFGB 2.625% 07/04/42	610,000.00	802,104.25	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	881,132.40	
RFGB 2% 04/15/24	520,000.00	585,002.60	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	769,177.50	
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	842,153.30	
RFGB 4.375% 07/04/19	920,000.00	999,598.40	
RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,031,616.00	
SPGB 0.25% 01/31/19	2,950,000.00	2,969,676.50	
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,058,722.75	
SPGB 0.75% 07/30/21	2,850,000.00	2,920,580.25	
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,101,205.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,100,000.00	2,080,848.00	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,443,591.20	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,300,000.00	2,262,360.50	
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,043,701.75	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,950,000.00	2,024,109.75	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,500,000.00	2,625,962.50	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,750,000.00	2,743,688.75	
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,801,748.25	
SPGB 2.35% 07/30/33	600,000.00	606,141.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,354,613.75	

	SPGB 2.75% 10/31/24	3,700,000.00	4,147,385.50
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,550,000.00	1,558,680.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	750,000.00	798,375.00
	SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,458,450.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,680,800.50
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	3,562,650.00
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,258,800.00
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,132,243.75
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,292,170.75
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,280,979.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,150,000.00	2,930,020.00
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,804,524.25
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,500,000.00	2,868,387.50
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,100,000.00	2,923,462.50
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,311,325.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,650,000.00	4,894,011.25
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,750,000.00	2,530,438.75
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,000,000.00	3,764,010.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,300,000.00	3,930,217.50
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,670,000.00	3,911,937.15
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,750,000.00	4,647,112.50
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,274,225.50
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,504,928.25
	ユーロ 小計	663,430,000.00	767,347,884.80 (102,510,003,930)
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,461,797.50
	UKT 0.75% 07/22/23	700,000.00	695,285.50
	UKT 1.25% 07/22/27	2,400,000.00	2,385,456.00
	UKT 1.5% 01/22/21	4,430,000.00	4,565,026.40
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,668,952.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,550,000.00	1,426,511.50
	UKT 1.75% 07/22/19	5,470,000.00	5,597,615.10
	UKT 1.75% 07/22/57	2,000,000.00	2,027,270.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,990,476.50
	UKT 1.75% 09/07/37	800,000.00	786,712.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,970,261.25
	UKT 2.5% 07/22/65	1,950,000.00	2,494,947.00
	UKT 2.75% 09/07/24	1,450,000.00	1,622,840.00
	UKT 2% 07/22/20	5,100,000.00	5,308,539.00
	UKT 2% 09/07/25	2,690,000.00	2,879,873.65
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,713,319.50
	UKT 3.5% 01/22/45	4,300,000.00	5,772,298.50
UKT 3.5% 07/22/68	2,350,000.00	3,843,624.75	

	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,103,402.75	
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	584,804.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	820,155.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,243,920.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,682,334.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,618,567.25	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,700,000.00	2,432,258.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,845,432.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,430,000.00	3,519,162.45	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,221,641.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,670,000.00	2,659,441.60	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,279,504.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,429,961.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	3,050,000.00	4,294,430.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,450,000.00	3,740,635.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,922,128.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	3,186,592.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,873,940.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,315,448.50	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,661,779.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,441,956.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,852,450.00	
	UKT 8% 06/07/21	1,050,000.00	1,331,688.75	
	イギリスポンド 小計	93,250,000.00	115,272,440.20 (17,093,750,157)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	433,030.00	
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,094,820.00	
	SWISS 3% 05/12/19	540,000.00	572,729.40	
	SWISS 4% 02/11/23	710,000.00	880,964.45	
	SWISS 4% 04/08/28	640,000.00	911,116.80	
	スイスフラン 小計	3,290,000.00	3,892,660.65 (449,446,598)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	4,500,000.00	4,470,930.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	11,250,000.00	12,142,068.75	
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,654,399.25	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,530,000.00	8,711,871.15	
	SGB 3.5% 03/30/39	6,100,000.00	8,281,939.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	13,670,000.00	15,934,572.20	
	SGB 4.25% 03/12/19	13,300,000.00	14,223,951.00	
	SGB 5% 12/01/20	11,800,000.00	13,786,589.00	
	スウェーデンクローナ 小計	76,500,000.00	86,206,320.85 (1,195,681,670)	

ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,660,000.00	5,664,895.90	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,200,000.00	3,244,944.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,900,000.00	5,018,629.00	
	NGB 2% 05/24/23	8,750,000.00	9,126,643.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	10,400,000.00	11,432,564.00	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,131,057.25	
	NGB 4.5% 05/22/19	10,850,000.00	11,527,908.00	
ノルウェークローネ 小計		49,310,000.00	52,146,641.90	(741,525,247)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/18	6,100,000.00	6,158,377.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,100,000.00	4,099,508.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,227,660.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	12,790,000.00	14,378,645.90	
	DGB 3% 11/15/21	12,950,000.00	14,729,589.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,050,000.00	28,835,130.50	
	DGB 4% 11/15/19	14,340,000.00	15,711,047.40	
デンマーククローネ 小計		73,930,000.00	91,139,957.80	(1,635,962,242)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	4,200,000.00	4,156,782.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	4,650,000.00	4,545,770.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,750,000.00	3,691,931.25	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,500,000.00	4,255,785.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,650,000.00	3,412,640.50	
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,464,405.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,870,000.00	9,120,089.65	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,716,008.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,400,000.00	3,613,537.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,430,000.00	3,742,147.15	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,794,402.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,182,479.25	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,200,000.00	2,510,651.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,294,819.50	
ポーランドズロチ 小計		50,530,000.00	51,501,448.35	(1,624,870,695)
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,650,000.00	2,622,413.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,030,000.00	1,928,621.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,981,321.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,000,000.00	941,735.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,489,408.25	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,350,000.00	3,347,353.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,028,756.75	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,366,561.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,497,467.00	

	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,233,925.25	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,050,000.00	1,034,712.00	
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,050,000.00	2,079,069.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,609,192.50	
	ACGB 3% 03/21/47	1,000,000.00	903,450.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,960,000.00	4,434,071.40	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,970,000.00	4,208,755.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,400,000.00	1,652,007.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,350,000.00	5,087,477.25	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,200,000.00	3,350,432.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,824,766.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,434,921.75	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	2,965,047.55	
	オーストラリアドル 小計	58,670,000.00	62,021,466.00 (5,505,025,322)	
シンガポ ールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	246,876.25	
	SIGB 1.625% 10/01/19	290,000.00	291,476.10	
	SIGB 1.75% 04/01/22	560,000.00	563,323.60	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	251,942.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	891,106.20	
	SIGB 2.375% 06/01/25	200,000.00	205,463.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,150,000.00	1,172,264.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	440,000.00	471,339.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	663,694.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	589,551.20	
	SIGB 2.875% 07/01/29	380,000.00	405,845.70	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	501,844.85	
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	406,278.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	768,574.80	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	619,744.85	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	885,296.10	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,150,000.00	1,286,188.75	
SIGB 3% 09/01/24	960,000.00	1,027,368.00		
	シンガポールドル 小計	10,640,000.00	11,248,177.40 (935,060,987)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,470,337.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	2,022,591.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,005,750.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,750,000.00	1,663,917.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	3,100,000.00	3,124,908.50	
	MGS 3.659% 10/15/20	800,000.00	806,584.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,244,522.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,105,142.50	

	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,089,970.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,520,055.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,113,513.30	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,890,000.00	1,885,426.20	
	MGS 4.048% 09/30/21	3,100,000.00	3,153,227.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,401,823.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,685,970.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,390,901.75	
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	640,419.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,249,533.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,844,109.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,250,000.00	1,266,725.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,300,000.00	1,335,600.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,880,044.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,063,504.50	
	マレーシアリングット 小計	39,770,000.00	39,964,576.00 (1,067,453,824)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	28,094,305.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,790,565.60	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,718,967.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,096,658.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,550,000.00	7,518,101.25	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,570,602.00	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,521,691.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	8,710,000.00	7,816,833.05	
	SAGB 8.5% 01/31/37	14,150,000.00	12,516,877.75	
	SAGB 8.75% 01/31/44	18,250,000.00	16,242,317.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,361,748.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,251,145.50	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,141,696.50	
	SAGB 8% 12/21/18	4,850,000.00	4,894,814.00	
	SAGB 9% 01/31/40	9,900,000.00	9,097,060.50	
	南アフリカランド 小計	174,980,000.00	160,633,383.90 (1,341,288,755)	
	合計		248,271,928,128 (248,271,928,128)	

有価証券明細表注記

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 184銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 285銘柄	100.0%	41.3%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.9%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 23銘柄	100.0%	0.4%
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。

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10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	918,247,524
コール・ローン	57,483,497
株式	45,110,078,943
投資信託受益証券	94,378,943
投資証券	155,830,762
派生商品評価勘定	32,943,285
未収入金	834,714
未収配当金	25,900,725
差入委託証拠金	125,149,188
流動資産合計	46,520,847,581
資産合計	46,520,847,581

	平成29年10月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	457,283
前受金	32,422,502
未払金	286,121
未払解約金	85,933,973
未払利息	93
流動負債合計	119,099,972
負債合計	119,099,972
純資産の部	
元本等	
元本	15,621,098,643
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,780,648,966
元本等合計	46,401,747,609
純資産合計	46,401,747,609
負債純資産合計	46,520,847,581

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10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>

平成29年10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>(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> <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10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,621,098,643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 2.9705円 (1万口当たり純資産額) (29,705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10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10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10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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	13,444,950,617円
期中追加設定元本額	2,791,228,922円
期中一部解約元本額	615,080,896円
期末元本額	15,621,098,643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	6,356,238,793円
世界経済インデックスファンド	2,925,880,666円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,204,186,399円
DC 世界経済インデックスファンド	2,122,615,101円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	17,728,314円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	201,494,208円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	253,638,130円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	359,530,349円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,766,300円
新興国株式インデックス・オープン	12,762,159円

区分	平成29年10月20日現在
S M T インデックスバランス・オープン	135,298,033円
S M T 世界経済インデックス・オープン	221,235円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	10,325,526円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	2,278,664円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	134,766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10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,156,543,289
投資信託受益証券	10,098,764
投資証券	2,294,896
合計	8,164,347,157

(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10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	株価指数先物取引 買建	940,192,810	-	972,615,312	32,422,502
	合計	940,192,810	-	972,615,312	32,422,502

(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10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 売建	86,213,500	-	86,150,000	63,500

	アメリカドル	78,980,000	-	78,925,000	55,000
	香港ドル	7,233,500	-	7,225,000	8,500
	合計	86,213,500	-	86,150,000	63,500

(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	454,644	4.33	1,968,608.52	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	33,723	51.84	1,748,200.32	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,280	117.90	858,312.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	5.64	609,706.56	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	81,414	5.05	411,140.70	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	43.77	968,673.87	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	14.42	244,130.60	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49,894	18.73	934,514.62	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	9,509	22.97	218,421.73	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	9,620	13.90	133,718.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,338	15.36	204,871.68	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	43.29	233,852.58	
	DP WORLD LTD	10,914	22.25	242,836.50	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	11,374	90.50	1,029,347.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	22,188	33.92	752,616.96	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,922	41.90	1,211,831.80	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	31,722	49.80	1,579,755.60	
	JD.COM INC-ADR	49,657	39.38	1,955,492.66	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	8.13	294,623.07	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	23,524	37.97	893,206.28	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	4.46	417,402.48	
	CREDICORP LTD	5,824	206.63	1,203,413.12	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	202,157	14.33	2,896,909.81	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	264,285	2.11	557,905.63		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.54	70,081.20		

	58.COM INC-ADR	7,312	67.48	493,413.76
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	88,073	177.93	15,670,828.89
	AUTOHOME INC-ADR	3,833	60.06	230,209.98
	BAIDU INC - SPON ADR	21,592	264.52	5,711,515.84
	MOMO INC-SPON ADR	10,135	32.81	332,529.35
	NETEASE INC-ADR	6,195	276.71	1,714,218.45
	SINA CORP	4,000	111.60	446,400.00
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	96.89	371,863.82
	YY INC-ADR	4,331	92.77	401,786.87
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.50	418,467.00
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	21,667	6.97	151,018.99
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.40	153,438.60
	アメリカドル 小計	1,958,172		47,735,264.84 (5,383,105,816)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	15.30	18,835,233.30
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	61.29	18,435,541.68
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	468.70	4,651,847.50
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	48.93	4,738,968.36
	ALFA S.A.B. -A	242,900	20.53	4,986,737.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	66.22	2,483,250.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	346.62	5,367,410.70
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	185.05	5,751,354.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	187.66	3,186,466.80
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	190,790	89.19	17,016,560.10
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	140.20	1,528,180.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	386,280	43.10	16,648,668.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	123.95	4,174,016.25
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	133.77	5,792,241.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	172.71	27,536,882.40
	GRUMA S.A.B. -B	14,210	263.49	3,744,192.90
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	44.59	5,903,716.00
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	31.33	1,121,614.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	34.12	3,159,512.00
	GRUPO FIN SANTANDER-B	169,700	33.78	5,732,466.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	187,400	118.94	22,289,356.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	150,500	32.00	4,816,000.00
	GENTERA SAB DE CV	77,100	24.56	1,893,576.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,504,640	17.51	43,856,246.40
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	98.07	3,697,239.00
	メキシコペソ 小計	6,209,010		237,347,275.39 (1,424,083,652)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	38.14	701,776.00

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	215,800	16.50	3,560,700.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	297,740	16.15	4,808,501.00
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	78.27	2,246,349.00
BRASKEM SA-PREF A	8,900	46.48	413,672.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	9.86	323,408.00
DURATEX SA	21,672	10.14	219,754.08
FIBRIA CELULOSE SA	24,900	50.19	1,249,731.00
GERDAU SA-PREF	87,000	11.72	1,019,640.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	19.31	778,193.00
VALE SA	192,785	33.00	6,361,905.00
VALE SA-PREF A	45,915	30.68	1,408,672.20
EMBRAER SA	41,400	16.13	667,782.00
WEG SA	51,440	22.13	1,138,367.20
CCR SA	101,100	18.95	1,915,845.00
LOCALIZA RENT A CAR	11,434	59.28	677,807.52
RUMO SA	47,800	13.10	626,180.00
KROTON EDUCATIONAL SA	97,284	18.93	1,841,586.12
LOJAS AMERICANAS SA	10,800	15.38	166,104.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	18.39	1,171,737.24
LOJAS RENNER S.A.	60,370	36.74	2,217,993.80
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	80.16	865,728.00
RAIA DROGASIL SA	17,000	77.78	1,322,260.00
AMBEV SA	369,000	21.83	8,055,270.00
BRF SA	38,800	44.48	1,725,824.00
JBS SA	27,000	8.05	217,350.00
M DIAS BRANCO SA	6,300	48.61	306,243.00
NATURA COSMETICOS SA	10,700	30.81	329,667.00
ODONTOPREV S.A.	12,400	16.02	198,648.00
QUALICORP SA	20,800	36.35	756,080.00
HYPERMARCAS SA	35,300	34.35	1,212,555.00
BANCO BRADESCO S.A.	72,518	34.25	2,483,741.50
BANCO BRADESCO SA-PREF	235,710	36.12	8,513,845.20
BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	37.18	2,569,138.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	255,021	44.09	11,243,875.89
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	289,925	11.15	3,232,663.75
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	24.45	4,217,698.35
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	28.61	1,610,743.00
PORTO SEGURO SA	7,300	38.46	280,758.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	13.54	772,633.02
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	75.20	413,600.00
CIELO SA	99,269	22.24	2,207,742.56
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	50.95	1,620,210.00

	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.15	885,735.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	24.12	426,924.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	20.55	256,875.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	8.30	547,733.60	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	27.88	92,004.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	30.60	798,660.00	
	CPFL ENERGIA SA	16,044	27.40	439,605.60	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	15.30	406,980.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	36.62	490,708.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,800	63.15	808,320.00	
	ブラジルリアル 小計	3,667,701		92,825,523.63 (3,300,875,620)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	32,412	9,541.10	309,246,133.20	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	1,837.60	154,872,928.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	36,982.00	268,489,320.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	8,495.70	187,814,439.90	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	6,069.90	322,269,200.70	
	CENCOSUD SA	137,988	1,904.90	262,853,341.20	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,833.00	82,350,059.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	3,073.70	46,757,124.40	
	BANCO DE CHILE	2,284,160	96.72	220,923,955.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,476	42,036.00	104,081,136.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	48.26	303,064,161.46	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.89	98,736,274.62	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	7,049.10	130,774,903.20	
	AES GENER SA	141,749	220.45	31,248,567.05	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	408.86	66,745,577.28	
	COLBUN SA	475,888	151.16	71,935,230.08	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	134.61	291,105,028.41	
	ENEL CHILE SA	1,939,330	74.77	145,003,704.10	
	ENEL GENERACION CHILE SA	216,099	569.83	123,139,693.17	
	チリペソ 小計	30,794,735		3,221,410,776.97 (580,820,363)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	1,460.00	521,697,420.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	11,500.00	368,126,500.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	20,720.00	367,220,560.00	
	BANCOLOMBIA SA	13,742	31,000.00	426,002,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	32,120.00	1,229,489,360.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,330.00	403,931,640.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	41,360.00	601,870,720.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	39,900.00	501,183,900.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,580.00	685,939,380.00	

	コロンビアペソ 小計	840,413		5,105,461,480.00 (197,070,813)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	20.86	90,907.88
	OPAP SA	17,668	9.35	165,195.80
	FF GROUP	3,404	17.76	60,455.04
	JUMBO SA	8,599	13.80	118,666.20
	ALPHA BANK AE	94,467	1.66	156,815.22
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.69	104,135.62
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.28	115,639.20
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	2.47	45,944.47
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.45	212,061.85
	ユーロ 小計	717,893		1,069,821.28 (142,917,424)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	130.30	1,511,870.90
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	8.46	987,747.30
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	6.33	303,922.29
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	28.92	688,614.12
	KOC HOLDING AS	62,460	16.65	1,039,959.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.29	185,190.72
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	18.37	180,687.32
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	9.94	618,178.54
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	48.92	159,381.36
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	30.40	205,200.00
	ARCELIK AS	15,358	23.10	354,769.80
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	75.90	1,182,294.30
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	21.56	242,118.80
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	37.70	166,520.90
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	19.61	188,765.86
	AKBANK T.A.S.	176,098	9.84	1,732,804.32
	TURKIYE GARANTI BANKASI	166,475	10.42	1,734,669.50
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	12.02	630,220.62
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	7.04	782,629.76
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	6.43	333,993.49
	YAPI VE KREDI BANKASI	109,792	4.51	495,161.92
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	10.37	637,195.02
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	6.78	120,656.88
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	14.10	1,340,853.60	
	トルコリラ 小計	1,286,299		15,823,406.32 (488,785,021)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	961.90	7,178,659.70
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	75.40	2,014,461.80
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	257.00	1,156,500.00

	CEZ AS	13,737	459.80	6,316,272.60	
	チェココルナ 小計	52,417		16,665,894.10 (86,495,990)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,199.00	105,157,528.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	6,549.00	55,397,991.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	10,640.00	208,001,360.00	
	ハンガリーフォリント 小計	60,880		368,556,879.00 (159,953,685)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	62.04	342,212.64	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	21,535	120.80	2,601,428.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	6.68	978,599.96	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	74.50	207,557.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	99.50	415,014.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	123.65	1,623,771.80	
	SYNTHOS SA	33,750	4.80	162,000.00	
	CCC SA	3,138	266.50	836,277.00	
	LPP SA	124	7,752.35	961,291.40	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	24.50	575,799.00	
	EUROCASH SA	5,057	36.02	182,153.14	
	ALIOR BANK SA	8,830	69.80	616,334.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	68.84	138,368.40	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	7.61	251,259.37	
	BANK PEKAO SA	10,614	126.95	1,347,447.30	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	362.00	868,076.00	
	M BANK SA	747	449.80	336,000.60	
	PKO BANK POLSKI SA	80,565	37.39	3,012,325.35	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	46.30	2,359,031.30	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.01	278,846.58	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	13.10	831,797.60		
TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	3.48	198,474.84		
	ポーランドズロチ 小計	624,527		19,124,065.78 (603,364,275)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	51,000	3.63	185,130.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	6.92	719,680.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,927,400	5.68	10,947,632.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	250,500	18.58	4,654,290.00	
	CNOOC LTD-R	1,389,000	10.00	13,890,000.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.30	1,883,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	4.99	8,752,460.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	7.55	845,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	6.67	2,267,800.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	32.60	3,586,000.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.02	1,986,600.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	12.70	1,054,100.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	14.54	1,468,540.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	4.76	947,240.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.78	2,026,620.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.54	562,960.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	46.60	1,817,400.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	9.88	3,082,560.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	15.42	2,459,490.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	9.90	1,084,050.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.54	1,962,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	11.26	1,914,200.00
CITIC LTD	502,000	11.40	5,722,800.00
CRRG CORP LTD-H	313,050	7.29	2,282,134.50
FOSUN INTERNATIONAL	185,000	18.00	3,330,000.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	22.85	799,750.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.53	593,040.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	24.40	927,200.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	6.66	452,880.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	108,800	8.63	938,944.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	39,500	46.40	1,832,800.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	147,000	10.60	1,558,200.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	6.53	770,540.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	12.48	1,347,840.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	91,513	24.20	2,214,614.60
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.37	945,120.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	8.96	913,920.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	12.34	839,120.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	9.98	878,240.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	20.50	5,125,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	73.60	3,643,200.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE-B	47,600	10.42	495,992.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	10.70	2,846,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	27.90	758,880.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	24.85	9,691,500.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	10.58	2,155,675.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	180,246	19.00	3,424,674.00
MINTH GROUP LTD	52,000	42.15	2,191,800.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,000	32.00	2,272,000.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	20.60	2,389,600.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	47,000	63.90	3,003,300.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	1.26	982,800.00

GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.95	564,260.10
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	7.77	1,515,150.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	197,000	20.85	4,107,450.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	22.00	3,124,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	12.06	1,471,320.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	30.35	607,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	6.07	1,997,030.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	74.55	4,957,575.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	224,000	3.91	875,840.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	5.69	614,520.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	19.90	855,700.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	34.75	3,461,100.00
3SBIO INC	84,500	13.88	1,172,860.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	14.68	1,468,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	274,000	13.34	3,655,160.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	37.95	986,700.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	2.77	889,170.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	352,000	8.77	3,087,040.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,892,000	3.61	6,830,120.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,245,200	3.99	24,918,348.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	609,475	5.98	3,644,660.50
CHINA CITIC BANK-H	627,200	5.08	3,186,176.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,604,620	6.78	44,779,323.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.80	847,400.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	295,423	30.20	8,921,774.60
CHINA MINSHENG BANKING-H	459,500	7.38	3,391,110.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	5.14	714,460.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,585,515	6.13	34,239,206.95
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	3.08	2,562,560.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	17.72	1,098,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	6.87	2,256,795.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	528,000	3.70	1,953,600.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	17.70	3,522,300.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.50	1,057,500.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	17.06	1,801,536.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	12.74	3,526,432.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	17.26	1,819,204.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	583,000	24.20	14,108,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	205,200	36.10	7,407,720.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	23.95	3,396,684.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	48.20	3,229,400.00

PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.69	2,553,480.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	322,859	14.78	4,771,856.02
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	404,000	64.70	26,138,800.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	29.20	6,949,600.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	3.89	855,800.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	25.30	8,274,112.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	219,111	23.90	5,236,752.90
CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	26.25	1,968,750.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	421,285	12.30	5,181,805.50
FULLSHARE HOLDINGS LTD	460,000	3.25	1,495,000.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	18.22	1,253,536.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	18.94	2,339,090.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	16.98	1,112,190.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	5.15	966,093.65
SOHO CHINA LTD	113,000	4.57	516,410.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	136,000	37.55	5,106,800.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	19.58	1,292,280.00
TENCENT HOLDINGS LTD	440,600	346.20	152,535,720.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	18.70	991,100.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	136.30	8,178,000.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	4.46	2,577,880.00
SUNNY OPTICAL TECH	57,000	112.50	6,412,500.00
ZTE CORP-H	48,508	26.15	1,268,484.20
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	4.48	582,400.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	482,500	78.30	37,779,750.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	4.00	4,400,000.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	442,000	11.16	4,932,720.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	6.43	2,623,440.00
CGN POWER CO LTD-H	669,000	2.23	1,491,870.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	23.90	3,250,400.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	6.16	1,558,480.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	208,000	2.46	511,680.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	29.00	2,494,000.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	13.86	2,431,044.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	58.50	3,276,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	11.06	2,455,320.00
HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	4.89	1,261,620.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.68	820,080.00
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	1.18	1,221,300.00
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	9.78	2,591,700.00
	56,035,568		670,005,186.92

	香港ドル 小計			(9,688,275,002)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	2.21	492,759.28
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	24.20	607,420.00
	SAPURA ENERGY BHD	282,600	1.47	415,422.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	7.54	1,584,154.00
	GAMUDA BHD	139,200	5.13	714,096.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.13	348,766.00
	IJM CORP BHD	198,100	3.23	639,863.00
	SIME DARBY BERHAD	167,246	9.04	1,511,903.84
	AIRASIA BHD	64,800	3.38	219,024.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.40	450,189.60
	MISC BHD	125,040	7.15	894,036.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.77	263,900.00
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	5.59	190,060.00
	GENTING BHD	205,300	9.60	1,970,880.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.24	1,174,284.00
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.78	329,430.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	42.42	462,378.00
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.83	146,949.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.36	145,040.00
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.49	806,583.60
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.38	1,336,024.00
	PPB GROUP BERHAD	43,900	16.72	734,008.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	7.70	277,200.00
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.80	1,329,940.00
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.82	269,692.00
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.48	583,296.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	287,275	6.18	1,775,359.50
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	16.02	981,897.84
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	16.62	248,186.46
	MALAYAN BANKING BHD	270,360	9.35	2,527,866.00
	PUBLIC BANK BERHAD	228,020	20.48	4,669,849.60
	RHB BANK BHD	53,119	4.99	265,063.81
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.98	304,573.50
	AXIATA GROUP BERHAD	156,574	5.18	811,053.32
DIGI.COM BERHAD	311,700	4.77	1,486,809.00	
MAXIS BHD	135,500	5.74	777,770.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.09	429,661.68	
PETRONAS GAS BHD	36,900	17.98	663,462.00	
TENAGA NATIONAL BHD	255,675	14.32	3,661,266.00	
YTL CORPORATION BERHAD	247,417	1.37	338,961.29	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.39	170,031.75	

	マレーシアリングット 小計	5,433,955		37,009,110.07 (988,513,329)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	17.30	2,050,050.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	39.50	2,713,650.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	6.40	3,665,920.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	90.25	11,254,175.00	
	PTT PCL-NVDR	78,900	416.00	32,822,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	103.00	4,944,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	43.50	4,432,650.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,734	79.25	11,787,169.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	488.00	6,588,000.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	490.00	9,163,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	52.25	3,542,550.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	305,000	57.50	17,537,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	7.90	3,090,480.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.40	3,087,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	40.25	6,512,852.50	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	17.90	1,004,190.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	11.90	2,756,456.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	69.00	2,401,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	372,000	68.25	25,389,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	26.00	8,858,200.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.20	4,368,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	21.00	9,569,700.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	218.00	5,580,800.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	196.50	3,183,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	90,300	218.00	19,685,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	212.00	10,939,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	18.70	4,623,575.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	148.50	21,978,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.52	3,367,980.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	76.00	10,039,600.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	85.25	2,753,575.00		
KCE ELECTRONICS - NVDR	24,700	95.25	2,352,675.00		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	70,900	192.50	13,648,250.00		
TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	6.10	3,707,024.90		
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	230.00	5,336,000.00		
GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	88.00	2,604,800.00		
	タイバーツ 小計	7,154,638		287,338,323.40 (976,950,299)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	75.40	8,647,626.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	15.48	9,142,488.00	

	DMCI HOLDINGS INC	345,450	15.80	5,458,110.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	75.20	17,323,072.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	970.00	22,120,850.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	102.00	6,450,480.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	247.00	6,286,150.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	140.10	8,879,538.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	98.00	5,137,160.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	147.00	25,536,987.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	92.00	3,785,984.00	
	SECURITY BANK CORP	30,810	265.20	8,170,812.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	1,116.00	24,964,920.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,215.00	7,454,025.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	6.90	5,076,330.00	
	AYALA LAND INC	637,000	43.35	27,613,950.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.39	3,438,820.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	26.40	2,455,200.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	590,250	36.80	21,721,200.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	2,016.00	3,608,640.00	
	PLDT INC	6,225	1,710.00	10,644,750.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	42.75	3,826,125.00	
	フィリピンペソ 小計	4,574,048		237,743,217.00 (520,657,645)	
インドネシア ピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,865.00	1,492,932,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	34,350.00	4,427,715,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	19,275.00	3,662,250,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	10,500.00	2,463,300,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	7,350.00	1,030,470,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	2,100.00	824,040,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	6,100.00	753,350,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	7,925.00	13,640,510,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	630,500	1,470.00	926,835,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	2,130.00	1,135,290,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	9,600.00	1,780,800,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,080.00	1,330,868,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	63,125.00	1,944,250,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,820.00	3,506,378,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,925.00	1,436,925,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	8,150.00	3,497,165,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	49,675.00	5,891,455,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,700.00	2,130,780,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	20,325.00	16,894,140,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	5,225.00	1,026,712,500.00	

	BANK MANDIRI	1,424,996	6,975.00	9,939,347,100.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	471,600	7,675.00	3,619,530,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	824,700	15,500.00	12,782,850,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,790.00	1,223,286,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	710.00	861,230,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	615.00	990,396,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	453,200	1,025.00	464,530,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,928,900	4,210.00	16,540,669,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	6,425.00	857,095,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	3,370.00	581,325,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	1,660.00	1,313,890,000.00	
	インドネシアルピア 小計	21,158,496		118,970,314,100.00 (999,350,638)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	68,300.00	288,704,100.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	132,000.00	448,932,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	207,500.00	1,089,790,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	32,700.00	350,086,200.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	141,000.00	198,669,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	55,500.00	401,931,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	536,000.00	419,688,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	68,400.00	71,888,400.00	
	LG CHEM LTD	3,844	385,000.00	1,479,940,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	246,000.00	117,834,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	393,500.00	436,785,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	102,500.00	115,517,500.00	
	POSCO	5,701	340,000.00	1,938,340,000.00	
	CJ CORP	1,230	179,500.00	220,785,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	82,300.00	129,293,300.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	7,140.00	59,047,800.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	37,150.00	160,042,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	19,650.00	65,670,300.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	26,950.00	91,576,100.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	45,000.00	127,125,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	37,600.00	142,015,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	39,300.00	250,734,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,820	152,000.00	428,640,000.00	
	KCC CORP	326	391,000.00	127,466,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	56,200.00	290,891,200.00	
	LG CORP	7,072	85,600.00	605,363,200.00	
	POSCO DAEWOO CORP	1,560	19,600.00	30,576,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,354	145,500.00	924,507,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	24,326	11,600.00	282,181,600.00	

SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,160	38,050.00	82,188,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,066	296,500.00	612,569,000.00
SK NETWORKS CO LTD	26,186	6,880.00	180,159,680.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	44,900.00	42,250,900.00
S-1 CORPORATION	960	91,400.00	87,744,000.00
CJ LOGISTICS	324	162,500.00	52,650,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	147,000.00	213,885,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,378	31,050.00	73,836,900.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,780.00	171,874,080.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	59,100.00	417,600,600.00
HANON SYSTEMS	10,825	13,450.00	145,596,250.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	249,000.00	1,388,673,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	11,843	151,500.00	1,794,214,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	104,500.00	302,214,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	95,800.00	287,687,400.00
HYUNDAI WIA CORP	1,737	65,500.00	113,773,500.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	33,250.00	685,847,750.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	99,500.00	396,209,000.00
HANSSEM CO LTD	615	173,000.00	106,395,000.00
LG ELECTRONICS INC	8,015	96,500.00	773,447,500.00
KANGWON LAND INC	8,683	34,350.00	298,261,050.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	18,100.00	91,767,000.00
CJ E&M CORP	2,024	84,600.00	171,230,400.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	61,400.00	132,132,800.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	87,900.00	107,413,800.00
LOTTE SHOPPING CO	1,158	246,500.00	285,447,000.00
SHINSEGAE CO LTD	417	210,000.00	87,570,000.00
BGF RETAIL CO LTD	1,576	84,600.00	133,329,600.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	27,350.00	41,599,350.00
EMART	1,661	221,000.00	367,081,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	34,700.00	45,491,700.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	377,000.00	189,631,000.00
KT&G CORP	8,747	108,500.00	949,049,500.00
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	31	1,354,000.00	41,974,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	450	166,000.00	74,700,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	93,000.00	185,349,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	784,000.00	53,312,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,436	286,500.00	697,914,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	158,000.00	112,180,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,071,000.00	803,250,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	634,000.00	85,590,000.00
PACIFIC CORP	2,115	133,000.00	281,295,000.00

CELLTRION INC	6,665	175,200.00	1,167,708,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	365	515,000.00	187,975,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	604	101,000.00	61,004,000.00	
MEDY-TOX INC	317	446,000.00	141,382,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,050	377,500.00	396,375,000.00	
YUHAN CORPORATION	572	210,000.00	120,120,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	9,990.00	231,927,840.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	10,350.00	127,056,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	21,772	47,400.00	1,031,992,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	14,400.00	259,862,400.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	30,294	57,300.00	1,735,846,200.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	32,668	50,800.00	1,659,534,400.00	
WOORI BANK	29,912	17,550.00	524,955,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	65,800.00	148,379,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	10,450.00	324,911,400.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	14,350.00	162,126,300.00	
SAMSUNG CARD CO	1,899	36,250.00	68,838,750.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	35,700.00	206,203,200.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	4,209	74,500.00	313,570,500.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	7,260.00	88,717,200.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	46,150.00	199,275,700.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	278,000.00	702,228,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	124,000.00	657,200,000.00	
KAKAO CORP	3,347	147,000.00	492,009,000.00	
NAVER CORP	2,139	811,000.00	1,734,729,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,148	424,500.00	487,326,000.00	
NETMARBLE GAMES CORP	1,183	173,000.00	204,659,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	187,000.00	583,627,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	18,774	29,100.00	546,323,400.00	
LG INNOTEK CO LTD	857	155,500.00	133,263,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	95,800.00	437,422,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,556	2,649,000.00	20,015,844,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,433	2,099,000.00	3,007,867,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	197,000.00	930,628,000.00	
KT CORP	3,800	29,850.00	113,430,000.00	
SK TELECOM	1,647	264,500.00	435,631,500.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,460	40,850.00	794,941,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,432	42,300.00	60,573,600.00	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	810	460,500.00	373,005,000.00	
SK HYNIX INC	46,200	79,000.00	3,649,800,000.00	
韓国ウォン 小計	697,035		68,976,673,050.00 (6,904,564,972)	

新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	106.00	11,579,440.00
	ASIA CEMENT CORP	297,176	26.95	8,008,893.20
	CHINA STEEL	890,261	24.85	22,122,985.85
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	247,061	93.60	23,124,909.60
	FORMOSA PLASTICS CORP	311,824	92.80	28,937,267.20
	NAN YA PLASTICS CORP	370,752	74.70	27,695,174.40
	TAIWAN CEMENT	297,929	33.75	10,055,103.75
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	39.30	1,336,200.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	189,028	24.85	4,697,345.80
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,019	299.50	3,899,190.50
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	27.80	3,085,800.00
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	11.35	1,477,804.05
	EVA AIRWAYS CORP	143,931	14.80	2,130,178.80
	EVERGREEN MARINE	107,563	16.95	1,823,192.85
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	24.30	4,301,100.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	60.20	10,659,072.20
	YULON MOTOR COMPANY	51,000	25.50	1,300,500.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	375.50	4,482,343.50
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	136.50	4,493,034.00
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	31.15	1,246,000.00
	GIANT MANUFACTURING	25,464	161.00	4,099,704.00
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	140.00	1,617,000.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	350.00	2,450,000.00
	POU CHEN	153,780	37.75	5,805,195.00
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	46.15	1,700,489.05
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	352.50	9,165,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	264.00	12,023,616.00
	STANDARD FOODS CORP	35,756	74.10	2,649,519.60
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	63.70	23,848,961.50
	TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	197.00	2,561,000.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	16.35	6,480,649.50
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.30	11,688,054.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	19.40	26,718,397.80
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	673,363	18.45	12,423,547.35
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	716,984	19.80	14,196,283.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	476,242	16.70	7,953,241.40	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	23.90	21,565,902.10	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,134,205	9.25	10,491,396.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	13.30	12,036,353.70	
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	8.41	1,614,392.01	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	16.25	11,788,432.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	64,429	79.20	5,102,776.80	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	47.20	26,011,070.40
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	13.30	10,269,634.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	606,951	49.35	29,953,031.85
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	153,922	28.40	4,371,384.80
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	9.25	5,695,881.75
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	40.20	1,693,224.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	29.35	1,635,792.90
ACER INC	255,803	15.60	3,990,526.80
ADVANTECH CO LTD	20,402	204.00	4,162,008.00
ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	256.50	14,131,098.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	12.55	7,405,629.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,700	302.00	15,311,400.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,649	76.70	2,197,378.30
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	14.00	10,850,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	21.80	9,412,368.00
DELTA ELECTRONICS INC	143,903	147.50	21,225,692.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	93.50	8,681,475.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	282.00	3,948,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,223,311	113.00	138,234,143.00
HTC CORPORATION	37,430	71.10	2,661,273.00
INVENTEC CO LTD	136,511	23.55	3,214,834.05
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	5,745.00	46,189,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	45.00	6,770,340.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	31,000	72.40	2,244,400.00
PEGATRON CORP	159,474	78.80	12,566,551.20
QUANTA COMPUTER INC	196,270	73.20	14,366,964.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	37.90	2,959,990.00
TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	85.90	811,325.50
WISTRON CORP	235,771	24.60	5,799,966.60
WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	42.30	6,606,710.10
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	64.00	1,403,008.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	10.15	2,009,700.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	285,315	102.50	29,244,787.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	72.50	11,382,500.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	107.50	16,361,500.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	518,630	37.30	19,344,899.00
GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	365.00	6,570,000.00
MEDIATEK INC	112,804	316.50	35,702,466.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	86.50	4,152,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	114.00	4,565,130.00
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	356.50	4,135,043.50
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	93.20	4,452,164.00

	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	110.00	3,073,840.00
	SILICONWARE PRECISION INDS	159,000	48.30	7,679,700.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,899,389	239.00	453,953,971.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	15.65	15,290,050.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	55.80	3,013,200.00
	新台湾ドル 小計	25,699,169		1,430,141,300.61 (5,334,427,051)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	508.15	33,598,878.00
	COAL INDIA LTD	41,924	285.80	11,981,879.20
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	460.35	27,356,298.75
	INDIAN OIL CORP LTD	58,804	409.65	24,089,058.60
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	172.05	17,689,148.70
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,073	909.90	176,587,022.70
	ACC LTD	1,768	1,765.15	3,120,785.20
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	274.05	10,190,549.25
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,178.50	29,415,360.00
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,138.65	31,132,968.30
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	273.90	21,643,851.90
	JSW STEEL LTD	80,284	253.70	20,368,050.80
	SHREE CEMENT LTD	901	18,213.05	16,409,958.05
	TATA STEEL LTD	25,839	705.50	18,229,414.50
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	4,034.35	29,668,609.90
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	793.70	20,809,226.60
	VEDANTA LTD	110,508	327.95	36,241,098.60
	ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	129.15	8,158,534.65
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	84.60	4,314,177.00
	EICHER MOTORS LTD	939	31,489.10	29,568,264.90
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	547.35	12,849,588.60
	LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,139.75	40,408,696.50
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,224.40	6,560,335.20
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	401.40	25,097,936.40
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,337	1,319.25	4,402,337.25
	BAJAJ AUTO LTD	5,458	3,217.95	17,563,571.10
	BHARAT FORGE LTD	13,392	628.15	8,412,184.80
	BOSCH LTD	431	21,538.70	9,283,179.70
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,735.60	12,136,964.40
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,474	1,375.75	43,300,355.50
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,037	7,731.10	62,134,850.70
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	354.95	18,182,313.75
	TATA MOTORS LTD	113,193	426.95	48,327,751.35
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	34,784	241.50	8,400,336.00
	TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	606.95	16,884,742.05

ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	489.35	24,128,380.45
ITC LTD	272,605	269.65	73,507,938.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	7,216.20	17,282,799.00
UNITED SPIRITS LTD	3,561	2,469.10	8,792,465.10
DABUR INDIA LTD	58,111	318.55	18,511,259.05
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	958.95	17,859,484.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	48,921	1,257.70	61,527,941.70
MARICO LTD	42,465	314.45	13,353,119.25
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	1,058.10	4,384,766.40
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	754.05	15,334,360.80
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	490.75	5,155,819.50
CIPLA LTD	31,308	607.80	19,029,002.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,373.05	18,512,163.05
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	608.55	9,758,707.80
LUPIN LTD	16,340	1,051.20	17,176,608.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,422	2,768.95	17,782,196.90
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	535.75	44,440,462.50
AXIS BANK LTD	141,543	460.30	65,152,242.90
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	120,033	1,745.75	209,547,609.75
ICICI BANK LTD	190,983	257.85	49,244,966.55
IDFC BANK LTD	75,550	56.25	4,249,687.50
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,360.70	36,627,322.60
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	663.05	18,546,171.55
STATE BANK OF INDIA	132,502	242.75	32,164,860.50
YES BANK LTD	123,760	357.80	44,281,328.00
BAJAJ FINANCE LTD	11,190	1,845.90	20,655,621.00
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	422.65	6,854,537.70
POWER FINANCE CORPORATION	37,247	130.25	4,851,421.75
RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	157.10	7,567,192.80
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,084.80	13,166,217.60
BAJAJ FINSERV LTD	2,289	5,306.10	12,145,662.90
HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	922.30	42,277,309.70
INFOSYS LTD	138,727	926.95	128,592,992.65
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	36,157	2,583.90	93,426,072.30
TECH MAHINDRA LTD	29,432	458.35	13,490,157.20
WIPRO LTD	89,034	292.05	26,002,379.70
BHARTI AIRTEL LTD	85,980	473.75	40,733,025.00
BHARTI INFRATEL LTD	36,202	460.25	16,661,970.50
IDEA CELLULAR LTD	142,255	91.25	12,980,768.75
GAIL INDIA LTD	39,878	433.25	17,277,143.50
NTPC LTD	145,475	175.05	25,465,398.75
TATA POWER CO LTD	93,250	81.50	7,599,875.00

	インドルピー 小計	4,019,428		2,240,617,690.00 (3,921,080,957)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	15.32	348,376.80	
	INDUSTRIES QATAR	15,948	94.00	1,499,112.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	26.49	540,369.51	
	DOHA BANK QSC	12,309	27.38	337,020.42	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	35.69	961,774.12	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	94.50	556,321.50	
	QATAR NATIONAL BANK	17,714	123.29	2,183,959.06	
	QATAR INSURANCE CO	9,170	47.00	430,990.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	30.18	115,468.68	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	9.14	443,737.86	
	OOREDOO QSC	7,280	85.90	625,352.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	178.00	283,198.00	
	カタールリアル 小計	192,361		8,325,679.95 (248,771,316)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	146.00	2,867,148.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	366.00	1,168,272.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,367	128.45	3,643,741.15	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	55.68	3,595,870.08	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,653	31.80	1,833,365.40	
	MONDI LTD	9,893	339.00	3,353,727.00	
	SAPPI LIMITED	49,985	93.00	4,648,605.00	
	SASOL LTD	43,699	391.38	17,102,914.62	
	SIBANYE-STILLWATER	160,975	16.67	2,683,453.25	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	178.32	4,939,820.64	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	239,087	60.78	14,531,707.86	
	NASPERS LTD-N SHS	34,259	3,255.00	111,513,045.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	193.69	2,409,503.60	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	181.60	3,867,898.40	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	138.08	3,318,338.56	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	77.46	3,669,047.82	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	58.00	4,853,672.00	
	BID CORP LTD	26,440	309.00	8,169,960.00	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	112.50	943,762.50	
	PICK N PAY STORES LTD	8,457	59.60	504,037.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	214.24	7,383,353.12	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	174.70	2,552,891.10	
PIONEER FOODS LTD	8,805	118.01	1,039,078.05		
TIGER BRANDS LTD	13,023	394.36	5,135,750.28		
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	78,446	26.45	2,074,896.70		
NETCARE LTD	60,221	25.37	1,527,806.77		

	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	319.51	9,625,238.75	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	47,198	147.00	6,938,106.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	930.00	2,996,460.00	
	NEDBANK GROUP LTD	14,966	219.57	3,286,084.62	
	STANDARD BANK GROUP LTD	98,518	170.47	16,794,363.46	
	BRAIT SE	20,371	52.51	1,069,681.21	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	72.89	736,480.56	
	FIRSTSTRAND LTD	249,465	53.95	13,458,636.75	
	INVESTEC LTD	28,883	98.82	2,854,218.06	
	PSG GROUP LTD	8,086	260.00	2,102,360.00	
	REMGRO LTD	46,153	220.00	10,153,660.00	
	RMB HOLDINGS LTD	43,247	65.52	2,833,543.44	
	DISCOVERY LIMITED	21,716	146.70	3,185,737.20	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	110.30	686,727.80	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	19.50	1,327,521.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	40.64	1,642,181.12	
	SANLAM LTD	113,378	72.28	8,194,961.84	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	85,801	40.20	3,449,200.20	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	49,578	17.38	861,665.64	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	194.28	6,005,971.92	
	MTN GROUP LTD	132,522	124.49	16,497,663.78	
	TELKOM SA LTD	11,353	54.40	617,603.20	
	VODACOM GROUP	42,279	154.70	6,540,561.30	
	南アフリカランド 小計	2,383,301		341,190,293.95 (2,848,938,954)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	234,432	0.77	182,153.66	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	7.40	1,365,596.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	96,441	6.09	587,325.69	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	10.45	1,123,719.85	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.47	670,560.54	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	3.99	723,023.91	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.31	414,975.33	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	8.75	2,630,442.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	17.80	2,451,505.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,693,627		10,149,302.48 (311,076,121)	
	合 計	175,253,673		45,110,078,943 (45,110,078,943)	

(2) 株式以外の有価証券

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

投資信託受益証券	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	845,320.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,070,593.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	293,313.02	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20,500	444,850.00	
	ブラジルリアル 小計		120,162	2,654,076.02	(94,378,943)
投資信託受益証券合計		120,162	94,378,943	(94,378,943)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	189,100	5,714,602.00	
		メキシコペソ 小計	189,100	5,714,602.00	(34,287,612)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	364,844.70	
		トルコリラ 小計	135,630	364,844.70	(11,270,052)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	153,979	3,918,765.55	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,471,328.63	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	324,053	3,538,658.76	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	3,277,606.20	
	南アフリカランド 小計		524,053	13,206,359.14	(110,273,098)
投資証券合計		848,783	155,830,762	(155,830,762)	
合計			250,209,705	(250,209,705)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 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 37銘柄	100.0%			11.9%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.6%			3.1%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.1%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	97.2%			7.3%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.8%		0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%			1.3%
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%			0.3%
トルコリラ	株式	24銘柄	97.7%			1.1%
	投資証券	1銘柄			2.3%	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%			0.4%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%			1.3%
香港ドル	株式	135銘柄	100.0%			21.4%
マレーシアリングギット	株式	41銘柄	100.0%			2.2%
タイバーツ	株式	36銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式	22銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアルピア	株式	31銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%			15.2%
新台湾ドル	株式	89銘柄	100.0%			11.8%
インドルピー	株式	77銘柄	100.0%			8.6%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.5%
南アフリカランド	株式	49銘柄	96.3%			6.3%
	投資証券	4銘柄			3.7%	0.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.7%

(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10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	293,888,425
コール・ローン	106,893,734
国債証券	31,155,689,610
派生商品評価勘定	48,778
未収利息	480,813,482
前払費用	39,929,340
流動資産合計	32,077,263,369
資産合計	32,077,263,369

	平成29年10月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,883
未払解約金	97,684,335
未払利息	173
流動負債合計	97,733,391
負債合計	97,733,391
純資産の部	
元本等	
元本	18,343,816,588
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,635,713,390
元本等合計	31,979,529,978
純資産合計	31,979,529,978
負債純資産合計	32,077,263,369

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10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10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			18,343,816,588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)		1.7433円 (17,433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10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10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。	

	平成29年10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>(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> <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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	15,195,533,638円
期中追加設定元本額	3,907,917,040円
期中一部解約元本額	759,634,090円
期末元本額	18,343,816,588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	3,447,452,747円
世界経済インデックスファンド	4,523,428,286円
DC 新興国債券インデックス・オープン	3,315,272,420円
DC 世界経済インデックスファンド	3,262,822,955円

区分	平成29年10月20日現在
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,966,096,133円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	18,459,124円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	100,765,729円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,187,781,896円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	176,009,114円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,808,348円
新興国債券インデックス・オープン	14,514,309円
SMT インデックスバランス・オープン	218,586,423円
SMT 世界経済インデックス・オープン	364,050円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	5,652,842円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	11,578,356円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	223,856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10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	275,153,582
合計	275,153,582

(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10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	4,804,564	-	4,755,681	48,883
	アメリカドル	4,804,564	-	4,755,681	48,883
	売建	106,279,564	-	106,230,786	48,778
	アメリカドル	101,475,000	-	101,475,000	-
	ロシアルーブル	4,804,564	-	4,755,786	48,778
合計		111,084,128	-	110,986,467	105

（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	11,800,000.00	15,007,004.00		
		MBONO 10% 12/05/24	44,350,000.00	51,905,022.50		
		MBONO 5.75% 03/05/26	37,800,000.00	34,846,497.00		
		MBONO 5% 12/11/19	72,700,000.00	69,912,318.50		
		MBONO 6.5% 06/09/22	36,200,000.00	35,587,134.00		
		MBONO 6.5% 06/10/21	63,000,000.00	62,142,570.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	27,100,000.00	27,945,655.50		
		MBONO 7.75% 05/29/31	24,800,000.00	25,997,468.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	40,250,000.00	41,851,547.50		
		MBONO 7.75% 11/23/34	19,600,000.00	20,510,714.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	18,700,000.00	20,709,128.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	16,350,000.00	18,316,332.75		
		MBONO 8.5% 12/13/18	31,200,000.00	31,685,472.00		
		MBONO 8% 06/11/20	34,200,000.00	35,072,784.00		
		MBONO 8% 11/07/47	8,000,000.00	8,563,320.00		
		MBONO 8% 12/07/23	17,300,000.00	18,212,229.00		
		メキシコペソ 小計			503,350,000.00	518,265,196.75 (3,109,591,180)
		ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/19	4,850,000.00	4,467,339.85	
			BLTN 0% 01/01/20	17,850,000.00	15,039,196.20	
			BLTN 0% 04/01/19	8,650,000.00	7,809,981.20	
			BLTN 0% 07/01/19	4,500,000.00	3,976,407.00	
			BLTN 0% 07/01/20	11,800,000.00	9,480,438.60	
			BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000.00	6,959,606.06	
BNTNF 10% 01/01/21			14,800,000.00	15,324,034.70		
BNTNF 10% 01/01/23			11,100,000.00	11,438,525.02		
BNTNF 10% 01/01/25			6,850,000.00	7,042,791.51		
BNTNF 10% 01/01/27			7,450,000.00	7,626,883.48		
BRAZIL 10.25% 01/10/28			400,000.00	435,750.00		

	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	512,156.25
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,932,062.50
ブラジルリアル 小計		97,350,000.00	92,045,172.37 (3,273,126,329)
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	3,550,000,000.00	3,761,935,000.00
チリペソ 小計		3,550,000,000.00	3,761,935,000.00 (678,276,880)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000.00	12,250,376,250.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	22,500,000,000.00	24,007,500,000.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	19,500,000,000.00	24,556,350,000.00
コロンビアペソ 小計		54,950,000,000.00	60,814,226,250.00 (2,347,429,133)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,100,000.00	3,316,240.50
	PERUGB 6.15% 08/12/32	4,100,000.00	4,360,760.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	4,300,000.00	4,690,784.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,800,000.00	3,129,588.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	3,650,000.00	4,160,854.00
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,750,000.00	1,944,740.00
	PERUGB 8.2% 08/12/26	3,300,000.00	4,065,171.00
ペルーヌエボソル 小計		23,000,000.00	25,668,137.50 (894,791,273)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	10,500,000.00	10,612,875.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	12,000,000.00	12,779,040.00
ウルグアイペソ 小計		22,500,000.00	23,391,915.00 (89,123,196)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,547,600.00
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,650,374.00
	TURKGB 10.5% 01/15/20	3,150,000.00	3,072,636.00
	TURKGB 10.6% 02/11/26	8,950,000.00	8,709,200.25
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,500,000.00	6,348,420.00
	TURKGB 10.7% 08/17/22	3,150,000.00	3,072,021.75
	TURKGB 11% 02/24/27	1,800,000.00	1,789,479.00
	TURKGB 11% 03/02/22	6,050,000.00	5,969,262.75
	TURKGB 7.1% 03/08/23	4,950,000.00	4,143,026.25
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,516,128.00
	TURKGB 8.5% 07/10/19	5,450,000.00	5,170,796.50
	TURKGB 8.5% 09/14/22	2,450,000.00	2,203,444.25
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,050,000.00	4,532,349.75
	TURKGB 8.8% 11/14/18	4,150,000.00	4,020,582.25
	TURKGB 8% 03/12/25	6,450,000.00	5,453,926.50
	TURKGB 9.2% 09/22/21	3,000,000.00	2,785,605.00
	TURKGB 9.4% 07/08/20	4,900,000.00	4,639,099.50
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,811,870.00

	TURKGB 9% 07/24/24	5,000,000.00	4,510,925.00	
トルコリラ 小計		82,150,000.00	76,946,746.75	(2,376,885,007)
チェココルナ	CZGB 0.45% 10/25/23	14,500,000.00	14,130,902.50	
	CZGB 0.95% 05/15/30	16,100,000.00	14,716,044.00	
	CZGB 0% 02/10/20	1,850,000.00	1,839,593.75	
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	44,264,562.00	
	CZGB 1% 06/26/26	17,500,000.00	17,110,800.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	16,500,000.00	18,079,380.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	17,250,000.00	18,923,336.25	
	CZGB 3.75% 09/12/20	17,800,000.00	19,506,486.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	33,000,000.00	37,379,925.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	15,000,000.00	18,014,775.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	24,900,000.00	32,748,355.50	
チェココルナ 小計		217,500,000.00	236,714,160.00	(1,228,546,490)
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	155,000,000.00	159,283,425.00	
	HGB 1% 09/23/20	139,000,000.00	141,121,140.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	269,000,000.00	286,246,935.00	
	HGB 2% 10/30/19	173,000,000.00	179,868,965.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	302,000,000.00	327,617,150.00	
	HGB 3% 06/26/24	278,000,000.00	299,478,280.00	
	HGB 3% 10/27/27	180,000,000.00	187,701,300.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	397,000,000.00	491,773,825.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	98,000,000.00	104,208,300.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	332,000,000.00	420,300,380.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	210,000,000.00	232,651,650.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	286,743,930.00	
	HGB 7% 06/24/22	285,000,000.00	362,149,500.00	
ハンガリーフォリント 小計		3,055,000,000.00	3,479,144,780.00	(1,509,948,834)
ポーランドズロチ	POLGB 0% 04/25/19	4,850,000.00	4,740,729.50	
	POLGB 1.5% 04/25/20	6,150,000.00	6,086,716.50	
	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000.00	8,211,714.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,140,504.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	10,500,000.00	9,930,165.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,350,000.00	5,937,059.50	
	POLGB 2% 04/25/21	7,300,000.00	7,225,759.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000.00	8,585,428.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,900,000.00	6,967,516.50	
	POLGB 4% 10/25/23	6,450,000.00	6,855,092.25	
	POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000.00	5,073,173.25	

	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,943,942.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,333,687.75
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,000,000.00	2,251,860.00
ポーランドズロチ 小計		92,350,000.00	93,283,348.00 (2,943,089,629)
ロシアルーブル	RFLB 6.4% 05/27/20	62,000,000.00	60,929,260.00
	RFLB 6.7% 05/15/19	91,000,000.00	90,351,625.00
	RFLB 6.8% 12/11/19	46,200,000.00	45,882,144.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	92,000,000.00	89,811,780.00
	RFLB 7.1% 10/16/24	90,000,000.00	88,905,600.00
	RFLB 7.4% 12/07/22	104,400,000.00	105,204,924.00
	RFLB 7.5% 02/27/19	45,800,000.00	45,972,437.00
	RFLB 7.5% 08/18/21	100,400,000.00	101,399,482.00
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	65,192,341.50
	RFLB 7.6% 07/20/22	47,500,000.00	48,347,400.00
	RFLB 7.7% 03/23/33	78,000,000.00	78,564,720.00
	RFLB 7.75% 09/16/26	97,600,000.00	99,776,968.00
	RFLB 7% 01/25/23	42,700,000.00	42,311,003.00
	RFLB 7% 08/16/23	81,200,000.00	80,482,192.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	105,000,000.00	110,447,925.00
	RFLB 8.5% 09/17/31	78,100,000.00	84,873,613.00
	ロシアルーブル 小計		1,226,250,000.00
マレーシアリングット	MGS 3.418% 08/15/22	3,400,000.00	3,359,659.00
	MGS 3.48% 03/15/23	5,200,000.00	5,130,476.00
	MGS 3.492% 03/31/20	7,000,000.00	7,020,125.00
	MGS 3.62% 11/30/21	3,850,000.00	3,846,342.50
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,586,559.25
	MGS 3.659% 10/15/20	5,100,000.00	5,141,973.00
	MGS 3.759% 03/15/19	1,650,000.00	1,664,602.50
	MGS 3.8% 08/17/23	5,500,000.00	5,492,905.00
	MGS 3.899% 11/16/27	2,800,000.00	2,806,664.00
	MGS 3.9% 11/30/26	2,400,000.00	2,382,720.00
	MGS 3.955% 09/15/25	4,750,000.00	4,738,505.00
	MGS 4.048% 09/30/21	3,950,000.00	4,017,821.50
	MGS 4.059% 09/30/24	3,500,000.00	3,541,055.00
	MGS 4.16% 07/15/21	2,250,000.00	2,299,050.00
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,764,398.50
	MGS 4.232% 06/30/31	4,200,000.00	4,138,092.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,450,000.00	2,390,048.50
MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,163,700.75	
マレーシアリングット 小計		71,300,000.00	71,484,697.50 (1,909,356,270)

タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000.00	79,416,725.00
	THAIGB 2.125% 12/17/26	36,000,000.00	35,601,300.00
	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000.00	78,855,636.25
	THAIGB 2% 12/17/22	7,000,000.00	7,070,140.00
	THAIGB 3.4% 06/17/36	38,000,000.00	41,777,580.00
	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000.00	81,532,427.50
	THAIGB 3.65% 06/20/31	60,000,000.00	67,052,100.00
	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000.00	98,307,755.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	65,400,000.00	73,508,619.00
	THAIGB 3.875% 06/13/19	97,700,000.00	101,599,695.50
	THAIGB 4.875% 06/22/29	69,000,000.00	85,782,525.00
タイバーツ 小計		694,350,000.00	750,504,503.25 (2,551,715,311)
フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,952,550.00
	PHILIP 4.95% 01/15/21	10,000,000.00	10,306,150.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	22,565,700.00
フィリピンペソ 小計		40,000,000.00	42,824,400.00 (93,785,436)
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	8,056,093,500.00
	INDOGB 11% 09/15/25	6,700,000,000.00	8,447,326,500.00
	INDOGB 11% 11/15/20	12,500,000,000.00	14,196,812,500.00
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	8,265,128,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	14,500,000,000.00	13,964,007,500.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	6,500,000,000.00	6,122,740,000.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	25,007,785,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	4,000,000,000.00	4,141,080,000.00
	INDOGB 7.875% 04/15/19	16,700,000,000.00	17,221,958,500.00
	INDOGB 7% 05/15/22	17,000,000,000.00	17,524,620,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	22,200,000,000.00	22,809,612,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/36	16,700,000,000.00	18,224,877,000.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	18,084,870,000.00
	INDOGB 8.25% 07/15/21	26,200,000,000.00	27,965,749,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000.00	34,986,400,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/34	21,000,000,000.00	23,056,635,000.00
	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000.00	37,587,121,000.00
	INDOGB 8.75% 05/15/31	21,900,000,000.00	24,919,024,500.00
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,606,983,000.00
	INDOGB 9% 03/15/29	21,500,000,000.00	24,828,737,500.00
インドネシアルピア 小計		340,800,000,000.00	369,017,560,500.00 (3,099,747,508)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	48,000,000.00	53,091,600.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,300,000.00	11,505,844.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	20,434,845.50

	SAGB 6.75% 03/31/21	14,150,000.00	13,755,851.75	
	SAGB 7.25% 01/15/20	16,000,000.00	15,932,400.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	19,100,000.00	18,845,206.00	
	SAGB 7% 02/28/31	25,800,000.00	21,043,383.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	27,100,000.00	24,321,030.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000.00	27,687,510.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	21,200,000.00	18,867,788.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	27,200,000.00	24,277,224.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	16,800,000.00	15,575,196.00	
	SAGB 8% 01/31/30	22,300,000.00	20,086,613.50	
	SAGB 8% 12/21/18	9,450,000.00	9,537,318.00	
	SAGB 9% 01/31/40	20,850,000.00	19,158,960.75	
	南アフリカランド 小計	344,850,000.00	314,120,771.50	(2,622,908,442)
	合計		31,155,689,610	(31,155,689,610)

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%	10.0%
ブラジルリアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.5%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	2.9%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	7.6%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	3.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	4.8%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.4%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	7.8%
マレーシアリンギット	国債証券 18銘柄	100.0%	6.1%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.2%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	9.9%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	8.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成29年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,131,683,630
投資証券	73,432,034,600
派生商品評価勘定	2,229,000
未収入金	87,748,989
未収配当金	621,175,466
前払金	16,458,200
差入委託証拠金	26,527,000
流動資産合計	79,317,856,885
資産合計	79,317,856,885
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,687,200
未払金	3,632,660,356
未払解約金	105,682,184
未払利息	8,324
流動負債合計	3,757,038,064
負債合計	3,757,038,064
純資産の部	
元本等	
元本	50,701,765,432
剰余金	
剰余金又は欠損金()	24,859,053,389
元本等合計	75,560,818,821
純資産合計	75,560,818,821
負債純資産合計	79,317,856,885

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10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

平成29年10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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	50,701,765,432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 1.4903円 (1万口当たり純資産額) (14,903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10月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

平成29年10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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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10月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	42,888,740,983円
期中追加設定元本額	9,511,128,307円
期中一部解約元本額	1,698,103,858円
期末元本額	50,701,765,432円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,724,538,614円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,354,318円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,378,828,154円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	22,995,325,976円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,568,289,501円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,296,269,325円
分散投資コア戦略ファンドA	1,158,230,649円
分散投資コア戦略ファンドS	2,060,114,697円
コア投資戦略ファンド（切替型）	908,261,609円
J - R E I T インデックス・オープン	259,067,022円
S M T インデックスバランス・オープン	44,420,329円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	816,894,069円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	1,297,282円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	260,581円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,479,613,306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10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		4,121,026,092
合計		4,121,026,092

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(平成29年10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	不動産投信指数先物取引 買建	2,135,383,200	-	2,118,925,000	16,458,200
	合計	2,135,383,200	-	2,118,925,000	16,458,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,286	1,416,266,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,001	754,377,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,622	1,427,596,800	
	産業ファンド投資法人	2,686	1,251,676,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,155	2,430,652,500	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,243	665,946,700	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,274	1,908,341,000	
	G L P 投資法人	17,312	2,027,235,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,606	835,870,800	
	日本プロロジスリート投資法人	12,437	3,006,022,900	

星野リゾート・リート投資法人	1,230	685,110,000	
Oneリート投資法人	1,081	241,603,500	
イオンリート投資法人	9,390	1,098,630,000	
ヒューリックリート投資法人	6,341	1,016,462,300	
日本リート投資法人	2,657	852,897,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	5,479	591,184,100	
日本ヘルスケア投資法人	479	79,274,500	
積水ハウス・リート投資法人	6,203	810,732,100	
トーセイ・リート投資法人	1,242	135,999,000	
ケネディクス商業リート投資法人	3,596	810,538,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,218	118,633,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,717	149,894,100	
ジャパン・シニアリビング投資法人	544	76,268,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	28,368	4,031,092,800	
いちごホテルリート投資法人	1,563	181,933,200	
ラサールロジポート投資法人	7,460	809,410,000	
スターアジア不動産投資法人	2,053	214,949,100	
マリモ地方創生リート投資法人	552	57,573,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,599	524,472,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,258	112,842,600	
さくら総合リート投資法人	2,377	215,118,500	
投資法人みらい	1,258	220,275,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,142	303,307,200	
日本ビルファンド投資法人	9,576	5,285,952,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,346	5,018,802,000	
日本リートファンド投資法人	19,023	3,895,910,400	
オリックス不動産投資法人	19,078	3,012,416,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,243	2,347,368,000	
プレミア投資法人	8,931	922,572,300	
東急リアル・エステート投資法人	6,630	899,028,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,588	615,350,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,809	3,581,037,800	
森トラスト総合リート投資法人	7,067	1,156,867,900	
インヴィンシブル投資法人	27,119	1,263,745,400	
フロンティア不動産投資法人	3,364	1,502,026,000	
平和不動産リート投資法人	6,158	564,688,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,587	1,364,167,700	
福岡リート投資法人	4,799	766,880,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,890	1,794,690,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	7,497	841,163,400	
いちごオフィスリート投資法人	7,657	587,291,900	
大和証券オフィス投資法人	2,132	1,213,108,000	

阪急リート投資法人	4,052	537,295,200	
スタートプロシード投資法人	1,558	249,435,800	
大和ハウスリート投資法人	10,170	2,698,101,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	28,540	2,171,894,000	
日本賃貸住宅投資法人	11,122	881,974,600	
ジャパンエクセレント投資法人	8,855	1,198,081,500	
合計	399,220	73,432,034,600	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年10月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	365,662,954
コール・ローン	362,722,274
投資証券	62,310,044,530
未収入金	156,108
未収配当金	54,435,731
流動資産合計	63,093,021,597
資産合計	63,093,021,597
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	505,210
未払金	309,739,424
未払解約金	102,798,059
未払利息	588
流動負債合計	413,043,281
負債合計	413,043,281
純資産の部	
元本等	
元本	35,610,964,819
剰余金	
剰余金又は欠損金()	27,069,013,497
元本等合計	62,679,978,316
純資産合計	62,679,978,316
負債純資産合計	63,093,021,597

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10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,610,964,819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 1.7601円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,601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10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10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	36,626,389,338円
期中追加設定元本額	1,670,747,320円
期中一部解約元本額	2,686,171,839円
期末元本額	35,610,964,819円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	193,104,213円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,636,783,651円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,752,968円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	7,454,507,802円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	17,712,389,699円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,216,281,289円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,996,507,865円
分散投資コア戦略ファンドA	591,641,875円
分散投資コア戦略ファンドS	1,202,190,422円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,936,589円
グローバルREITインデックス・オープン	29,093,523円
SMT インデックスバランス・オープン	207,852,808円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	690,559,004円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	225,734円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	538,546,312円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	620,591,065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10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		3,426,153,164
合計		3,426,153,164

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(平成29年10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	258,529,160	-	258,024,400	504,760
	アメリカドル	248,534,000	-	248,050,000	484,000
	シンガポールドル	9,995,160	-	9,974,400	20,760
	売建	77,489,050	-	77,489,500	450
	アメリカドル	55,247,500	-	55,247,500	-
	イギリスポンド	22,241,550	-	22,242,000	450
合計		336,018,210	-	335,513,900	505,210

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	39,900	1,201,788.00	
		AGREE REALTY CORP	14,630	735,596.40	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,600	1,019,712.00	
		ALEXANDER'S INC	1,790	761,806.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,430	5,480,884.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	18,480	736,797.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	66,700	2,919,459.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	107,060	2,288,942.80	
		APARTMENT INVEST & MGMT	75,533	3,333,271.29	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	102,003	1,959,477.63	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	25,870	367,095.30	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	14,500	147,900.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	324,511.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,650	12,036,990.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	104,310.00	
		BOSTON PROPERTIES	74,580	9,220,325.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,018	1,413,764.10	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,330	2,770,804.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	44,610	4,129,547.70	
		CARETRUST REIT INC	38,680	743,816.40	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	739,008.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	179,878.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	18,110	400,049.90	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,960	857,155.60	
		CITY OFFICE REIT INC	13,300	178,220.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	83,512.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	268,195	3,352,437.50	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	57,860	1,237,046.80	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	7,200	199,224.00	
		CORECIVIC INC	58,220	1,513,137.80	
		CORESITE REALTY CORP	16,930	1,944,241.20	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	49,030	1,568,469.70	
COUSINS PROPERTIES INC	194,953	1,803,315.25			
CUBESMART	87,050	2,298,120.00			

CYRUSONE INC	44,450	2,752,344.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	43,687	2,564,863.77	
DDR CORPORATION	148,209	1,280,525.76	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,570	1,048,919.70	
DIGITAL REALTY TRUST INC	98,770	12,235,627.60	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	73,670	2,985,108.40	
DUKE REALTY CORP	168,680	4,871,478.40	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19,000	391,970.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	16,810	1,538,787.40	
EDUCATION REALTY TRUST INC	34,626	1,265,580.30	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	63,310	1,311,783.20	
EPR PROPERTIES	30,830	2,179,372.70	
EQUITY COMMONWEALTH	57,530	1,726,475.30	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,370	3,718,814.90	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,320	11,713,759.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	31,420	8,167,314.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,690	4,876,673.00	
FARMLAND PARTNERS INC	13,000	117,910.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,210	4,352,538.30	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	55,680	1,726,080.00	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	129,580	3,243,387.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	31,500	795,375.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	543,918.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	97,100	3,574,251.00	
GEO GROUP INC/THE	61,050	1,615,993.50	
GETTY REALTY CORP	17,300	513,464.00	
GGP INC	297,720	6,329,527.20	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	337,950.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	69,300.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	86,355.00	
GLOBAL NET LEASE INC	32,910	725,336.40	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	45,930	883,693.20	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	78,996	2,422,017.36	
HCP INC	227,450	5,995,582.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	58,510	1,898,649.50	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	94,370	2,805,620.10	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	342,541.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	48,310	2,527,579.20	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	76,853	2,249,487.31	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	351,850	6,977,185.50	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	72,820	2,455,490.40	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	40,000	419,400.00
INFRAREIT INC	19,000	434,530.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	391,645.70
INVITATION HOMES INC	39,100	889,134.00
IRON MOUNTAIN INC	128,432	5,260,574.72
ISTAR INC	35,000	421,050.00
JBG SMITH PROPERTIES	44,620	1,417,131.20
KILROY REALTY CORPORATION	47,600	3,441,480.00
KIMCO REALTY CORP	205,000	3,909,350.00
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	827,800.00
LASALLE HOTEL PROPERTIES	54,070	1,646,972.20
LEXINGTON CORP PROPERTIES	107,306	1,122,420.76
LIBERTY PROPERTY TRUST	69,310	2,863,196.10
LIFE STORAGE INC	21,660	1,773,737.40
LTC PROPERTIES INC	19,700	934,568.00
MACERICH CO/THE	52,940	3,023,932.80
MACK-CALI REALTY CORP	40,770	944,640.90
MANULIFE US REAL ESTATE INV	469,000	429,135.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	11,500	130,640.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	176,160	2,348,212.80
MID-AMERICA APARTMENT COMM	53,958	5,670,446.22
MONMOUTH REIT -CL A	33,500	566,485.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	73,010	3,065,689.90
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	20,000	498,000.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	20,480	1,592,320.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	365,600.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	241,800.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	411,458.04
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	92,556	2,971,973.16
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	200,480.00
PARAMOUNT GROUP INC	99,000	1,602,810.00
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	70,830	2,051,945.10
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	32,350	1,196,626.50
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	335,365.30
PHYSICIANS REALTY TRUST	86,040	1,533,232.80
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,362,727.50
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	14,000	282,380.00
PROLOGIS INC	256,410	16,551,265.50
PS BUSINESS PARKS INC	9,620	1,296,295.00
PUBLIC STORAGE	72,150	15,527,401.50
QTS REALTY TRUST INC	24,450	1,370,422.50
QUALITY CARE PROPERTIES	43,944	714,529.44
RAMCO-GERSHENSON PRYS	39,850	533,591.50

REALTY INCOME CORP	132,660	7,456,818.60	
REGENCY CENTERS CORP	71,380	4,595,444.40	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	53,940	1,028,096.40	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	106,650	1,384,317.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,790	982,716.30	
RLJ LODGING TRUST	84,201	1,899,574.56	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,000	1,632,000.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	81,790	1,739,673.30	
SAUL CENTERS INC	6,700	427,259.00	
SELECT INCOME REIT	30,920	757,230.80	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	114,730	2,245,266.10	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	12,000	514,800.00	
SIMON PROPERTY GROUP	149,690	24,776,688.80	
SL GREEN REALTY CORP	47,840	4,719,894.40	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	219,300	1,813,611.00	
STAG INDUSTRIAL INC	42,260	1,181,589.60	
STARWOOD WAYPOINT HOMES	60,920	2,233,936.40	
STORE CAPITAL CORP	78,070	2,001,714.80	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	53,900	877,492.00	
SUN COMMUNITIES INC	38,460	3,446,400.60	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	106,990	1,814,550.40	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	43,340	1,103,436.40	
TAUBMAN CENTERS INC	28,590	1,435,503.90	
TERRENO REALTY CORP	25,970	958,293.00	
TIER REIT INC	21,060	419,725.80	
UDR INC	126,870	4,887,032.40	
UMH PROPERTIES INC	14,000	218,400.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	451,562.10	
URBAN EDGE PROPERTIES	48,410	1,198,147.50	
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	371,910.00	
VENTAS INC	172,010	10,840,070.20	
VEREIT INC	473,450	3,839,679.50	
VORNADO REALTY TRUST	81,960	6,134,706.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	91,000	778,050.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	36,940	1,223,822.20	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	56,410	1,812,453.30	
WELLTOWER INC	178,060	12,140,130.80	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	36,160.00	
WHITESTONE REIT	16,110	221,512.50	
WP CAREY INC	50,450	3,503,248.00	

	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,580	1,077,990.20
	アメリカドル 小計	11,107,076	398,022,552.17 (44,885,003,208)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	76,608.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	22,610	927,236.10
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	481,406.20
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	446,066.50
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	32,850	1,139,238.00
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	17,660	822,779.40
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,100	335,336.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	45,000	629,550.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	294,329.82
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	208,050.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	44,000	488,400.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	125,034.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,790	394,777.90
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,740	492,454.40
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	67,620	1,459,239.60
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,000	148,500.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	241,740.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	122,531.70
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	198,268.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	11,403	266,602.14
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	21,390	243,204.30
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	70,000	456,400.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	77,820	1,915,928.40
	SLATE OFFICE REI	9,400	76,704.00
	SLATE RETAIL REIT	7,000	93,100.00
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	30,610	911,871.90
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	12,500	93,250.00
	カナダドル 小計	683,050	13,088,606.36 (1,181,770,268)
ユーロ	AEDIFICA	8,600	706,490.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	59,957	743,466.80
	ALTAREA	1,750	341,250.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	31,350	517,275.00
	BEFIMMO S.C.A.	11,560	610,483.60

	BENI STABILI SPA	547,000	387,823.00
	COFINIMMO	9,300	1,003,005.00
	EUROCOMMERCIAL	24,100	872,781.50
	FONCIERE DES REGIONS	25,620	2,202,039.00
	GECINA SA	21,800	2,938,640.00
	GREEN REIT PLC	337,170	514,184.25
	HAMBORNER REIT AG	40,000	366,360.00
	HIBERNIA REIT PLC	338,290	493,903.40
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	54,100	791,753.50
	ICADE	21,120	1,571,328.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	144,936.80
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,900	153,870.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	239,840.00
	KLEPIERRE	101,190	3,346,859.25
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	380,646.36
	MERCIALYS	28,020	472,417.20
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	155,780	1,707,348.80
	NSI NV	9,200	295,872.00
	RETAIL ESTATES	3,000	210,780.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	47,890	9,958,725.50
	VASTNED RETAIL	7,300	273,750.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,897	735,921.43
	WERELDHAVE NV	18,380	715,717.20
	ユーロ 小計	2,281,206	32,697,467.59 (4,368,054,695)
イギリスポ ンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	39,000	39,975.00
	ASSURA PLC	864,900	537,967.80
	BIG YELLOW GROUP PLC	70,290	559,859.85
	BRITISH LAND CO PLC	505,230	3,084,429.15
	CAPITAL & REGIONAL PLC	220,000	123,750.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	107,800.00
	DERWENT LONDON PLC	54,240	1,507,329.60
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	283,475.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	162,393	1,019,828.04
	HAMMERSON PLC	372,940	2,008,281.90
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	383,580	525,504.60
	INTU PROPERTIES PLC	428,960	951,862.24
	LAND SECURITIES GROUP PLC	356,340	3,520,639.20
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	343,070	608,263.11
	LXI REIT PLC	68,000	70,720.00
	NEWRIVER REIT PL	150,000	518,850.00
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	281,000	339,307.50	

	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	612,000	233,600.40	
	REGIONAL REIT LTD	130,000	134,875.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	97,990	445,854.50	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	150,000.00	
	SEGREO PLC	485,280	2,676,319.20	
	SHAFTESBURY PLC	108,100	1,089,648.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	627,830	912,864.82	
	UNITE GROUP PLC	119,000	853,230.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	54,920	503,616.40	
	イギリスポンド 小計	7,173,063	22,807,851.31 (3,382,176,270)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	159,010	623,319.20	
	ARENA REIT	114,000	255,360.00	
	BWP TRUST	247,960	753,798.40	
	CHARTER HALL GROUP	215,600	1,218,140.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	91,000	379,470.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	159,170	638,271.70	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	575,940	570,180.60	
	DEXUS	487,800	4,687,758.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	286,488.00	
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	255,455.84	
	GOODMAN GROUP	755,010	6,311,883.60	
	GPT GROUP	870,285	4,368,830.70	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	105,200	346,108.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	246,480.00	
	INDUSTRIA REIT	75,000	186,000.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	241,200.00	
	INVESTA OFFICE FUND	241,190	1,075,707.40	
	MIRVAC GROUP	1,810,410	4,218,255.30	
	NATIONAL STORAGE REIT	233,217	353,323.75	
	PROPERTYLINK GROUP	250,000	247,500.00	
	RURAL FUNDS GROUP	122,000	259,860.00	
	SCENTRE GROUP	2,534,560	10,239,622.40	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	342,000	796,860.00	
STOCKLAND	1,136,810	4,967,859.70		
VICINITY CENTERS	1,539,740	4,049,516.20		
VIVA ENERGY REIT	230,000	503,700.00		
WESTFIELD CORP	927,460	7,299,110.20		
	オーストラリアドル 小計	13,711,650	55,380,058.99 (4,915,534,035)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	431,600.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	450,000	600,750.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	136,680.00	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	690,000	921,150.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	593,400.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	285,360.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	147,460	326,623.90	
ニュージーランドドル 小計		2,438,460	3,295,563.90 (260,283,636)	
香港ドル	CHAMPION REIT	953,000	5,479,750.00	
	FORTUNE REIT	659,000	6,108,930.00	
	LINK REIT	1,056,000	68,164,800.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,965,440.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,324,410.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,745,670.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	600,000	2,958,000.00	
香港ドル 小計		4,774,000	88,747,000.00 (1,283,281,620)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	404,600.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	263,000	226,180.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,167,166	3,174,691.52	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	561,000	678,810.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	518,200	432,697.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,247,328	2,070,564.48	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,314,100	2,693,905.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	256,560	428,455.20	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	315,900	513,337.50	
	ESR REIT	521,000	296,970.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	272,300.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	258,000	353,460.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	643,422.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,000	336,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	558,200	627,975.00	
	KEPPEL DC REIT	369,460	495,076.40	
	KEPPEL REIT	845,300	997,454.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	419,760.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	866,130	1,342,501.50	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	893,000	1,062,670.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	585,760	1,112,944.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	995,452	1,219,428.70	
	QUE HOSPITALITY TRUST	590,000	477,900.00	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	554,400.00		

	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	229,699.20	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	221,628.00	
	SPH REIT	232,300	234,623.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	626,300	485,382.50	
	SUNTEC REIT	1,080,200	2,063,182.00	
	シンガポールドル 小計	17,218,896	24,070,017.00 (2,000,940,513)	
	イスラエルシェケル REIT 1 LTD	72,370	1,020,417.00	
	イスラエルシェケル 小計	72,370	1,020,417.00 (33,000,285)	
	合計	59,459,771	62,310,044,530 (62,310,044,530)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 159銘柄	100.0%	72.0%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	7.0%
イギリスポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	7.9%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1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REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年10月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,453,846
コール・ローン	716,342
投資証券	446,756,274
派生商品評価勘定	4,170
未収入金	6,546,944
流動資産合計	461,477,576
資産合計	461,477,576
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,850
未払解約金	1,267,356
未払利息	1
流動負債合計	1,273,207
負債合計	1,273,207
純資産の部	
元本等	
元本	535,791,062
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	75,586,693
元本等合計	460,204,369
純資産合計	460,204,369
負債純資産合計	461,477,576

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10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

平成29年10月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	535,791,062口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 75,586,693円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8589円 (1万口当たり純資産額) (8,589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10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10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。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 4月21日
期首元本額	551,024,507円
期中追加設定元本額	43,174,352円
期中一部解約元本額	58,407,797円
期末元本額	535,791,062円
期末元本額の内訳	
SMT インデックスバランス・オープン	222,984,231円
SMT 新興国REITインデックス・オープン	312,806,831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10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,412,300
合計	4,412,300

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

(平成29年10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	3,899,350	-	3,893,500	5,850
	メキシコペソ	3,899,350	-	3,893,500	5,850
	売建	5,492,370	-	5,488,200	4,170
	マレーシアリン ギット	1,069,520	-	1,068,000	1,520
	南アフリカランド	4,422,850	-	4,420,200	2,650
合計		9,391,720	-	9,381,700	1,680

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	40,800	484,704.00		
		CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	83,000	2,584,620.00		
		CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	69,800	928,340.00		
		FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOB	36,400	408,044.00		
		FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	289,700	8,754,734.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	84,600	1,890,810.00		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	82,800	2,559,348.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	35,800	1,343,216.00		
	メキシコペソ 小計			722,900	18,953,816.00 (113,722,896)	
	ユーロ	GRIVALIA PROPERTIES REIC	4,200	37,800.00		
	ユーロ 小計			4,200	37,800.00 (5,049,702)	
	トルコリラ	AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	14,210	43,908.90		
		EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	201,290	541,470.10		
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	48,493	65,950.48		

	TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	7,600	49,020.00	
	トルコリラ 小計	271,593	700,349.48 (21,633,795)	
ポーランド ズロチ	GRIFFIN PREMIUM RE NV	8,500	44,540.00	
	ポーランドズロチ 小計	8,500	44,540.00 (1,405,237)	
マレーシア リングgit	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	66,100	103,777.00	
	CAPITALAND MALAYSIA MALL TRU	62,700	90,915.00	
	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	131,800	218,788.00	
	KIP REIT MANAGEMENT SDN BHD	56,000	52,080.00	
	KLCCP STAPLED GROUP	36,900	290,403.00	
	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	66,300	112,710.00	
	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	125,500	215,860.00	
	マレーシアリングgit 小計	545,300	1,084,533.00 (28,967,876)	
タイパーツ	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	168,500	3,639,600.00	
	GLAND OFFICE LEASEHOLD REIT	33,000	376,200.00	
	GOLDEN VENTURES LEASEHOLD RE	70,000	1,029,000.00	
	HEMRAJ LEASEHOLD REIT	50,800	419,100.00	
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	74,700	1,068,210.00	
	SAMUI AIRPORT PROPERTY FUND	57,800	1,392,980.00	
	TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	182,700	3,233,790.00	
	TICON PROPERTY FUND	66,000	745,800.00	
	タイパーツ 小計	703,500	11,904,680.00 (40,475,912)	
新台湾ドル	SHIN KONG NO 1 REIT	108,000	1,547,640.00	
	新台湾ドル 小計	108,000	1,547,640.00 (5,772,697)	
南アフリカ ランド	ARROWHEAD PROPERTIES LTD	105,000	875,700.00	
	DELTA PROPERTY FUND LTD	58,437	427,174.47	
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	55,170	735,967.80	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	278,090	7,077,390.50	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	25,260	2,723,280.60	
	OCTODEC INVESTMENTS LTD	18,208	424,428.48	
	REBOSIS PROPERTY FUND LTD	67,984	747,144.16	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	543,480	5,934,801.60	
	RESILIENT REIT LTD	39,810	5,649,039.00	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	266,110	1,325,227.80	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	79,610	1,592,200.00	
	南アフリカランド 小計	1,537,159	27,512,354.41 (229,728,159)	

合計	3,901,152	446,756,274 (446,756,274)	
----	-----------	------------------------------	--

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	投資証券 8銘柄	100.0%	25.5%
ユーロ	投資証券 1銘柄	100.0%	1.1%
トルコリラ	投資証券 4銘柄	100.0%	4.8%
ポーランドズロチ	投資証券 1銘柄	100.0%	0.3%
マレーシアリングット	投資証券 7銘柄	100.0%	6.5%
タイバーツ	投資証券 8銘柄	100.0%	9.1%
新台湾ドル	投資証券 1銘柄	100.0%	1.3%
南アフリカランド	投資証券 11銘柄	100.0%	51.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【SMT インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

（平成29年11月30日現在）

資産総額	3,249,937,370円
負債総額	10,588,694円
純資産総額（ - ）	3,239,348,676円
発行済口数	3,115,222,804口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0398円
（1万口当たり純資産額）	（10,398円）

（参考）

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11月30日現在）

資産総額	188,463,070,603円
負債総額	1,599,743,462円
純資産総額（ - ）	186,863,327,141円
発行済口数	117,383,025,318口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5919円
（1万口当たり純資産額）	（15,919円）

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11月30日現在）

資産総額	346,266,672,999円
負債総額	7,381,446,298円
純資産総額（ - ）	338,885,226,701円
発行済口数	244,614,850,813口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3854円
（1万口当たり純資産額）	（13,854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11月30日現在）

資産総額	328,239,290,254円
負債総額	220,837,186円
純資産総額（ - ）	328,018,453,068円
発行済口数	134,941,109,754口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4308円
（1万口当たり純資産額）	（24,308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11月30日現在）

資産総額	255,451,914,030円
負債総額	158,169,416円
純資産総額（ - ）	255,293,744,614円
発行済口数	91,939,185,035口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7768円
（1万口当たり純資産額）	（27,768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11月30日現在）

資産総額	48,539,253,651円
負債総額	574,907,170円
純資産総額（ - ）	47,964,346,481円
発行済口数	15,918,424,502口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0131円
（1万口当たり純資産額）	（30,131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11月30日現在）

資産総額	31,825,048,833円
負債総額	1,652,213円
純資産総額（ - ）	31,823,396,620円
発行済口数	18,573,612,592口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7134円
（1万口当たり純資産額）	（17,134円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	86,359,853,597円
負債総額	208,001,448円
純資産総額（ - ）	86,151,852,149円
発行済口数	56,645,330,864口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5209円
（1万口当たり純資産額）	（15,209円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	61,888,323,784円
負債総額	69,552,521円
純資産総額（ - ）	61,818,771,263円
発行済口数	35,080,669,677口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7622円
（1万口当たり純資産額）	（17,622円）

新興国R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	458,004,042円
負債総額	1,433,545円
純資産総額（ - ）	456,570,497円

発行済口数	549,574,656口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8308円
（1万口当たり純資産額）	（8,308円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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11月30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、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成30年 1月19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11月30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	494	9,669,496
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	69	244,603
単位型公社債投資信託	0	0
合計	563	9,914,099

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

す。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第32期事業年度の間接会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の間接財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日
至 平成28年3月31日）

（自 平成28年4月 1日
至 平成29年3月31日）

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

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

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

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

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

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

区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

第32期中間会計期間末
（平成29年9月30日）

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		74,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		20,972,132
利益剰余金合計		23,146,632
株主資本合計		23,796,632
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		384
評価・換算差額等合計		384
純資産合計		23,797,016
負債・純資産合計		28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

第32期中間会計期間
（自 平成29年4月1日
至 平成29年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000

当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,978,187	1,978,187	1,978,187
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

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

重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p>

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目	
受取利息	1,314千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金、並びに(5)未払法人税等

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（３）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

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

（関連情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,564,703千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

府令で定めるものを除きます。)。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 1月19日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成29年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
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。

株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
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。
フィデリティ証券株式会社	8,157	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。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
藍澤証券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
GMOクリック証券株式会社	4,346	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。
岡三オンライン証券株式会社	1,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成29年3月末日現在）

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

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

第3【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29年 7月20日	有価証券届出書
平成29年 7月20日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年12月20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

松崎雅則

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SMT インデックスバランス・オープンの平成29年4月21日から平成29年10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、SMT インデックスバランス・オープンの平成29年10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

- 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。
- XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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