

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年3月11日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）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「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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。

（６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2019年 3月12日から2019年 9月10日までとします。

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

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第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並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。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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



DR(預託証券)とは

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

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(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) 日本	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	北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージ ング				

(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]

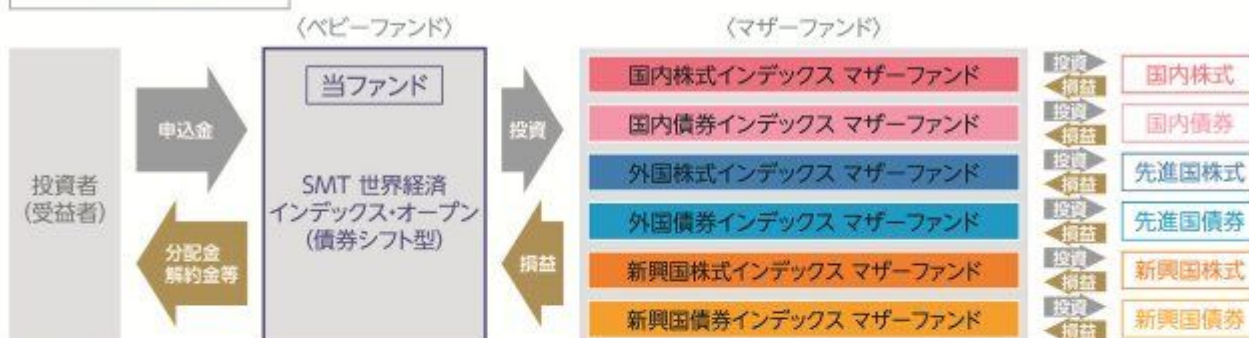
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、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 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 世界の株式及び債券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



? 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。

特色2 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率に基づき決定します。
※年1回地域別構成比の見直しを行います。

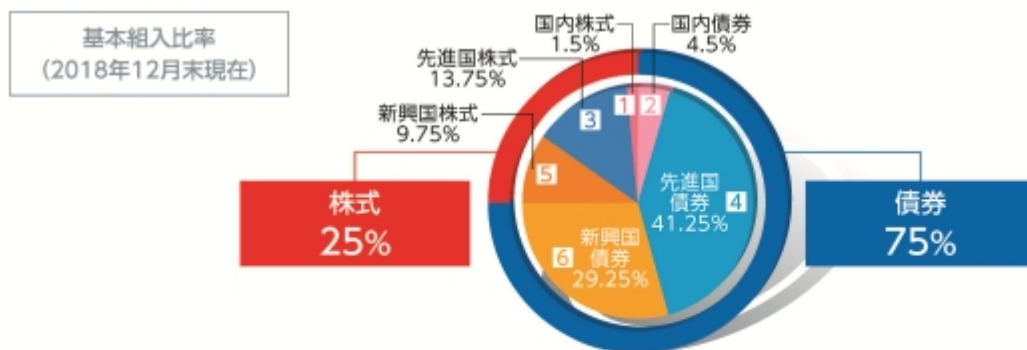


(出所) IMF「世界経済見通し2018年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※ 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。

※ GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※ 上記のファンドの地域別構成比は、2018年12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。



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- 基本組入比率は年1回見直しを行います。

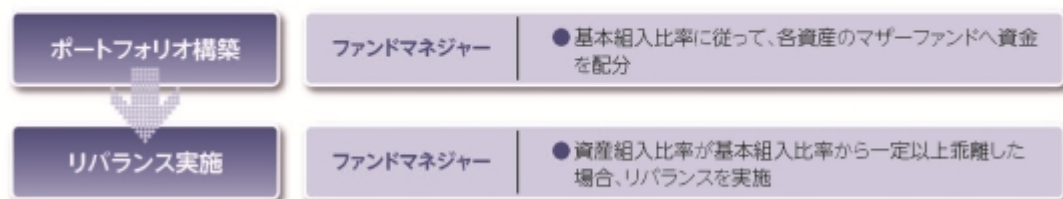
資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数)※ ¹
2 国内債券	NOMURA-BPI総合※ ²
3 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)※ ³
4 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)※ ⁴
5 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)※ ⁵
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)※ ⁶

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

- ※¹ 「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。
- ※² 「NOMURA-BPI総合」とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。
- ※³ 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※⁴ 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※⁵ 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※⁶ 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド」とは、新興国の現地通貨債権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。

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

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

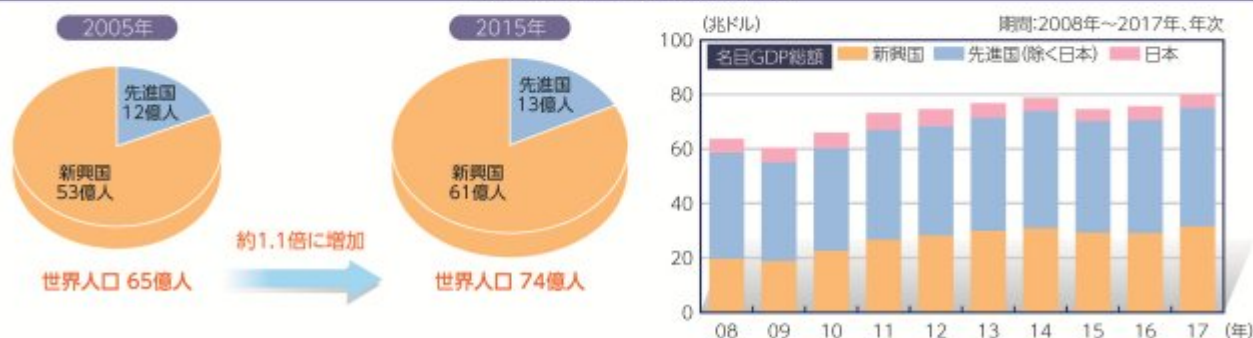
主な投資制限

- 株式、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35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

〈ご参考情報〉

世界人口・名目GDP総額の推移



(出所) 国連「World Population Prospects(The 2017 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2018年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

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

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

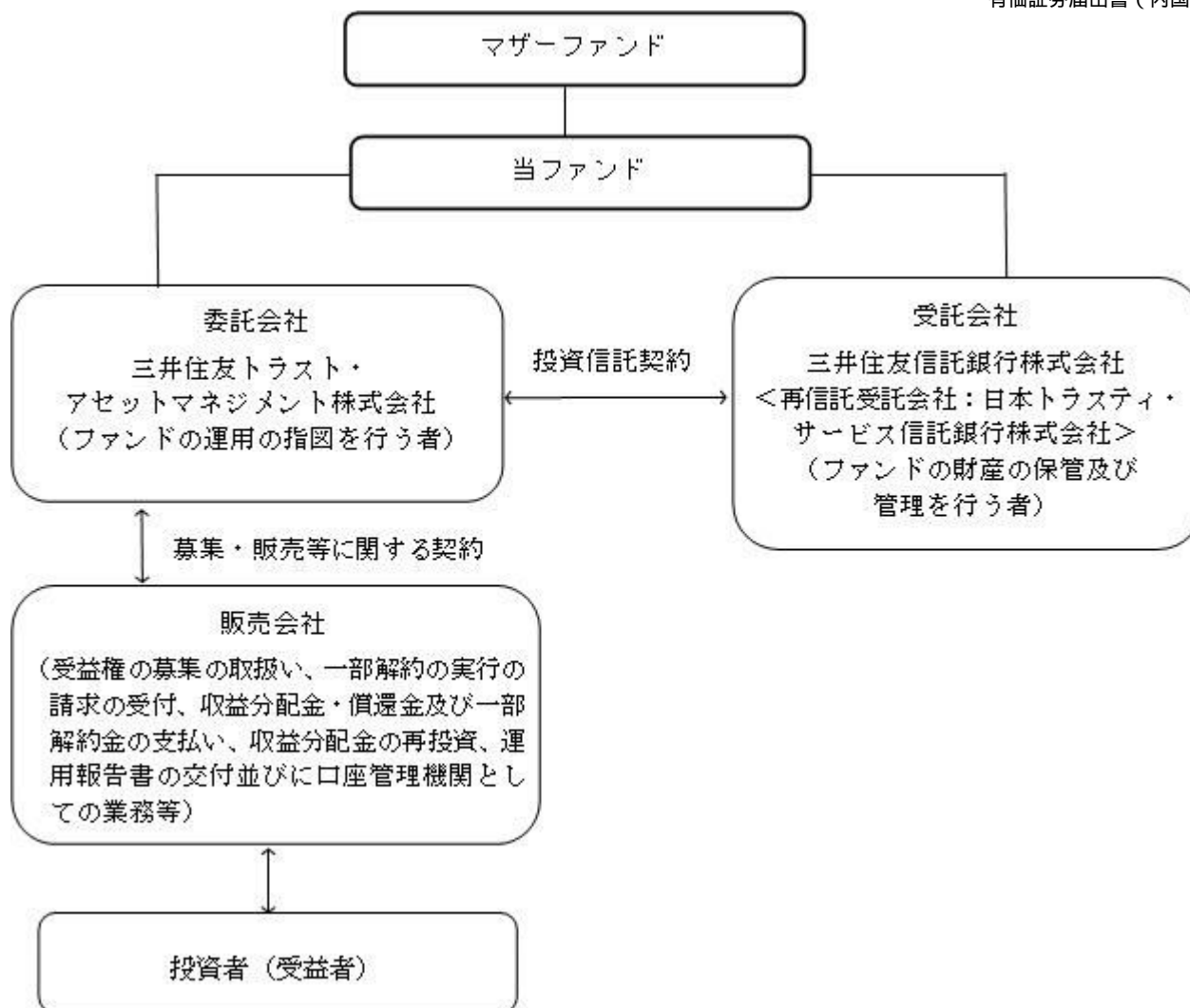
(2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25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（2018年12月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

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

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．株式と債券の基本資産配分比率は、株式25%、債券75%とします。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。
- ホ．各マザーファンドは、インデック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。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	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）

- ヘ．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。
- ト．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す。）
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」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」の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す。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で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、並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並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

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

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。

「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、並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並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並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並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。投資信託財産に属する資産の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、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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、並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並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

投資信託財産に属する資産の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並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「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、FTSE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

FTSE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、並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並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

投資信託財産に属する資産の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並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「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、並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並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデッ

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並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並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

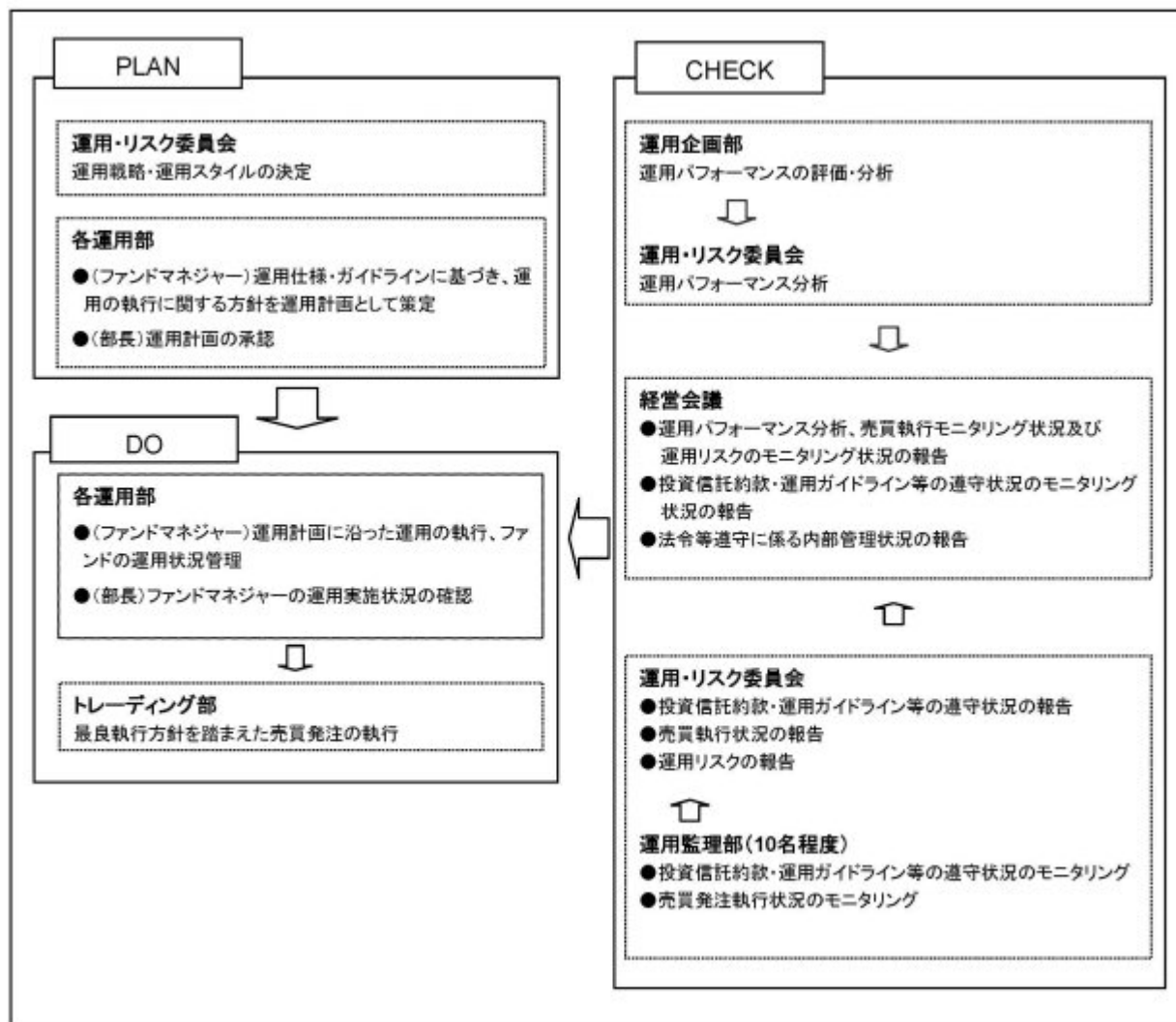
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

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35%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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

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（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みます。）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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象

資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の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します。

（ニ）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します。

（ニ）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、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)において投資信託財産に属するとみなした額とは、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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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。

（ハ）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。

（ニ）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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

※当ファンドについては2018年8月～2018年12月の5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年1月～2018年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

※各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{*3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)^{*6}

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

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

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 2 ）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1944% （税抜 0.18%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.2376% （税抜 0.22%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（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）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び
譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離
課税を選択したものに限り、）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）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」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。つみたてNISA
は一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象で
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。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできませ
ん。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。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）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

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、2018年12月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2018年12月28日現在の状況について記載してあります。

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	679,825,182	98.98
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		6,973,643	1.02
合計（純資産総額）		686,798,825	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	108,211,216	2.6836	290,395,714	2.7092	293,165,826	42.69
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	125,129,062	1.6315	204,156,976	1.6153	202,120,973	29.43
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	40,513,168	2.4949	101,076,471	2.2326	90,449,698	13.17
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	23,577,803	2.9008	68,394,522	2.5568	60,283,726	8.78
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	18,423,625	1.3904	25,617,650	1.3992	25,778,336	3.75
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	5,908,446	1.5786	9,327,613	1.3585	8,026,623	1.17

(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。

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.98
合計	98.98

(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 (2018年 6月11日)	545,359,273	545,359,273	10,037	10,037
2017年12月末日	367,093,369		10,527	
2018年 1月末日	402,848,727		10,481	
2月末日	415,687,565		10,216	
3月末日	477,598,551		10,128	
4月末日	486,134,179		10,234	
5月末日	493,887,756		9,950	
6月末日	605,657,576		9,923	
7月末日	684,962,627		10,139	
8月末日	685,946,324		9,952	
9月末日	724,381,374		10,213	
10月末日	687,003,688		9,830	
11月末日	732,192,177		10,041	
12月末日	686,798,825		9,729	

【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	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0.4
第2期中間計算期間	2018年 6月12日～2018年12月11日	1.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	755,925,234	212,584,152	543,341,082
第2期中間計算期間	2018年 6月12日～2018年12月11日	294,868,405	102,316,413	735,893,074

(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	232,893,406,680	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,554,235,807	1.08
合計(純資産総額)		235,447,642,487	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	2,658,430,000	1.13

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,228,300	6,897.69	8,472,438,360	6,406.00	7,868,489,800	3.34
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,571,000	670.69	5,077,818,429	537.90	4,072,440,900	1.73
日本	株式	ソニー	電気機器	739,100	5,358.66	3,960,590,978	5,326.00	3,936,446,600	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	739,800	5,043.46	3,731,153,852	4,482.00	3,315,783,600	1.41
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	452,000	8,006.36	3,618,876,635	7,305.00	3,301,860,000	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	54,100	63,968.18	3,460,678,642	55,680.00	3,012,288,000	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	766,200	4,455.18	3,413,565,869	3,645.00	2,792,799,000	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	929,800	3,417.04	3,177,165,022	2,894.50	2,691,306,100	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,772,000	191.51	2,828,986,008	170.30	2,515,671,600	1.07
日本	株式	KDDI	情報・通信業	953,200	2,910.33	2,774,129,834	2,624.00	2,501,196,800	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	761,800	3,065.27	2,335,126,993	3,020.00	2,300,636,000	0.98
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	98,700	22,464.45	2,217,241,252	23,165.00	2,286,385,500	0.97
日本	株式	花王	化学	267,600	8,336.32	2,230,800,905	8,154.00	2,182,010,400	0.93
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	455,000	4,858.97	2,210,835,670	4,783.00	2,176,265,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	394,100	5,282.47	2,081,822,825	5,236.00	2,063,507,600	0.88
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	754,500	3,000.98	2,264,240,244	2,662.50	2,008,856,250	0.85
日本	株式	任天堂	その他製品	67,900	40,364.17	2,740,727,156	29,285.00	1,988,451,500	0.84
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	776,700	2,794.63	2,170,589,817	2,472.50	1,920,390,750	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	196,000	10,514.89	2,060,918,706	9,711.00	1,903,356,000	0.81
日本	株式	キヤノン	電気機器	593,400	3,643.83	2,162,249,117	3,001.00	1,780,793,400	0.76
日本	株式	ダイキン工業	機械	150,500	12,734.06	1,916,477,398	11,695.00	1,760,097,500	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	104,800	22,479.68	2,355,871,314	16,670.00	1,747,016,000	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	115,700	16,274.16	1,882,921,124	14,955.00	1,730,293,500	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	638,800	2,919.27	1,864,831,927	2,616.50	1,671,420,200	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	132,700	16,400.82	2,176,389,284	12,475.00	1,655,432,500	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	190,200	10,578.74	2,012,076,704	8,536.00	1,623,547,200	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	435,100	4,435.12	1,929,724,280	3,705.00	1,612,045,500	0.68
日本	株式	三井物産	卸売業	894,400	1,878.46	1,680,096,324	1,690.50	1,511,983,200	0.64
日本	株式	資生堂	化学	219,000	8,049.62	1,762,868,812	6,892.00	1,509,348,000	0.64
日本	株式	HOYA	精密機器	221,900	6,409.40	1,422,247,353	6,615.00	1,467,868,500	0.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	3.07
		食料品	4.49
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.41
		医薬品	4.85
		石油・石炭製品	0.70
		ゴム製品	0.82
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	0.99
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.77
		電気機器	12.55
		輸送用機器	8.22
		精密機器	1.88
		その他製品	2.06
		電気・ガス業	2.01
		陸運業	4.89
		海運業	0.17
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.42
		卸売業	5.05
		小売業	5.21
		銀行業	6.44
		証券、商品先物取引業	0.87
		保険業	2.33
		その他金融業	1.16
		不動産業	2.39
		サービス業	4.75
	小計	98.92	
合計		98.92	

(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	178	円	2,743,658,560	2,658,430,000	1.13

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

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

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	355,101,316,850	82.98
地方債証券	日本	23,985,266,253	5.60
特殊債券	日本	30,158,758,577	7.05
社債券	日本	15,691,472,090	3.67
	フランス	1,099,359,000	0.26
	オーストラリア	501,289,000	0.12
	オランダ	200,670,000	0.05
	アメリカ	106,255,000	0.02
	イギリス	100,291,000	0.02
	スウェーデン	100,236,000	0.02
	小計	17,799,572,090	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		912,959,207	0.21
合計(純資産総額)		427,957,872,977	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
--------	----	-----	----	------------	------------	-----------	-----------	--------	------	----------

日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	100.86	5,951,004,000	101.16	5,968,853,000	0.100	2023/6/20	1.39
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,790,000,000	101.04	5,850,216,000	101.10	5,853,690,000	0.100	2023/3/20	1.37
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.84	5,586,591,400	100.83	5,586,369,800	0.100	2022/3/20	1.31
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.65	4,811,342,700	100.55	4,806,433,400	0.100	2021/3/20	1.12
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.97	4,785,978,000	0.100	2022/9/20	1.12
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.82	4,744,950,100	103.41	4,726,156,900	1.000	2021/12/20	1.10
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	4,220,000,000	103.49	4,367,486,200	103.74	4,377,954,600	0.500	2024/9/20	1.02
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	4,320,000,000	100.38	4,336,726,900	100.38	4,336,718,400	0.100	2020/7/1	1.01
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,930,000,000	102.62	4,033,313,500	103.12	4,052,930,400	0.300	2025/12/20	0.95
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	100.87	4,035,056,800	100.90	4,036,120,000	0.100	2022/6/20	0.94
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	103.24	4,016,200,500	103.58	4,029,495,400	0.400	2025/6/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,870,000,000	103.30	3,997,835,300	103.69	4,012,880,400	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	100.66	3,966,004,000	101.29	3,990,944,200	0.100	2028/3/20	0.93
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	102.63	3,910,279,200	1.200	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.42	3,625,450,800	0.100	2020/9/20	0.85
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.74	3,558,522,100	0.600	2023/12/20	0.83
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	3,510,000,000	100.23	3,518,239,300	101.02	3,545,802,000	0.100	2028/9/20	0.83
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	102.23	3,455,374,000	102.70	3,471,429,000	0.300	2024/12/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	101.44	3,256,256,100	0.100	2027/12/20	0.76
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	104.07	3,267,871,600	103.31	3,244,153,800	1.200	2021/6/20	0.76
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	100.76	3,224,448,000	100.68	3,221,760,000	0.100	2021/9/20	0.75
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	101.77	3,205,755,000	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	101.03	3,202,809,500	0.100	2022/12/20	0.75
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	3,070,000,000	103.97	3,192,125,900	103.70	3,183,712,800	1.000	2022/3/20	0.74
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.29	3,149,263,000	0.100	2020/3/20	0.74
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	117.98	2,996,934,100	118.25	3,003,575,400	1.500	2034/6/20	0.70
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.49	2,974,533,600	0.100	2020/12/20	0.70
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	2,920,000,000	100.88	2,945,696,000	101.65	2,968,296,800	0.100	2027/3/20	0.69
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	101.05	2,940,793,600	101.78	2,961,885,300	0.100	2026/3/20	0.69
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	104.12	2,905,115,400	0.600	2024/6/20	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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	82.98
地方債証券	5.60
特殊債券	7.05
社債券	4.16
合計	99.79

(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。

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	188,240,042,310	60.49
	イギリス	18,696,499,812	6.01
	フランス	11,274,929,376	3.62
	カナダ	10,964,274,375	3.52
	スイス	10,652,621,857	3.42
	ドイツ	9,938,125,197	3.19
	オーストラリア	7,075,106,018	2.27
	オランダ	5,254,110,374	1.69
	アイルランド	5,087,722,223	1.63
	スペイン	3,545,959,689	1.14
	香港	2,895,978,252	0.93
	スウェーデン	2,737,840,656	0.88
	イタリア	2,176,316,973	0.70
	デンマーク	1,981,983,729	0.64
	シンガポール	1,436,657,899	0.46
	フィンランド	1,424,342,727	0.46
	バミューダ	1,261,658,793	0.41
	ベルギー	1,075,425,087	0.35

	ジャージー	832,096,177	0.27
	ケイマン	818,426,546	0.26
	ノルウェー	818,050,026	0.26
	イスラエル	628,553,290	0.20
	キュラソー	465,546,970	0.15
	ルクセンブルク	412,685,337	0.13
	ニュージーランド	275,740,161	0.09
	オーストリア	274,876,137	0.09
	パナマ	187,658,196	0.06
	ポルトガル	165,918,118	0.05
	リベリア	146,047,429	0.05
	パプアニューギニア	65,932,720	0.02
	英ヴァージン諸島	48,538,623	0.02
	マン島	40,443,701	0.01
	モーリシャス	7,975,665	0.00
	小計	290,908,084,443	93.48
投資信託受益証券	オーストラリア	150,521,047	0.05
	香港	67,737,363	0.02
	小計	218,258,410	0.07
投資証券	アメリカ	6,059,150,275	1.95
	オーストラリア	552,418,178	0.18
	フランス	371,483,083	0.12
	イギリス	218,955,197	0.07
	香港	200,824,959	0.06
	シンガポール	137,842,803	0.04
	カナダ	59,837,090	0.02
	小計	7,600,511,585	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,475,442,901	4.01
合計(純資産総額)		311,202,297,339	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	8,654,184,375	2.78
	買建	カナダ	498,374,150	0.16
	買建	ドイツ	2,223,720,519	0.71
	買建	イギリス	990,504,255	0.32
	買建	オーストラリア	510,106,909	0.16

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		2,171,991,270	0.70

(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	402,424	20,936.82	8,425,478,852	17,332.65	6,975,074,344	2.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	607,015	10,947.01	6,645,002,480	11,230.98	6,817,373,325	2.19
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	34,551	178,920.11	6,181,868,803	162,242.03	5,605,624,724	1.80
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	224,187	13,558.59	3,039,661,844	14,142.50	3,170,566,889	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,270	119,416.89	3,137,081,724	115,870.68	3,043,922,764	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	280,308	12,282.15	3,442,784,903	10,771.44	3,019,320,804	0.97
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	201,196	20,366.84	4,097,727,913	14,931.71	3,004,202,337	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	24,939	120,356.71	3,001,576,199	116,871.89	2,914,668,314	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	353,203	8,740.20	3,087,068,249	7,652.33	2,702,829,445	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	108,290	21,664.14	2,346,010,508	22,213.32	2,405,480,423	0.77
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	490,285	3,977.93	1,950,321,084	4,756.35	2,331,967,060	0.75
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	257,152	8,657.34	2,226,253,838	8,812.66	2,266,194,430	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	80,495	27,259.30	2,194,238,018	27,302.67	2,197,728,422	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	147,681	14,585.29	2,153,970,464	14,653.11	2,163,985,938	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	791,962	3,344.42	2,648,661,471	2,705.06	2,142,312,647	0.69

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	207,952	8,302.04	1,726,425,977	10,214.21	2,124,067,477	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	344,914	5,421.59	1,869,984,728	6,121.64	2,111,442,788	0.68
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	385,464	6,139.61	2,366,600,682	5,145.95	1,983,582,325	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	160,008	13,550.69	2,168,220,402	12,134.51	1,941,620,276	0.62
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	382,781	6,090.16	2,331,197,977	5,053.82	1,934,510,101	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	606,409	3,529.05	2,140,050,969	3,124.65	1,894,815,882	0.61
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	223,104	6,596.14	1,471,625,579	8,367.18	1,866,751,327	0.60
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	390,187	4,801.86	1,873,623,348	4,763.01	1,858,464,583	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,435	20,730.41	1,978,407,549	18,905.51	1,804,248,301	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	337,491	4,730.27	1,596,426,488	5,275.83	1,780,545,143	0.57
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	180,510	8,524.53	1,538,763,245	9,208.84	1,662,287,889	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,796	39,944.96	1,829,319,628	35,202.54	1,612,135,522	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,741	21,242.16	1,630,144,971	20,944.58	1,607,308,781	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,377	24,546.96	1,432,978,363	26,528.03	1,548,627,099	0.50
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,677,565	1,026.47	1,721,977,284	896.13	1,503,324,376	0.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.17
		素材	4.31
		資本財	6.57
		商業・専門サービス	1.09
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.17
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.83
		メディア・娯楽	5.57
		小売	4.45
		食品・生活必需品小売り	1.52

	食品・飲料・タバコ	4.73
	家庭用品・パーソナル用品	2.06
	ヘルスケア機器・サービス	4.71
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.47
	銀行	8.04
	各種金融	4.11
	保険	3.69
	不動産	0.62
	ソフトウェア・サービス	8.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93
	電気通信サービス	2.51
	公益事業	3.40
	半導体・半導体製造装置	2.77
	小計	93.48
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.44
合計		95.99

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	625	アメリカドル	79,093,722.5	8,779,403,198	77,965,625	8,654,184,375	2.78
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	36	カナダドル	6,150,296	501,372,130	6,113,520	498,374,150	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	61	スイスフラン	5,122,247	576,508,900	4,915,380	553,226,019	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	450	ユーロ	13,564,405	1,722,679,435	13,153,500	1,670,494,500	0.54
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	47	オーストラリアドル	6,471,404	505,934,364	6,524,775	510,106,909	0.16
	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	108	イギリスポンド	7,172,870	1,007,501,320	7,051,860	990,504,255	0.32

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	13,715,000.00	1,522,334,050	1,521,310,150	0.49
	カナダドル	買建	875,000.00	71,445,750	71,292,000	0.02
	ユーロ	買建	1,804,000.00	228,193,112	229,089,960	0.07
	イギリスポンド	買建	947,700.00	133,204,590	133,070,540	0.04
	スイスフラン	買建	689,000.00	77,210,962	77,548,950	0.02
	スウェーデンクローナ	買建	2,304,000.00	28,187,136	28,385,280	0.01
	ノルウェークローネ	買建	402,000.00	5,102,184	5,085,300	0.00
	デンマーククローネ	買建	1,115,000.00	18,852,420	18,966,150	0.01
	オーストラリアドル	買建	834,000.00	65,439,112	65,158,820	0.02
	香港ドル	買建	256,000.00	3,630,848	3,627,520	0.00
	シンガポールドル	買建	228,000.00	18,461,160	18,456,600	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	113,502,543,288	45.30
	フランス	24,809,786,636	9.90
	イタリア	22,126,313,576	8.83
	ドイツ	16,992,871,207	6.78
	イギリス	16,205,005,947	6.47
	スペイン	14,301,584,201	5.71
	ベルギー	6,000,169,798	2.39
	オランダ	5,166,072,597	2.06
	オーストラリア	5,100,117,714	2.04
	カナダ	4,856,861,297	1.94
	オーストリア	3,608,102,771	1.44
	メキシコ	2,010,418,839	0.80
	アイルランド	1,890,552,472	0.75
	フィンランド	1,567,438,239	0.63
	ポーランド	1,552,619,844	0.62
	南アフリカ	1,384,443,477	0.55
	デンマーク	1,352,537,863	0.54
	マレーシア	1,103,256,376	0.44

	シンガポール	981,264,176	0.39
	スウェーデン	955,671,850	0.38
	ノルウェー	567,803,763	0.23
	小計	246,035,435,931	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,521,001,856	1.80
合計(純資産総額)		250,556,437,787	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	613,529,959	0.24
	買建	ドイツ	701,635,630	0.28

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,812,112,994	0.72
	売建		1,964,060,674	0.78

(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 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,578.42	1,851,225,110	10,706.08	1,873,564,734	1.750	2023/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,882.46	1,630,607,490	9,927.78	1,638,084,387	2.500	2046/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,703.65	1,568,086,102	10,808.89	1,583,502,915	1.875	2022/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,453.02	1,531,368,674	10,640.24	1,558,795,338	2.250	2027/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,070.03	1,544,269,185	11,081.56	1,545,878,225	2.500	2020/5/31	0.62
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	13,687.23	1,505,595,795	13,387.45	1,472,619,610	3.500	2020/4/25	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,799.41	1,349,926,722	10,935.14	1,366,892,974	2.375	2024/8/15	0.55

アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,946.76	1,312,973,221	10,163.37	1,341,565,032	1.500	2026/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,455.80	1,286,064,186	10,632.24	1,307,765,752	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,583.59	1,270,031,554	10,733.29	1,287,995,715	2.125	2025/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/20	11,500,000	11,023.12	1,267,659,944	11,048.32	1,270,557,918	2.250	2020/3/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,401.06	1,265,518,272	11,343.21	1,259,097,331	3.625	2021/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	11,047.16	1,215,188,040	11,148.95	1,226,384,512	2.750	2021/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,117.77	1,222,955,590	11,107.35	1,221,809,010	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,704.18	1,198,869,079	10,808.43	1,210,544,455	1.750	2022/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 06/30/25	10,500,000	10,890.43	1,143,495,360	11,138.25	1,169,516,406	2.750	2025/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,664.40	1,162,420,547	10,714.84	1,167,918,394	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	10,988.75	1,142,830,848	11,071.29	1,151,414,282	2.750	2028/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	10,000,000	11,156.98	1,115,698,885	11,315.61	1,131,561,928	3.000	2025/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/47	10,850,000	10,470.47	1,136,046,848	10,408.29	1,129,299,629	2.750	2047/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,576.48	1,110,530,685	10,731.45	1,126,802,964	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,697.53	1,085,800,262	10,843.84	1,100,649,914	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,655.52	1,081,535,745	10,765.80	1,092,729,306	1.750	2022/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	9,760,000	11,150.50	1,088,288,865	11,182.15	1,091,378,748	2.875	2028/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,858.70	1,085,870,199	10,906.71	1,090,671,537	1.500	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,587.22	1,058,722,140	10,700.87	1,070,087,486	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	10,885.91	1,047,225,468	10,937.91	1,052,227,393	1.250	2020/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,605.69	1,039,358,046	10,720.37	1,050,596,837	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/47	9,950,000	10,371.25	1,031,939,786	10,412.41	1,036,034,977	2.750	2047/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,714.51	1,023,236,064	10,820.98	1,033,403,713	1.750	2022/3/31	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.20
合計	98.20

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

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	22	アメリカドル	2,512,400.5	278,876,456	2,516,078.18	279,284,678	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	14	アメリカドル	1,697,946.68	188,472,081	1,701,437.5	188,859,562	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカドル	1,305,411	144,900,621	1,309,781.25	145,385,719	0.06

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	10	ユーロ	1,119,330	142,154,910	1,119,500	142,176,500	0.06
ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	11	ユーロ	1,457,174	185,061,098	1,458,050	185,172,350	0.07
ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	18	ユーロ	2,943,492	373,823,484	2,947,140	374,286,780	0.15

(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	4,510,000.00	503,260,809	499,798,200	0.20
	カナダドル	買建	690,000.00	56,666,314	56,186,700	0.02
	ユーロ	買建	8,740,000.00	1,110,837,396	1,109,892,600	0.44
	イギリスポンド	買建	670,000.00	94,562,661	94,041,200	0.04
	スウェーデンクローナ	買建	3,677,188.09	45,323,831	45,302,957	0.02
	ポーランドズロチ	買建	233,051.67	6,897,440	6,891,337	0.00
	アメリカドル	売建	4,550,000.00	504,676,900	504,731,500	0.20
	カナダドル	売建	839,427.91	68,391,458	68,396,586	0.03
	ユーロ	売建	9,680,000.00	1,229,097,672	1,229,263,200	0.49
	イギリスポンド	売建	660,992.40	92,809,429	92,816,552	0.04
	ノルウェークローネ	売建	347,936.61	4,402,424	4,401,398	0.00
	デンマーククローネ	売建	507,256.84	8,625,540	8,628,438	0.00
	オーストラリアドル	売建	350,124.04	27,352,838	27,355,191	0.01
	シンガポールドル	売建	92,104.36	7,451,349	7,455,847	0.00
	南アフリカランド	売建	2,750,256.87	21,020,127	21,011,962	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	7,151,528,004	14.85
	韓国	6,596,600,284	13.70
	台湾	5,368,483,504	11.15
	中国	5,178,136,221	10.76

	インド	4,508,804,339	9.37
	ブラジル	3,440,597,106	7.15
	南アフリカ	2,769,858,011	5.75
	香港	1,781,066,631	3.70
	ロシア	1,716,800,670	3.57
	メキシコ	1,286,335,405	2.67
	マレーシア	1,162,376,010	2.41
	タイ	1,159,465,880	2.41
	インドネシア	1,124,812,892	2.34
	ポーランド	601,844,500	1.25
	フィリピン	533,127,398	1.11
	チリ	525,580,418	1.09
	カタール	503,787,708	1.05
	バミューダ	487,340,928	1.01
	アラブ首長国連邦	333,245,334	0.69
	トルコ	292,721,680	0.61
	コロンビア	193,720,771	0.40
	ハンガリー	159,202,547	0.33
	アメリカ	142,053,962	0.30
	ギリシャ	107,833,445	0.22
	チェコ	76,558,958	0.16
	エジプト	59,811,484	0.12
	ペルー	30,556,280	0.06
	シンガポール	26,360,620	0.05
	マン島	25,103,299	0.05
	パキスタン	22,498,354	0.05
	ルクセンブルク	18,509,648	0.04
	小計	47,384,722,291	98.42
投資信託受益証券	ブラジル	85,159,170	0.18
投資証券	南アフリカ	132,141,496	0.27
	メキシコ	37,657,490	0.08
	小計	169,798,986	0.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		505,397,957	1.05
合計(純資産総額)		48,145,078,404	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	790,022,520	1.64

(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		300,315,555	0.62
	売建		894,999	0.00

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

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

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	メディア・娯楽	517,800	3,961.30	2,051,165,983	4,390.12	2,273,208,278	4.72
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	117,435	16,236.17	1,906,695,435	15,367.94	1,804,735,208	3.75
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,232,389	831.20	1,855,564,859	802.79	1,792,161,889	3.72
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	437,637	4,395.37	1,923,580,263	3,802.05	1,663,917,756	3.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア・娯楽	39,879	21,023.58	838,399,694	21,958.92	875,699,850	1.82
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,631,620	91.16	786,916,255	89.75	774,769,032	1.61
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	545,000	1,033.72	563,378,490	1,055.70	575,357,045	1.20
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,239,515	75.72	472,463,564	77.28	482,195,959	1.00
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	258,794	1,740.37	450,397,694	1,781.11	460,942,652	0.96
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	464,000	1,093.54	507,405,595	979.83	454,644,832	0.94
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	25,114	20,405.63	512,467,057	17,935.37	450,429,133	0.94
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	145,120	2,894.49	420,049,643	3,098.67	449,679,208	0.93
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	426,781	967.86	413,067,644	980.63	418,517,239	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	288,278	1,559.80	449,656,499	1,415.20	407,972,467	0.85
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	45,453	8,350.41	379,551,413	7,758.90	352,665,282	0.73
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	47.50	351,911,725	47.21	349,810,759	0.73
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	314,410	1,048.60	329,691,898	1,044.31	328,342,136	0.68

韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	53,572	7,196.62	385,537,814	6,123.04	328,023,499	0.68
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	292,161	1,020.09	298,030,865	1,072.12	313,233,112	0.65
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	1,185,248	273.37	324,015,508	254.87	302,096,010	0.63
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	252,453	1,326.70	334,930,472	1,187.14	299,698,316	0.62
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,626,000	190.97	310,519,789	166.75	271,146,557	0.56
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	81,948	3,035.62	248,763,643	3,035.23	248,731,069	0.52
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	41,282	5,863.06	242,039,223	5,955.30	245,846,695	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	76,736	3,692.71	283,363,795	3,121.16	239,505,334	0.50
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER-L	電気通信サービス	3,037,840	82.17	249,633,894	78.00	236,955,165	0.49
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	487,161	500.60	243,877,668	477.96	232,846,394	0.48
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	346,340	727.90	252,101,371	619.54	214,573,319	0.45
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	278,100	801.09	222,785,308	698.73	194,319,483	0.40
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,377,400	94.86	225,534,527	80.82	192,155,732	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.87
		素材	7.44
		資本財	3.58
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	2.65
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	1.17
		メディア・娯楽	9.47
		小売	5.54
		食品・生活必需品小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	3.60
		家庭用品・パーソナル用品	1.28
		ヘルスケア機器・サービス	0.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.09
		銀行	18.05
		各種金融	2.72
		保険	3.59

	不動産	2.55
	ソフトウェア・サービス	1.87
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.94
	電気通信サービス	4.67
	公益事業	2.62
	半導体・半導体製造装置	5.26
	小計	98.42
投資信託受益証券		0.18
投資証券		0.35
合計		98.95

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	148	アメリカドル	7,145,656	793,167,816	7,117,320	790,022,520	1.64

(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	2,707,983.02	300,288,294	300,315,555	0.62
	ブラジルリアル	売建	31,304.63	885,294	894,999	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	4,660,470,848	10.25
	ブラジル	4,567,439,742	10.04

	インドネシア	4,243,376,391	9.33
	ポーランド	4,231,647,613	9.31
	タイ	3,885,973,506	8.55
	南アフリカ	3,726,807,513	8.20
	ロシア	3,122,784,806	6.87
	コロンビア	3,110,998,804	6.84
	マレーシア	2,597,122,823	5.71
	トルコ	2,310,246,152	5.08
	ハンガリー	2,180,362,929	4.79
	チェコ	1,857,685,678	4.09
	チリ	1,373,833,589	3.02
	ペルー	1,362,869,582	3.00
	フィリピン	132,310,556	0.29
	ウルグアイ	111,899,445	0.25
	ドミニカ共和国	43,855,686	0.10
	小計	43,519,685,663	95.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,952,214,864	4.29
合計(純資産総額)		45,471,900,527	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	47,000,000,000	4.16	1,958,259,277	4.13	1,945,240,700	9.850	2027/6/28	4.28
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	8,410,000,000	16.37	1,376,724,177	16.33	1,373,833,589	5.500	2020/8/5	3.02
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,537.33	952,769,527	2,586.03	971,055,060	0.000	2020/7/1	2.14
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000	2,920.35	754,912,132	2,992.23	773,491,592	10.000	2023/1/1	1.70
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.19	755,160,842	3.20	757,495,002	4.375	2023/3/21	1.67
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	76,750,000	822.53	631,292,389	833.47	639,693,551	10.500	2026/12/21	1.41
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	167,500,000	350.05	586,345,852	361.60	605,695,854	3.400	2036/6/17	1.33
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/20	21,600,000	2,590.78	559,608,616	2,633.62	568,863,253	0.000	2020/4/1	1.25
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	360.91	494,097,180	376.23	515,068,042	3.650	2031/6/20	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	536.67	492,132,827	538.05	493,399,938	6.500	2021/6/10	1.09
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,700,000	517.36	479,599,019	522.84	484,677,241	7.500	2027/6/3	1.07

メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	91,600,000	527.08	482,813,542	529.02	484,582,979	6.500	2022/6/9	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000	559.92	475,933,938	559.85	475,876,410	8.000	2020/6/11	1.05
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	15,700,000	2,852.33	447,816,883	2,983.35	468,386,248	10.000	2027/1/1	1.03
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	15,550,000	2,894.26	450,058,596	2,981.45	463,615,801	10.000	2025/1/1	1.02
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	597.88	462,461,959	597.99	462,549,210	10.000	2024/12/5	1.02
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000	2,854.47	415,325,869	2,932.67	426,704,896	2.500	2026/7/25	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000	2,974.86	416,480,434	2,998.33	419,767,587	2.250	2022/4/25	0.92
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	13,800,000	2,959.60	408,425,456	2,989.45	412,544,318	10.000	2021/1/1	0.91
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	11,600,000,000	3.53	409,491,140	3.51	408,263,102	7.750	2021/4/14	0.90
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000	673.57	395,049,162	678.09	397,704,283	8.750	2048/2/28	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000	2,960.09	395,172,660	2,969.81	396,470,322	1.500	2020/4/25	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	3,034.76	385,415,225	3,096.31	393,231,675	3.250	2025/7/25	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	402.77	382,639,138	413.17	392,518,910	4.875	2029/6/22	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,500,000	2,306.65	380,598,393	2,369.60	390,984,016	0.000	2021/7/1	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	56,800,000	675.32	383,586,634	678.85	385,592,389	8.750	2044/1/31	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000	2,817.18	370,460,475	2,908.96	382,528,675	2.500	2027/7/25	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	74,100,000	484.49	359,010,732	496.41	367,839,988	7.750	2042/11/13	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000	358.97	362,561,513	360.44	364,045,966	3.650	2021/12/17	0.80
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	45,200,000,000	0.77	352,070,304	0.78	353,726,974	8.375	2024/3/15	0.78

(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	95.71
合計	95.71

(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。

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：2017年8月25日
作成基準日：2018年12月28日

基準価額・純資産の推移



基準価額	9,729円
純資産総額	6.87億円

※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	2018年6月	-	-	-	-
分配金	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	上位銘柄銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	42.7%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.3%
		T 2.5% 02/15/46	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.3%
新興国債券 インデックス マザーファンド	29.4%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	1.3%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.9%
外国株式 インデックス マザーファンド	13.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/デバイス	-	-	0.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.3%
新興国株式 インデックス マザーファンド	8.8%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア/娯楽	-	-	0.4%
		ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	3.8%	第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/06/20	0.1%
		第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	1.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.0%

※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）



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1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、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ませんとします。

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

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、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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。（2017年 8月25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6月11日から翌年6月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を

記載した書面決議の通知を發します。

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、本手続きに従います。

(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。

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は、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違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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、）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1期計算期間(2017年8月25日から2018年6月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (2018年 6月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		72,354
コール・ローン		4,472,687
親投資信託受益証券		539,936,958
未収入金		1,555,657
流動資産合計		546,037,656
資産合計		
		546,037,656
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		74,548
未払委託者報酬		596,361
未払利息		11
その他未払費用		7,463
流動負債合計		678,383
負債合計		
		678,383
純資産の部		
元本等		
元本		543,341,082
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,018,191
（分配準備積立金）		7,154,469
元本等合計		545,359,273
純資産合計		
		545,359,273
負債純資産合計		
		546,037,656

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	13,223,041
営業収益合計	13,223,041
営業費用	
支払利息	1,831
受託者報酬	130,749
委託者報酬	1,045,818
その他費用	13,053
営業費用合計	1,191,451
営業利益又は営業損失（ ）	14,414,492
経常利益又は経常損失（ ）	14,414,492
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,414,492
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（ ）	609,468
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,166,590
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,166,590
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,124,439
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,124,439
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,018,191

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2017年 8月25日から2018年 6月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年 6月11日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		543,341,082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)	1.0037円 (10,037円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,154,469円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	1,059,690円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,214,159円
当ファンドの期末残存口数	F	543,341,082口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	151円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2018年 6月11日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期
	自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	755,425,234円
期中一部解約元本額	212,584,152円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年 6月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	13,203,449
合計	13,203,449

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	18,057,627	53,548,087	
	国内株式インデックス マザーファンド	5,325,908	8,551,810	
	外国株式インデックス マザーファンド	31,662,787	78,906,831	
	国内債券インデックス マザーファンド	17,904,940	24,929,047	
	外国債券インデックス マザーファンド	82,577,938	220,441,805	
	新興国債券インデックス マザーファンド	93,690,896	153,559,378	
合計		249,220,096	539,936,958	

(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

	2018年 6月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	42,446,672
コール・ローン	2,623,902,039
株式	208,376,298,860
派生商品評価勘定	44,775,640
未収入金	6,730,280
未収配当金	1,356,623,186
差入委託証拠金	103,716,200
流動資産合計	212,554,492,877
資産合計	212,554,492,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,620
前受金	44,765,500
未払金	597,543,240

項目	2018年 6月11日現在
	金額（円）
未払解約金	89,834,665
未払利息	6,952
その他未払費用	40,910
流動負債合計	732,207,887
負債合計	732,207,887
純資産の部	
元本等	
元本	131,918,382,031
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,903,902,959
元本等合計	211,822,284,990
純資産合計	211,822,284,990
負債純資産合計	212,554,492,877

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	131,918,382,031口
2. 1口当たり純資産額	1.6057円

計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	(1万口当たり純資産額)	(16,057円)
-----------------------------	--------------	-----------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 8月25日
期首元本額	119,170,463,069円
期中追加設定元本額	28,425,550,856円
期中一部解約元本額	15,677,631,894円
期末元本額	131,918,382,031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）	660,552,304円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,709,642,697円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,730,689円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,060,593,770円
世界経済インデックスファンド	1,917,560,704円
日本株式インデックス・オープン	5,966,802,820円
DCマイセレクション25	5,696,910,162円
DCマイセレクション50	16,619,945,395円
DCマイセレクション75	15,693,841,558円
DC日本株式インデックス・オープン	5,140,558,291円
DCマイセレクションS25	2,262,105,087円
DCマイセレクションS50	6,681,313,472円
DCマイセレクションS75	4,489,080,174円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,231,674,611円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	376,611,693円

DCターゲット・イヤー ファンド2035	561,927,936円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	352,120,263円
DC世界経済インデックスファンド	1,481,435,131円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	379,515,685円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	24,210,316円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	76,747,493円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,258,357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)	360,499,090円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,680,266円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	136,145,627円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	482,524,313円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	74,455,752円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	642,905,470円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,050,944,360円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	779,703,103円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,421,088,919円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	666,888,663円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	67,825,575円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	872,989,708円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	966,215,894円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	505,519,500円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	636,384,210円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	59,719,761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)	1,015,675,035円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,425,140,959円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	163,020,858円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	199,811,135円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	229,495,242円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,423,739円
SMT インデックスバランス・オープン	85,371,172円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,563,261円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	42,951,807円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,325,908円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	737,742円
グローバル経済コア	326,552,561円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,252,719円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	34,507,986円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	149,100円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	24,368,777,047円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

2018年 6月11日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,897,472,513
合計	2,897,472,513

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,365,545,980	-	3,410,305,000	44,759,020
	合計	3,365,545,980	-	3,410,305,000	44,759,020

(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	3,600	3,810.00	13,716,000	
日本水産	102,900	538.00	55,360,200	
マルハニチロ	17,300	4,085.00	70,670,500	
カネコ種苗	3,100	1,599.00	4,956,900	
サカタのタネ	13,500	4,295.00	57,982,500	
ホクト	9,300	2,012.00	18,711,600	
ホクリヨウ	1,500	901.00	1,351,500	
住石ホールディングス	29,800	159.00	4,738,200	
日鉄鉱業	2,700	5,870.00	15,849,000	
三井松島産業	5,200	1,597.00	8,304,400	

国際石油開発帝石	445,100	1,200.50	534,342,550
石油資源開発	14,800	2,822.00	41,765,600
K&Oエナジーグループ	5,900	1,848.00	10,903,200
ヒノキヤグループ	2,300	2,848.00	6,550,400
ショーボンドホールディングス	8,600	7,740.00	66,564,000
ミライト・ホールディングス	28,100	1,803.00	50,664,300
タマホーム	6,800	1,094.00	7,439,200
サンヨーホームズ	1,500	1,060.00	1,590,000
日本アクア	2,600	387.00	1,006,200
ファーストコーポレーション	2,900	1,160.00	3,364,000
ベステラ	1,700	1,500.00	2,550,000
TATERU	8,700	2,189.00	19,044,300
ダイセキ環境ソリューション	2,100	1,177.00	2,471,700
第一カッター興業	1,200	2,961.00	3,553,200
安藤・間	71,200	992.00	70,630,400
東急建設	35,100	1,076.00	37,767,600
コムシスホールディングス	32,100	2,978.00	95,593,800
ミサワホーム	7,700	991.00	7,630,700
ピーアールホールディングス	8,700	450.00	3,915,000
高松コンストラクショングループ	5,900	3,220.00	18,998,000
東建コーポレーション	3,400	10,300.00	35,020,000
ソネック	1,100	845.00	929,500
ヤマウラ	4,200	897.00	3,767,400
大成建設	91,000	6,150.00	559,650,000
大林組	274,100	1,152.00	315,763,200
清水建設	279,600	1,127.00	315,109,200
飛鳥建設	83,200	199.00	16,556,800
長谷工コーポレーション	106,700	1,601.00	170,826,700
松井建設	10,000	940.00	9,400,000
銭高組	1,300	5,790.00	7,527,000
鹿島建設	402,000	906.00	364,212,000
不動テトラ	68,700	193.00	13,259,100
大末建設	2,900	1,345.00	3,900,500
鉄建建設	5,600	3,050.00	17,080,000
西松建設	21,100	3,160.00	66,676,000
三井住友建設	65,200	770.00	50,204,000
大豊建設	33,000	639.00	21,087,000
前田建設工業	65,200	1,280.00	83,456,000
佐田建設	5,800	482.00	2,795,600
ナカノフドー建設	7,100	709.00	5,033,900
奥村組	15,000	3,765.00	56,475,000
東鉄工業	11,000	3,360.00	36,960,000

イチケン	1,700	2,678.00	4,552,600
浅沼組	32,000	384.00	12,288,000
戸田建設	106,000	1,000.00	106,000,000
熊谷組	14,400	3,785.00	54,504,000
青木あすなろ建設	5,900	1,018.00	6,006,200
北野建設	19,000	386.00	7,334,000
植木組	1,200	2,678.00	3,213,600
三井ホーム	12,000	716.00	8,592,000
矢作建設工業	12,300	897.00	11,033,100
ピーエス三菱	10,800	601.00	6,490,800
日本ハウスホールディングス	17,300	549.00	9,497,700
大東建託	32,600	17,970.00	585,822,000
新日本建設	10,800	1,293.00	13,964,400
N I P P O	21,200	2,117.00	44,880,400
東亜道路工業	1,900	3,910.00	7,429,000
前田道路	28,600	2,253.00	64,435,800
日本道路	2,500	6,050.00	15,125,000
東亜建設工業	7,300	2,872.00	20,965,600
若築建設	4,900	1,660.00	8,134,000
東洋建設	28,500	515.00	14,677,500
五洋建設	108,600	729.00	79,169,400
世紀東急工業	12,300	770.00	9,471,000
福田組	3,000	6,970.00	20,910,000
住友林業	58,400	1,702.00	99,396,800
日本基礎技術	10,100	381.00	3,848,100
日成ビルド工業	13,500	1,201.00	16,213,500
巴コーポレーション	11,400	503.00	5,734,200
大和ハウス工業	270,000	4,032.00	1,088,640,000
ライト工業	17,600	1,088.00	19,148,800
積水ハウス	297,400	1,865.00	554,651,000
日特建設	7,800	626.00	4,882,800
北陸電気工事	5,100	1,204.00	6,140,400
ユアテック	13,900	933.00	12,968,700
西部電気工業	1,500	3,740.00	5,610,000
四電工	1,400	2,729.00	3,820,600
中電工	11,800	3,000.00	35,400,000
関電工	36,300	1,221.00	44,322,300
きんでん	60,800	1,843.00	112,054,400
東京エネシス	10,400	1,281.00	13,322,400
トーエネック	2,600	3,295.00	8,567,000
住友電設	7,200	2,053.00	14,781,600
日本電設工業	14,000	2,490.00	34,860,000

協和エクシオ	32,800	2,937.00	96,333,600
新日本空調	7,100	1,723.00	12,233,300
N D S	1,400	6,090.00	8,526,000
九電工	18,000	5,420.00	97,560,000
三機工業	19,400	1,117.00	21,669,800
日揮	78,700	2,243.00	176,524,100
中外炉工業	2,800	2,881.00	8,066,800
ヤマト	7,600	732.00	5,563,200
太平電業	6,200	2,959.00	18,345,800
高砂熱学工業	25,200	2,047.00	51,584,400
三晃金属工業	1,000	3,650.00	3,650,000
朝日工業社	1,900	3,515.00	6,678,500
明星工業	16,400	865.00	14,186,000
大気社	11,700	3,425.00	40,072,500
ダイダン	6,100	2,427.00	14,804,700
日比谷総合設備	10,200	2,286.00	23,317,200
東芝プラントシステム	19,800	2,558.00	50,648,400
O S J Bホールディングス	40,200	290.00	11,658,000
東洋エンジニアリング	10,100	832.00	8,403,200
千代田化工建設	59,400	916.00	54,410,400
新興プランテック	17,600	993.00	17,476,800
日本製粉	27,200	1,913.00	52,033,600
日清製粉グループ本社	100,200	2,374.00	237,874,800
日東富士製粉	600	5,290.00	3,174,000
昭和産業	7,500	2,968.00	22,260,000
鳥越製粉	7,200	989.00	7,120,800
中部飼料	10,000	2,082.00	20,820,000
フィード・ワン	54,800	245.00	13,426,000
東洋精糖	1,300	1,230.00	1,599,000
日本甜菜製糖	4,700	2,278.00	10,706,600
三井製糖	6,500	3,560.00	23,140,000
塩水港精糖	9,300	265.00	2,464,500
日新製糖	3,900	2,163.00	8,435,700
森永製菓	19,200	5,370.00	103,104,000
中村屋	2,100	4,815.00	10,111,500
江崎グリコ	22,900	5,500.00	125,950,000
名糖産業	3,900	1,733.00	6,758,700
井村屋グループ	3,200	3,375.00	10,800,000
不二家	5,200	2,578.00	13,405,600
山崎製パン	66,900	2,665.00	178,288,500
第一屋製パン	1,400	1,183.00	1,656,200
モロゾフ	1,400	6,690.00	9,366,000

亀田製菓	5,100	6,090.00	31,059,000
寿スピリッツ	7,900	5,900.00	46,610,000
カルビー	37,300	3,880.00	144,724,000
森永乳業	16,400	4,215.00	69,126,000
六甲バター	5,400	2,418.00	13,057,200
ヤクルト本社	47,600	7,280.00	346,528,000
明治ホールディングス	54,100	9,310.00	503,671,000
雪印メグミルク	19,700	2,964.00	58,390,800
プリマハム	58,000	634.00	36,772,000
日本ハム	35,400	4,445.00	157,353,000
林兼産業	2,800	814.00	2,279,200
丸大食品	44,000	505.00	22,220,000
S Foods	5,700	4,505.00	25,678,500
伊藤ハム米久ホールディングス	52,600	976.00	51,337,600
サッポロホールディングス	29,900	2,831.00	84,646,900
アサヒグループホールディングス	171,400	5,585.00	957,269,000
キリンホールディングス	393,500	2,956.00	1,163,186,000
宝ホールディングス	61,300	1,425.00	87,352,500
オエノンホールディングス	23,200	456.00	10,579,200
養命酒製造	2,500	2,434.00	6,085,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	57,500	4,630.00	266,225,000
サントリー食品インターナショナル	62,600	4,815.00	301,419,000
ダイトーグループホールディングス	4,200	6,180.00	25,956,000
伊藤園	27,100	5,010.00	135,771,000
キーコーヒー	8,000	2,198.00	17,584,000
ユニカフェ	2,400	1,160.00	2,784,000
ジャパンフーズ	1,200	1,477.00	1,772,400
日清オイリオグループ	9,700	3,300.00	32,010,000
不二製油グループ本社	22,200	4,115.00	91,353,000
かどや製油	900	6,200.00	5,580,000
J - オイルミルズ	4,200	3,985.00	16,737,000
キッコーマン	63,900	5,400.00	345,060,000
味の素	188,300	2,144.00	403,715,200
キューピー	45,600	2,760.00	125,856,000
ハウス食品グループ本社	31,200	4,060.00	126,672,000
カゴメ	32,800	3,790.00	124,312,000
焼津水産化学工業	4,000	1,221.00	4,884,000
アリアケジャパン	7,500	9,660.00	72,450,000
ピエトロ	1,100	1,647.00	1,811,700
エバラ食品工業	1,800	2,419.00	4,354,200
ニチレイ	39,000	2,850.00	111,150,000
東洋水産	44,900	3,950.00	177,355,000

イトアンド	2,200	2,124.00	4,672,800
大冷	900	1,992.00	1,792,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	1,029.00	1,646,400
日清食品ホールディングス	35,700	8,270.00	295,239,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,481.00	13,329,000
一正蒲鉾	3,200	1,438.00	4,601,600
フジッコ	8,900	2,721.00	24,216,900
ロック・フィールド	8,800	1,962.00	17,265,600
日本たばこ産業	506,500	3,021.00	1,530,136,500
ケンコーマヨネーズ	5,400	4,405.00	23,787,000
わらべや日洋ホールディングス	5,400	2,766.00	14,936,400
なとり	4,600	1,883.00	8,661,800
イフジ産業	1,400	791.00	1,107,400
ピクルスコーポレーション	1,600	2,156.00	3,449,600
北の達人コーポレーション	25,000	832.00	20,800,000
ユーグレナ	32,500	890.00	28,925,000
ミヨシ油脂	3,100	1,446.00	4,482,600
理研ビタミン	3,100	4,420.00	13,702,000
片倉工業	9,900	1,333.00	13,196,700
ゲンゼ	6,400	7,420.00	47,488,000
東洋紡	31,600	1,828.00	57,764,800
ユニチカ	24,800	670.00	16,616,000
富士紡ホールディングス	4,800	3,890.00	18,672,000
倉敷紡績	86,000	379.00	32,594,000
シキボウ	4,200	1,341.00	5,632,200
日本毛織	24,200	1,085.00	26,257,000
トーア紡コーポレーション	3,500	571.00	1,998,500
ダイドーリミテッド	9,700	456.00	4,423,200
帝国繊維	9,000	2,354.00	21,186,000
帝人	70,200	2,165.00	151,983,000
東レ	619,800	909.80	563,894,040
サカイオーベックス	2,200	2,412.00	5,306,400
住江織物	2,200	2,818.00	6,199,600
日本フェルト	4,500	527.00	2,371,500
イチカワ	6,000	364.00	2,184,000
日東製網	900	1,786.00	1,607,400
アツギ	5,700	1,235.00	7,039,500
ダイニック	3,100	1,055.00	3,270,500
セーレン	19,700	2,049.00	40,365,300
ソトー	3,300	1,041.00	3,435,300
東海染工	1,300	1,447.00	1,881,100
小松精練	13,100	1,013.00	13,270,300

ワコールホールディングス	23,600	3,445.00	81,302,000
ホギメディカル	10,800	5,150.00	55,620,000
レナウン	23,100	155.00	3,580,500
クラウドシアホールディングス	2,300	597.00	1,373,100
T S Iホールディングス	30,700	816.00	25,051,200
マツオカコーポレーション	2,000	4,015.00	8,030,000
三陽商会	4,500	2,504.00	11,268,000
ナイガイ	3,200	568.00	1,817,600
オンワードホールディングス	50,600	909.00	45,995,400
ルックホールディングス	15,000	302.00	4,530,000
ゴールドウイン	4,800	9,190.00	44,112,000
デサント	19,500	2,107.00	41,086,500
キング	4,400	523.00	2,301,200
ヤマトインターナショナル	5,800	618.00	3,584,400
特種東海製紙	4,700	4,495.00	21,126,500
王子ホールディングス	360,000	760.00	273,600,000
日本製紙	38,300	1,832.00	70,165,600
三菱製紙	12,100	668.00	8,082,800
北越紀州製紙	47,600	595.00	28,322,000
中越パルプ工業	3,400	1,820.00	6,188,000
巴川製紙所	13,000	263.00	3,419,000
大王製紙	34,000	1,552.00	52,768,000
阿波製紙	2,000	650.00	1,300,000
レンゴー	82,400	1,035.00	85,284,000
トーモク	4,900	2,222.00	10,887,800
ザ・パック	6,000	3,900.00	23,400,000
クラレ	143,800	1,683.00	242,015,400
旭化成	532,800	1,516.00	807,724,800
共和レザー	5,000	1,044.00	5,220,000
昭和電工	56,900	5,060.00	287,914,000
住友化学	629,000	654.00	411,366,000
住友精化	3,500	6,010.00	21,035,000
日産化学工業	49,700	5,160.00	256,452,000
ラサ工業	3,000	3,425.00	10,275,000
クレハ	7,400	7,420.00	54,908,000
多木化学	1,200	5,210.00	6,252,000
テイカ	6,500	2,651.00	17,231,500
石原産業	15,200	1,211.00	18,407,200
片倉コープアグリ	2,000	1,248.00	2,496,000
日東エフシー	5,100	759.00	3,870,900
日本曹達	59,000	617.00	36,403,000
東ソー	123,500	1,855.00	229,092,500

トクヤマ	24,800	3,810.00	94,488,000
セントラル硝子	17,400	2,478.00	43,117,200
東亜合成	50,000	1,319.00	65,950,000
大阪ソーダ	8,300	3,145.00	26,103,500
関東電化工業	20,400	1,137.00	23,194,800
デンカ	31,400	4,095.00	128,583,000
信越化学工業	142,300	11,105.00	1,580,241,500
日本カーバイド工業	2,700	2,092.00	5,648,400
堺化学工業	5,800	2,863.00	16,605,400
エア・ウォーター	70,400	2,201.00	154,950,400
大陽日酸	65,800	1,827.00	120,216,600
日本化学工業	3,200	4,325.00	13,840,000
東邦アセチレン	1,200	1,571.00	1,885,200
日本パーカラライジング	43,700	1,703.00	74,421,100
高压ガス工業	12,700	1,020.00	12,954,000
チタン工業	900	2,783.00	2,504,700
四国化成工業	12,300	1,562.00	19,212,600
戸田工業	1,700	3,005.00	5,108,500
ステラ ケミファ	4,300	3,815.00	16,404,500
保土谷化学工業	2,800	3,695.00	10,346,000
日本触媒	13,400	8,580.00	114,972,000
大日精化工業	6,600	3,730.00	24,618,000
カネカ	115,000	1,137.00	130,755,000
三菱瓦斯化学	70,400	2,823.00	198,739,200
三井化学	77,700	3,150.00	244,755,000
J S R	85,900	2,032.00	174,548,800
東京応化工業	14,800	4,210.00	62,308,000
大阪有機化学工業	7,400	1,544.00	11,425,600
三菱ケミカルホールディングス	572,200	1,000.50	572,486,100
K Hネオケム	13,100	3,185.00	41,723,500
ダイセル	115,200	1,250.00	144,000,000
住友ベークライト	69,000	1,120.00	77,280,000
積水化学工業	177,400	1,824.00	323,577,600
日本ゼオン	72,000	1,417.00	102,024,000
アイカ工業	24,000	4,160.00	99,840,000
宇部興産	43,000	3,140.00	135,020,000
積水樹脂	13,200	2,370.00	31,284,000
タキロンシーアイ	17,200	689.00	11,850,800
旭有機材	5,000	2,257.00	11,285,000
日立化成	42,200	2,424.00	102,292,800
ニチバン	4,200	2,974.00	12,490,800
リケンテクノス	18,400	574.00	10,561,600

大倉工業	20,000	541.00	10,820,000
積水化成成品工業	10,600	1,286.00	13,631,600
群栄化学工業	2,100	3,675.00	7,717,500
タイガースポリマー	4,300	815.00	3,504,500
ミライアル	2,900	1,507.00	4,370,300
ダイキアクシス	2,900	1,332.00	3,862,800
ダイキョーニシカワ	16,900	1,751.00	29,591,900
竹本容器	1,300	3,160.00	4,108,000
森六ホールディングス	4,300	3,255.00	13,996,500
日本化薬	55,500	1,199.00	66,544,500
カーリットホールディングス	7,900	1,099.00	8,682,100
日本精化	7,000	1,244.00	8,708,000
扶桑化学工業	8,100	2,870.00	23,247,000
トリケミカル研究所	2,000	4,760.00	9,520,000
A D E K A	36,700	1,982.00	72,739,400
日油	33,000	3,500.00	115,500,000
ハリマ化成グループ	6,600	913.00	6,025,800
花王	200,600	8,506.00	1,706,303,600
第一工業製薬	16,000	804.00	12,864,000
石原ケミカル	2,000	2,210.00	4,420,000
日華化学	2,600	1,215.00	3,159,000
ニイタカ	1,300	1,796.00	2,334,800
三洋化成工業	5,400	5,400.00	29,160,000
有機合成薬品工業	5,500	289.00	1,589,500
大日本塗料	9,800	1,563.00	15,317,400
日本ペイントホールディングス	65,900	4,720.00	311,048,000
関西ペイント	89,800	2,328.00	209,054,400
神東塗料	6,200	230.00	1,426,000
中国塗料	24,400	1,062.00	25,912,800
日本特殊塗料	5,400	2,531.00	13,667,400
藤倉化成	10,800	705.00	7,614,000
太陽ホールディングス	6,600	4,770.00	31,482,000
D I C	33,700	3,670.00	123,679,000
サカタインクス	17,400	1,537.00	26,743,800
東洋インキ S C ホールディングス	84,000	633.00	53,172,000
T & K T O K A	5,800	1,262.00	7,319,600
富士フイルムホールディングス	169,400	4,317.00	731,299,800
資生堂	151,900	8,990.00	1,365,581,000
ライオン	113,600	2,052.00	233,107,200
高砂香料工業	5,100	3,540.00	18,054,000
マンダム	15,900	3,620.00	57,558,000
ミルボン	10,900	5,220.00	56,898,000

ファンケル	19,800	5,680.00	112,464,000
コーセー	13,800	24,830.00	342,654,000
コタ	3,900	1,533.00	5,978,700
シーズ・ホールディングス	9,900	6,220.00	61,578,000
シーボン	1,000	3,095.00	3,095,000
ポーラ・オルビスホールディングス	34,800	5,010.00	174,348,000
ノエビアホールディングス	5,200	8,030.00	41,756,000
アジュバンコスメジャパン	1,800	1,251.00	2,251,800
エステー	5,800	2,812.00	16,309,600
アグロ カネショウ	3,300	2,866.00	9,457,800
コニシ	13,400	1,845.00	24,723,000
長谷川香料	10,500	2,246.00	23,583,000
星光PMC	4,600	1,138.00	5,234,800
小林製薬	22,900	9,470.00	216,863,000
荒川化学工業	7,300	1,938.00	14,147,400
メック	5,600	2,285.00	12,796,000
日本高純度化学	2,300	2,492.00	5,731,600
タカラバイオ	21,400	2,548.00	54,527,200
JCU	9,900	2,659.00	26,324,100
新田ゼラチン	5,500	851.00	4,680,500
OATアグリオ	1,300	3,630.00	4,719,000
デクセリアルズ	21,000	1,126.00	23,646,000
アース製薬	6,100	5,720.00	34,892,000
北興化学工業	8,300	685.00	5,685,500
大成ラミック	2,500	3,190.00	7,975,000
クミアイ化学工業	37,000	876.00	32,412,000
日本農薬	20,600	693.00	14,275,800
アキレス	6,200	2,355.00	14,601,000
有沢製作所	13,600	1,229.00	16,714,400
日東電工	61,600	8,762.00	539,739,200
レック	4,800	4,770.00	22,896,000
きもと	14,000	315.00	4,410,000
藤森工業	6,800	3,865.00	26,282,000
前澤化成工業	5,600	1,262.00	7,067,200
ウェーブロックホールディングス	2,100	1,172.00	2,461,200
JSP	4,800	3,570.00	17,136,000
エフピコ	6,700	6,590.00	44,153,000
天馬	6,400	1,984.00	12,697,600
信越ポリマー	16,600	1,161.00	19,272,600
東リ	20,300	350.00	7,105,000
ニフコ	30,000	3,935.00	118,050,000
日本バルカー工業	6,600	3,495.00	23,067,000

ユニ・チャーム	173,000	3,422.00	592,006,000
協和発酵キリン	102,200	2,379.00	243,133,800
武田薬品工業	300,500	4,291.00	1,289,445,500
アステラス製薬	838,300	1,712.50	1,435,588,750
大日本住友製薬	60,500	2,268.00	137,214,000
塩野義製薬	114,900	5,710.00	656,079,000
田辺三菱製薬	99,500	1,917.00	190,741,500
わかもと製薬	9,400	285.00	2,679,000
あすか製薬	9,200	1,303.00	11,987,600
日本新薬	21,300	7,490.00	159,537,000
ピオフェルミン製薬	1,400	2,911.00	4,075,400
中外製薬	85,000	5,980.00	508,300,000
科研製薬	14,700	5,770.00	84,819,000
エーザイ	97,600	8,228.00	803,052,800
ロート製薬	44,800	3,465.00	155,232,000
小野薬品工業	192,600	2,552.00	491,515,200
久光製薬	24,100	9,080.00	218,828,000
持田製薬	5,700	8,010.00	45,657,000
参天製薬	154,500	1,995.00	308,227,500
扶桑薬品工業	2,900	2,942.00	8,531,800
日本ケミファ	1,100	4,620.00	5,082,000
ツムラ	29,200	3,785.00	110,522,000
日医工	21,500	1,679.00	36,098,500
キッセイ薬品工業	14,700	3,070.00	45,129,000
生化学工業	15,800	1,556.00	24,584,800
栄研化学	13,200	2,589.00	34,174,800
日水製薬	3,400	1,438.00	4,889,200
鳥居薬品	5,100	2,758.00	14,065,800
JCRファーマ	5,700	6,930.00	39,501,000
東和薬品	3,900	6,570.00	25,623,000
富士製薬工業	2,800	4,150.00	11,620,000
沢井製薬	16,400	4,860.00	79,704,000
ゼリア新薬工業	17,500	2,274.00	39,795,000
第一三共	233,400	3,813.00	889,954,200
キョーリン製薬ホールディングス	22,800	2,287.00	52,143,600
大幸薬品	4,300	2,087.00	8,974,100
ダイト	4,800	3,640.00	17,472,000
大塚ホールディングス	169,500	5,374.00	910,893,000
大正製薬ホールディングス	18,300	12,150.00	222,345,000
ペプチドリーム	37,300	4,790.00	178,667,000
日本コークス工業	67,800	119.00	8,068,200
昭和シェル石油	76,300	1,528.00	116,586,400

ニチレキ	10,300	1,290.00	13,287,000
ユシロ化学工業	4,600	1,741.00	8,008,600
ビーピー・カストロール	3,500	1,659.00	5,806,500
富士石油	19,500	382.00	7,449,000
MORESCO	2,900	1,928.00	5,591,200
出光興産	68,500	3,760.00	257,560,000
JXTGホールディングス	1,301,700	727.30	946,726,410
コスモエネルギーホールディングス	23,600	3,660.00	86,376,000
横浜ゴム	47,200	2,483.00	117,197,600
東洋ゴム工業	48,300	1,778.00	85,877,400
ブリヂストン	270,000	4,464.00	1,205,280,000
住友ゴム工業	84,000	1,894.00	159,096,000
藤倉ゴム工業	7,100	705.00	5,005,500
オカモト	28,000	1,228.00	34,384,000
フコク	3,600	1,007.00	3,625,200
ニッタ	8,400	4,345.00	36,498,000
住友理工	15,700	1,145.00	17,976,500
三ツ星ベルト	20,000	1,332.00	26,640,000
バンドー化学	15,400	1,354.00	20,851,600
日東紡績	12,100	2,729.00	33,020,900
旭硝子	82,300	4,610.00	379,403,000
日本板硝子	40,800	1,081.00	44,104,800
石塚硝子	1,100	2,486.00	2,734,600
日本山村硝子	34,000	180.00	6,120,000
日本電気硝子	35,300	3,120.00	110,136,000
オハラ	3,200	2,254.00	7,212,800
住友大阪セメント	159,000	533.00	84,747,000
太平洋セメント	51,500	4,090.00	210,635,000
日本ヒューム	8,100	900.00	7,290,000
日本コンクリート工業	17,400	380.00	6,612,000
三谷セキサン	4,300	2,708.00	11,644,400
アジアパイルホールディングス	10,400	722.00	7,508,800
東海カーボン	74,100	2,191.00	162,353,100
日本カーボン	4,200	6,840.00	28,728,000
東洋炭素	5,300	3,475.00	18,417,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,700	5,360.00	25,192,000
TOTO	62,800	5,720.00	359,216,000
日本碍子	99,600	2,091.00	208,263,600
日本特殊陶業	70,000	3,185.00	222,950,000
MARUWA	2,800	8,990.00	25,172,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,805.00	8,371,000
黒崎播磨	1,600	6,200.00	9,920,000

ヨータイ	6,500	716.00	4,654,000
イソライト工業	4,100	780.00	3,198,000
東京窯業	10,400	399.00	4,149,600
ニッカトー	3,600	1,132.00	4,075,200
フジミインコーポレーテッド	7,300	2,858.00	20,863,400
クニミネ工業	2,200	1,109.00	2,439,800
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,291.00	2,194,700
ニチアス	45,000	1,446.00	65,070,000
ニチハ	12,300	4,440.00	54,612,000
新日鐵住金	361,000	2,299.00	829,939,000
神戸製鋼所	147,600	1,126.00	166,197,600
中山製鋼所	11,200	725.00	8,120,000
合同製鐵	4,300	2,374.00	10,208,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	217,800	2,291.50	499,088,700
日新製鋼	22,300	1,613.00	35,969,900
東京製鐵	43,100	984.00	42,410,400
共英製鋼	9,100	2,205.00	20,065,500
大和工業	17,100	3,560.00	60,876,000
東京鐵鋼	3,300	1,683.00	5,553,900
大阪製鐵	5,400	2,253.00	12,166,200
淀川製鋼所	11,800	2,941.00	34,703,800
東洋鋼鋳	19,000	717.00	13,623,000
丸一鋼管	28,600	3,700.00	105,820,000
モリ工業	2,600	3,365.00	8,749,000
大同特殊鋼	14,300	5,460.00	78,078,000
日本高周波鋼業	2,900	838.00	2,430,200
日本冶金工業	66,500	344.00	22,876,000
山陽特殊製鋼	9,300	2,825.00	26,272,500
愛知製鋼	4,500	4,480.00	20,160,000
日立金属	86,900	1,219.00	105,931,100
日本金属	2,000	2,075.00	4,150,000
大平洋金属	5,000	4,045.00	20,225,000
新日本電工	48,300	335.00	16,180,500
栗本鐵工所	4,100	2,011.00	8,245,100
虹技	1,200	2,004.00	2,404,800
日本鑄鉄管	8,000	157.00	1,256,000
三菱製鋼	6,000	2,335.00	14,010,000
日亜鋼業	11,800	351.00	4,141,800
日本精線	1,300	4,450.00	5,785,000
シンニッタン	12,400	481.00	5,964,400
新家工業	1,800	2,165.00	3,897,000
大紀アルミニウム工業所	13,400	774.00	10,371,600

日本軽金属ホールディングス	236,000	263.00	62,068,000
三井金属鉱業	21,800	5,110.00	111,398,000
東邦亜鉛	4,500	4,415.00	19,867,500
三菱マテリアル	53,300	3,190.00	170,027,000
住友金属鉱山	103,100	4,730.00	487,663,000
DOWAホールディングス	20,400	3,735.00	76,194,000
古河機械金属	13,400	1,692.00	22,672,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,500	1,747.00	14,849,500
東邦チタニウム	14,500	1,036.00	15,022,000
UACJ	12,300	2,601.00	31,992,300
CKサンエツ	1,600	3,750.00	6,000,000
古河電気工業	26,900	4,125.00	110,962,500
住友電気工業	301,700	1,691.00	510,174,700
フジクラ	97,600	773.00	75,444,800
昭和電線ホールディングス	10,000	816.00	8,160,000
東京特殊電線	1,100	2,820.00	3,102,000
タツタ電線	16,000	630.00	10,080,000
カナレ電気	1,400	2,468.00	3,455,200
平河ヒューテック	4,100	1,503.00	6,162,300
リョービ	10,000	3,705.00	37,050,000
アーレスティ	9,900	1,047.00	10,365,300
アサヒホールディングス	13,900	2,094.00	29,106,600
稲葉製作所	4,600	1,445.00	6,647,000
宮地エンジニアリンググループ	2,300	2,186.00	5,027,800
トーカロ	22,400	1,344.00	30,105,600
アルファC o	2,900	1,701.00	4,932,900
SUMCO	74,300	2,584.00	191,991,200
川田テクノロジーズ	1,600	6,980.00	11,168,000
RS Technologies	1,300	6,170.00	8,021,000
東洋製罐グループホールディングス	55,200	1,868.00	103,113,600
ホッカインホールディングス	21,000	376.00	7,896,000
コロナ	4,500	1,251.00	5,629,500
横河ブリッジホールディングス	15,000	2,655.00	39,825,000
駒井ハルテック	1,800	2,422.00	4,359,600
高田機工	700	3,205.00	2,243,500
三和ホールディングス	77,400	1,231.00	95,279,400
文化シャッター	23,700	1,043.00	24,719,100
三協立山	11,200	1,555.00	17,416,000
アルインコ	5,900	1,093.00	6,448,700
東洋シャッター	2,000	684.00	1,368,000
LIXILグループ	118,900	2,433.00	289,283,700
日本フィルコン	6,000	619.00	3,714,000

ノーリツ	18,000	1,929.00	34,722,000
長府製作所	9,100	2,429.00	22,103,900
リンナイ	14,400	10,420.00	150,048,000
ダイニチ工業	4,400	810.00	3,564,000
日東精工	11,100	755.00	8,380,500
三洋工業	1,000	2,159.00	2,159,000
岡部	16,300	1,041.00	16,968,300
ジーテクト	8,900	2,016.00	17,942,400
東プレ	15,100	3,080.00	46,508,000
高周波熱錬	15,400	996.00	15,338,400
東京製綱	5,800	1,937.00	11,234,600
サンコール	4,600	721.00	3,316,600
モリテック スチール	6,200	666.00	4,129,200
パイオラックス	11,900	2,795.00	33,260,500
エイチワン	7,900	1,246.00	9,843,400
日本発條	80,400	1,128.00	90,691,200
中央発條	1,000	3,780.00	3,780,000
アドバネクス	1,300	2,337.00	3,038,100
立川ブラインド工業	3,600	1,416.00	5,097,600
三益半導体工業	6,700	1,911.00	12,803,700
日本ドライケミカル	1,100	2,317.00	2,548,700
日本製鋼所	26,400	3,175.00	83,820,000
三浦工業	35,000	2,779.00	97,265,000
タクマ	27,500	1,317.00	36,217,500
ツガミ	22,000	1,132.00	24,904,000
オークマ	9,400	6,300.00	59,220,000
東芝機械	46,000	595.00	27,370,000
アマダホールディングス	124,700	1,171.00	146,023,700
アイダエンジニアリング	20,600	1,268.00	26,120,800
滝澤鉄工所	2,500	1,897.00	4,742,500
F U J I	24,200	2,232.00	54,014,400
牧野フライス製作所	41,000	948.00	38,868,000
オーエスジー	37,300	2,424.00	90,415,200
ダイジェット工業	1,100	1,812.00	1,993,200
旭ダイヤモンド工業	24,200	886.00	21,441,200
D M G 森精機	44,800	1,783.00	79,878,400
ソディック	17,600	1,128.00	19,852,800
ディスコ	10,900	20,370.00	222,033,000
日東工器	5,000	2,810.00	14,050,000
日進工具	2,100	2,841.00	5,966,100
パンチ工業	6,700	1,285.00	8,609,500
富士ダイス	4,100	889.00	3,644,900

豊和工業	4,700	1,096.00	5,151,200
OKK	3,200	1,286.00	4,115,200
東洋機械金属	6,300	741.00	4,668,300
島精機製作所	10,200	5,940.00	60,588,000
オプトラン	7,900	4,200.00	33,180,000
NCホールディングス	2,500	775.00	1,937,500
フリュー	5,700	1,030.00	5,871,000
ヤマシンフィルタ	12,300	1,223.00	15,042,900
日阪製作所	11,600	1,101.00	12,771,600
やまびこ	15,600	1,467.00	22,885,200
平田機工	3,000	7,690.00	23,070,000
ペガサスミシン製造	7,500	999.00	7,492,500
ナプテスコ	44,400	3,580.00	158,952,000
三井海洋開発	8,600	2,891.00	24,862,600
レオン自動機	7,200	2,307.00	16,610,400
SMC	25,600	41,870.00	1,071,872,000
新川	5,900	994.00	5,864,600
ホソカワミクロン	3,000	7,400.00	22,200,000
ユニオンツール	3,700	3,945.00	14,596,500
オイレス工業	10,400	2,345.00	24,388,000
日精エー・エス・ビー機械	2,600	5,450.00	14,170,000
サトーホールディングス	10,600	3,150.00	33,390,000
技研製作所	5,600	2,648.00	14,828,800
日本エアータック	2,700	888.00	2,397,600
カワタ	1,600	1,801.00	2,881,600
日精樹脂工業	6,900	1,316.00	9,080,400
オカダアイヨン	2,700	1,718.00	4,638,600
ワイエイシイホールディングス	2,600	961.00	2,498,600
小松製作所	393,900	3,528.00	1,389,679,200
住友重機械工業	46,800	3,910.00	182,988,000
日立建機	38,200	3,860.00	147,452,000
日工	2,300	2,627.00	6,042,100
巴工業	3,500	2,265.00	7,927,500
井関農機	8,300	2,058.00	17,081,400
TOWA	6,300	1,313.00	8,271,900
丸山製作所	1,900	1,851.00	3,516,900
北川鉄工所	4,000	2,820.00	11,280,000
ローツェ	4,000	2,496.00	9,984,000
タカキタ	2,700	782.00	2,111,400
クボタ	437,700	1,871.50	819,155,550
荏原実業	2,500	2,403.00	6,007,500
三菱化工機	2,900	2,158.00	6,258,200

月島機械	16,300	1,742.00	28,394,600
帝国電機製作所	5,700	1,447.00	8,247,900
新東工業	19,600	1,078.00	21,128,800
澁谷工業	7,200	3,675.00	26,460,000
アイチ コーポレーション	14,400	738.00	10,627,200
小森コーポレーション	20,700	1,430.00	29,601,000
鶴見製作所	7,000	1,904.00	13,328,000
住友精密工業	13,000	378.00	4,914,000
酒井重工業	1,600	4,260.00	6,816,000
荏原製作所	33,600	3,700.00	124,320,000
石井鐵工所	1,400	2,088.00	2,923,200
西島製作所	8,500	1,084.00	9,214,000
北越工業	9,100	1,176.00	10,701,600
ダイキン工業	111,300	13,335.00	1,484,185,500
オルガノ	3,000	3,110.00	9,330,000
トーヨーカネツ	3,500	4,010.00	14,035,000
栗田工業	44,200	3,155.00	139,451,000
椿本チエイン	49,000	896.00	43,904,000
大同工業	3,300	1,546.00	5,101,800
木村化工機	7,100	452.00	3,209,200
アネスト岩田	13,700	1,119.00	15,330,300
ダイフク	41,600	5,620.00	233,792,000
サムコ	2,200	1,278.00	2,811,600
加藤製作所	4,000	2,969.00	11,876,000
油研工業	1,700	2,818.00	4,790,600
タダノ	39,500	1,511.00	59,684,500
フジテック	26,100	1,442.00	37,636,200
C K D	22,700	2,212.00	50,212,400
キトー	6,200	2,492.00	15,450,400
平和	25,300	2,523.00	63,831,900
理想科学工業	8,100	2,339.00	18,945,900
S A N K Y O	20,400	4,375.00	89,250,000
日本金銭機械	7,500	1,251.00	9,382,500
マースエンジニアリング	5,200	2,708.00	14,081,600
福島工業	5,000	4,765.00	23,825,000
オーイズミ	3,300	587.00	1,937,100
ダイコク電機	3,700	1,884.00	6,970,800
竹内製作所	13,600	2,532.00	34,435,200
アマノ	25,200	2,780.00	70,056,000
J U K I	12,100	1,217.00	14,725,700
サンデンホールディングス	10,000	1,534.00	15,340,000
蛇の目マシン工業	7,400	730.00	5,402,000

マックス	12,500	1,449.00	18,112,500
グローリー	24,300	3,215.00	78,124,500
新晃工業	8,300	2,012.00	16,699,600
大和冷機工業	13,100	1,332.00	17,449,200
セガサミーホールディングス	80,900	1,874.00	151,606,600
日本ピストンリング	3,000	2,340.00	7,020,000
リケン	3,800	5,710.00	21,698,000
T P R	9,100	2,877.00	26,180,700
ツバキ・ナカシマ	8,200	2,732.00	22,402,400
ホシザキ	25,700	11,450.00	294,265,000
大豊工業	6,600	1,398.00	9,226,800
日本精工	167,500	1,232.00	206,360,000
N T N	188,800	472.00	89,113,600
ジェイテクト	86,900	1,613.00	140,169,700
不二越	7,600	5,250.00	39,900,000
日本トムソン	26,000	944.00	24,544,000
T H K	50,800	3,780.00	192,024,000
ユーシン精機	7,200	1,442.00	10,382,400
前澤給装工業	3,200	1,968.00	6,297,600
イーグル工業	10,100	1,860.00	18,786,000
前澤工業	6,000	469.00	2,814,000
日本ピラー工業	8,200	1,634.00	13,398,800
キッツ	35,100	998.00	35,029,800
マキタ	106,400	4,955.00	527,212,000
日立造船	65,000	552.00	35,880,000
三菱重工業	136,800	4,133.00	565,394,400
I H I	62,700	4,020.00	252,054,000
スター精密	13,000	1,853.00	24,089,000
日清紡ホールディングス	49,900	1,312.00	65,468,800
イビデン	50,100	1,824.00	91,382,400
コニカミノルタ	191,300	1,036.00	198,186,800
ブラザー工業	99,800	2,290.00	228,542,000
ミネベアミツミ	151,600	2,008.00	304,412,800
日立製作所	1,959,000	824.80	1,615,783,200
三菱電機	815,700	1,562.50	1,274,531,250
富士電機	246,000	825.00	202,950,000
東洋電機製造	3,300	1,896.00	6,256,800
安川電機	94,600	4,335.00	410,091,000
シンフォニアテクノロジー	53,000	425.00	22,525,000
明電舎	69,000	421.00	29,049,000
オリジン電気	2,400	2,439.00	5,853,600
山洋電気	4,000	8,890.00	35,560,000

デンヨー	7,600	1,978.00	15,032,800
東芝テック	59,000	655.00	38,645,000
芝浦メカトロニクス	13,000	394.00	5,122,000
マブチモーター	22,600	5,190.00	117,294,000
日本電産	98,200	16,940.00	1,663,508,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,100	2,706.00	8,388,600
トレックス・セミコンダクター	2,600	1,528.00	3,972,800
東光高岳	4,300	1,975.00	8,492,500
ダブル・スコープ	12,100	1,781.00	21,550,100
ダイヘン	45,000	762.00	34,290,000
ヤーマン	12,000	2,534.00	30,408,000
JVCケンウッド	60,700	322.00	19,545,400
ミマキエンジニアリング	7,600	900.00	6,840,000
第一精工	4,000	2,190.00	8,760,000
日新電機	19,100	1,161.00	22,175,100
大崎電気工業	17,600	859.00	15,118,400
オムロン	86,700	5,800.00	502,860,000
日東工業	13,100	2,070.00	27,117,000
I D E C	10,100	2,970.00	29,997,000
不二電機工業	1,200	1,433.00	1,719,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	147,000	517.00	75,999,000
サクサホールディングス	2,100	2,330.00	4,893,000
メルコホールディングス	4,000	4,225.00	16,900,000
テクノメディカ	1,800	2,008.00	3,614,400
日本電気	105,600	3,040.00	321,024,000
富士通	839,000	682.40	572,533,600
沖電気工業	33,200	1,256.00	41,699,200
岩崎通信機	3,600	837.00	3,013,200
電気興業	4,700	3,205.00	15,063,500
サンケン電気	48,000	648.00	31,104,000
ナカヨ	1,600	1,857.00	2,971,200
アイホン	4,700	1,827.00	8,586,900
ルネサスエレクトロニクス	42,600	1,140.00	48,564,000
セイコーエプソン	121,500	1,958.00	237,897,000
ワコム	63,900	651.00	41,598,900
アルバック	18,800	4,830.00	90,804,000
アクセル	3,900	926.00	3,611,400
E I Z O	7,500	4,725.00	35,437,500
日本信号	22,600	1,071.00	24,204,600
京三製作所	19,200	831.00	15,955,200
能美防災	10,900	2,582.00	28,143,800
ホーチキ	6,100	2,205.00	13,450,500

星和電機	3,200	594.00	1,900,800
エレコム	7,200	2,757.00	19,850,400
パナソニック	931,900	1,575.50	1,468,208,450
シャープ	75,700	2,898.00	219,378,600
アンリツ	59,500	1,533.00	91,213,500
富士通ゼネラル	25,000	1,725.00	43,125,000
ソニー	546,000	5,509.00	3,007,914,000
T D K	42,700	11,070.00	472,689,000
帝国通信工業	3,800	1,323.00	5,027,400
タムラ製作所	31,600	773.00	24,426,800
アルプス電気	70,400	2,765.00	194,656,000
池上通信機	26,000	154.00	4,004,000
パイオニア	135,500	159.00	21,544,500
日本電波工業	7,800	631.00	4,921,800
鈴木	4,200	1,035.00	4,347,000
日本トリム	1,800	4,700.00	8,460,000
ローランド ディー・ジー・	4,300	2,537.00	10,909,100
フォスター電機	9,600	1,685.00	16,176,000
クラリオン	43,000	285.00	12,255,000
S M K	21,000	427.00	8,967,000
ヨコオ	5,500	2,146.00	11,803,000
ホシデン	20,800	1,066.00	22,172,800
ヒロセ電機	13,800	14,570.00	201,066,000
日本航空電子工業	21,000	1,852.00	38,892,000
T O A	8,700	1,188.00	10,335,600
マクセルホールディングス	16,400	1,844.00	30,241,600
古野電気	10,000	958.00	9,580,000
ユニデンホールディングス	23,000	343.00	7,889,000
アルパイン	19,500	2,102.00	40,989,000
スミダコーポレーション	8,600	1,253.00	10,775,800
アイコム	4,500	2,715.00	12,217,500
リオン	3,600	2,419.00	8,708,400
本多通信工業	6,600	993.00	6,553,800
横河電機	81,700	2,075.00	169,527,500
新電元工業	2,900	6,150.00	17,835,000
アズビル	24,500	5,320.00	130,340,000
東亜ディーケーケー	4,300	1,219.00	5,241,700
日本光電工業	34,200	3,070.00	104,994,000
チノー	2,900	1,766.00	5,121,400
共和電業	9,500	447.00	4,246,500
日本電子材料	3,300	854.00	2,818,200
堀場製作所	16,200	9,160.00	148,392,000

アドバンテスト	45,500	2,502.00	113,841,000
小野測器	3,900	873.00	3,404,700
エスベック	7,400	2,349.00	17,382,600
キーエンス	40,000	67,150.00	2,686,000,000
日置電機	4,300	4,340.00	18,662,000
シスメックス	63,500	10,220.00	648,970,000
日本マイクロニクス	14,100	1,067.00	15,044,700
メガチップス	6,500	3,140.00	20,410,000
O B A R A G R O U P	4,800	6,530.00	31,344,000
澤藤電機	1,100	2,298.00	2,527,800
コーセル	11,600	1,388.00	16,100,800
イリソ電子工業	6,900	7,110.00	49,059,000
新日本無線	4,900	847.00	4,150,300
オブテックスグループ	13,400	3,045.00	40,803,000
千代田インテグレ	4,000	2,354.00	9,416,000
アイ・オー・データ機器	3,700	1,280.00	4,736,000
レーザーテック	16,800	3,595.00	60,396,000
スタンレー電気	62,500	3,960.00	247,500,000
岩崎電気	3,400	1,699.00	5,776,600
ウシオ電機	49,800	1,449.00	72,160,200
岡谷電機産業	6,300	553.00	3,483,900
ヘリオス テクノ ホールディング	7,400	752.00	5,564,800
日本セラミック	8,400	2,969.00	24,939,600
遠藤照明	4,400	971.00	4,272,400
古河電池	6,100	950.00	5,795,000
双信電機	4,200	593.00	2,490,600
山一電機	6,100	1,796.00	10,955,600
図研	5,500	1,816.00	9,988,000
日本電子	30,000	1,154.00	34,620,000
カシオ計算機	65,700	1,704.00	111,952,800
ファナック	77,500	22,790.00	1,766,225,000
日本シイエムケイ	14,900	756.00	11,264,400
エンプラス	3,800	3,335.00	12,673,000
大真空	3,200	1,443.00	4,617,600
ローム	36,600	10,830.00	396,378,000
浜松ホトニクス	58,600	4,655.00	272,783,000
三井ハイテック	11,000	1,388.00	15,268,000
新光電気工業	31,100	993.00	30,882,300
京セラ	133,900	6,514.00	872,224,600
太陽誘電	36,800	2,551.00	93,876,800
村田製作所	85,600	16,660.00	1,426,096,000
ユーシン	12,300	712.00	8,757,600

双葉電子工業	13,500	2,051.00	27,688,500
北陸電気工業	3,500	1,335.00	4,672,500
ニチコン	25,900	1,437.00	37,218,300
日本ケミコン	6,600	4,330.00	28,578,000
K O A	11,400	2,476.00	28,226,400
市光工業	12,400	1,492.00	18,500,800
小糸製作所	48,900	7,910.00	386,799,000
ミツバ	15,400	1,075.00	16,555,000
S C R E E Nホールディングス	15,400	9,090.00	139,986,000
キャノン電子	7,600	2,412.00	18,331,200
キャノン	439,100	3,746.00	1,644,868,600
リコー	245,300	1,007.00	247,017,100
象印マホービン	15,400	1,736.00	26,734,400
M U T O Hホールディングス	1,300	2,423.00	3,149,900
東京エレクトロン	54,400	20,545.00	1,117,648,000
トヨタ紡織	23,800	2,137.00	50,860,600
芦森工業	1,700	2,691.00	4,574,700
ユニプレス	15,800	2,371.00	37,461,800
豊田自動織機	66,000	6,560.00	432,960,000
モリタホールディングス	13,100	2,224.00	29,134,400
三櫻工業	10,400	781.00	8,122,400
デンソー	181,000	5,581.00	1,010,161,000
東海理化電機製作所	21,500	2,150.00	46,225,000
三井E & Sホールディングス	29,500	1,506.00	44,427,000
川崎重工業	63,500	3,460.00	219,710,000
名村造船所	24,400	510.00	12,444,000
日本車輛製造	30,000	285.00	8,550,000
三菱ロジスネクスト	10,000	1,196.00	11,960,000
近畿車輛	1,100	2,557.00	2,812,700
日産自動車	962,000	1,099.50	1,057,719,000
いすゞ自動車	236,300	1,562.50	369,218,750
トヨタ自動車	991,600	7,492.00	7,429,067,200
日野自動車	116,400	1,230.00	143,172,000
三菱自動車工業	301,900	877.00	264,766,300
エフテック	5,300	1,532.00	8,119,600
レシップホールディングス	2,800	880.00	2,464,000
G M B	1,400	1,556.00	2,178,400
ファルテック	1,400	1,262.00	1,766,800
武蔵精密工業	8,700	4,075.00	35,452,500
日産車体	31,800	1,043.00	33,167,400
新明和工業	35,400	1,289.00	45,630,600
極東開発工業	15,200	1,752.00	26,630,400

日信工業	16,600	2,079.00	34,511,400
トピー工業	6,700	3,300.00	22,110,000
ティラド	3,000	3,680.00	11,040,000
曙ブレーキ工業	37,500	230.00	8,625,000
タチエス	13,900	2,012.00	27,966,800
N O K	43,900	2,117.00	92,936,300
フタバ産業	24,900	792.00	19,720,800
K Y B	8,500	5,280.00	44,880,000
大同メタル工業	10,300	1,201.00	12,370,300
プレス工業	43,400	647.00	28,079,800
ミクニ	10,500	622.00	6,531,000
太平洋工業	17,100	1,756.00	30,027,600
ケーヒン	18,800	2,310.00	43,428,000
河西工業	10,000	1,525.00	15,250,000
アイシン精機	67,200	5,600.00	376,320,000
マツダ	256,000	1,409.50	360,832,000
今仙電機製作所	7,500	1,304.00	9,780,000
本田技研工業	734,000	3,575.00	2,624,050,000
スズキ	161,600	6,439.00	1,040,542,400
S U B A R U	253,200	3,403.00	861,639,600
安永	4,000	2,082.00	8,328,000
ヤマハ発動機	115,200	3,070.00	353,664,000
ショーワ	21,200	2,078.00	44,053,600
T B K	9,600	554.00	5,318,400
エクセディ	9,900	3,605.00	35,689,500
豊田合成	29,700	2,957.00	87,822,900
愛三工業	14,300	1,074.00	15,358,200
盟和産業	1,200	1,307.00	1,568,400
日本プラスト	4,500	1,031.00	4,639,500
ヨロズ	8,300	1,795.00	14,898,500
エフ・シー・シー	13,400	3,150.00	42,210,000
シマノ	32,900	16,260.00	534,954,000
テイ・エス テック	19,000	5,040.00	95,760,000
ジャムコ	4,100	2,387.00	9,786,700
テルモ	125,000	6,380.00	797,500,000
クリエートメディック	2,700	1,442.00	3,893,400
日機装	28,200	1,237.00	34,883,400
島津製作所	97,500	3,000.00	292,500,000
J M S	7,600	666.00	5,061,600
長野計器	6,400	1,392.00	8,908,800
ブイ・テクノロジー	1,900	23,380.00	44,422,000
東京計器	5,200	1,292.00	6,718,400

愛知時計電機	1,100	4,115.00	4,526,500
インターアクション	4,300	1,469.00	6,316,700
オーバル	7,700	334.00	2,571,800
東京精密	14,700	4,190.00	61,593,000
マニー	9,900	5,390.00	53,361,000
ニコン	142,100	1,823.00	259,048,300
トプコン	43,800	1,966.00	86,110,800
オリンパス	121,500	4,100.00	498,150,000
理研計器	7,800	2,687.00	20,958,600
タムロン	6,600	2,152.00	14,203,200
H O Y A	164,200	6,563.00	1,077,644,600
シード	1,200	6,950.00	8,340,000
ノーリツ鋼機	8,300	2,012.00	16,699,600
エー・アンド・デイ	7,400	1,174.00	8,687,600
シチズン時計	97,400	749.00	72,952,600
リズム時計工業	3,100	2,424.00	7,514,400
大研医器	7,200	767.00	5,522,400
メニコン	11,200	2,937.00	32,894,400
シンシア	700	653.00	457,100
松風	4,000	1,432.00	5,728,000
セイコーホールディングス	12,600	2,557.00	32,218,200
ニプロ	56,500	1,299.00	73,393,500
中本パックス	2,100	1,783.00	3,744,300
スノーピーク	2,500	1,524.00	3,810,000
パラマウントベッドホールディングス	8,600	5,140.00	44,204,000
トランザクション	4,300	1,016.00	4,368,800
S H O - B I	2,600	444.00	1,154,400
ニホンフラッシュ	3,800	3,275.00	12,445,000
前田工織	9,000	1,979.00	17,811,000
永大産業	10,600	556.00	5,893,600
アートネイチャー	8,600	721.00	6,200,600
バンダイナムコホールディングス	84,300	4,740.00	399,582,000
アイフィスジャパン	1,700	711.00	1,208,700
共立印刷	13,400	384.00	5,145,600
S H O E I	3,900	4,055.00	15,814,500
フランスベッドホールディングス	9,700	984.00	9,544,800
パイロットコーポレーション	14,200	6,240.00	88,608,000
萩原工業	4,500	1,923.00	8,653,500
トッパン・フォームズ	17,500	1,183.00	20,702,500
フジシールインターナショナル	18,300	4,375.00	80,062,500
タカラトミー	34,000	981.00	33,354,000
廣済堂	7,600	541.00	4,111,600

A s - m e エステール	2,300	794.00	1,826,200
アーク	41,400	129.00	5,340,600
タカノ	3,500	970.00	3,395,000
プロネクサス	7,600	1,342.00	10,199,200
ホクシン	5,500	175.00	962,500
ウッドワン	2,700	1,484.00	4,006,800
大建工業	6,400	2,718.00	17,395,200
凸版印刷	230,000	937.00	215,510,000
大日本印刷	106,700	2,496.00	266,323,200
図書印刷	5,500	1,072.00	5,896,000
共同印刷	2,500	3,065.00	7,662,500
N I S S H A	16,700	2,311.00	38,593,700
光村印刷	700	2,326.00	1,628,200
宝印刷	4,300	1,920.00	8,256,000
アシックス	81,000	1,751.00	141,831,000
ツツミ	2,500	1,884.00	4,710,000
小松ウオール工業	2,800	2,233.00	6,252,400
ヤマハ	54,900	6,030.00	331,047,000
河合楽器製作所	2,700	5,860.00	15,822,000
クリナップ	7,500	882.00	6,615,000
ピジョン	49,300	5,210.00	256,853,000
兼松サステック	600	2,015.00	1,209,000
キングジム	6,800	1,113.00	7,568,400
リンテック	19,400	3,295.00	63,923,000
イトーキ	17,200	656.00	11,283,200
任天堂	50,200	41,640.00	2,090,328,000
三菱鉛筆	13,400	2,291.00	30,699,400
タカラスタンダード	16,900	1,858.00	31,400,200
コクヨ	39,100	2,098.00	82,031,800
ナカバヤシ	8,000	725.00	5,800,000
グローブライド	3,600	3,905.00	14,058,000
オカムラ	28,500	1,684.00	47,994,000
美津濃	8,100	4,115.00	33,331,500
東京電力ホールディングス	651,100	514.00	334,665,400
中部電力	249,500	1,683.00	419,908,500
関西電力	332,800	1,584.00	527,155,200
中国電力	112,800	1,441.00	162,544,800
北陸電力	79,900	1,138.00	90,926,200
東北電力	191,000	1,362.00	260,142,000
四国電力	73,400	1,520.00	111,568,000
九州電力	180,100	1,256.00	226,205,600
北海道電力	81,800	769.00	62,904,200

沖縄電力	16,525	2,380.00	39,329,500
電源開発	64,900	2,907.00	188,664,300
エフオン	4,100	1,798.00	7,371,800
イーレックス	12,900	1,160.00	14,964,000
レノバ	4,200	1,505.00	6,321,000
東京瓦斯	174,000	3,018.00	525,132,000
大阪瓦斯	158,300	2,330.00	368,839,000
東邦瓦斯	40,400	3,610.00	145,844,000
北海道瓦斯	22,000	310.00	6,820,000
広島ガス	16,600	388.00	6,440,800
西部瓦斯	9,900	3,020.00	29,898,000
静岡ガス	23,100	1,080.00	24,948,000
メタウォーター	4,600	3,145.00	14,467,000
SBSホールディングス	8,000	1,302.00	10,416,000
東武鉄道	86,000	3,490.00	300,140,000
相鉄ホールディングス	26,100	3,420.00	89,262,000
東京急行電鉄	221,500	1,975.00	437,462,500
京浜急行電鉄	111,700	1,931.00	215,692,700
小田急電鉄	121,300	2,418.00	293,303,400
京王電鉄	45,600	5,360.00	244,416,000
京成電鉄	56,800	3,830.00	217,544,000
富士急行	11,100	3,375.00	37,462,500
新京成電鉄	2,100	2,206.00	4,632,600
東日本旅客鉄道	146,500	10,735.00	1,572,677,500
西日本旅客鉄道	73,600	7,918.00	582,764,800
東海旅客鉄道	73,000	23,210.00	1,694,330,000
西武ホールディングス	104,000	1,912.00	198,848,000
鴻池運輸	11,500	1,717.00	19,745,500
西日本鉄道	22,600	3,070.00	69,382,000
ハマキョウレックス	5,800	3,685.00	21,373,000
サカイ引越センター	4,300	5,960.00	25,628,000
近鉄グループホールディングス	77,300	4,685.00	362,150,500
阪急阪神ホールディングス	103,000	4,600.00	473,800,000
南海電気鉄道	36,600	3,160.00	115,656,000
京阪ホールディングス	34,400	3,955.00	136,052,000
神戸電鉄	1,800	4,035.00	7,263,000
名古屋鉄道	61,500	2,950.00	181,425,000
山陽電気鉄道	5,900	2,772.00	16,354,800
日本通運	30,300	8,530.00	258,459,000
ヤマトホールディングス	135,400	3,293.00	445,872,200
山九	19,800	6,170.00	122,166,000
丸運	4,200	360.00	1,512,000

丸全昭和運輸	27,000	541.00	14,607,000
センコーグループホールディングス	46,500	919.00	42,733,500
トナミホールディングス	1,900	7,360.00	13,984,000
ニッコンホールディングス	29,400	3,070.00	90,258,000
日本石油輸送	900	3,275.00	2,947,500
福山通運	11,300	5,820.00	65,766,000
セイノーホールディングス	57,900	2,072.00	119,968,800
エスライン	2,000	1,144.00	2,288,000
神奈川中央交通	1,900	3,785.00	7,191,500
日立物流	17,000	3,035.00	51,595,000
丸和運輸機関	4,100	4,005.00	16,420,500
C & F ロジホールディングス	8,500	1,408.00	11,968,000
九州旅客鉄道	64,800	3,535.00	229,068,000
S Gホールディングス	73,000	2,332.00	170,236,000
日本郵船	64,800	2,264.00	146,707,200
商船三井	49,100	2,887.00	141,751,700
川崎汽船	35,900	2,210.00	79,339,000
N S ユナイテッド海運	3,900	2,191.00	8,544,900
飯野海運	40,400	514.00	20,765,600
共栄タンカー	900	2,003.00	1,802,700
乾汽船	5,900	1,051.00	6,200,900
日本航空	143,300	4,277.00	612,894,100
A N Aホールディングス	150,000	4,427.00	664,050,000
パスコ	7,000	328.00	2,296,000
トランコム	2,200	8,110.00	17,842,000
日新	6,700	2,493.00	16,703,100
三菱倉庫	26,700	2,379.00	63,519,300
三井倉庫ホールディングス	44,000	362.00	15,928,000
住友倉庫	54,000	711.00	38,394,000
澁澤倉庫	4,200	1,863.00	7,824,600
東陽倉庫	13,900	372.00	5,170,800
日本トランスシティ	18,700	539.00	10,079,300
ケイヒン	1,500	1,679.00	2,518,500
中央倉庫	4,600	1,252.00	5,759,200
川西倉庫	1,600	2,117.00	3,387,200
安田倉庫	6,900	942.00	6,499,800
東洋埠頭	2,400	1,738.00	4,171,200
宇徳	6,600	521.00	3,438,600
上組	47,600	2,479.00	118,000,400
サンリツ	1,900	839.00	1,594,100
キムラユニティー	2,000	1,174.00	2,348,000
キューソー流通システム	2,200	2,781.00	6,118,200

近鉄エクスプレス	14,600	2,377.00	34,704,200
東海運	4,200	386.00	1,621,200
エーアイティー	5,500	1,190.00	6,545,000
内外トランスライン	2,700	1,615.00	4,360,500
日本コンセプト	1,500	1,479.00	2,218,500
NEC ネットエスアイ	8,900	2,602.00	23,157,800
システナ	25,900	1,234.00	31,960,600
デジタルアーツ	4,000	5,800.00	23,200,000
新日鉄住金ソリューションズ	12,200	3,050.00	37,210,000
キューブシステム	4,800	969.00	4,651,200
エイジア	1,700	1,660.00	2,822,000
コア	3,500	1,464.00	5,124,000
ソリトンシステムズ	3,700	1,201.00	4,443,700
ソフトクリエイティブホールディングス	4,000	1,713.00	6,852,000
T I S	26,700	5,280.00	140,976,000
ネオス	2,600	422.00	1,097,200
電算システム	2,900	2,179.00	6,319,100
グリー	43,000	631.00	27,133,000
コーエーテクモホールディングス	13,700	2,250.00	30,825,000
三菱総合研究所	3,400	4,930.00	16,762,000
電算	1,000	2,251.00	2,251,000
A G S	4,700	876.00	4,117,200
ファインデックス	6,900	851.00	5,871,900
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	2,164.00	4,111,600
ブレインパッド	1,800	3,035.00	5,463,000
K L a b	15,200	1,616.00	24,563,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	2,315.00	13,658,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,300	1,267.00	1,647,100
ネクソン	180,300	1,761.00	317,508,300
アイスタイル	20,500	1,335.00	27,367,500
エムアップ	2,800	1,410.00	3,948,000
エイチーム	5,400	2,592.00	13,996,800
テクノスジャパン	7,300	1,053.00	7,686,900
コロプラ	25,400	762.00	19,354,800
モバイルクリエイティブ	6,900	338.00	2,332,200
ブロードリーフ	39,800	610.00	24,278,000
クロス・マーケティンググループ	2,400	713.00	1,711,200
ハーツユナイテッドグループ	4,400	1,668.00	7,339,200
メディアドゥホールディングス	2,700	2,324.00	6,274,800
サイバーリンクス	1,300	1,181.00	1,535,300
フィックスターズ	7,800	1,623.00	12,659,400
VOYAGE GROUP	4,400	1,242.00	5,464,800

オブティム	1,500	2,663.00	3,994,500
セレス	2,600	1,995.00	5,187,000
ベリサーブ	1,100	3,340.00	3,674,000
ティーガイア	8,100	3,060.00	24,786,000
セック	1,100	2,930.00	3,223,000
日本アジアグループ	8,400	518.00	4,351,200
豆蔵ホールディングス	6,000	1,083.00	6,498,000
テクマトリックス	4,500	2,378.00	10,701,000
プロシップ	1,200	2,746.00	3,295,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	217,600	303.00	65,932,800
GMOペイメントゲートウェイ	6,600	11,100.00	73,260,000
ザッパラス	4,100	375.00	1,537,500
システムリサーチ	1,100	2,888.00	3,176,800
インターネットイニシアティブ	13,100	2,383.00	31,217,300
さくらインターネット	9,800	879.00	8,614,200
ヴィンクス	2,300	1,247.00	2,868,100
GMOクラウド	1,800	3,215.00	5,787,000
SRAホールディングス	4,300	3,105.00	13,351,500
Minor iソリューションズ	1,700	1,625.00	2,762,500
朝日ネット	7,500	540.00	4,050,000
eBASE	2,200	1,563.00	3,438,600
アバント	2,200	959.00	2,109,800
アドソル日進	3,200	1,858.00	5,945,600
フリービット	5,600	1,391.00	7,789,600
コムチュア	4,100	3,130.00	12,833,000
サイバーコム	1,500	2,131.00	3,196,500
インフォテリア	4,000	1,242.00	4,968,000
メディカル・データ・ビジョン	6,200	1,579.00	9,789,800
gumi	9,400	836.00	7,858,400
ショーケース・ティービー	1,600	1,363.00	2,180,800
モバイルファクトリー	2,100	1,731.00	3,635,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,289.00	4,640,400
PCIホールディングス	1,500	3,455.00	5,182,500
パイプドHD	1,300	1,049.00	1,363,700
アイビーシー	1,400	1,685.00	2,359,000
ネオジャパン	2,000	1,624.00	3,248,000
オープンドア	3,300	1,986.00	6,553,800
マイネット	2,200	1,196.00	2,631,200
アカツキ	2,100	4,555.00	9,565,500
ベネフィットジャパン	500	1,322.00	661,000
Ubicomホールディングス	1,300	1,075.00	1,397,500
LINE	24,200	4,100.00	99,220,000

シンクロ・フード	2,900	886.00	2,569,400
オークネット	3,500	1,449.00	5,071,500
AOI TYO Holdings	6,600	1,377.00	9,088,200
マクロミル	10,100	2,414.00	24,381,400
ビーグリー	1,900	1,601.00	3,041,900
オロ	800	3,695.00	2,956,000
ソルクシーズ	3,200	1,548.00	4,953,600
フェイス	2,800	1,371.00	3,838,800
ハイマックス	1,200	1,865.00	2,238,000
野村総合研究所	50,900	5,690.00	289,621,000
サイバネットシステム	6,700	927.00	6,210,900
CEホールディングス	2,300	827.00	1,902,100
日本システム技術	1,400	1,368.00	1,915,200
インテージホールディングス	9,600	1,150.00	11,040,000
東邦システムサイエンス	2,900	869.00	2,520,100
ソースネクスト	11,500	795.00	9,142,500
フォーカスシステムズ	4,700	855.00	4,018,500
クレスコ	1,900	3,415.00	6,488,500
フジ・メディア・ホールディングス	83,900	1,850.00	155,215,000
オービック	25,200	9,650.00	243,180,000
ジャストシステム	13,100	2,469.00	32,343,900
TDCソフト	3,600	1,711.00	6,159,600
ヤフー	577,600	385.00	222,376,000
トレンドマイクロ	39,100	6,400.00	250,240,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,600	1,478.00	3,842,800
日本オラクル	13,000	8,600.00	111,800,000
アルファシステムズ	2,700	2,289.00	6,180,300
フューチャー	11,000	1,469.00	16,159,000
CAC Holdings	6,100	1,100.00	6,710,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,500	1,736.00	6,076,000
トーセ	2,200	1,203.00	2,646,600
オービックビジネスコンサルタント	4,100	8,330.00	34,153,000
伊藤忠テクノソリューションズ	36,600	2,000.00	73,200,000
アイティフォー	9,800	1,320.00	12,936,000
東計電算	1,500	3,200.00	4,800,000
エックスネット	1,400	923.00	1,292,200
大塚商会	48,200	4,590.00	221,238,000
サイボウズ	10,800	553.00	5,972,400
ソフトブレーン	6,600	586.00	3,867,600
電通国際情報サービス	5,000	3,550.00	17,750,000
デジタルガレージ	14,400	4,585.00	66,024,000
EMシステムズ	5,600	1,094.00	6,126,400

ウェザーニューズ	2,800	3,440.00	9,632,000
C I J	6,400	714.00	4,569,600
東洋ビジネスエンジニアリング	900	1,955.00	1,759,500
日本エンタープライズ	9,100	225.00	2,047,500
WOWOW	3,900	3,390.00	13,221,000
スカラ	6,600	892.00	5,887,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,000	1,046.00	7,322,000
ネットワンシステムズ	32,800	1,853.00	60,778,400
システムソフト	20,000	146.00	2,920,000
アルゴグラフィックス	3,700	3,760.00	13,912,000
マーベラス	13,800	934.00	12,889,200
エイベックス	15,000	1,525.00	22,875,000
日本ユニシス	22,300	2,709.00	60,410,700
兼松エレクトロニクス	5,100	3,670.00	18,717,000
東京放送ホールディングス	44,300	2,389.00	105,832,700
日本テレビホールディングス	73,600	1,842.00	135,571,200
朝日放送グループホールディングス	8,200	860.00	7,052,000
テレビ朝日ホールディングス	22,100	2,472.00	54,631,200
スカパーJ S A Tホールディングス	61,500	513.00	31,549,500
テレビ東京ホールディングス	6,600	3,200.00	21,120,000
日本BS放送	2,800	1,453.00	4,068,400
ビジョン	2,100	3,550.00	7,455,000
ワイヤレスゲート	3,900	1,557.00	6,072,300
コネクシオ	5,800	2,074.00	12,029,200
クロップス	1,800	906.00	1,630,800
日本電信電話	574,400	5,174.00	2,971,945,600
K D D I	720,800	3,011.00	2,170,328,800
光通信	9,700	20,010.00	194,097,000
N T T ドコモ	574,800	2,848.00	1,637,030,400
エムティーアイ	10,500	661.00	6,940,500
G M O インターネット	29,200	2,816.00	82,227,200
アйдママーケティングコミュニケーション	1,900	782.00	1,485,800
カドカワ	23,500	1,225.00	28,787,500
学研ホールディングス	2,700	5,560.00	15,012,000
ゼンリン	14,600	2,599.00	37,945,400
昭文社	3,900	822.00	3,205,800
インプレスホールディングス	6,400	187.00	1,196,800
アイネット	4,600	1,815.00	8,349,000
松竹	5,300	15,930.00	84,429,000
東宝	52,700	3,630.00	191,301,000
東映	3,000	11,660.00	34,980,000
エヌ・ティ・ティ・データ	248,800	1,278.00	317,966,400

ピー・シー・エー	1,300	1,808.00	2,350,400
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	2,338.00	3,507,000
D T S	8,300	4,510.00	37,433,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,200	5,290.00	196,788,000
シーイーシー	4,800	4,535.00	21,768,000
カプコン	34,400	2,525.00	86,860,000
アイ・エス・ビー	1,700	1,932.00	3,284,400
ジャステック	4,800	1,187.00	5,697,600
S C S K	18,500	5,360.00	99,160,000
日本システムウエア	2,700	2,441.00	6,590,700
アイネス	10,300	1,152.00	11,865,600
T K C	7,200	4,425.00	31,860,000
富士ソフト	11,100	4,695.00	52,114,500
N S D	13,200	2,476.00	32,683,200
コナミホールディングス	32,700	5,360.00	175,272,000
福井コンピュータホールディングス	2,400	1,960.00	4,704,000
J B C Cホールディングス	6,400	1,207.00	7,724,800
ミロク情報サービス	7,100	3,050.00	21,655,000
ソフトバンクグループ	362,400	8,143.00	2,951,023,200
ハウスイ	600	1,179.00	707,400
高千穂交易	3,000	1,212.00	3,636,000
伊藤忠食品	2,000	6,180.00	12,360,000
エレマテック	3,800	2,643.00	10,043,400
J A L U X	2,300	3,095.00	7,118,500
あらた	4,000	7,150.00	28,600,000
トーメンデバイス	1,200	2,892.00	3,470,400
東京エレクトロン デバイス	2,900	2,066.00	5,991,400
フィールズ	6,100	937.00	5,715,700
双日	475,400	399.00	189,684,600
アルフレッサ ホールディングス	89,300	2,735.00	244,235,500
横浜冷凍	20,500	1,049.00	21,504,500
神栄	1,100	1,450.00	1,595,000
ラサ商事	3,600	966.00	3,477,600
ラクーン	4,800	628.00	3,014,400
アルコニックス	8,500	1,840.00	15,640,000
神戸物産	5,200	5,470.00	28,444,000
ペッパーフードサービス	5,800	5,160.00	29,928,000
あい ホールディングス	12,900	2,612.00	33,694,800
ディーブイエックス	2,900	1,388.00	4,025,200
ダイワボウホールディングス	6,800	6,510.00	44,268,000
マクニカ・富士エレホールディングス	15,400	1,919.00	29,552,600
ラクト・ジャパン	1,500	5,420.00	8,130,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,000	1,135.00	17,025,000
八洲電機	6,200	952.00	5,902,400
メディアスホールディングス	4,500	1,118.00	5,031,000
U K C ホールディングス	5,200	2,261.00	11,757,200
ジューテックホールディングス	1,800	1,170.00	2,106,000
大光	2,000	794.00	1,588,000
O C H I ホールディングス	2,300	1,503.00	3,456,900
T O K A I ホールディングス	42,500	1,147.00	48,747,500
C o m i n i x	1,200	938.00	1,125,600
三洋貿易	4,300	2,229.00	9,584,700
ビューティガレージ	1,100	2,372.00	2,609,200
ウイン・パートナーズ	5,800	1,447.00	8,392,600
ミタチ産業	1,800	1,012.00	1,821,600
シップヘルスケアホールディングス	16,700	4,220.00	70,474,000
明治電機工業	2,800	2,097.00	5,871,600
デリカフーズホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000
スターティアホールディングス	1,800	746.00	1,342,800
コメダホールディングス	14,900	2,165.00	32,258,500
富士興産	3,000	629.00	1,887,000
協栄産業	1,000	2,103.00	2,103,000
小野建	7,100	2,016.00	14,313,600
佐島電機	5,900	1,067.00	6,295,300
エコトレーディング	1,800	723.00	1,301,400
伯東	4,900	1,779.00	8,717,100
コンドーテック	6,400	1,049.00	6,713,600
中山福	4,600	739.00	3,399,400
ナガイレーベン	11,600	2,995.00	34,742,000
三菱食品	8,800	3,000.00	26,400,000
松田産業	5,900	1,701.00	10,035,900
第一興商	12,000	5,140.00	61,680,000
メディバルホールディングス	80,500	2,462.00	198,191,000
S P K	1,700	2,822.00	4,797,400
萩原電気ホールディングス	2,900	3,190.00	9,251,000
アズワン	6,300	8,260.00	52,038,000
スズデン	2,800	1,654.00	4,631,200
尾家産業	2,400	1,401.00	3,362,400
シモジマ	4,800	1,148.00	5,510,400
ドウシシャ	8,500	2,518.00	21,403,000
小津産業	1,800	2,167.00	3,900,600
高速	4,800	1,347.00	6,465,600
たけびし	2,800	1,748.00	4,894,400
リックス	1,800	2,062.00	3,711,600

丸文	7,100	919.00	6,524,900
ハビネット	5,500	1,454.00	7,997,000
橋本総業ホールディングス	1,700	1,853.00	3,150,100
日本ライフライン	22,900	2,720.00	62,288,000
エクセル	2,900	2,522.00	7,313,800
マルカキカイ	2,600	2,007.00	5,218,200
I D O M	24,400	727.00	17,738,800
日本エム・ディ・エム	5,400	1,118.00	6,037,200
進和	4,800	2,596.00	12,460,800
エスケイジャパン	1,900	500.00	950,000
ダイトロン	3,700	2,623.00	9,705,100
シークス	10,200	2,163.00	22,062,600
田中商事	2,400	725.00	1,740,000
オーハシテクニカ	4,500	1,857.00	8,356,500
白銅	2,900	2,289.00	6,638,100
伊藤忠商事	589,600	2,161.00	1,274,125,600
丸紅	660,200	880.40	581,240,080
高島	1,400	2,195.00	3,073,000
長瀬産業	48,400	1,877.00	90,846,800
蝶理	5,100	2,017.00	10,286,700
豊田通商	89,700	3,985.00	357,454,500
三共生興	13,600	483.00	6,568,800
兼松	34,200	1,669.00	57,079,800
ツカモトコーポレーション	1,400	1,263.00	1,768,200
三井物産	661,800	1,971.00	1,304,407,800
日本紙パルプ商事	4,200	5,260.00	22,092,000
日立ハイテクノロジーズ	27,900	4,955.00	138,244,500
カメイ	10,500	1,803.00	18,931,500
東都水産	1,200	1,882.00	2,258,400
O U Gホールディングス	1,300	2,719.00	3,534,700
スターゼン	3,100	6,600.00	20,460,000
山善	31,300	1,171.00	36,652,300
椿本興業	1,800	4,360.00	7,848,000
住友商事	506,700	1,911.50	968,557,050
内田洋行	3,700	3,320.00	12,284,000
三菱商事	563,700	3,186.00	1,795,948,200
第一実業	3,700	3,515.00	13,005,500
キャノンマーケティングジャパン	23,000	2,382.00	54,786,000
西華産業	4,900	2,749.00	13,470,100
佐藤商事	7,200	1,308.00	9,417,600
菱洋エレクトロ	7,500	1,860.00	13,950,000
東京産業	8,000	622.00	4,976,000

ユアサ商事	7,600	3,815.00	28,994,000
神鋼商事	1,800	3,095.00	5,571,000
小林産業	5,200	354.00	1,840,800
阪和興業	15,000	4,545.00	68,175,000
正栄食品工業	4,400	4,445.00	19,558,000
カナデン	7,700	1,474.00	11,349,800
菱電商事	5,800	1,862.00	10,799,600
フルサト工業	4,400	1,834.00	8,069,600
岩谷産業	17,800	3,940.00	70,132,000
すてきナイスグループ	3,400	1,366.00	4,644,400
昭光通商	28,000	111.00	3,108,000
ニチモウ	1,300	1,718.00	2,233,400
極東貿易	12,000	471.00	5,652,000
イワキ	11,400	448.00	5,107,200
三愛石油	21,600	1,577.00	34,063,200
稲畑産業	19,300	1,667.00	32,173,100
G S I クレオス	2,100	1,632.00	3,427,200
明和産業	7,400	510.00	3,774,000
ワキタ	17,000	1,232.00	20,944,000
東邦ホールディングス	23,800	2,769.00	65,902,200
サンゲツ	26,800	2,317.00	62,095,600
ミツウロコグループホールディングス	11,700	922.00	10,787,400
シナネンホールディングス	3,600	2,744.00	9,878,400
伊藤忠エネクス	17,800	1,124.00	20,007,200
サンリオ	22,600	2,102.00	47,505,200
サンワテクノス	5,200	1,629.00	8,470,800
リョーサン	10,100	3,975.00	40,147,500
新光商事	8,800	1,769.00	15,567,200
トーヨー	3,600	2,681.00	9,651,600
三信電気	7,400	2,152.00	15,924,800
東陽テクニカ	9,200	924.00	8,500,800
モスフードサービス	10,500	3,370.00	35,385,000
加賀電子	7,300	2,785.00	20,330,500
ソーダニッカ	8,300	719.00	5,967,700
立花エレテック	5,400	2,189.00	11,820,600
フォーバル	3,400	902.00	3,066,800
P A L T A C	11,300	6,380.00	72,094,000
三谷産業	8,400	363.00	3,049,200
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,200	5,370.00	11,814,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,508.00	1,055,600
ヤマタネ	4,000	2,209.00	8,836,000
丸紅建材リース	8,000	245.00	1,960,000

日鉄住金物産	6,300	5,810.00	36,603,000
泉州電業	2,700	3,395.00	9,166,500
トラスコ中山	16,700	2,863.00	47,812,100
オートバックスセブン	31,900	2,000.00	63,800,000
モリト	6,400	1,024.00	6,553,600
加藤産業	12,600	3,930.00	49,518,000
イノテック	6,900	1,417.00	9,777,300
イエローハット	7,600	3,405.00	25,878,000
J Kホールディングス	8,000	899.00	7,192,000
日伝	6,700	2,168.00	14,525,600
北沢産業	6,400	274.00	1,753,600
杉本商事	4,300	2,025.00	8,707,500
因幡電機産業	10,600	4,940.00	52,364,000
バイテックホールディングス	3,600	2,537.00	9,133,200
東テク	2,700	2,779.00	7,503,300
ミスミグループ本社	93,300	3,260.00	304,158,000
アルテック	6,600	338.00	2,230,800
タキヒヨー	2,700	2,395.00	6,466,500
蔵王産業	1,300	1,743.00	2,265,900
スズケン	36,600	4,865.00	178,059,000
ジェコス	5,600	1,091.00	6,109,600
ルネサスイーストン	7,400	603.00	4,462,200
ローソン	20,300	6,940.00	140,882,000
サンエー	6,100	5,710.00	34,831,000
カワチ薬品	6,300	2,453.00	15,453,900
エービーシー・マート	14,600	6,350.00	92,710,000
ハードオフコーポレーション	3,600	1,088.00	3,916,800
アスクル	7,000	3,305.00	23,135,000
ゲオホールディングス	14,800	1,521.00	22,510,800
アダストリア	12,400	1,452.00	18,004,800
ジーフット	4,900	792.00	3,880,800
くらコーポレーション	4,700	7,850.00	36,895,000
キャンドゥ	3,900	1,820.00	7,098,000
パルグループホールディングス	4,100	2,832.00	11,611,200
エディオン	31,300	1,143.00	35,775,900
サーラコーポレーション	14,000	704.00	9,856,000
ワッツ	3,200	1,118.00	3,577,600
ハローズ	3,100	2,709.00	8,397,900
あみやき亭	1,800	5,160.00	9,288,000
ひらまつ	11,200	517.00	5,790,400
大黒天物産	1,900	5,550.00	10,545,000
ハニーズホールディングス	7,900	1,022.00	8,073,800

ファーマライズホールディングス	2,000	685.00	1,370,000
アルペン	6,200	2,461.00	15,258,200
ハブ	2,100	1,175.00	2,467,500
クオール	8,900	2,363.00	21,030,700
ジーンズ	5,500	6,120.00	33,660,000
ビックカメラ	42,800	1,713.00	73,316,400
D C Mホールディングス	43,300	1,073.00	46,460,900
M o n o t a R O	28,600	4,470.00	127,842,000
東京一番フーズ	2,100	672.00	1,411,200
D Dホールディングス	1,800	2,877.00	5,178,600
きちり	2,300	920.00	2,116,000
アークランドサービスホールディングス	6,800	2,522.00	17,149,600
J . フロント リテイリング	96,000	1,774.00	170,304,000
ドトール・日レスホールディングス	14,100	2,240.00	31,584,000
マツモトキヨシホールディングス	33,200	5,220.00	173,304,000
ブロンコビリー	4,200	4,710.00	19,782,000
スタートトゥデイ	78,900	4,255.00	335,719,500
トレジャー・ファクトリー	2,500	751.00	1,877,500
物語コーポレーション	2,300	11,530.00	26,519,000
ココカラファイン	8,400	7,630.00	64,092,000
三越伊勢丹ホールディングス	150,300	1,406.00	211,321,800
H a m e e	2,300	1,733.00	3,985,900
ウエルシアホールディングス	21,200	5,880.00	124,656,000
クリエイティブSDホールディングス	11,900	3,300.00	39,270,000
丸善C H Iホールディングス	9,400	364.00	3,421,600
ティーライフ	1,200	1,377.00	1,652,400
エー・ピーカンパニー	1,700	708.00	1,203,600
チムニー	2,500	2,950.00	7,375,000
シュッピン	4,900	1,530.00	7,497,000
ネクステージ	8,700	1,252.00	10,892,400
ジョイフル本田	11,800	3,765.00	44,427,000
鳥貴族	2,900	2,772.00	8,038,800
麒麟堂ホールディングス	2,900	2,905.00	8,424,500
ホットランド	4,800	1,396.00	6,700,800
すかいらーく	50,000	1,688.00	84,400,000
綿半ホールディングス	3,000	3,450.00	10,350,000
ヨシックス	1,300	4,055.00	5,271,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	26,700	1,454.00	38,821,800
ブックオフコーポレーション	4,600	822.00	3,781,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,300	1,293.00	4,266,900
B E E N O S	2,000	1,743.00	3,486,000
あさひ	6,100	1,423.00	8,680,300

日本調剤	2,900	2,966.00	8,601,400
コスモス薬品	4,100	22,820.00	93,562,000
トーエル	3,900	1,016.00	3,962,400
一六堂	2,000	413.00	826,000
オンリー	1,500	971.00	1,456,500
セブン&アイ・ホールディングス	336,700	5,053.00	1,701,345,100
薬王堂	3,500	3,830.00	13,405,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	21,600	1,544.00	33,350,400
ツルハホールディングス	17,400	15,920.00	277,008,000
サンマルクホールディングス	5,800	2,849.00	16,524,200
フェリシモ	2,100	1,387.00	2,912,700
トリドールホールディングス	9,900	2,978.00	29,482,200
TOKYO BASE	7,300	978.00	7,139,400
ウイルプラスホールディングス	900	1,202.00	1,081,800
サツドラホールディングス	1,400	2,321.00	3,249,400
ダイユー・リックホールディングス	3,800	1,177.00	4,472,600
パロックジャパンリミテッド	6,600	1,068.00	7,048,800
クスリのアオキホールディングス	6,400	7,810.00	49,984,000
力の源ホールディングス	1,900	1,681.00	3,193,900
スシログローバルホールディングス	8,800	6,810.00	59,928,000
LIXILピバ	10,200	1,904.00	19,420,800
メディカルシステムネットワーク	9,500	517.00	4,911,500
総合メディカル	7,000	2,531.00	17,717,000
はるやまホールディングス	3,800	1,024.00	3,891,200
ノジマ	14,200	2,669.00	37,899,800
カッパ・クリエイト	10,000	1,459.00	14,590,000
ライトオン	6,900	1,015.00	7,003,500
良品計画	10,700	39,200.00	419,440,000
三城ホールディングス	10,200	503.00	5,130,600
アドヴァン	8,300	988.00	8,200,400
アルビス	2,600	3,360.00	8,736,000
コナカ	10,400	541.00	5,626,400
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,795.00	1,974,500
G-7ホールディングス	2,400	3,025.00	7,260,000
イオン北海道	8,100	809.00	6,552,900
コジマ	13,700	537.00	7,356,900
ヒマラヤ	2,600	1,157.00	3,008,200
コーナン商事	11,400	2,710.00	30,894,000
エコス	3,300	1,726.00	5,695,800
ワタミ	9,600	1,449.00	13,910,400
マルシェ	2,200	818.00	1,799,600
ドンキホーテホールディングス	52,100	5,850.00	304,785,000

西松屋チェーン	17,600	1,210.00	21,296,000
ゼンショーホールディングス	41,700	2,776.00	115,759,200
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,762.00	8,810,000
ハークスレイ	2,000	1,089.00	2,178,000
サイゼリヤ	13,300	2,546.00	33,861,800
V Tホールディングス	27,400	556.00	15,234,400
魚力	2,300	1,435.00	3,300,500
ポプラ	2,000	891.00	1,782,000
フジ・コーポレーション	1,500	2,705.00	4,057,500
ユナイテッドアローズ	10,000	4,040.00	40,400,000
ハイデイ日高	10,600	2,684.00	28,450,400
京都きもの友禅	5,200	662.00	3,442,400
コロワイド	26,700	3,060.00	81,702,000
ピーシーデポコーポレーション	12,000	594.00	7,128,000
壱番屋	5,700	5,040.00	28,728,000
トップカルチャー	3,100	406.00	1,258,600
P L A N T	1,900	1,338.00	2,542,200
スギホールディングス	17,700	6,560.00	116,112,000
ヴィア・ホールディングス	9,600	715.00	6,864,000
スクロール	12,500	625.00	7,812,500
ヨンドシーホールディングス	8,200	2,803.00	22,984,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	25,700	12,180.00	313,026,000
木曽路	9,900	2,870.00	28,413,000
S R Sホールディングス	9,500	1,003.00	9,528,500
タカキュー	6,700	219.00	1,467,300
ケーヨー	14,800	562.00	8,317,600
上新電機	9,500	3,910.00	37,145,000
日本瓦斯	14,800	6,100.00	90,280,000
ロイヤルホールディングス	14,300	2,951.00	42,199,300
いなげや	9,000	1,817.00	16,353,000
島忠	18,200	3,410.00	62,062,000
チヨダ	9,500	2,633.00	25,013,500
ライフコーポレーション	6,100	2,829.00	17,256,900
リンガーハット	9,900	2,659.00	26,324,100
M r M a x H D	10,100	699.00	7,059,900
テンアライド	7,400	467.00	3,455,800
A O K Iホールディングス	16,100	1,703.00	27,418,300
オークワ	12,000	1,153.00	13,836,000
コメリ	12,400	2,847.00	35,302,800
青山商事	15,500	3,910.00	60,605,000
しまむら	9,400	11,250.00	105,750,000
はせがわ	4,400	493.00	2,169,200

高島屋	126,000	915.00	115,290,000
松屋	16,200	1,622.00	26,276,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	38,100	1,848.00	70,408,800
近鉄百貨店	3,100	4,095.00	12,694,500
パルコ	7,800	1,380.00	10,764,000
丸井グループ	77,000	2,352.00	181,104,000
アクシアル リテイリング	6,700	4,185.00	28,039,500
イオン	309,200	2,403.00	743,007,600
イズミ	14,500	6,940.00	100,630,000
東武ストア	1,000	3,080.00	3,080,000
平和堂	16,300	2,674.00	43,586,200
フジ	9,600	2,318.00	22,252,800
ヤオコー	9,100	6,010.00	54,691,000
ゼビオホールディングス	11,000	1,871.00	20,581,000
ケーズホールディングス	70,600	1,216.00	85,849,600
Olympicグループ	4,800	619.00	2,971,200
日産東京販売ホールディングス	12,200	375.00	4,575,000
Genky DrugStores	3,300	4,610.00	15,213,000
アインホールディングス	10,800	7,750.00	83,700,000
元気寿司	2,100	3,515.00	7,381,500
ヤマダ電機	269,400	552.00	148,708,800
アークランドサカモト	13,700	1,675.00	22,947,500
ニトリホールディングス	31,900	18,940.00	604,186,000
グルメ杵屋	6,000	1,210.00	7,260,000
愛眼	6,400	471.00	3,014,400
ケーユーホールディングス	4,200	979.00	4,111,800
吉野家ホールディングス	26,400	2,195.00	57,948,000
松屋フーズ	3,900	3,750.00	14,625,000
サガミチェーン	10,800	1,415.00	15,282,000
関西スーパーマーケット	6,200	1,222.00	7,576,400
王将フードサービス	5,900	6,170.00	36,403,000
プレナス	9,100	1,864.00	16,962,400
ミニストップ	6,000	2,307.00	13,842,000
アークス	15,100	2,987.00	45,103,700
バローホールディングス	18,700	2,638.00	49,330,600
藤久	700	1,571.00	1,099,700
ベルク	3,600	5,850.00	21,060,000
大庄	4,400	1,773.00	7,801,200
ファーストリテイリング	10,700	50,270.00	537,889,000
サンドラッグ	34,000	4,920.00	167,280,000
サックスパー ホールディングス	7,700	1,024.00	7,884,800
ヤマザワ	1,700	1,835.00	3,119,500

やまや	1,700	3,315.00	5,635,500
ペルーナ	19,800	1,484.00	29,383,200
島根銀行	1,600	1,234.00	1,974,400
じもとホールディングス	53,800	182.00	9,791,600
めぶきフィナンシャルグループ	418,000	396.00	165,528,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,900	2,542.00	27,707,800
九州フィナンシャルグループ	132,000	542.00	71,544,000
ゆうちょ銀行	227,900	1,352.00	308,120,800
富山第一銀行	20,500	499.00	10,229,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	480,400	631.00	303,132,400
西日本フィナンシャルホールディングス	52,800	1,322.00	69,801,600
関西みらいフィナンシャルグループ	35,100	912.00	32,011,200
三十三フィナンシャルグループ	6,800	2,276.00	15,476,800
新生銀行	69,600	1,746.00	121,521,600
あおぞら銀行	47,900	4,360.00	208,844,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,632,100	676.70	3,811,242,070
りそなホールディングス	882,800	634.20	559,871,760
三井住友トラスト・ホールディングス	158,200	4,608.00	728,985,600
三井住友フィナンシャルグループ	608,900	4,542.00	2,765,623,800
第四銀行	9,900	4,785.00	47,371,500
北越銀行	8,100	2,393.00	19,383,300
千葉銀行	284,900	849.00	241,880,100
群馬銀行	163,400	632.00	103,268,800
武蔵野銀行	12,800	3,620.00	46,336,000
千葉興業銀行	22,000	516.00	11,352,000
筑波銀行	33,400	299.00	9,986,600
七十七銀行	25,200	2,495.00	62,874,000
青森銀行	6,200	3,395.00	21,049,000
秋田銀行	5,200	3,115.00	16,198,000
山形銀行	9,000	2,480.00	22,320,000
岩手銀行	5,600	4,470.00	25,032,000
東邦銀行	71,700	430.00	30,831,000
東北銀行	4,100	1,399.00	5,735,900
みちのく銀行	5,200	1,767.00	9,188,400
ふくおかフィナンシャルグループ	327,000	602.00	196,854,000
静岡銀行	212,400	1,091.00	231,728,400
十六銀行	10,800	3,025.00	32,670,000
スルガ銀行	82,300	1,055.00	86,826,500
八十二銀行	145,600	516.00	75,129,600
山梨中央銀行	50,000	463.00	23,150,000
大垣共立銀行	12,700	2,924.00	37,134,800
福井銀行	6,900	2,415.00	16,663,500

北國銀行	9,100	4,755.00	43,270,500
清水銀行	2,700	2,180.00	5,886,000
富山銀行	1,600	4,365.00	6,984,000
滋賀銀行	76,000	592.00	44,992,000
南都銀行	9,400	2,851.00	26,799,400
百五銀行	77,000	477.00	36,729,000
京都銀行	30,700	5,740.00	176,218,000
紀陽銀行	30,300	1,923.00	58,266,900
ほくほくフィナンシャルグループ	53,600	1,583.00	84,848,800
広島銀行	118,800	799.00	94,921,200
山陰合同銀行	47,600	1,024.00	48,742,400
中国銀行	55,500	1,254.00	69,597,000
鳥取銀行	2,600	1,721.00	4,474,600
伊予銀行	114,800	787.00	90,347,600
百十四銀行	85,000	378.00	32,130,000
四国銀行	12,300	1,454.00	17,884,200
阿波銀行	64,000	741.00	47,424,000
大分銀行	4,600	3,955.00	18,193,000
宮崎銀行	5,400	3,640.00	19,656,000
佐賀銀行	4,900	2,478.00	12,142,200
十八銀行	49,000	304.00	14,896,000
沖縄銀行	7,800	4,405.00	34,359,000
琉球銀行	15,600	1,733.00	27,034,800
セブン銀行	301,700	355.00	107,103,500
みずほフィナンシャルグループ	10,930,400	193.50	2,115,032,400
高知銀行	2,800	1,277.00	3,575,600
山口フィナンシャルグループ	100,000	1,350.00	135,000,000
長野銀行	2,600	1,825.00	4,745,000
名古屋銀行	6,500	3,980.00	25,870,000
北洋銀行	121,300	388.00	47,064,400
愛知銀行	2,700	5,240.00	14,148,000
中京銀行	3,300	2,339.00	7,718,700
大光銀行	2,800	2,283.00	6,392,400
愛媛銀行	11,100	1,275.00	14,152,500
トマト銀行	3,100	1,560.00	4,836,000
京葉銀行	71,000	499.00	35,429,000
栃木銀行	41,600	418.00	17,388,800
北日本銀行	2,500	2,772.00	6,930,000
東和銀行	14,100	1,218.00	17,173,800
福島銀行	7,300	697.00	5,088,100
大東銀行	3,900	1,295.00	5,050,500
トモニホールディングス	66,100	516.00	34,107,600

フィデアホールディングス	77,900	178.00	13,866,200
池田泉州ホールディングス	85,100	397.00	33,784,700
F P G	27,200	1,519.00	41,316,800
マーキュリアインベストメント	2,300	1,134.00	2,608,200
S B Iホールディングス	91,000	2,876.00	261,716,000
ジャフコ	11,600	4,660.00	54,056,000
大和証券グループ本社	688,800	648.90	446,962,320
野村ホールディングス	1,384,300	573.00	793,203,900
岡三証券グループ	69,000	570.00	39,330,000
丸三証券	25,700	1,022.00	26,265,400
東洋証券	29,000	272.00	7,888,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	89,300	762.00	68,046,600
光世証券	2,000	1,400.00	2,800,000
水戸証券	24,200	404.00	9,776,800
いちよし証券	17,000	1,300.00	22,100,000
松井証券	39,400	1,043.00	41,094,200
だいこう証券ビジネス	4,000	611.00	2,444,000
マネックスグループ	82,700	588.00	48,627,600
カブドットコム証券	51,700	390.00	20,163,000
極東証券	10,900	1,510.00	16,459,000
岩井コスモホールディングス	8,300	1,487.00	12,342,100
藍澤証券	15,200	793.00	12,053,600
マネーパートナーズグループ	10,500	451.00	4,735,500
かんぽ生命保険	30,400	2,476.00	75,270,400
S O M P Oホールディングス	157,800	4,620.00	729,036,000
アニコム ホールディングス	5,500	4,220.00	23,210,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	210,300	3,553.00	747,195,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	66,100	2,143.00	141,652,300
第一生命ホールディングス	455,100	2,117.00	963,446,700
東京海上ホールディングス	303,100	5,473.00	1,658,866,300
アドバンテッジリスクマネジメント	2,500	1,149.00	2,872,500
T & Dホールディングス	248,800	1,810.50	450,452,400
アドバンスクリエイト	1,900	2,196.00	4,172,400
全国保証	22,700	5,080.00	115,316,000
ジェイリース	1,500	689.00	1,033,500
イントラスト	1,600	811.00	1,297,600
アルヒ	9,100	2,188.00	19,910,800
クレディセゾン	61,100	1,812.00	110,713,200
アクリーティブ	4,200	299.00	1,255,800
芙蓉総合リース	9,200	7,860.00	72,312,000
興銀リース	15,100	3,055.00	46,130,500
東京センチュリー	16,200	6,390.00	103,518,000

日本証券金融	32,900	638.00	20,990,200
アイフル	135,000	352.00	47,520,000
リコーリース	6,300	3,730.00	23,499,000
イオンフィナンシャルサービス	57,100	2,563.00	146,347,300
アコム	161,700	452.00	73,088,400
ジャックス	9,800	2,457.00	24,078,600
オリエントコーポレーション	173,600	154.00	26,734,400
日立キャピタル	22,100	2,898.00	64,045,800
アプラスフィナンシャル	38,500	114.00	4,389,000
オリックス	536,700	1,869.00	1,003,092,300
三菱UFJリース	204,200	672.00	137,222,400
九州リースサービス	3,500	767.00	2,684,500
日本取引所グループ	230,900	2,119.00	489,277,100
イー・ギャランティ	4,300	2,224.00	9,563,200
アサックス	1,100	1,931.00	2,124,100
NECキャピタルソリューション	3,300	2,035.00	6,715,500
いちご	115,100	539.00	62,038,900
日本駐車場開発	97,000	179.00	17,363,000
ヒューリック	167,900	1,163.00	195,267,700
三栄建築設計	3,200	1,930.00	6,176,000
スター・マイカ	3,900	2,398.00	9,352,200
野村不動産ホールディングス	53,500	2,506.00	134,071,000
三重交通グループホールディングス	16,400	492.00	8,068,800
サムティ	6,900	2,273.00	15,683,700
ディア・ライフ	9,100	527.00	4,795,700
コーセーアールイー	1,800	859.00	1,546,200
エー・ディー・ワークス	107,300	41.00	4,399,300
日本商業開発	4,500	1,947.00	8,761,500
プレサンスコーポレーション	11,100	1,773.00	19,680,300
ユニゾホールディングス	11,000	2,193.00	24,123,000
THEグローバル社	3,700	867.00	3,207,900
日本管理センター	5,300	1,406.00	7,451,800
サンセイランディック	2,300	1,242.00	2,856,600
エストラスト	1,100	931.00	1,024,100
フージャースホールディングス	19,500	841.00	16,399,500
オープンハウス	13,100	6,550.00	85,805,000
東急不動産ホールディングス	194,800	809.00	157,593,200
飯田グループホールディングス	67,100	2,123.00	142,453,300
イーランド	1,300	1,204.00	1,565,200
ムゲンエステート	5,000	1,174.00	5,870,000
ビーロッド	1,200	1,762.00	2,114,400
ファーストブラザーズ	2,200	1,503.00	3,306,600

ハウストゥ	1,300	5,240.00	6,812,000
シーアールイー	1,300	1,925.00	2,502,500
ケイアイスター不動産	2,900	2,696.00	7,818,400
グッドコムアセット	1,000	1,807.00	1,807,000
パーク24	46,900	2,893.00	135,681,700
パラカ	2,500	2,494.00	6,235,000
三井不動産	401,700	2,717.50	1,091,619,750
三菱地所	598,800	1,972.50	1,181,133,000
平和不動産	14,200	2,245.00	31,879,000
東京建物	87,900	1,515.00	133,168,500
ダイビル	20,700	1,193.00	24,695,100
京阪神ビルディング	13,400	1,012.00	13,560,800
住友不動産	193,000	4,187.00	808,091,000
大京	12,800	2,546.00	32,588,800
テーオーシー	27,700	885.00	24,514,500
東京楽天地	1,300	5,790.00	7,527,000
レオパレス21	96,000	682.00	65,472,000
スターツコーポレーション	11,000	2,814.00	30,954,000
フジ住宅	10,200	984.00	10,036,800
空港施設	8,100	649.00	5,256,900
明和地所	4,500	698.00	3,141,000
ゴールドクレスト	6,400	1,940.00	12,416,000
日本エスリード	3,200	2,023.00	6,473,600
日神不動産	10,700	725.00	7,757,500
日本エスコン	14,500	699.00	10,135,500
タカラレーベン	37,800	425.00	16,065,000
サンヨーハウジング名古屋	4,600	1,237.00	5,690,200
イオンモール	51,900	2,078.00	107,848,200
ファースト住建	3,000	1,524.00	4,572,000
カチタス	11,000	4,550.00	50,050,000
トーセイ	9,900	1,384.00	13,701,600
穴吹興産	900	3,445.00	3,100,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	49,900	1,175.00	58,632,500
サンフロンティア不動産	9,600	1,379.00	13,238,400
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	1,060.00	6,572,000
インテリックス	2,300	1,022.00	2,350,600
ランドビジネス	4,600	336.00	1,545,600
グランディハウス	7,100	494.00	3,507,400
日本空港ビルデング	23,500	5,590.00	131,365,000
日本工営	5,300	3,290.00	17,437,000
LIFULL	27,100	749.00	20,297,900
ジェイエシーリクルートメント	6,300	2,212.00	13,935,600

日本M & Aセンター	54,000	3,480.00	187,920,000
メンバーズ	2,600	1,245.00	3,237,000
中広	900	793.00	713,700
タケエイ	8,100	1,213.00	9,825,300
トラスト・テック	3,700	3,615.00	13,375,500
コシダカホールディングス	20,900	1,706.00	35,655,400
パソナグループ	7,500	1,714.00	12,855,000
C D S	2,200	1,463.00	3,218,600
リンクアンドモチベーション	14,400	1,413.00	20,347,200
G C A	8,900	939.00	8,357,100
エス・エム・エス	15,400	4,090.00	62,986,000
パーソルホールディングス	72,000	2,322.00	167,184,000
リニカル	5,100	2,211.00	11,276,100
クックパッド	24,500	577.00	14,136,500
エスクリ	2,800	839.00	2,349,200
アイ・ケイ・ケイ	4,700	845.00	3,971,500
学情	3,600	1,510.00	5,436,000
スタジオアリス	4,000	2,642.00	10,568,000
シミックホールディングス	4,400	2,318.00	10,199,200
N J S	2,000	1,840.00	3,680,000
総合警備保障	31,000	5,270.00	163,370,000
カカクコム	58,700	2,490.00	146,163,000
アイロムグループ	2,700	2,115.00	5,710,500
セントケア・ホールディング	3,500	711.00	2,488,500
サイネックス	1,200	840.00	1,008,000
ルネサンス	3,800	2,307.00	8,766,600
ディップ	11,000	2,732.00	30,052,000
オプトホールディング	5,500	2,087.00	11,478,500
ツクイ	18,400	912.00	16,780,800
キャリアデザインセンター	2,000	2,205.00	4,410,000
エムスリー	82,000	4,590.00	376,380,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,400	654.00	4,185,600
プラス	700	809.00	566,300
アウトソーシング	23,300	2,101.00	48,953,300
ウェルネット	7,900	1,270.00	10,033,000
ワールドホールディングス	2,600	3,605.00	9,373,000
ディー・エヌ・エー	42,100	2,103.00	88,536,300
博報堂D Yホールディングス	108,400	1,718.00	186,231,200
ぐるなび	12,400	920.00	11,408,000
エスアールジータカミヤ	9,300	683.00	6,351,900
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	887.00	8,249,100
ファンコミュニケーションズ	21,700	759.00	16,470,300

ライク	3,100	2,011.00	6,234,100
ビジネス・ブレイクスルー	3,700	455.00	1,683,500
WDBホールディングス	3,600	3,085.00	11,106,000
ティア	4,100	1,094.00	4,485,400
CDG	800	1,692.00	1,353,600
バリューコマース	7,100	1,503.00	10,671,300
インフォマート	39,500	1,449.00	57,235,500
JPホールディングス	24,400	408.00	9,955,200
エコナックホールディングス	15,900	135.00	2,146,500
EPSホールディングス	11,800	2,353.00	27,765,400
レグス	2,000	1,056.00	2,112,000
プレステージ・インターナショナル	16,200	1,590.00	25,758,000
アミューズ	5,200	3,045.00	15,834,000
ドリームインキュベータ	2,700	2,349.00	6,342,300
クイック	4,900	1,821.00	8,922,900
TAC	4,800	349.00	1,675,200
ケネディクス	103,400	680.00	70,312,000
電通	95,000	5,280.00	501,600,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,670.00	6,179,000
ぴあ	2,600	6,320.00	16,432,000
イオンファンタジー	2,500	7,110.00	17,775,000
シーティーエス	7,800	1,009.00	7,870,200
ネクシィーズグループ	3,000	1,719.00	5,157,000
みらかホールディングス	23,300	3,400.00	79,220,000
アルプス技研	6,900	2,401.00	16,566,900
ダイオーズ	1,600	1,324.00	2,118,400
日本空調サービス	8,200	814.00	6,674,800
オリエンタルランド	92,100	11,275.00	1,038,427,500
ダスキン	21,000	2,701.00	56,721,000
明光ネットワークジャパン	9,800	1,310.00	12,838,000
ファルコホールディングス	4,100	1,879.00	7,703,900
ラウンドワン	24,200	1,900.00	45,980,000
リゾートトラスト	33,000	2,074.00	68,442,000
ビー・エム・エル	10,100	2,853.00	28,815,300
ワタベウェディング	1,400	537.00	751,800
りらいあコミュニケーションズ	12,400	1,584.00	19,641,600
リソー教育	13,200	847.00	11,180,400
早稲田アカデミー	1,200	2,312.00	2,774,400
ユー・エス・エス	95,200	2,140.00	203,728,000
東京個別指導学院	2,800	951.00	2,662,800
サイバーエージェント	48,000	5,970.00	286,560,000
楽天	399,800	709.60	283,698,080

クリーク・アンド・リバー社	4,000	1,163.00	4,652,000
テー・オー・ダブリュー	7,500	893.00	6,697,500
セントラルスポーツ	2,900	4,170.00	12,093,000
フルキャストホールディングス	6,900	2,799.00	19,313,100
リソルホールディングス	900	4,435.00	3,991,500
テクノプロ・ホールディングス	14,700	7,090.00	104,223,000
アトラ	1,400	767.00	1,073,800
インターワークス	1,800	1,005.00	1,809,000
K e e P e r 技研	2,500	1,354.00	3,385,000
ファーストロジック	1,600	762.00	1,219,200
三機サービス	1,200	1,862.00	2,234,400
G u n o s y	4,700	1,522.00	7,153,400
デザインワン・ジャパン	1,600	1,241.00	1,985,600
イー・ガーディアン	3,900	3,155.00	12,304,500
リブセンス	5,000	561.00	2,805,000
ジャパンマテリアル	21,400	1,833.00	39,226,200
ベクトル	9,400	2,200.00	20,680,000
ウチヤマホールディングス	3,900	572.00	2,230,800
ライクキッズネクスト	1,400	1,172.00	1,640,800
キャリアリンク	2,600	562.00	1,461,200
I B J	6,200	672.00	4,166,400
アサンテ	2,900	2,199.00	6,377,100
N・フィールド	4,400	1,673.00	7,361,200
バリューHR	1,800	2,092.00	3,765,600
M&Aキャピタルパートナーズ	2,000	10,170.00	20,340,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,200	1,345.00	4,304,000
E R Iホールディングス	2,200	1,054.00	2,318,800
アビスト	1,200	4,865.00	5,838,000
シグマクシス	4,200	1,316.00	5,527,200
ウィルグループ	3,500	1,115.00	3,902,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,900	508.00	5,537,200
日本ビューホテル	2,500	1,449.00	3,622,500
リクルートホールディングス	601,300	3,056.00	1,837,572,800
エラン	1,900	2,679.00	5,090,100
土木管理総合試験所	2,500	575.00	1,437,500
日本郵政	442,300	1,250.00	552,875,000
ベルシステム24ホールディングス	13,100	1,853.00	24,274,300
鎌倉新書	1,400	3,330.00	4,662,000
一蔵	1,100	822.00	904,200
L I T A L I C O	1,800	1,780.00	3,204,000
グローバルグループ	1,000	1,659.00	1,659,000
エボラブルアジア	2,200	2,306.00	5,073,200

ストライク	2,000	3,860.00	7,720,000
ソラスト	4,800	3,375.00	16,200,000
セラク	1,800	945.00	1,701,000
インソース	2,600	2,410.00	6,266,000
キャリアインデックス	1,100	3,085.00	3,393,500
MS - J a p a n	800	7,480.00	5,984,000
船場	1,500	1,190.00	1,785,000
フルテック	900	1,132.00	1,018,800
グリーンズ	1,700	1,627.00	2,765,900
日総工産	1,300	5,760.00	7,488,000
キュービーネットホールディングス	3,900	1,808.00	7,051,200
リログループ	42,600	2,825.00	120,345,000
東祥	4,900	4,245.00	20,800,500
エイチ・アイ・エス	12,200	3,780.00	46,116,000
ラックランド	1,500	2,689.00	4,033,500
共立メンテナンス	13,900	5,980.00	83,122,000
イチネンホールディングス	8,800	1,462.00	12,865,600
建設技術研究所	5,400	1,418.00	7,657,200
スペース	5,100	1,519.00	7,746,900
長大	3,200	946.00	3,027,200
燦ホールディングス	1,900	2,741.00	5,207,900
スバル興業	600	6,850.00	4,110,000
東京テアトル	3,300	1,448.00	4,778,400
タナベ経営	1,500	2,036.00	3,054,000
ナガワ	1,600	4,740.00	7,584,000
よみうりランド	1,700	4,805.00	8,168,500
東京都競馬	5,800	4,835.00	28,043,000
カナモト	11,900	3,720.00	44,268,000
東京ドーム	31,600	1,010.00	31,916,000
西尾レントオール	7,900	3,695.00	29,190,500
トランス・コスモス	8,700	2,671.00	23,237,700
乃村工藝社	18,300	2,392.00	43,773,600
藤田観光	3,100	3,520.00	10,912,000
KNT - CTホールディングス	4,800	1,653.00	7,934,400
日本管財	8,400	2,298.00	19,303,200
トーカイ	7,600	2,450.00	18,620,000
白洋舎	900	3,450.00	3,105,000
セコム	82,700	8,262.00	683,267,400
セントラル警備保障	3,800	4,635.00	17,613,000
丹青社	16,000	1,529.00	24,464,000
メイテック	9,100	5,100.00	46,410,000
応用地質	8,500	1,473.00	12,520,500

船井総研ホールディングス	16,200	2,820.00	45,684,000	
進学会ホールディングス	3,600	648.00	2,332,800	
オオバ	6,300	641.00	4,038,300	
いであ	1,600	1,140.00	1,824,000	
学究社	2,900	1,827.00	5,298,300	
ベネッセホールディングス	28,600	4,070.00	116,402,000	
イオンディライト	9,600	4,045.00	38,832,000	
ナック	5,200	913.00	4,747,600	
ニチイ学館	14,800	1,238.00	18,322,400	
ダイセキ	13,100	3,455.00	45,260,500	
ステップ	2,900	1,765.00	5,118,500	
合 計	98,447,425		208,376,298,860	

(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

	2018年 6月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	18,198,393
コール・ローン	1,124,959,834
国債証券	317,487,741,300
地方債証券	21,351,463,246
特殊債券	26,888,043,273
社債券	15,598,748,530
未収入金	18,704
未収利息	1,005,383,179
前払費用	47,706,907
流動資産合計	383,522,263,366
資産合計	383,522,263,366
負債の部	
流動負債	
未払金	600,840,996

項目	2018年 6月11日現在
	金額（円）
未払解約金	121,652,929
未払利息	2,980
その他未払費用	28,073
流動負債合計	722,524,978
負債合計	722,524,978
純資産の部	
元本等	
元本	274,944,322,915
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	107,855,415,473
元本等合計	382,799,738,388
純資産合計	382,799,738,388
負債純資産合計	383,522,263,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	274,944,322,915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 103,367,000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 1.3923円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,923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

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2018年 6月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 8月25日
期首元本額	227,377,666,493円
期中追加設定元本額	59,763,859,086円
期中一部解約元本額	12,197,202,664円
期末元本額	274,944,322,915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）	3,277,099,539円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,182,698円
S M T 国内債券インデックス・オープン	12,427,476,447円
世界経済インデックスファンド	1,527,584,279円
D C マイセレクション 2 5	19,106,164,413円
D C マイセレクション 5 0	21,744,738,728円
D C マイセレクション 7 5	6,041,122,307円
D C 日本債券インデックス・オープン	446,374,613円
D C 日本債券インデックス・オープン S	75,958,387,838円
D C 日本債券インデックス・オープン P	34,818,768,979円
D C マイセレクション S 2 5	7,607,577,246円
D C マイセレクション S 5 0	8,654,895,895円

区分	2018年 6月11日現在
DCマイセレクションS75	1,747,410,765円
DCターゲット・イヤールファンド2025	1,266,638,334円
DCターゲット・イヤールファンド2035	1,120,024,570円
DCターゲット・イヤールファンド2045	357,075,233円
DC世界経済インデックスファンド	1,162,759,346円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	101,882,078円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	8,704,364円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	98,269,413円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	17,015,306円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	951,991円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	320,487,407円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	450,853,138円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	79,962,293円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	201,414,276円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	5,459,771,364円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,140,587,303円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,365,903,114円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	895,429,256円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	166,966,615円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,522,490,119円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	794,252,649円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,676,272,031円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,186,077,996円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	180,314,540円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,805,663,836円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,557,676,906円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	50,545,613円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	616,519,645円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	67,959,187円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,600,859円
SMT インデックスバランス・オープン	79,588,694円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,931,756円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	15,784,411円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	17,904,940円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	765,698円
グローバル経済コア	274,415,017円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,313,760円
DCターゲット・イヤールファンド2055	67,485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)	39,465,471,385円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		362,977,850
地方債証券		23,073,986
特殊債券		23,357,623
社債券		13,084,880
合計		422,494,339

(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378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,684,300,800	
	第379回利付国債(2年)	2,200,000,000	2,206,072,000	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,785,268,800	
	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	2,588,152,800	
	第382回利付国債(2年)	310,000,000	311,041,600	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,304,615,000	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,726,450,000	
	第385回利付国債(2年)	550,000,000	552,172,500	
	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	3,002,348,700	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,717,404,300	
	第388回利付国債(2年)	2,130,000,000	2,139,648,900	
	第120回利付国債(5年)	2,800,000,000	2,811,956,000	
	第121回利付国債(5年)	890,000,000	892,661,100	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,532,355,200	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,152,528,600	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,958,892,000	
第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,628,519,300		

第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,976,842,400	
第127回利付国債（5年）	4,390,000,000	4,417,437,500	
第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,620,980,200	
第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	3,223,136,000	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,370,580,800	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,585,095,600	
第132回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,641,334,800	
第133回利付国債（5年）	4,740,000,000	4,783,750,200	
第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	3,200,241,800	
第135回利付国債（5年）	6,400,000,000	6,462,848,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	578,932,000	
第2回利付国債（40年）	420,000,000	588,432,600	
第3回利付国債（40年）	520,000,000	732,232,800	
第4回利付国債（40年）	700,000,000	990,437,000	
第5回利付国債（40年）	750,000,000	1,020,480,000	
第6回利付国債（40年）	420,000,000	560,154,000	
第7回利付国債（40年）	690,000,000	879,832,800	
第8回利付国債（40年）	750,000,000	886,665,000	
第9回利付国債（40年）	970,000,000	832,114,500	
第10回利付国債（40年）	1,960,000,000	1,991,477,600	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,417,216,200	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	488,788,800	
第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,951,676,200	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,201,753,800	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	717,752,000	
第308回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,533,180,200	
第309回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,511,078,500	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,446,335,700	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,102,906,800	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,938,282,700	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,299,500,000	
第314回利付国債（10年）	310,000,000	320,552,400	
第315回利付国債（10年）	2,980,000,000	3,099,289,400	
第316回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,130,330,000	
第317回利付国債（10年）	710,000,000	738,343,200	
第318回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,129,937,600	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,783,170,900	
第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,034,639,200	
第321回利付国債（10年）	1,340,000,000	1,396,293,400	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	778,672,500	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,009,372,300	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,326,784,000	

第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,378,966,500	
第326回利付国債(10年)	860,000,000	891,458,800	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	770,436,200	
第328回利付国債(10年)	2,320,000,000	2,398,392,800	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,352,195,000	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,507,910,400	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,430,452,800	
第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,559,379,600	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,421,126,300	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,903,022,900	
第335回利付国債(10年)	2,710,000,000	2,806,448,900	
第336回利付国債(10年)	610,000,000	632,161,300	
第337回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,026,015,200	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,524,872,000	
第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,857,211,600	
第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,168,516,300	
第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,209,063,800	
第342回利付国債(10年)	2,690,000,000	2,717,222,800	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,180,366,000	
第344回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,685,197,000	
第345回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,926,273,200	
第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,426,792,000	
第347回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,448,589,500	
第348回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,239,102,000	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,231,314,400	
第350回利付国債(10年)	3,280,000,000	3,299,122,400	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,068,800	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	202,065,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	150,608,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	146,944,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,848,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	245,193,100	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	230,940,000	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,933,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	279,069,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	179,115,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,736,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	241,003,600	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	364,202,300	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,754,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	454,692,200	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	495,918,400	

第17回利付国債(30年)	330,000,000	438,061,800
第18回利付国債(30年)	345,000,000	453,357,600
第19回利付国債(30年)	280,000,000	368,600,400
第20回利付国債(30年)	420,000,000	567,550,200
第21回利付国債(30年)	270,000,000	356,046,300
第22回利付国債(30年)	400,000,000	542,508,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	584,249,600
第24回利付国債(30年)	260,000,000	353,883,400
第25回利付国債(30年)	290,000,000	384,690,800
第26回利付国債(30年)	410,000,000	551,716,500
第27回利付国債(30年)	600,000,000	821,058,000
第28回利付国債(30年)	930,000,000	1,276,118,100
第29回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,670,955,000
第30回利付国債(30年)	750,000,000	1,007,805,000
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,195,344,000
第32回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,610,534,100
第33回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,697,013,300
第34回利付国債(30年)	1,005,000,000	1,347,373,350
第35回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,161,087,600
第36回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,487,483,400
第37回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,736,559,000
第38回利付国債(30年)	760,000,000	962,897,200
第39回利付国債(30年)	910,000,000	1,175,037,500
第40回利付国債(30年)	600,000,000	761,352,000
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,109,135,800
第42回利付国債(30年)	800,000,000	997,512,000
第43回利付国債(30年)	820,000,000	1,023,015,600
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,385,546,400
第45回利付国債(30年)	800,000,000	960,352,000
第46回利付国債(30年)	840,000,000	1,008,554,400
第47回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,582,584,900
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,295,624,000
第49回利付国債(30年)	790,000,000	930,493,600
第50回利付国債(30年)	790,000,000	811,195,700
第51回利付国債(30年)	790,000,000	710,968,400
第52回利付国債(30年)	770,000,000	730,198,700
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,040,842,500
第54回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,402,797,800
第55回利付国債(30年)	970,000,000	992,193,600
第56回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,471,406,400
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,184,035,200
第58回利付国債(30年)	830,000,000	846,276,300
第43回利付国債(20年)	140,000,000	145,422,200

第44回利付国債（20年）	170,000,000	177,930,500	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	303,015,200	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	178,051,200	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	94,777,200	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	138,646,300	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	148,695,400	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	232,438,800	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	106,451,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	118,033,300	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	86,252,800	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	216,340,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	151,160,800	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	162,753,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	259,435,200	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	325,752,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	216,356,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	373,852,500	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	252,650,400	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	334,534,400	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	219,124,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	353,648,000	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	244,164,800	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	364,415,700	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	144,835,600	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	214,985,000	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	439,026,900	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	459,748,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	227,454,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	715,692,600	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	408,430,800	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	228,216,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	148,985,200	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	305,764,200	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	330,382,500	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	193,290,000	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	308,893,500	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	253,239,800	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	447,876,000	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	693,414,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	336,574,000	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	541,938,200	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	338,235,700	

第86回利付国債(20年)	210,000,000	248,203,200
第87回利付国債(20年)	550,000,000	645,766,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	498,489,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	412,594,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	745,290,000
第91回利付国債(20年)	450,000,000	536,076,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,037,502,400
第93回利付国債(20年)	410,000,000	481,487,600
第94回利付国債(20年)	610,000,000	721,703,200
第95回利付国債(20年)	610,000,000	735,580,700
第96回利付国債(20年)	320,000,000	380,112,000
第97回利付国債(20年)	400,000,000	480,716,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	524,717,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,376,055,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	580,896,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	879,214,050
第102回利付国債(20年)	410,000,000	506,079,400
第103回利付国債(20年)	400,000,000	489,744,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	433,591,200
第105回利付国債(20年)	680,000,000	821,222,400
第106回利付国債(20年)	380,000,000	462,798,200
第107回利付国債(20年)	150,000,000	181,713,000
第108回利付国債(20年)	660,000,000	785,756,400
第109回利付国債(20年)	230,000,000	274,548,700
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,154,288,000
第111回利付国債(20年)	490,000,000	602,504,000
第112回利付国債(20年)	790,000,000	962,765,100
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,650,078,000
第114回利付国債(20年)	910,000,000	1,116,060,400
第115回利付国債(20年)	800,000,000	990,256,000
第116回利付国債(20年)	760,000,000	943,464,000
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,045,321,500
第118回利付国債(20年)	690,000,000	842,731,500
第119回利付国債(20年)	270,000,000	323,370,900
第120回利付国債(20年)	790,000,000	927,460,000
第121回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,927,668,300
第122回利付国債(20年)	200,000,000	240,060,000
第123回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,475,243,000
第124回利付国債(20年)	460,000,000	564,604,000
第125回利付国債(20年)	520,000,000	652,745,600
第126回利付国債(20年)	610,000,000	750,458,600
第127回利付国債(20年)	580,000,000	706,289,200
第128回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,281,420,000

第129回利付国債（20年）	220,000,000	265,685,200	
第130回利付国債（20年）	935,000,000	1,131,368,700	
第131回利付国債（20年）	380,000,000	454,879,000	
第132回利付国債（20年）	840,000,000	1,007,227,200	
第133回利付国債（20年）	870,000,000	1,054,674,900	
第134回利付国債（20年）	920,000,000	1,116,502,800	
第135回利付国債（20年）	510,000,000	612,102,000	
第136回利付国債（20年）	570,000,000	676,481,700	
第137回利付国債（20年）	480,000,000	577,022,400	
第138回利付国債（20年）	340,000,000	399,194,000	
第139回利付国債（20年）	510,000,000	605,732,100	
第140回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,938,407,800	
第141回利付国債（20年）	950,000,000	1,144,645,500	
第142回利付国債（20年）	460,000,000	561,098,800	
第143回利付国債（20年）	930,000,000	1,108,039,200	
第144回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,236,070,500	
第145回利付国債（20年）	1,760,000,000	2,126,396,800	
第146回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,789,142,400	
第147回利付国債（20年）	1,860,000,000	2,221,937,400	
第148回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,499,463,600	
第149回利付国債（20年）	1,890,000,000	2,231,579,700	
第150回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,320,638,500	
第151回利付国債（20年）	1,655,000,000	1,877,663,700	
第152回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,724,652,800	
第153回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,957,873,000	
第154回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,690,792,400	
第155回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,101,095,500	
第156回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,684,406,100	
第157回利付国債（20年）	1,670,000,000	1,603,066,400	
第158回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,707,136,600	
第159回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,641,024,000	
第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	2,030,847,000	
第161回利付国債（20年）	1,540,000,000	1,573,572,000	
第162回利付国債（20年）	1,670,000,000	1,702,347,900	
第163回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,241,691,600	
第164回利付国債（20年）	1,190,000,000	1,186,787,000	
国債証券合計	292,285,000,000	317,487,741,300	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,713,000
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,966,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	131,841,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	129,470,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,236,000

第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,298,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	236,834,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,606,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	103,238,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	103,499,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	103,232,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	207,114,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	103,367,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,859,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	104,240,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	103,334,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,266,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,398,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	206,918,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,559,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,687,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,610,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,600,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	135,710,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,805,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,120,000	
第172回神奈川県公募公債	100,000,000	102,330,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,816,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,634,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	200,604,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	237,400,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,134,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,880,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,555,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,611,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,083,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,812,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,454,880	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,961,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,758,000	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,678,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,597,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,518,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,971,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,230,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	106,134,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,163,000	

第4回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,709,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,706,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,648,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,982,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,434,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	116,678,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	99,572,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,834,912	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,352,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,067,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,177,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,355,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,364,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	121,778,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,884,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,494,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,384,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,893,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,534,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,004,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,962,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	199,660,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	121,309,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,632,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,478,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,619,976	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	200,088,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,243,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	199,538,840	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,946,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,761,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,430,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,684,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,500,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,764,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,177,000	

平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,702,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	120,985,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	207,000,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,250,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	129,067,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,647,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,890,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,874,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,155,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,295,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,169,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,500,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	220,466,400	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,071,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,108,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,181,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,388,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	369,759,400	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,393,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,926,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,706,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,943,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,395,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,333,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,121,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,202,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,051,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,375,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,289,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,846,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,371,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,308,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,051,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,739,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,314,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,392,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,415,308	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,446,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,628,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,035,000	

第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,162,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,212,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,730,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,176,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	206,728,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,414,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,232,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,682,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,666,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,044,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	119,153,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,123,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,227,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,446,980	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,658,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,358,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,807,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,212,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	143,073,600	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,559,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,245,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,549,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,170,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,162,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,951,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,499,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,480,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,272,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,344,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,083,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,412,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,300,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,181,250	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,864,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,501,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,200,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,446,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,088,200	
平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	207,114,000	
	200,000,000	203,234,000	

	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）			
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,430,000	
	地方債証券合計	20,265,920,000	21,351,463,246	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,945,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,278,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,157,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,126,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,367,000	
	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	105,256,000	
	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	210,802,000	
	第14回道路債券	100,000,000	108,325,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,655,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	471,088,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,032,000	
	第28回道路債券	200,000,000	269,880,000	
	第33回道路債券	200,000,000	273,522,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,743,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,837,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,518,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,572,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,729,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,485,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,619,000	
	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	141,435,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,582,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,377,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,092,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,604,000	
	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	130,671,000	
	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	102,314,000	

第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,429,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,400,000	
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	204,650,000	
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	206,322,000	
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	122,205,000	
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	103,265,000	
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	103,854,000	
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	103,561,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,305,000	
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	310,410,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,536,000	
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	311,113,600	
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	207,358,000	
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	103,731,000	
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	103,490,000	
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	310,359,000	
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	117,961,000	
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	103,979,000	
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	311,844,000	
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	206,562,000	
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	205,450,000	
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	309,309,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,120,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	154,364,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,676,000	
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	231,270,000	
	102,000,000	105,907,620	

第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	103,771,000	
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	103,543,000	
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	103,263,000	
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	102,848,000	
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	305,664,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,652,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,232,810	
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	315,731,400	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,350,550	
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	100,348,000	
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	300,924,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	320,000,000	321,840,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,249,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	319,746,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,056,700	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,243,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,094,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	134,160,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,952,400	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,685,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,706,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,314,920	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,114,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,477,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,712,760	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,841,030	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,948,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,374,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,362,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	516,170,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,277,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,925,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,712,000	

第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,073,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,401,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,386,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,678,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,037,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	222,224,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,459,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,691,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,174,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,170,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,768,060	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,405,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,363,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,630,300	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,304,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,785,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,388,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,549,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,392,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,405,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,420,400	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,862,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,699,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	107,283,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,019,200	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,759,000	17,604,994	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,859,000	17,816,591	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,235,000	18,335,110	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,717,000	18,765,846	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,462,000	19,561,412	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,834,000	15,386,863	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,962,000	32,696,800	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,890,000	18,881,821	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,298,000	17,218,185	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,953,000	20,075,586	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,306,000	17,240,496	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,639,000	19,639,727	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,425,000	

第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,854,000	20,404,154	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,272,000	20,812,248	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,459,000	27,520,669	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,186,000	28,398,455	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,266,000	30,718,640	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,047,000	34,417,837	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,900,000	36,346,902	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,878,000	37,298,533	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,778,000	78,904,833	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,868,000	17,602,770	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	39,981,909	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,886,000	17,604,499	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,266,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,599,000	17,554,936	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,923,000	43,583,813	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,516,000	16,365,345	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,802,000	43,551,646	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,441,000	41,073,439	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,408,000	18,484,162	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,390,000	80,914,579	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,391,000	43,876,115	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,781,000	18,798,784	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,120,000	56,018,227	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,838,000	53,608,671	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,502,000	53,295,265	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,294,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,252,000	113,784,759	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,287,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,370,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,599,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,712,000	120,615,874	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,454,000	60,847,106	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,124,000	61,024,968	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,522,000	62,574,883	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,020,000	55,552,765	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,988,000	56,130,243	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,445,000	62,599,746	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,017,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,352,000	56,533,689	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,437,000	63,778,364	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,665,000	65,100,788	

第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,790,000	65,036,626	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,113,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,642,000	138,384,954	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,308,000	69,398,586	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,322,000	142,623,931	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,247,000	79,353,525	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,361,000	83,351,090	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,287,000	82,696,412	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,564,000	170,032,461	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,406,000	83,904,350	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,937,000	88,694,718	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,239,000	93,321,982	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,512,000	93,365,186	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,533,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,749,000	94,101,496	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,339,000	95,151,258	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,739,000	95,390,804	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,498,000	97,059,618	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,806,000	97,493,322	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,108,000	97,485,750	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,419,000	97,791,140	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,757,000	98,220,368	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,400,000	196,841,900	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,213,000	98,591,120	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,444,000	198,760,951	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,176,000	99,523,116	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,890,000	199,192,312	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,256,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	128,313,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,519,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,306,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,088,000	

	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,785,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	113,335,000	
	い第779号商工債	100,000,000	100,233,000	
	い第786号商工債	300,000,000	300,774,000	
	い第795号商工債	200,000,000	199,168,000	
	い第780号農林債	100,000,000	100,469,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,839,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,670,000	
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,219,000	
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,810,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,368,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,420,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,942,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,013,000	
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,649,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,885,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,646,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,876,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,890,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,871,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,678,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,151,000	
	特殊債券合計	25,403,817,000	26,888,043,273	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,908,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,527,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,332,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,740,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,127,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,506,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,965,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,195,000	
	第4回スウェンスカ・ハンデルスバンケンA円貨社債	100,000,000	100,243,000	
	第6回スウェンスカ・ハンデルスバンケンA円貨社債	100,000,000	100,212,000	
	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	100,632,000	

第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,303,000	
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,209,000	
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	100,331,000	
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	200,892,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,035,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,348,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,958,000	
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	99,919,000	
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	100,131,000	
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,122,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,376,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,887,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,043,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,926,000	
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	99,866,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,273,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,592,000	
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	101,628,000	
第24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	100,144,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,814,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,894,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,690,000	
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	102,977,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,919,000	
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	102,525,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,105,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,642,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,865,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,278,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,500,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,026,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,380,000	

第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,905,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,048,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,458,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,688,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,914,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,109,000	
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	100,334,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,310,000	
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	100,437,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,322,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,576,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,586,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
第2回ユニ・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	100,381,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,349,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,750,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,375,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,756,000	
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	125,021,000	
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	102,775,000	
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	104,164,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	117,855,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,277,000	
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	102,501,000	
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	103,328,000	
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	103,054,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,221,000	
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	103,071,000	
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	102,329,000	
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	102,899,000	
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	104,019,000	

第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,843,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,318,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000	
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	100,542,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,472,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,491,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,300,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,842,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,181,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,234,000	
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	100,372,000	
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	101,940,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,044,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,351,000	
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	103,041,000	
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	104,094,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,748,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,949,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,969,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,106,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,447,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	243,144,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,876,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,251,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,581,560	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,039,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,471,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,911,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,653,400	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,367,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,922,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,781,000	

第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,349,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,874,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,609,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,783,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	120,874,800	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,166,100	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,777,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,075,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,437,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,057,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,024,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,233,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,828,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,025,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,342,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,866,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,055,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,440,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,894,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,718,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,247,080	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,434,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,608,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,037,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,372,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,213,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,473,590	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,186,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,469,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,018,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,954,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,092,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,507,000	
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	101,153,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,811,000	
社債券合計	15,196,000,000	15,598,748,530	
合計		381,325,996,349	

(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

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,402,267,982
金銭信託	1,687,503
コール・ローン	104,315,447
株式	322,493,528,471
投資信託受益証券	246,144,498
投資証券	7,453,995,606
派生商品評価勘定	385,520,701
未収入金	31,621,719
未収配当金	647,802,701
差入委託証拠金	2,133,566,443
流動資産合計	342,900,451,071
資産合計	342,900,451,071
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,959,615
前受金	359,517,086
未払解約金	110,647,147
未払利息	276
その他未払費用	6,220
流動負債合計	496,130,344
負債合計	496,130,344
純資産の部	
元本等	
元本	137,398,170,903
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	205,006,149,824
元本等合計	342,404,320,727
純資産合計	342,404,320,727
負債純資産合計	342,900,451,071

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2018年 6月11日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,398,170,903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) 2,4921円 (24,921円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2018年 6月11日現在
期首	2017年 8月25日
期首元本額	137,154,212,826円
期中追加設定元本額	17,589,352,848円
期中一部解約元本額	17,345,394,771円
期末元本額	137,398,170,903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）	2,416,183,364円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,247,672円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,039,081,514円
世界経済インデックスファンド	7,121,586,177円
外国株式インデックス・オープン	878,525,541円
D C マイセレクション 2 5	1,005,995,265円
D C マイセレクション 5 0	4,646,131,331円
D C マイセレクション 7 5	5,119,180,168円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,546,007,414円
D C マイセレクション S 2 5	388,573,082円
D C マイセレクション S 5 0	1,870,290,559円
D C マイセレクション S 7 5	1,468,351,967円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	121,919,071円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	182,078,371円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	114,242,356円
D C 世界経済インデックスファンド	5,595,847,881円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,705,468,323円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	20,878,795円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	14,293,459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）	62,987,397円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	91,684,290円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	313,555,113円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	48,474,545円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	418,498,582円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	920,543,653円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	443,094,927円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,907,878,081円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,153,351,339円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	131,327,244円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	428,456,226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）	256,164,203円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	140,398,049円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,112,815,584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）	2,511,635,194円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,448,271,473円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,116,259,362円

区分	2018年 6月11日現在
コア投資戦略ファンド(成長型)	7,047,753,100円
分散投資コア戦略ファンドA	2,066,522,976円
分散投資コア戦略ファンドS	4,189,244,647円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	622,285,069円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	769,287,837円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,748,857,964円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	875,189,185円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,475,804円
SMT インデックスバランス・オープン	318,714,432円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	2,060,371,500円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	30,097,874,564円
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,346,796円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	256,141,429円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	31,662,787円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	475,358円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	22,620,582円
グローバル経済コア	1,267,221,508円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,777,268円
DCターゲット・イヤーフンド2055	48,752円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,709,584,375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)	480,437,398円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,853,571,441
投資信託受益証券	598,797
投資証券	154,296,258
合計	4,007,268,902

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	11,695,981,946	-	12,055,499,032	359,517,086
	合計	11,695,981,946	-	12,055,499,032	359,517,086

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	147,721,500	-	147,677,500	44,000
	アメリカドル	147,721,500	-	147,677,500	44,000
	合計	147,721,500	-	147,677,500	44,000

(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	71.40	3,168,732.00	
	ANDEAVOR	11,677	144.68	1,689,428.36	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	19.62	365,638.32	
	APACHE CORP	29,810	42.24	1,259,174.40	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	34.70	1,221,787.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	23.54	844,591.66	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	65.39	1,026,034.49	
	CHEVRON CORP	154,681	126.44	19,557,865.64	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	85.59	650,398.41	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	128.28	1,512,806.04	

CONOCOPHILLIPS	96,082	69.43	6,670,973.26
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	65.84	503,478.48
DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	42.16	1,830,587.20
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	113.96	938,916.44
EOG RESOURCES INC	46,520	117.67	5,474,008.40
EQT CORPORATION	22,120	53.12	1,175,014.40
EXXON MOBIL	342,921	83.60	28,668,195.60
HALLIBURTON CO	71,448	48.10	3,436,648.80
HELMERICH & PAYNE	8,315	65.38	543,634.70
HESS CORP	22,081	61.84	1,365,489.04
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	77.19	1,089,150.90
KINDER MORGAN INC	157,150	16.85	2,647,977.50
MARATHON OIL CORP	65,596	20.99	1,376,860.04
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	78.99	3,046,328.34
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	42.58	1,290,642.38
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	29.15	468,527.95
NOBLE ENERGY INC	38,291	34.06	1,304,191.46
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	85.47	5,323,669.89
ONEOK INC	33,743	68.45	2,309,708.35
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	27.20	556,920.00
PHILLIPS 66	36,131	116.84	4,221,546.04
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	193.24	2,599,078.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	24.76	244,876.40
SCHLUMBERGER	112,385	69.43	7,802,890.55
TARGA RESOURCES CORP	16,467	49.31	811,987.77
TECHNIPFMC PLC	36,005	32.60	1,173,763.00
VALERO ENERGY CORP	35,381	119.72	4,235,813.32
WILLIAMS COS	67,038	26.12	1,751,032.56
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	168.51	3,020,036.22
ALBEMARLE CORP	8,647	95.37	824,664.39
AVERY DENNISON CORP	7,457	108.03	805,579.71
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	31.85	560,751.10
BALL CORP	27,142	37.60	1,020,539.20
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	117.11	1,294,416.83
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	43.18	765,192.78
CHEMOURS CO/THE	15,493	51.28	794,481.04
CROWN HOLDINGS INC	10,321	44.58	460,110.18
DOWDUPONT INC	187,231	69.49	13,010,682.19
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	109.07	1,293,352.06
ECOLAB INC	20,812	146.19	3,042,506.28
FMC CORP	10,402	88.64	922,033.28
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	18.03	2,008,469.88

INT'L PAPER CO	30,605	58.81	1,799,880.05
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	126.41	767,308.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	118.09	3,155,364.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	229.56	1,145,274.84
MOSAIC CO/THE	27,677	29.46	815,364.42
NEWMONT MINING CORP	42,952	38.38	1,648,497.76
NUCOR CORP	24,915	66.85	1,665,567.75
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	122.64	883,621.20
PPG INDUSTRIES INC	19,958	104.15	2,078,625.70
PRAXAIR INC	23,446	159.83	3,747,374.18
SEALED AIR CORP	14,689	43.80	643,378.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	398.05	2,759,282.60
STEEL DYNAMICS INC	18,273	50.74	927,172.02
VULCAN MATERIALS CO	10,740	130.04	1,396,629.60
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	117.67	406,549.85
WESTROCK CO	21,244	60.96	1,295,034.24
3 M COMPANY	48,314	206.59	9,981,189.26
ACUITY BRANDS INC	3,505	121.84	427,049.20
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	54.83	621,223.90
AGCO CORP	4,669	63.68	297,321.92
ALLEGION PLC	7,168	81.12	581,468.16
AMETEK INC	18,866	75.75	1,429,099.50
ARCONIC INC	36,550	17.94	655,707.00
BOEING CO	45,238	369.50	16,715,441.00
CATERPILLAR	48,537	155.32	7,538,766.84
CUMMINS INC	12,421	143.68	1,784,649.28
DEERE&CO	25,056	157.12	3,936,798.72
DOVER CORP	12,008	78.92	947,671.36
EATON CORP	35,279	80.35	2,834,667.65
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	73.15	3,725,310.05
FASTENAL CO	23,228	52.82	1,226,902.96
FLOWSERVE CORP	10,826	42.17	456,532.42
FLUOR CORP	11,267	50.34	567,180.78
FORTIVE CORP	25,813	78.20	2,018,576.60
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	58.52	749,641.20
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	202.58	4,064,159.96
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	13.93	9,810,703.98
GRAINGER (WW) INC	3,976	314.59	1,250,809.84
HARRIS CORP	9,793	154.65	1,514,487.45
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	42.89	653,043.14
HONEYWELL INTL INC	61,022	151.86	9,266,800.92
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	226.35	797,204.70

IDEX CORP	5,756	144.13	829,612.28
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	147.76	3,624,257.28
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	90.69	1,836,381.81
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	66.60	645,553.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	62.41	1,036,006.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	36.71	605,715.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	35.14	2,617,508.32
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	204.22	1,249,213.74
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	213.76	616,697.60
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	322.31	6,732,088.97
MASCO CORP	24,547	38.86	953,896.42
MIDDLEBY CORP	4,364	104.19	454,685.16
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	338.63	4,564,393.77
OWENS CORNING	7,979	65.55	523,023.45
PACCAR INC	27,548	65.26	1,797,782.48
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	174.71	1,808,947.34
PENTAIR PLC	13,583	45.00	611,235.00
RAYTHEON COMPANY	23,492	214.56	5,040,443.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	178.01	1,871,063.11
ROCKWELL COLLIN	13,112	139.18	1,824,928.16
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	285.58	2,313,198.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	53.85	744,637.80
SMITH (A.O.) CORP	12,146	64.84	787,546.64
SNAP-ON INC	4,900	156.94	769,006.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	89.49	758,964.69
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	145.37	1,746,620.55
TEXTRON	21,877	69.32	1,516,513.64
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	346.00	1,408,912.00
UNITED RENTALS INC	6,446	166.80	1,075,192.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	127.61	7,763,920.01
WABCO HOLDINGS INC	3,841	124.28	477,359.48
WABTEC CORP	7,158	102.69	735,055.02
XYLEM INC	13,941	73.27	1,021,457.07
CINTAS CORP	7,034	191.48	1,346,870.32
COPART INC	17,540	57.63	1,010,830.20
COSTAR GROUP INC	3,008	401.85	1,208,764.80
EQUIFAX INC	9,276	127.82	1,185,658.32
IHS MARKIT LTD	32,775	51.14	1,676,113.50
MANPOWER GROUP	5,123	92.30	472,852.90
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	31.24	859,224.96
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	68.24	1,259,778.64
ROBERT HALF INTL INC	9,566	68.91	659,193.06

ROLLINS INC	7,031	52.81	371,307.11
STERICYCLE INC	6,767	64.60	437,148.20
TRANSUNION	15,344	70.93	1,088,349.92
VERISK ANALYTICS INC	12,301	109.06	1,341,547.06
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	76.73	1,565,905.84
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	83.59	2,919,882.29
AMERCO	602	346.68	208,701.36
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	43.11	427,651.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	88.32	1,011,087.36
CSX CORP	68,519	67.07	4,595,569.33
DELTA AIR LINES INC	15,095	54.09	816,488.55
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	76.52	1,056,205.56
FEDEX CORP	20,716	260.15	5,389,267.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	128.68	918,003.12
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	109.25	955,172.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	40.51	433,457.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	154.23	3,516,289.77
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	160.64	842,556.80
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	50.48	578,753.20
UNION PACIFIC CORP	63,871	144.52	9,230,636.92
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	69.99	420,149.97
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	116.60	6,437,719.20
XPO LOGISTICS INC	10,037	111.28	1,116,917.36
APTIV PLC	20,954	100.81	2,112,372.74
AUTOLIV INC	6,639	158.85	1,054,605.15
BORGWARNER INC	15,953	50.02	797,969.06
FORD MOTOR COMPANY	299,765	12.10	3,627,156.50
GENERAL MOTORS CO	101,158	44.25	4,476,241.50
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	25.31	547,379.37
HARLEY-DAVIDSON	14,677	42.65	625,974.05
LEAR CORP	5,287	205.34	1,085,632.58
TESLA INC	10,369	317.66	3,293,816.54
DR HORTON INC	28,586	44.19	1,263,215.34
GARMIN LTD	9,564	61.85	591,533.40
HANESBRANDS INC	31,136	20.09	625,522.24
HASBRO INC	9,007	90.33	813,602.31
LEGGETT & PLATT INC	10,594	43.64	462,322.16
LENNAR CORP-CL A	23,545	54.00	1,271,430.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	122.02	1,033,753.44
MATTEL INC	27,399	17.03	466,604.97
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	64.65	746,513.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	210.44	1,065,247.28

NEWELL BRANDS INC	37,563	24.68	927,054.84
NIKE B	105,293	74.90	7,886,445.70
NVR INC	264	3,196.45	843,862.80
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	126.01	591,112.91
PULTE GROUP INC	21,959	32.56	714,985.04
PVH CORP	5,820	168.16	978,691.20
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	142.23	651,128.94
TAPESTRY INC	22,032	46.24	1,018,759.68
TOLL BROTHERS INC	11,211	40.52	454,269.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	24.31	387,744.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	22.40	364,739.20
VF CORP	26,718	83.67	2,235,495.06
WHIRLPOOL CORP	5,324	148.86	792,530.64
ARAMARK	19,980	39.03	779,819.40
BLOCK H & R INC	16,984	29.15	495,083.60
CARNIVAL CORPORATION	35,126	60.94	2,140,578.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	453.38	895,425.50
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	91.45	917,334.95
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	270.04	932,448.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	84.14	1,979,225.22
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	78.00	2,522,598.00
MARRIOTT INTL A	25,016	138.38	3,461,714.08
MCDONALD'S CORP	63,834	168.91	10,782,200.94
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	29.65	523,678.30
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	30.78	1,374,511.68
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.75	923,116.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	103.48	1,436,819.80
STARBUCKS CORP	113,248	56.60	6,409,836.80
VAIL RESORTS INC	2,987	275.25	822,171.75
WYNN RESORTS LTD	8,052	178.12	1,434,222.24
YUM BRANDS INC	27,323	83.18	2,272,727.14
CBS CORP-CL B	28,628	51.13	1,463,749.64
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	277.26	3,779,608.32
COMCAST CORP-CL A	373,142	32.08	11,970,395.36
DISCOVERY INC - A	12,804	23.02	294,748.08
DISCOVERY INC-C	23,672	21.80	516,049.60
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	32.08	584,433.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	23.12	782,242.08
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	72.90	631,532.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	29.37	455,704.92
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	28.35	1,311,782.85
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	32.01	448,460.10

LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	46.17	703,307.61
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.03	293,855.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	45.86	579,532.82
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.82	529,637.78
OMNICOM GROUP	19,030	73.90	1,406,317.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	7.24	937,616.20
THE WALT DISNEY CO	121,890	103.98	12,674,122.20
TIME WARNER INC	62,552	95.34	5,963,707.68
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	39.99	3,444,538.65
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	39.55	1,441,953.45
VIACOM INC-CLASS B	26,755	27.91	746,732.05
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	131.71	814,758.06
AMAZON.COM	33,277	1,683.99	56,038,135.23
AUTOZONE INC	2,151	674.39	1,450,612.89
BEST BUY COMPANY INC	21,836	72.31	1,578,961.16
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	2,136.54	8,351,734.86
CARMAX INC	14,253	73.79	1,051,728.87
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	94.90	2,119,117.00
DOLLAR TREE INC	19,550	82.63	1,615,416.50
EXPEDIA GROUP INC	9,800	120.89	1,184,722.00
GAP	16,326	31.74	518,187.24
GENUINE PARTS CO	11,245	94.62	1,064,001.90
HOME DEPOT	94,571	198.33	18,756,266.43
KOHL'S CORP	12,602	77.76	979,931.52
L BRANDS INC	19,499	36.99	721,268.01
LKQ CORP	24,693	32.59	804,744.87
LOWES COMPANIES	66,782	100.22	6,692,892.04
MACY'S INC	25,926	39.88	1,033,928.88
NETFLIX INC	35,175	360.57	12,683,049.75
NORDSTROM INC	10,094	52.47	529,632.18
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	283.13	1,869,507.39
QURATE RETAIL INC	35,071	21.46	752,623.66
ROSS STORES INC	30,239	85.84	2,595,715.76
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	78.02	3,264,044.72
TIFFANY & CO	9,326	132.19	1,232,803.94
TJX COMPANIES INC	51,517	94.94	4,891,023.98
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	76.58	724,140.48
TRIPADVISOR INC	10,393	55.84	580,345.12
ULTA BEAUTY INC	4,911	253.06	1,242,777.66
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	203.76	7,268,934.24
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	8.90	301,710.00
KROGER CO	72,735	25.36	1,844,559.60

SYSCO CORP	40,229	66.15	2,661,148.35
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	63.40	4,298,329.80
WALMART INC	119,581	84.36	10,087,853.16
ALTRIA GROUP INC	152,862	57.71	8,821,666.02
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	44.85	1,998,829.95
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	52.97	1,167,458.80
BUNGE LIMITED	11,767	69.17	813,923.39
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	34.05	479,151.60
COCA-COLA CO	328,376	43.95	14,432,125.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	38.42	656,059.92
CONAGRA BRANDS INC	33,243	37.74	1,254,590.82
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	227.28	3,186,011.04
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	120.52	1,790,324.60
GENERAL MILLS INC	44,875	42.91	1,925,586.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	91.77	1,027,824.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	36.21	849,667.65
INGREDION INC	5,835	111.96	653,286.60
JM SMUCKER CO	9,442	102.52	967,993.84
KELLOGG CO	21,051	63.71	1,341,159.21
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	58.47	2,917,185.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	103.48	959,880.48
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	63.56	959,756.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	39.78	4,783,226.76
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	55.48	1,938,027.36
PEPSICO INC	115,115	102.49	11,798,136.35
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	79.42	10,006,125.80
TYSON FOODS INC	24,363	70.75	1,723,682.25
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	48.19	919,609.77
CLOROX COMPANY	10,045	126.75	1,273,203.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	63.34	4,293,438.56
COTY INC-CL A	39,000	13.89	541,710.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	153.05	2,727,657.10
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	103.27	2,890,527.30
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	77.18	15,652,567.08
ABBOTT LABORATORIES	142,028	63.27	8,986,111.56
ABIOMED INC	3,502	409.77	1,435,014.54
AETNA INC	26,686	180.81	4,825,095.66
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	346.67	2,171,540.88
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	86.09	1,105,998.23
ANTHEM INC	20,871	228.30	4,764,849.30
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	74.78	3,146,069.38
BECTON DICKINSON & CO	21,729	231.84	5,037,651.36

BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	31.95	3,596,579.55
CARDINAL HEALTH	25,252	53.35	1,347,194.20
CENTENE CORP	16,736	119.81	2,005,140.16
CERNER CORP	23,088	60.69	1,401,210.72
CIGNA CORP	19,408	177.81	3,450,936.48
CVS HEALTH CORP	81,494	66.03	5,381,048.82
DANAHER CORP	50,460	103.00	5,197,380.00
DAVITA INC	11,875	71.05	843,718.75
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	42.96	766,148.64
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	142.82	2,395,948.32
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	78.39	3,620,755.71
HCA HEALTHCARE INC	23,027	105.39	2,426,815.53
HENRY SCHEIN INC	12,492	72.12	900,923.04
HOLOGIC INC	21,094	38.34	808,743.96
HUMANA INC	11,281	297.89	3,360,497.09
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	219.72	1,583,082.60
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	484.60	4,390,960.60
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	186.96	1,486,892.88
MCKESSON CORP	16,655	145.37	2,421,137.35
MEDTRONIC PLC	110,187	87.18	9,606,102.66
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	109.72	1,155,571.04
RESMED INC	10,895	106.79	1,163,477.05
STRYKER CORP	27,181	178.95	4,864,039.95
TELEFLEX INC	3,697	283.28	1,047,286.16
THE COOPER COS INC	4,135	232.21	960,188.35
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	250.68	19,682,892.24
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	115.30	835,694.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	121.67	854,853.42
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	79.53	776,292.33
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	114.50	1,839,213.50
ABBVIE INC	122,922	100.43	12,345,056.46
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	65.73	1,664,480.79
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	118.33	2,097,872.57
ALKERMES PLC	12,547	48.61	609,909.67
ALLERGAN PLC	26,330	170.35	4,485,315.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	100.24	741,675.76
AMGEN	54,777	184.30	10,095,401.10
BIOGEN INC	17,262	303.29	5,235,391.98
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	90.64	1,299,868.24
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	53.16	7,066,027.20
CELGENE CORP	61,389	79.06	4,853,414.34
GILEAD SCIENCES INC	106,635	71.91	7,668,122.85

ILLUMINA INC	12,043	282.03	3,396,487.29
INCYTE CORP	14,121	70.01	988,611.21
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	104.60	1,361,996.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	176.79	878,823.09
JOHNSON & JOHNSON	217,581	124.06	26,993,098.86
LILLY (ELI) & CO	79,730	86.08	6,863,158.40
MERCK & CO	218,364	62.58	13,665,219.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	594.86	1,193,289.16
MYLAN NV	42,644	41.36	1,763,755.84
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	54.14	731,268.98
PERRIGO CO PLC	11,333	73.26	830,255.58
PFIZER	483,121	36.67	17,716,047.07
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	308.10	2,018,055.00
SEATTLE GENETICS INC	9,601	65.01	624,161.01
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	23.11	1,864,745.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	217.02	6,996,290.76
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	111.89	363,306.83
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	150.55	3,131,289.45
WATERS CORP	6,513	205.32	1,337,249.16
ZOETIS INC	39,742	86.78	3,448,810.76
BANK OF AMERICA CORP	787,725	30.01	23,639,627.25
BB&T CORP	64,293	54.60	3,510,397.80
CIT GROUP INC	10,713	52.08	557,933.04
CITIGROUP	208,262	68.47	14,259,699.14
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	41.98	1,679,619.80
COMERICA INC	14,360	96.47	1,385,309.20
EAST WEST BANCORP INC	10,794	72.66	784,292.04
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	31.81	1,851,882.77
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	103.38	1,300,313.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	15.69	1,371,588.42
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	111.11	30,774,358.92
KEY CORP	87,033	20.54	1,787,657.82
M & T BANK CORP	11,745	177.11	2,080,156.95
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	11.99	468,749.05
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	19.19	525,498.96
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	148.85	5,641,266.15
REGIONS FINL CORP	96,209	19.11	1,838,553.99
SIGNATURE BANK	4,354	130.64	568,806.56
SUNTRUST BANKS	38,353	70.53	2,705,037.09
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	325.72	1,429,910.80
US BANCORP	127,580	52.05	6,640,539.00
WELLS FARGO & CO	378,753	55.68	21,088,967.04

ZIONS BANCORPORATION	15,186	57.19	868,487.34
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	165.05	731,666.65
ALLY FINANCIAL INC	36,028	26.63	959,425.64
AMERICAN EXPRESS	59,473	101.00	6,006,773.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	142.63	1,690,165.50
BANK NEW YORK CO	81,361	57.56	4,683,139.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	196.01	20,268,218.04
BLACKROCK INC	9,812	549.41	5,390,810.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	96.97	3,849,902.94
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	103.95	984,406.50
CME GROUP INC	27,733	170.97	4,741,511.01
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	75.38	2,228,609.70
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	65.41	1,380,674.28
EATON VANCE CORP	10,061	56.45	567,943.45
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	34.41	897,068.70
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	233.39	6,844,861.92
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	75.66	3,548,907.96
INVESCO LTD	30,943	27.93	864,237.99
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	23.07	593,037.42
MOODY'S CORP	14,116	179.21	2,529,728.36
MORGAN STANLEY	108,682	51.91	5,641,682.62
MSCI INC	6,934	166.29	1,153,054.86
NASDAQ INC	9,070	95.13	862,829.10
NORTHERN TRUST CORP	17,320	106.92	1,851,854.40
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	125.98	2,527,914.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	100.60	999,159.20
S&P GLOBAL INC	20,491	206.47	4,230,776.77
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	57.73	5,692,351.19
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	66.75	721,033.50
STATE STREET CORP	29,345	100.46	2,947,998.70
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	35.45	2,139,301.15
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	62.31	1,458,303.24
VOYA FINANCIAL INC	14,081	53.59	754,600.79
AFLAC	61,894	45.89	2,840,315.66
ALLEGHANY CORP	1,276	591.69	754,996.44
ALLSTATE CORP	28,446	93.71	2,665,674.66
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	111.63	619,434.87
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	55.12	3,996,806.32
AON PLC	20,163	142.97	2,882,704.11
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,517	84.29	970,767.93
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	67.78	1,014,802.16
ASSURANT INC	4,769	98.29	468,745.01

ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	45.81	611,426.07
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.94	423,077.88
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	46.70	317,373.20
CHUBB LTD	37,790	133.52	5,045,720.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	71.28	884,798.64
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	230.32	772,262.96
FNF GROUP	20,786	37.87	787,165.82
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	53.26	1,526,538.12
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	69.25	1,231,957.50
LOEWS CORP	22,051	50.42	1,111,811.42
MARKEL CORP	1,132	1,117.59	1,265,111.88
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	82.90	3,385,470.20
METLIFE INC	71,520	47.41	3,390,763.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	56.80	1,315,204.00
PROGRESSIVE CORP	46,702	62.84	2,934,753.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	100.55	3,373,050.30
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	151.68	823,774.08
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	127.64	414,702.36
TORCHMARK CORP	8,473	86.24	730,711.52
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	131.32	2,864,220.52
UNUM GROUP	18,574	39.35	730,886.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	158.13	1,728,360.90
WR BERKLEY CORP	7,296	78.31	571,349.76
XL GROUP LTD	20,644	56.30	1,162,257.20
CBRE GROUP INC-A	26,855	48.59	1,304,884.45
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.32	722,484.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	170.77	627,238.21
WEYERHAEUSER CO	62,107	38.11	2,366,897.77
ACCENTURE PLC-CL A	50,076	162.17	8,120,824.92
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	74.29	4,303,322.54
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	251.21	9,905,210.30
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	78.48	1,112,689.44
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	222.38	893,078.08
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,132.71	27,362,875.47
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,120.87	28,559,767.60
ANSYS INC	6,865	172.23	1,182,358.95
AUTODESK INC	18,086	135.13	2,443,961.18
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	135.35	4,841,198.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	119.40	1,152,210.00
CA INC	26,520	36.28	962,145.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	44.07	951,250.95
CDK GLOBAL INC	10,687	64.99	694,548.13

CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	99.10	1,070,379.10
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	107.94	1,225,334.88
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	77.11	3,702,822.20
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	88.33	1,397,998.91
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	85.54	2,010,018.92
EBAY	78,686	40.29	3,170,258.94
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	137.87	3,456,400.90
FACEBOOK INC-A	193,825	189.10	36,652,307.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	106.14	2,879,047.50
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	20.05	787,122.90
FISERV INC	33,784	75.47	2,549,678.48
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	202.50	1,450,507.50
FORTINET INC	10,871	62.53	679,763.63
GARTNER INC	7,002	137.73	964,385.46
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	117.08	1,465,022.04
GODADDY INC - CLASS A	12,570	72.64	913,084.80
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	157.17	1,000,229.88
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	146.14	10,917,534.84
INTUIT INC	19,851	206.26	4,094,467.26
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	129.65	775,177.35
LEIDOS HOLDINGS	10,999	61.29	674,128.71
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	200.04	15,028,405.08
MERCADOLIBRE INC	3,264	288.80	942,643.20
MICROSOFT CORP	591,521	101.63	60,116,279.23
ORACLE CORP	250,503	48.18	12,069,234.54
PAYCHEX INC	25,506	68.17	1,738,744.02
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	84.34	7,726,134.38
RED HAT INC	13,963	171.06	2,388,510.78
SABRE CORP	17,243	25.53	440,213.79
SALESFORCE.COM INC	55,092	133.53	7,356,434.76
SERVICENOW INC	13,794	178.19	2,457,952.86
SPLUNK INC	11,773	116.75	1,374,497.75
SQUARE INC - A	22,319	61.78	1,378,867.82
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	51.68	913,754.08
SYMANTEC CORP	48,508	21.32	1,034,190.56
SYNOPSIS INC	12,264	90.51	1,110,014.64
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	113.42	1,083,387.84
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	87.14	1,098,835.40
TWITTER INC	55,701	41.21	2,295,438.21
VERISIGN INC	7,289	137.87	1,004,934.43
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	134.74	19,667,189.36
VMWARE INC-CLASS A	5,821	149.64	871,054.44

WESTERN UNION CO	38,757	20.81	806,533.17
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	123.90	1,324,614.90
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	82.07	1,921,915.26
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	62.43	621,927.66
AMPHENOL CORPORATION	24,215	90.91	2,201,385.65
APPLE INC	410,252	191.70	78,645,308.40
ARISTA NETWORKS INC	4,324	273.75	1,183,695.00
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	77.74	518,214.84
AVNET INC	10,936	39.58	432,846.88
CDW CORP/DE	12,482	84.71	1,057,350.22
CISCO SYSTEMS	390,187	43.48	16,965,330.76
COGNEX CORP	12,660	47.52	601,603.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	29.80	445,003.40
CORNING	71,752	28.75	2,062,870.00
F5 NETWORKS INC	5,350	176.80	945,880.00
FLEX LTD	40,465	14.07	569,342.55
FLIR SYSTEMS INC	11,686	55.06	643,431.16
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	16.01	2,077,073.36
HP INC	134,066	23.71	3,178,704.86
IPG PHOTONICS CORP	3,207	248.95	798,382.65
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.92	874,007.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	60.99	966,874.47
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	112.30	1,417,226.00
NETAPP INC	20,821	74.35	1,548,041.35
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	199.33	1,437,368.63
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	55.98	1,278,359.28
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	97.25	2,723,875.25
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	34.52	711,871.44
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	82.62	1,947,931.74
XEROX CORP	16,718	27.91	466,599.38
AT&T INC	497,265	33.83	16,822,474.95
CENTURYLINK INC	73,994	17.65	1,305,994.10
SPRINT CORP	64,825	5.17	335,145.25
T-MOBILE US INC	28,273	57.80	1,634,179.40
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	49.18	16,444,169.06
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	36.29	554,837.81
AES CORP	52,646	12.77	672,289.42
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	39.23	755,412.88
AMEREN CORPORATION	18,723	56.69	1,061,406.87
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	64.11	2,492,083.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	79.28	1,132,356.24
ATMOS ENERGY CORP	9,385	85.31	800,634.35

CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	25.35	797,029.35
CMS ENERGY CORP	21,593	43.35	936,056.55
CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	72.75	1,860,290.25
DOMINION ENERGY INC	53,227	62.60	3,332,010.20
DTE ENERGY COMPANY	14,355	96.97	1,392,004.35
DUKE ENERGY CORP	57,060	73.12	4,172,227.20
EDISON INTL	26,184	59.61	1,560,828.24
ENERGY CORP	13,854	76.89	1,065,234.06
EVERGY INC	11,492	51.32	589,769.44
EVERSOURCE ENERGY	25,381	53.56	1,359,406.36
EXELON CORP	77,742	40.00	3,109,680.00
FIRSTENERGY CORP	39,519	33.32	1,316,773.08
NEXTERA ENERGY INC	37,780	156.80	5,923,904.00
NISOURCE INC	26,021	23.52	612,013.92
OGE ENERGY CORP	15,686	33.75	529,402.50
PG&E CORP	41,241	41.45	1,709,439.45
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	74.40	700,550.40
PPL CORPORATION	53,473	25.79	1,379,068.67
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	50.89	2,066,439.34
SCANA CORP	11,459	36.15	414,242.85
SEMPRA ENERGY	19,952	101.43	2,023,731.36
SOUTHERN CO	81,059	43.28	3,508,233.52
UGI CORP	13,950	48.81	680,899.50
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.56	726,018.16
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	59.46	1,503,565.02
XCEL ENERGY INC	40,763	42.69	1,740,172.47
ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	15.25	1,176,812.00
ANALOG DEVICES	30,277	101.06	3,059,793.62
APPLIED MATERIALS	84,218	51.15	4,307,750.70
BROADCOM INC	33,321	257.97	8,595,818.37
INTEL CORP	378,881	55.05	20,857,399.05
KLA-TENCOR CORP	12,266	114.20	1,400,777.20
LAM RESEARCH CORP	12,814	188.03	2,409,416.42
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	21.75	821,127.75
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	60.75	1,326,111.75
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	102.15	1,902,441.60
MICRON TECHNOLOGY	92,766	61.39	5,694,904.74
NVIDIA CORP	46,674	262.28	12,241,656.72
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	120.17	3,278,598.11
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	25.20	907,099.20
QORVO INC	10,609	80.16	850,417.44
QUALCOMM	120,270	60.26	7,247,470.20

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	99.81	1,448,243.10
	TEXAS INSTRUMENTS	79,005	115.74	9,144,038.70
	XILINX INC	20,299	69.54	1,411,592.46
	アメリカドル 小計	24,801,972		1,964,918,098.81 (214,981,689,190)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	25.01	297,268.86
	ARC RESOURCES LTD	27,117	12.80	347,097.60
	CAMECO CORP	28,709	15.13	434,367.17
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	43.66	4,369,929.40
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	13.00	1,011,439.00
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	9.96	430,710.24
	ENBRIDGE	138,840	40.55	5,629,962.00
	ENCANA CORP	76,271	16.07	1,225,674.97
	HUSKY ENERGY INC	31,439	19.42	610,545.38
	IMPERIAL OIL	24,763	42.47	1,051,684.61
	INTER PIPELINE LTD	30,317	24.81	752,164.77
	KEYERA CORP	14,929	36.46	544,311.34
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	44.81	1,894,387.56
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	26.51	486,458.50
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	15.00	300,150.00
	SUNCOR ENERGY	134,041	52.73	7,067,981.93
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	24.45	488,144.25
	TRANSCANADA CORP	70,703	54.11	3,825,739.33
	VERMILION ENERGY INC	10,067	45.70	460,061.90
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	57.54	1,016,213.94
	BARRICK GOLD CORP	94,395	16.87	1,592,443.65
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.46	846,939.94
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	21.83	1,242,127.00
	FRANCO-NEVADA CORP	14,257	91.47	1,304,087.79
	GOLDCORP INC	68,688	18.33	1,259,051.04
	KINROSS GOLD CORP	107,615	4.64	499,333.60
	LUNDIN MINING CORP	62,243	8.75	544,626.25
	METHANEX CORP	7,099	91.88	652,256.12
	NUTRIEN LTD	51,428	68.09	3,501,732.52
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	38.20	1,744,861.40
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.66	259,860.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	96.00	415,392.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	28.69	1,056,882.22
	BOMBARDIER B	157,835	4.88	770,234.80
	CAE INC	18,372	27.61	507,250.92
	FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	34.25	402,917.00
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	58.50	860,710.50

WSP GLOBAL INC	9,471	73.28	694,034.88
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	107.88	6,530,947.32
CP RAILWAY LIMITED	11,959	248.83	2,975,757.97
LINAMAR CORP	3,889	65.09	253,135.01
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	85.47	2,391,279.66
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	37.43	660,976.37
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	76.55	1,406,376.60
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	26.98	969,850.06
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	166.28	899,408.52
DOLLARAMA INC	8,900	151.19	1,345,591.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	53.89	1,835,655.07
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	24.18	278,045.82
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	65.37	1,020,948.66
METRO INC	19,179	42.71	819,135.09
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	103.51	494,260.25
SAPUTO INC	20,412	41.80	853,221.60
BANK MONTREAL	52,905	102.17	5,405,303.85
BANK NOVA SCOTIA	96,431	76.36	7,363,471.16
CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	115.25	4,073,511.25
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	63.08	1,780,622.24
ROYAL BANK OF CANADA	116,879	99.89	11,675,043.31
TORONTO-DOMINION BANK	148,256	75.20	11,148,851.20
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	53.40	3,648,234.60
CI FINANCIAL CORP	18,671	25.11	468,828.81
IGM FINANCIAL INC	7,685	39.48	303,403.80
ONEX CORP	6,603	94.19	621,936.57
THOMSON REUTERS CORP	22,284	52.74	1,175,258.16
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	742.14	1,710,632.70
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	33.45	795,708.60
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	53.31	438,741.30
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	95.41	998,561.06
MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	24.74	3,971,710.12
POWER CORP OF CANADA	29,774	30.48	907,511.52
POWER FINANCIAL CORP	20,740	32.61	676,331.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	55.03	2,725,966.08
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.12	263,260.80
BLACKBERRY LIMITED	39,400	15.66	617,004.00
CGI GROUP INC - CL A	21,192	80.60	1,708,075.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,034.33	1,759,395.33
OPEN TEXT CORP	19,994	46.16	922,923.04
SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	210.68	1,546,812.56
BCE INC	12,539	54.78	686,886.42

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	61.51	1,776,470.31	
	TELUS CORP	16,454	45.75	752,770.50	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.01	204,451.41	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.32	323,347.68	
	EMERA INC	4,086	40.15	164,052.90	
	FORTIS INC	34,128	40.76	1,391,057.28	
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.57	425,490.94	
	カナダドル 小計	3,222,912		145,565,249.48 (12,290,074,013)	
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.85	436,431.15	
	ENI	202,686	15.22	3,085,691.66	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	16.08	641,260.69	
	NESTE OIL OYJ	11,086	70.88	785,775.68	
	OMV AG	12,139	50.76	616,175.64	
	REPSOL SA	110,036	17.03	1,874,463.26	
	SNAM SPA	173,485	3.45	599,564.16	
	TENARIS SA	40,648	15.56	632,482.88	
	TOTAL SA	195,662	53.10	10,389,652.20	
	VOPAK	6,360	42.06	267,501.60	
	AIR LIQUIDE	34,556	109.50	3,783,882.00	
	AKZO NOBEL	19,791	75.98	1,503,720.18	
	ARCELORMITTAL	53,985	28.04	1,514,009.32	
	ARKEMA	5,335	103.30	551,105.50	
	BASF SE	73,727	85.88	6,331,674.76	
	COVESTRO AG	16,178	78.12	1,263,825.36	
	CRH PLC	71,124	32.11	2,283,791.64	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	30.42	409,270.68	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	45.16	260,211.92	
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	78.52	895,677.64	
	IMERYS SA	3,000	72.35	217,050.00	
	K+S AG	14,355	22.71	326,002.05	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	88.60	1,349,732.40	
	LANXESS	7,293	69.18	504,529.74	
	LINDE AG - TENDER	15,262	196.85	3,004,324.70	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	33.70	659,340.50	
	SOLVAY SA	5,511	114.10	628,805.10	
	STORA ENSO OYJ R	47,237	18.07	853,808.77	
	SYMRISE AG	9,083	70.70	642,168.10	
	THYSSEN KRUPP	33,044	23.36	771,907.84	
	UMICORE	17,605	49.65	874,088.25	
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	32.08	1,411,199.20	
	VOESTALPINE AG	8,140	45.81	372,893.40	

ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,077	36.70	736,825.90
AIRBUS SE	46,842	100.90	4,726,357.80
ALSTOM	13,816	41.00	566,456.00
ANDRITZ AG	5,242	42.52	222,889.84
BOUYGUES ORD	16,815	39.18	658,811.70
BRENTAG AG	11,626	50.12	582,695.12
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	9.71	744,300.63
DASSAULT AVIATION SA	213	1,687.00	359,331.00
EIFFAGE	6,079	96.16	584,556.64
FERROVIAL SA	37,634	18.30	688,890.37
GEA GROUP AG	13,382	32.04	428,759.28
HOCHTIEF AG	1,354	156.80	212,307.20
KION GROUP AG	5,887	70.54	415,268.98
KONE OYJ-B	26,924	44.24	1,191,117.76
LEGRAND SA	21,312	63.84	1,360,558.08
LEONARDO SPA	35,425	8.63	306,001.15
MAN SE	3,262	94.25	307,443.50
METSO OYJ	9,561	30.22	288,933.42
MTU AERO ENGINES AG	3,907	161.70	631,761.90
OSRAM LICHT AG	7,440	51.70	384,648.00
PRYSMIAN SPA	14,715	24.16	355,514.40
REXEL SA	24,339	12.68	308,618.52
SAFRAN SA	27,252	102.55	2,794,692.60
SAINT-GOBAIN	39,044	42.50	1,659,370.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	73.60	3,298,310.40
SIEMENS	61,389	113.80	6,986,068.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.97	226,858.27
THALES SA	8,109	110.35	894,828.15
VINCI S.A.	40,049	84.32	3,376,931.68
WARTSILA OYJ	34,386	18.19	625,653.27
BUREAU VERITAS SA	19,558	21.67	423,821.86
EDENRED	18,941	25.89	490,382.49
RANDSTAD NV	9,588	52.16	500,110.08
RELX NV	80,302	18.87	1,515,298.74
SOCIETE BIC SA	2,424	80.50	195,132.00
TELEPERFORMANCE	4,523	137.30	621,007.90
WOLTERS KLUWER	23,031	47.94	1,104,106.14
ADP	2,382	176.00	419,232.00
AENA SME SA	5,610	159.00	891,990.00
ATLANTIA SPA	42,039	23.58	991,279.62
BOLLORE	61,805	4.15	256,614.36
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	22.99	389,197.71

DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	31.17	2,449,712.64
FRAPORT AG	3,561	79.56	283,313.16
GETLINK	36,478	11.71	427,157.38
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.87	364,711.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	85.64	2,303,030.88
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	74.60	372,328.60
CONTINENTAL AG	8,828	221.90	1,958,933.20
DAIMLER AG	74,263	61.96	4,601,335.48
FAURECIA	5,945	72.62	431,725.90
FERRARI NV	9,947	115.30	1,146,889.10
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	17.96	1,554,312.28
MICHELIN	13,802	116.45	1,607,242.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	35.15	361,763.80
PEUGEOT SA	46,029	20.60	948,197.40
PIRELLI & C SPA	39,097	7.27	284,469.77
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	61.88	719,911.92
RENAULT SA	15,041	83.50	1,255,923.50
SCHAEFFLER AG	15,247	13.25	202,022.75
VALEO SA	19,350	54.02	1,045,287.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	159.40	2,355,932.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	160.80	417,115.20
ADIDAS AG	14,964	199.35	2,983,073.40
HERMES INTERNATIONAL	2,561	563.20	1,442,355.20
HUGO BOSS AG	4,852	78.36	380,202.72
KERING	6,060	505.40	3,062,724.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	53.50	712,566.50
LVMH	22,399	300.35	6,727,539.65
MONCLER SPA	15,736	39.75	625,506.00
PUMA AG	772	494.50	381,754.00
SEB SA	2,075	155.70	323,077.50
ACCOR	14,931	43.40	648,005.40
PADDY POWER PLC	7,143	98.35	702,514.05
SODEXO	7,035	81.32	572,086.20
AXEL SPRINGER SE	3,827	61.00	233,447.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	17.33	207,603.96
JC DECAUX SA	4,674	26.66	124,608.84
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	24.85	476,473.90
PUBLICIS GROUPE	17,601	56.74	998,680.74
RTL GROUP	3,513	65.05	228,520.65
SES	31,369	15.60	489,356.40
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	41.82	209,016.36
VIVENDI	83,098	21.48	1,784,945.04

INDITEX	86,470	28.29	2,446,236.30
ZALANDO SE	9,155	46.03	421,404.65
CARREFOUR	43,442	14.96	650,109.53
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	32.82	121,007.34
COLRUYT SA	4,160	45.48	189,196.80
JERONIMO MARTINS	20,234	13.33	269,820.39
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	19.92	2,002,858.27
METRO AG	13,712	11.32	155,219.84
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	80.10	4,873,203.90
DANONE (GROUPE)	48,771	64.31	3,136,463.01
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	6.44	274,080.07
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	83.00	745,340.00
HEINEKEN NV	20,246	85.42	1,729,413.32
KERRY GROUP PLC-A	13,146	90.25	1,186,426.50
PERNOD-RICARD	17,495	141.10	2,468,544.50
REMY COINTREAU	1,575	122.90	193,567.50
BEIERSDORF AG	7,693	98.00	753,914.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	96.40	830,775.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	107.30	1,535,892.20
LOREAL	20,321	206.10	4,188,158.10
UNILEVER NV-CVA	125,731	47.42	5,962,164.02
BIOMERIEUX	3,246	76.80	249,292.80
ESSILOR INTERNATIONAL	17,239	117.25	2,021,272.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	86.68	1,559,893.28
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	67.76	2,293,676.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	36.00	2,680,932.30
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	122.20	396,661.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.20	440,000.00
BAYER	66,378	98.44	6,534,250.32
BAYER AG-RTS	66,378	1.49	99,434.24
EUROFINS SCIENTIFIC	971	422.60	410,344.60
GRIFOLS SA	22,128	26.91	595,464.48
IPSEN	2,722	133.45	363,250.90
MERCK KGAA	10,480	84.52	885,769.60
ORION OYJ-CLASS B	7,975	26.35	210,141.25
QIAGEN N.V.	17,548	31.02	544,338.96
RECORDATI SPA	7,493	32.55	243,897.15
SANOFI	91,271	66.43	6,063,132.53
UCB (GROUPE)	10,465	66.16	692,364.40
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	23.04	764,674.56
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	6.07	3,291,960.28
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.46	646,723.06

BANCO SANTANDER SA	1,302,544	4.69	6,117,397.89
BANKIA SA	110,053	3.35	369,007.70
BANKINTER SA	58,881	8.43	496,602.35
BNP PARIBAS	90,844	53.70	4,878,322.80
CAIXABANK	277,342	3.84	1,066,379.99
COMMERZBANK AG	80,494	9.32	750,526.05
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	11.89	1,103,796.26
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	36.10	834,198.80
ING GROEP NV-CVA	314,846	12.66	3,986,580.05
INTESA SANPAOLO	1,095,718	2.42	2,657,116.15
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.51	163,280.00
KBC GROEP NV	20,232	66.48	1,345,023.36
MEDIOBANCA	53,990	7.82	422,633.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	27.43	342,600.70
SOCIETE GENERALE	63,719	37.23	2,372,258.37
UNICREDIT SPA	163,189	13.60	2,219,370.40
AMUNDI SA	4,764	64.22	305,944.08
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	9.55	1,539,684.42
DEUTSCHE BOERSE	15,552	117.45	1,826,582.40
EURAZEO SA	3,198	65.45	209,309.10
EXOR NV	7,813	58.90	460,185.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	91.36	570,725.92
NATIXIS	69,996	6.28	439,574.88
WENDEL	2,023	116.20	235,072.60
AEGON	133,499	5.37	717,156.62
AGEAS	16,065	43.63	700,915.95
ALLIANZ SE-REG	36,019	178.58	6,432,273.02
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.17	1,440,366.33
AXA	157,703	21.80	3,437,925.40
CNP ASSURANCES	11,830	19.61	231,986.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	109.40	514,836.40
MAPFRE SA	90,939	2.60	236,714.21
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	178.85	2,265,135.25
NN GROUP NV	23,899	36.51	872,552.49
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.08	326,111.94
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	41.88	1,516,600.44
SCOR SE	13,354	31.79	424,523.66
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	40.50	1,115,896.50
VONOVIA SE	40,469	40.65	1,645,064.85
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	70.32	2,544,599.52
ATOS SE	7,634	118.10	901,575.40
CAPGEMINI SA	13,238	113.20	1,498,541.60

	DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	119.25	1,248,428.25	
	DELIVERY HERO AG	8,671	41.12	356,551.52	
	SAP SE	78,835	100.44	7,918,187.40	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	95.62	653,084.60	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	55.06	523,785.78	
	WIRECARD AG	9,864	142.00	1,400,688.00	
	INGENICO GROUP	4,681	70.98	332,257.38	
	NOKIA OYJ	458,694	4.93	2,261,820.11	
	1&1 DRILLISCH AG	3,773	60.05	226,568.65	
	DEUTSCHE TELEKOM	268,918	13.33	3,586,021.53	
	ELISA A	11,722	38.97	456,806.34	
	ILIAD SA	2,053	147.70	303,228.10	
	KPN (KON.)	261,596	2.38	624,952.84	
	ORANGE	164,543	14.67	2,414,668.52	
	PROXIMUS	13,141	22.47	295,278.27	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.67	573,085.45	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.59	278,985.22	
	TELEFONICA	377,880	7.58	2,865,086.16	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.62	242,889.30	
	E.ON SE	183,255	8.86	1,625,105.34	
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	11.12	553,064.32	
	ENDESA	24,774	19.01	471,077.61	
	ENEL	656,974	4.59	3,018,138.55	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.37	652,384.99	
	ENGIE	151,158	13.50	2,040,633.00	
	FORTUM OYJ	38,328	20.20	774,225.60	
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	21.01	546,974.34	
	IBERDROLA SA	476,207	6.35	3,025,819.27	
	INNOGY SE	11,000	36.40	400,400.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	17.51	575,763.82	
	RWE STAMM	42,828	18.90	809,449.20	
	SUEZ	28,043	11.43	320,671.70	
	TERNA SPA	105,905	4.44	470,430.01	
	UNIPER SE	14,751	25.60	377,625.60	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	19.09	873,214.78	
	ASML HOLDING NV	33,413	175.65	5,868,993.45	
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	24.73	2,244,074.39	
	STMICROELECTRONICS	57,598	21.04	1,211,861.92	
	ユーロ 小計	15,584,318		320,948,825.52 (41,421,655,421)	
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.83	9,439,421.33	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	26.06	9,724,564.78	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	27.00	8,213,886.00
WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	6.44	347,868.00
ANGLO AMERICAN PLC	87,426	18.49	1,616,856.44
ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.98	393,878.16
BHP BILLITON PLC	168,203	17.63	2,966,428.10
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	48.30	494,736.90
FRESNILLO PLC	17,743	12.16	215,754.88
GLENCORE PLC	943,407	3.83	3,621,267.76
JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	37.88	534,524.68
MONDI PLC	27,192	20.97	570,216.24
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	58.30	425,240.20
RIO TINTO PLC REG	96,058	44.20	4,245,763.60
ASHTREAD GROUP PLC	42,021	23.75	997,998.75
BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.48	1,665,122.08
BUNZL PLC	27,712	22.72	629,616.64
DCC PLC	7,320	72.05	527,406.00
FERGUSON PLC	20,276	58.94	1,195,067.44
MEGGITT PLC	66,268	4.98	330,213.44
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.37	968,111.82
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	8.35	1,117,873.80
SMITHS GROUP PLC	28,628	17.84	510,866.66
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	14.14	262,460.47
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	22.00	408,892.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.54	168,217.60
EXPERIAN PLC	75,041	18.83	1,413,022.03
G4S PLC	132,555	2.75	365,454.13
INTERTEK GROUP PLC	12,430	57.14	710,250.20
RELX PLC	82,063	16.73	1,373,324.30
EASYJET PLC	11,633	17.13	199,331.45
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.82	362,366.45
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.86	418,708.72
BURBERRY GROUP PLC	35,328	21.14	746,833.92
PERSIMMON PLC	26,389	28.80	760,003.20
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.91	516,973.65
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	43.21	457,982.79
CARNIVAL PLC	13,721	45.20	620,189.20
COMPASS GROUP PLC	126,022	15.79	1,989,887.38
GVC HOLDINGS PLC	42,500	10.55	448,375.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	49.15	686,330.60
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.82	249,260.24
TUI AG-DI	37,945	17.34	657,966.30
WHITBREAD PLC	14,664	41.45	607,822.80

ITV PLC	295,435	1.69	499,728.30
PEARSON	66,305	8.82	585,340.54
SKY PLC	83,042	13.40	1,112,762.80
WPP PLC	98,371	12.16	1,196,191.36
KINGFISHER PLC	170,994	3.01	515,375.91
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.90	392,262.70
NEXT PLC	11,202	60.54	678,169.08
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.46	413,923.75
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.04	452,125.08
TESCO	786,019	2.47	1,948,541.10
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	27.40	790,353.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	36.56	6,815,478.64
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.00	466,960.00
DIAGEO	200,277	27.24	5,455,545.48
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	25.84	1,988,721.06
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	58.74	3,150,754.86
UNILEVER PLC	99,877	41.15	4,110,437.93
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.26	254,734.59
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	5.50	165,388.71
NMC HEALTH PLC	9,509	34.34	326,539.06
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.60	965,967.20
ASTRAZENECA	101,347	53.53	5,425,104.91
GLAXOSMITHKLINE	403,375	15.28	6,163,570.00
SHIRE PLC	74,526	39.98	2,979,549.48
BARCLAYS	1,365,547	1.99	2,717,438.53
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	7.29	11,929,273.92
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.62	3,729,948.61
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.67	790,822.22
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	7.26	1,696,749.05
3I GROUP PLC	79,251	9.67	766,674.17
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	19.62	401,601.78
INVESTEC PLC	54,280	5.52	299,734.16
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	45.04	1,184,371.84
SCHRODERS PLC	8,614	32.53	280,213.42
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.93	533,867.50
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.51	776,176.83
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.02	309,251.37
AVIVA PIC	318,261	5.06	1,612,310.22
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.47	395,500.77
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.70	1,311,602.13
OLD MUTUAL PLC	397,509	2.22	884,060.01
PRUDENTIAL	212,799	18.36	3,906,989.64

	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.43	556,785.49	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.17	333,641.70	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	13.36	468,080.96	
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.71	599,343.91	
	BT GROUP PLC	663,615	2.04	1,360,078.94	
	VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.87	4,082,421.99	
	CENTRICA PLC	440,558	1.45	641,011.89	
	NATIONAL GRID PLC	272,668	8.28	2,259,054.38	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	19.37	350,829.44	
	SSE PLC	80,824	13.42	1,085,062.20	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.79	458,870.88	
	イギリスポンド 小計	24,811,314		156,751,629.62 (23,001,734,130)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	24.70	429,730.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	644.50	433,104.00	
	GIVAUDAN-REG	740	2,203.00	1,630,220.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	51.86	2,091,721.24	
	SIKA AG-BR	175	8,240.00	1,442,000.00	
	ABB LTD	149,127	22.66	3,379,217.82	
	GEBERIT AG-REG	3,021	439.00	1,326,219.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	214.00	316,506.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	220.00	657,580.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	59.74	790,001.76	
	SGS SA	437	2,611.00	1,141,007.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	152.35	604,067.75	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	92.26	3,828,328.70	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	492.50	1,222,877.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	89.40	352,057.20	
	DUFREY AG-REG	2,548	136.85	348,693.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,764.00	282,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	75,400.00	603,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,270.00	470,250.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	252,246	73.46	18,529,991.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	173.55	718,497.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	691.50	538,678.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	268.00	1,542,876.00	
	NOVARTIS	180,510	73.86	13,332,468.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	207.70	11,846,584.90	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	157.50	567,157.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	15.18	3,214,315.24	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	59.18	1,021,091.72	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	88.60	300,974.20	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	730.50	1,089,175.50
	UBS GROUP AG	317,371	15.19	4,822,452.34
	BALOISE HOLDING AG	3,877	147.00	569,919.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	342.30	1,009,442.70
	SWISS RE LTD	26,239	87.06	2,284,367.34
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	294.70	3,626,283.50
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	91.65	575,287.05
	TEMENOS AG	5,252	146.00	766,792.00
	SWISSCOM	2,064	442.30	912,907.20
	スイスフラン 小計	1,398,491		88,618,283.82 (9,844,605,149)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	278.80	3,956,450.80
	BOLIDEN AB	20,141	314.05	6,325,281.05
	ALFA LAVAL AB	25,639	224.10	5,745,699.90
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	189.00	15,175,755.00
	ATLAS COPCO A	53,833	353.60	19,035,348.80
	ATLAS COPCO B	29,972	319.45	9,574,555.40
	SANDVIK AB	87,313	154.85	13,520,418.05
	SKANSKA B	28,530	159.55	4,551,961.50
	SKF AB-B	28,335	171.20	4,850,952.00
	VOLVO B	123,214	148.90	18,346,564.60
	SECURITAS B	22,844	142.65	3,258,696.60
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	215.80	3,921,086.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	88.02	3,407,430.24
	HENNES & MAURITZ B	73,962	134.60	9,955,285.20
	ICA GRUPPEN AB	5,730	270.70	1,551,111.00
	SWEDISH MATCH AB	15,149	425.30	6,442,869.70
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	217.00	10,539,907.00
	NORDEA BANK AB	244,135	84.54	20,639,172.90
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	80.26	11,132,864.60
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	97.30	11,693,222.10
	SWEDBANK AB-A	71,353	186.95	13,339,443.35
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	184.15	2,355,646.80
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	366.10	13,454,907.20
	KINNEVIK AB - B	18,104	304.60	5,514,478.40
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	285.20	2,076,256.00
	ERICSSON (LM) B	248,169	63.42	15,738,877.98
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	525.60	11,302,502.40
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	554.00	3,431,476.00
	TELE2 AB-B SHS	33,266	110.80	3,685,872.80
	TELIA CO AB	235,437	42.33	9,966,048.21
		1,908,474		264,490,141.58

スウェーデンクローナ 小計				(3,324,641,079)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	296.60	3,058,242.60
	EQUINOR ASA	92,696	216.70	20,087,223.20
	NORSK HYDRO	106,150	53.72	5,702,378.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	358.00	4,822,260.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	240.50	1,676,525.50
	MARINE HARVEST	32,238	168.65	5,436,938.70
	ORKLA	69,804	74.30	5,186,437.20
	DNB ASA	80,217	154.30	12,377,483.10
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	127.20	2,362,612.80
	TELENOR ASA	60,821	171.60	10,436,883.60
ノルウェークローネ 小計		491,252		71,146,984.70 (965,464,582)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	640.00	4,736,640.00
	NOVOZYMES A/S	17,687	326.00	5,765,962.00
	VESTAS WIND SYSSEMS	17,720	407.60	7,222,672.00
	ISS A/S	14,253	222.40	3,169,867.20
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,990.00	2,688,010.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,588.00	4,870,704.00
	DSV A/S	14,599	531.00	7,752,069.00
	PANDORA A/S	8,431	502.40	4,235,734.40
	CARLSBERG AS-B	8,236	720.20	5,931,567.20
	COLOPLAST-B	9,476	630.00	5,969,880.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	241.80	1,794,156.00
	GENMAB A/S	4,512	952.00	4,295,424.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	450.90	2,196,333.90
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	285.55	41,102,638.10
	DANSKE BANK A/S	59,378	213.40	12,671,265.20
	TRYG A/S	9,828	148.40	1,458,475.20
ORSTED A/S	15,908	371.90	5,916,185.20	
デンマーククローネ 小計		344,469		121,777,583.40 (2,109,187,744)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	29.35	605,461.15
	OIL SEARCH LTD	118,781	8.38	995,384.78
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	9.94	1,333,967.88
	SANTOS	156,437	5.89	921,413.93
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	33.48	2,575,147.68
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.73	465,350.34
	AMCOR	88,486	13.91	1,230,840.26
	BHP BILLITON LTD	258,265	34.07	8,799,088.55
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	18.45	910,101.60
	BORAL LIMITED	81,732	6.38	521,450.16

FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.71	634,323.96
INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.54	533,120.46
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.77	850,755.51
NEWCREST MINING LIMITED	61,159	20.84	1,274,553.56
ORICA LTD	29,211	17.53	512,068.83
RIO TINTO LTD	32,522	86.60	2,816,405.20
SOUTH32 LTD	408,172	3.85	1,571,462.20
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	41.51	382,722.20
BRAMBLES LTD	129,297	9.06	1,171,430.82
SEEK LTD	26,358	20.89	550,618.62
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.14	660,276.18
TRANSURBAN GROUP	182,844	11.67	2,133,789.48
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	30.01	1,312,187.25
CROWN RESORTS LTD	30,328	13.36	405,182.08
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	52.91	292,221.93
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	61.53	200,772.39
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.58	764,154.68
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.49	157,618.87
WESFARMERS LTD	93,277	46.36	4,324,321.72
WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	28.87	2,968,442.27
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.16	422,550.80
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	16.99	991,791.25
COCHLEAR LIMITED	4,811	198.63	955,608.93
HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.28	319,836.12
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	56.66	693,971.68
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	24.25	770,592.25
CSL LIMITED	36,265	189.19	6,860,975.35
AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	26.66	6,261,660.86
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	10.09	359,204.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.30	437,070.20
COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	69.37	9,731,431.71
NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	26.38	5,870,420.54
WESTPAC BANKING	277,750	27.61	7,668,677.50
AMP LTD	244,230	3.63	886,554.90
ASX LTD	15,814	61.89	978,728.46
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	12.60	555,256.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	113.07	3,027,788.46
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	8.01	1,462,273.56
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.87	615,649.44
QBE INSURANCE GROUP	113,093	9.33	1,055,157.69
SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.03	1,443,981.63
COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	17.66	575,080.24

	REA GROUP LTD	3,593	88.74	318,842.82	
	TELSTRA CORP	342,339	2.77	948,279.03	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.42	170,594.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	21.19	1,087,979.36	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.54	185,154.20	
	オーストラリアドル 小計	5,815,961		96,529,746.82 (8,035,136,125)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.88	527,310.72	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.85	581,907.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	11.50	768,821.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	14.48	658,955.84	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.23	444,156.91	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.70	538,161.30	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.14	347,108.16	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		3,866,421.43 (297,869,106)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	90.05	19,180,289.80	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	14.70	1,455,300.00	
	MTR CORP	114,000	44.50	5,073,000.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	38.00	1,748,000.00	
	LI & FUNG	554,800	3.09	1,714,332.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	46.20	5,497,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	23.00	1,575,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	64.40	12,751,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	20.80	1,397,760.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	44.75	9,075,300.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	16.62	1,628,760.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	10.24	1,351,680.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	27.45	3,864,960.00	
	WH GROUP LTD	699,000	7.88	5,508,120.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	32.65	3,564,074.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	39.95	12,384,500.00	
	HANG SENG BANK	61,100	200.20	12,232,220.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	260.00	25,194,000.00	
	AIA GROUP LTD	968,600	71.95	69,690,770.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	66.30	14,320,534.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	24.40	1,976,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.98	3,110,540.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	45.95	5,231,131.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	45.80	2,702,200.00	
KERRY PROPERTIES LTD	64,500	41.35	2,667,075.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	12.10	5,947,150.00		

	SINO LAND CO	235,400	14.14	3,328,556.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	126.90	16,750,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	83.25	3,371,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	30.95	2,977,390.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	25.80	2,347,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	60.40	5,496,400.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	59.20	3,848,000.00	
	PCCW LTD	357,000	4.56	1,627,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	59.40	2,970,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	81.95	10,940,325.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	737,913	15.48	11,422,893.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	55.45	6,154,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	106.50	2,524,050.00	
	香港ドル 小計	7,660,909		304,603,306.64 (4,246,170,094)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	7.58	851,234.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.94	314,580.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.49	380,410.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.01	201,899.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.40	399,600.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	11.43	495,296.19	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.13	262,656.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.25	531,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.70	343,170.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	34.52	341,748.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.30	127,795.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.24	578,664.00	
	DBS GROUP	145,600	28.50	4,149,600.00	
	OCBC BANK	260,000	12.58	3,270,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	28.02	3,101,814.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.25	451,675.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.50	654,850.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	11.84	369,408.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	8.13	386,175.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	21.13	543,041.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.23	2,070,245.89	
	シンガポールドル 小計	3,459,876		19,825,911.08 (1,626,319,485)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	352.60	1,069,083.20	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	16.78	1,136,945.68	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	452.00	659,920.00	
	BANK HAPUALIM BM	84,067	24.61	2,068,888.87	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	22.02	2,549,783.88	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	69.55	570,310.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	185.40	801,484.20	
	NICE LTD	4,894	380.00	1,859,720.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.28	662,486.71	
	イスラエルシェケル 小計	444,132		11,378,622.54 (348,982,353)	
	合 計	90,510,346		322,493,528,471 (322,493,528,471)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	748,813.56	
		LENDLEASE GROUP	44,009	840,131.81	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	640,701.80	
		オーストラリアドル 小計	223,440	2,229,647.17 (185,595,830)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,658,160.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,685,360.00	
		香港ドル 小計	488,500	4,343,520.00 (60,548,668)	
		投資信託受益証券合計	711,940	246,144,498 (246,144,498)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	682,824.48	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,078,444.01	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	4,974,883.42	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	1,020,356.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,813,462.92	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,508,840.30	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	646,293.96	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,379,815.04	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,843,405.68	
		DUKE REALTY CORP	29,929	859,560.88	
		EQUINIX INC	6,496	2,620,161.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,855,247.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,223,506.23	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	989,217.84	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	728,664.94	
		GGP INC	55,941	1,156,300.47	
HCP INC	36,011	876,507.74			

	HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,311,880.92
	INVITATION HOMES INC	24,000	531,840.00
	IRON MOUNTAIN INC	20,489	709,124.29
	KIMCO REALTY CORP	35,407	579,966.66
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	531,398.90
	MACERICH CO/THE	10,128	577,296.00
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	839,263.64
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	462,399.20
	PROLOGIS INC	43,653	2,878,915.35
	PUBLIC STORAGE	12,835	2,779,419.25
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,155,479.57
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	696,809.99
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,473,459.12
	SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,319,560.22
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	795,002.85
	UDR INC	20,960	785,371.20
	VENTAS INC	27,813	1,525,264.92
	VEREIT INC	77,798	558,589.64
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	951,922.00
	WELLTOWER INC	29,615	1,717,373.85
	アメリカドル 小計	919,180	52,437,830.80 (5,737,223,067)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	192,125.60
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	373,928.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	170,281.44
	カナダドル 小計	30,576	736,335.64 (62,168,818)
ユーロ	COVIVIO	3,578	316,653.00
	GECINA SA	3,549	527,736.30
	ICADE	2,845	228,738.00
	KLEPIERRE	17,225	573,592.50
	UNIBAIL GROUP STAPLED	7,814	1,501,069.40
	ユーロ 小計	35,011	3,147,789.20 (406,253,674)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	543,191.76
	HAMMERSON PLC	61,184	326,355.45
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	549,960.15
	SEGRO PLC	81,695	548,827.01
	イギリスポンド 小計	280,843	1,968,334.37 (288,833,385)
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	724,600.20
	GOODMAN GROUP	140,271	1,321,352.82

	GPT GROUP	136,015	682,795.30	
	MIRVAC GROUP	306,089	670,334.91	
	ONEMARKET LTD	8,072	10,816.48	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,779,184.71	
	STOCKLAND	207,412	858,685.68	
	UNIBAIL-RODAMCO-WTFIELD-CDI	59,520	879,705.60	
	VICINITY CENTERS	291,115	762,721.30	
	オーストラリアドル 小計	1,649,247	7,690,197.00	(640,131,998)
香港ドル	LINK REIT	179,500	13,157,350.00	
	香港ドル 小計	179,500	13,157,350.00	(183,413,459)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	523,375.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	413,100.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	416,624.00	
	SUNTEC REIT	173,000	304,480.00	
	シンガポールドル 小計	813,800	1,657,579.00	(135,971,205)
	投資証券合計	3,908,157	7,453,995,606	(7,453,995,606)
	合計		7,700,140,104	(7,700,140,104)

(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 601銘柄	97.4%			65.1%
	投資証券 37銘柄			2.6%	1.7%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			12.5%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 97銘柄	98.8%			7.0%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.0%

ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	90.7%			2.4%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券	9銘柄			7.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	94.6%			1.3%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 6月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	151,650,591
金銭信託	50,853,945
コール・ローン	3,143,609,750
国債証券	241,310,483,562
派生商品評価勘定	19,565,026
未収入金	3,106,125
未収利息	1,779,951,355
前払金	9,529,609
前払費用	123,789,161
差入委託証拠金	118,570,539
流動資産合計	246,711,109,663
資産合計	246,711,109,663
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,880,874
未払金	39,693,707

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
未払解約金	112,674,039
未払利息	8,330
その他未払費用	38,112
流動負債合計	177,295,062
負債合計	177,295,062
純資産の部	
元本等	
元本	92,353,094,819
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,180,719,782
元本等合計	246,533,814,601
純資産合計	246,533,814,601
負債純資産合計	246,711,109,663

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益

	2018年 6月11日現在
	約定日基準で計上しております。
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	92,353,094,819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	1口当たり純資産額 2.6695円 (1万口当たり純資産額) (26,695円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 8月25日
期首元本額	83,845,600,457円
期中追加設定元本額	24,172,055,936円

区分	2018年 6月11日現在
期中一部解約元本額	15,664,561,574円
期末元本額	92,353,094,819円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,074,714,113円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	880,695,693円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	572,553,708円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,984,951,672円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,355,721円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,975,588,867円
世界経済インデックスファンド	6,111,056,503円
D C マイセレクション 2 5	1,564,297,815円
D C マイセレクション 5 0	1,362,942,985円
D C マイセレクション 7 5	901,196,108円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,723,153,491円
D C マイセレクション S 2 5	617,805,825円
D C マイセレクション S 5 0	544,508,145円
D C マイセレクション S 7 5	258,000,661円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	54,883,975円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	59,735,048円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	27,499,325円
D C 世界経済インデックスファンド	4,779,656,678円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	583,886,492円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	51,430,107円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,057,964円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,474,391円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	61,231,855円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	189,571,064円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	270,158,659円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	211,614,811円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	609,099,382円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,686,314,782円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	713,513,176円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,620,569,884円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	987,183,539円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	140,569,077円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	737,780,473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）	1,024,136,915円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	288,825,333円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	355,338,054円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,184,217,111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）	978,766,791円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	912,264,322円

区分	2018年 6月11日現在
外国債券ファンド・シリーズ1	642,533,349円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,562,931,400円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,859,123,710円
分散投資コア戦略ファンドA	999,598,262円
分散投資コア戦略ファンドS	2,811,615,649円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	180,752,268円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,931,470,479円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,210,304,516円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	230,525,969円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	115,659,156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）	944,618,174円
SMT インデックスバランス・オープン	249,504,822円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	23,969,372,563円
SMT 世界経済インデックス・オープン	13,666,274円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	72,505,178円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	82,577,938円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	419,163円
グローバル経済コア	1,165,631,561円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,504,320円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	9,345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）	1,019,246,505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）	5,811,491,998円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	359,431,705円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,486,566,809
合計	1,486,566,809

(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

（2018年 6月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	債券先物取引		うち1年超	

	買建	2,221,780,469	-	2,212,250,860	9,529,609
	合計	2,221,780,469	-	2,212,250,860	9,529,609

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,159,358,275	-	3,163,574,900	4,216,625
	アメリカドル	1,478,038,066	-	1,475,401,300	2,636,766
	カナダドル	140,771,501	-	140,120,600	650,901
	ユーロ	1,310,558,126	-	1,317,702,600	7,144,474
	イギリスポンド	229,990,582	-	230,350,400	359,818
	売建	70,020,360	-	70,023,224	2,864
	イギリスポンド	70,020,360	-	70,023,224	2,864
	合計	3,229,378,635	-	3,233,598,124	4,213,761

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,407,648.62	
		T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,248,481.07	

T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,899,840.36	
T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,364,684.19	
T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,770,389.20	
T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,909,236.03	
T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,435,128.41	
T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,330,124.35	
T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,371,584.65	
T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,368,541.54	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,213,900.60	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,413,215.06	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,536,979.80	
T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,915,875.40	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,913,837.90	
T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,650,921.55	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,907,934.45	
T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,118,243.40	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	979,536.92	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,171,682.66	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,516,215.90	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,423,161.43	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,667,107.50	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,327,067.20	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,895,371.88	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,436,785.60	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,835,129.30	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,529,097.25	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,312,313.50	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,362,809.13	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,771,368.80	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,647,908.92	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,224,287.65	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,051,046.25	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,782,018.30	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,834,069.67	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,911,956.66	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,932,383.10	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,383,095.40	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,434,302.79	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,315,523.89	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,514,796.00	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,731,656.05	
T 1.625% 06/30/19	10,000,000.00	9,923,957.70	

T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,946,805.59
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,906,066.00
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,389,852.20
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,429,939.27
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,466,082.20
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,813,808.35
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,980,804.80
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,216,960.66
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,414,874.47
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,215,688.02
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,796,512.60
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,661,676.20
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,671,817.05
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,198,337.86
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,735,683.36
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,957,972.85
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,737,879.85
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,924,256.04
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,031,357.24
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,426,172.45
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,702,123.11
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,695,283.22
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,860,968.60
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,118,898.38
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,254,673.52
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,287,206.25
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,873,916.21
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,374,322.65
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,928,212.04
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,170,595.48
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,963,751.99
T 2.125% 02/29/24	15,750,000.00	15,160,426.31
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,116,959.99
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,281,382.97
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,387,001.40
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,051,019.23
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,601,889.02
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,999,469.86
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,440,891.73
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,965,046.26
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,929,794.12
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,412,287.12
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,480,748.36

T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,020,339.63	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,463,802.86	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,963,259.72	
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,475,299.56	
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,037,582.40	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,071,807.32	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,779,211.66	
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,772,781.49	
T 2.25% 11/15/27	6,700,000.00	6,317,488.08	
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,940,885.42	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,085,719.04	
T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,425,718.24	
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,156,507.25	
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,288,010.51	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,886,849.30	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,634,838.50	
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,712,970.47	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,000,123.80	
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,845,041.05	
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,271,840.79	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,484,719.55	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,391,408.71	
T 2.625% 03/31/25	3,000,000.00	2,951,364.03	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,510,453.19	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,012,671.12	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,987,413.50	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,228,560.68	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,836,875.24	
T 2.75% 08/15/47	8,250,000.00	7,717,774.09	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,878,963.97	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,969,087.02	
T 2.75% 11/15/47	8,550,000.00	7,994,466.56	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	4,970,697.90	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,486,729.66	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,438,246.60	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,512,912.16	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,949,598.46	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,936,889.00	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,731,423.68	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,001,248.42	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,142,729.54	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,913,299.91	

T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,585,213.54
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,659,326.63
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,938,331.65
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,524,386.14
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,346,224.73
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,117,218.71
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,424,071.29
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,936,880.62
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,147,686.94
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,374,705.76
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,045,462.40
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,374,374.90
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,051,556.62
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,425,142.49
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,907,284.55
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,865,452.13
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,222,315.39
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,132,031.83
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,392,917.90
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,485,088.45
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,738,542.47
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,191,536.86
T 3.75% 11/15/43	7,050,000.00	7,883,468.41
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,570,207.31
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,929,138.33
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,450,093.18
T 3% 05/15/47	6,700,000.00	6,590,807.62
T 3% 11/15/44	2,300,000.00	2,267,919.48
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,070,893.84
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,373,922.61
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,203,125.85
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,304,965.79
T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	5,051,689.96
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,270,234.54
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,223,864.99
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,223,536.92
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	307,469.43
T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	4,880,834.51
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,418,988.52
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,512,121.21
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,567,773.48
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,006,123.32
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,468,324.95

	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,062,221.92
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,829,303.18
	T 6.25% 05/15/30	400,000.00	531,679.66
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,924,890.44
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,995,093.63
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,240,145.01
	アメリカドル 小計	995,270,000.00	972,912,831.08 (106,446,392,848)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,924,307.50
	CAN 0.75% 03/01/21	2,850,000.00	2,756,320.50
	CAN 0.75% 08/01/19	2,770,000.00	2,738,865.20
	CAN 0.75% 09/01/20	2,470,000.00	2,406,150.50
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,564,563.65
	CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,474,562.50
	CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,059,831.50
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,325,144.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,169,716.50
	CAN 1.75% 03/01/23	1,050,000.00	1,030,916.25
	CAN 1.75% 09/01/19	2,600,000.00	2,598,804.00
	CAN 1% 06/01/27	1,890,000.00	1,691,275.95
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,432,245.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,549,310.25
	CAN 2.5% 06/01/24	2,000,000.00	2,032,120.00
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,612,513.25
	CAN 2.75% 12/01/48	1,550,000.00	1,682,432.00
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	695,494.30
	CAN 2% 06/01/28	1,000,000.00	972,350.00
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	367,668.00
	CAN 3.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,646,079.30
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,854,522.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,500,000.00	3,068,725.00
	CAN 3.75% 06/01/19	1,700,000.00	1,733,201.00
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,573,570.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,900,000.00	2,526,354.00
CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,285,392.00	
CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,243,440.00	
CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	525,787.20	
	カナダドル 小計	57,880,000.00	60,541,661.35 (5,111,532,467)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	20,848,454.00
	MBONO 10% 12/05/24	40,000,000.00	44,484,400.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	21,750,000.00	19,166,317.50

	MBONO 5% 12/11/19	44,050,000.00	42,356,497.75
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,599,200.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	31,300,000.00	30,247,068.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	22,150,000.00	21,690,609.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	16,936,438.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	23,945,718.75
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,872,531.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,347,942.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	12,650,000.00	13,374,086.00
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,924,506.25
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	9,300,967.50
	MBONO 8% 12/07/23	6,400,000.00	6,449,152.00
	メキシコペソ 小計	345,450,000.00	346,543,888.75 (1,867,871,560)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,708,874.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,152,048.50
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,116,583.20
	BGB 0.8% 06/22/28	850,000.00	842,668.75
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	846,251.50
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	793,964.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,298,794.50
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,166,324.50
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,163,514.50
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,276,840.50
	BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	466,285.50
	BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,670,737.50
	BGB 2.25% 06/22/57	450,000.00	486,162.00
	BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,738,556.00
	BGB 3.75% 06/22/45	1,260,000.00	1,817,033.40
	BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	3,020,792.50
	BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,293,038.00
	BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,092,260.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,221,710.20
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,710,137.50
	BGB 4.25% 09/28/22	1,350,000.00	1,608,795.00
	BGB 4.5% 03/28/26	980,000.00	1,278,919.60
	BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,617,256.25
	BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,405,599.80
	BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,273,610.00
	BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,493,519.70
	BKO 0% 12/13/19	800,000.00	808,340.00
	BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,467,633.00
	BTPS 0.35% 06/15/20	4,350,000.00	4,239,314.25

BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,589,993.00	
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,339,065.00	
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,179,028.50	
BTPS 0.65% 11/01/20	900,000.00	875,497.50	
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	1,965,540.00	
BTPS 0.9% 08/01/22	500,000.00	471,840.00	
BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,212,555.50	
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,866,350.00	
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,328,967.75	
BTPS 1.25% 12/01/26	2,600,000.00	2,281,968.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	1,550,000.00	1,498,005.25	
BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	638,694.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,010,667.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	2,932,432.00	
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,406,876.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,449,120.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,571,450.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	1,908,840.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	2,940,128.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,503,275.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,684,701.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	1,801,180.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,169,337.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,305,536.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,600,000.00	2,260,700.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	778,752.40	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,450,000.00	1,342,866.75	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,500,823.50	
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,223,371.50	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,487,891.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,450,000.00	1,418,672.75	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,210,000.00	3,262,226.70	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,050,000.00	4,238,649.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	2,500,000.00	2,618,912.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,197,080.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,268,207.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,698,742.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,742,153.75	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,725,405.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	3,996,494.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	4,701,838.75	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,250,044.50	

BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,634,112.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,274,077.75
BTPS 4.75% 09/01/28	2,400,000.00	2,711,472.00
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,848,212.00
BTPS 4% 02/01/37	3,500,000.00	3,785,792.50
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,409,227.00
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,431,599.50
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,319,300.50
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,811,400.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,877,713.75
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,425,220.00
BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,290,790.00
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,001,204.50
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	4,196,640.00
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,495,660.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,004,799.75
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	4,958,713.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,836,569.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,054,088.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,425,547.25
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,294,464.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,479,611.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,050,000.00	2,060,137.25
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,082,086.00
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,055,973.50
DBR 1.25% 08/15/48	1,100,000.00	1,132,912.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,761,433.25
DBR 1.5% 05/15/23	2,050,000.00	2,223,932.25
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,844,896.95
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,563,593.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,350,000.00	1,490,589.00
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,348,540.00
DBR 1% 08/15/24	3,000,000.00	3,186,555.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,242,043.25
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,662,862.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,178,770.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,592,528.75
DBR 2.5% 07/04/44	3,200,000.00	4,251,584.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,110,000.00	4,178,487.15
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,589,822.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,336,649.00
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,603,762.00
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,798,055.00

DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,814,223.00	
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,061,232.00	
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,765,405.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,050,000.00	4,686,035.25	
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,023,066.50	
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,340,181.50	
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,157,205.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,691,390.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,300,000.00	3,664,544.00	
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,985,680.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,709,650.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,650,000.00	2,711,659.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,638,867.50	
FRTR 0.25% 11/25/20	4,600,000.00	4,680,592.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,716,261.25	
FRTR 0.5% 05/25/25	4,750,000.00	4,798,093.75	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,580,000.00	5,576,066.10	
FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,793,106.25	
FRTR 0.75% 05/25/28	3,600,000.00	3,578,418.00	
FRTR 0% 03/25/23	750,000.00	750,378.75	
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,033,570.00	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,591,791.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	950,000.00	951,966.50	
FRTR 1.25% 05/25/36	3,350,000.00	3,299,130.25	
FRTR 1.5% 05/25/31	4,800,000.00	5,051,856.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,800,000.00	5,218,344.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,050,000.00	1,011,213.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,150,000.00	2,266,949.25	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,297,083.75	
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,754,225.75	
FRTR 1% 11/25/25	7,050,000.00	7,349,378.25	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,479,750.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000.00	7,840,814.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,157,746.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,835,887.25	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,700,000.00	6,763,620.00	
FRTR 2% 05/25/48	2,800,000.00	2,991,506.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,551,946.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,678,130.75	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,831,050.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	1,880,000.00	2,325,682.20	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,910,000.00	6,618,815.85	

FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,321,923.60
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,153,150.00
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,662,187.50
FRTR 4.5% 04/25/41	3,660,000.00	5,817,954.30
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,622,340.00
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,282,695.75
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,705,637.00
FRTR 4% 10/25/38	3,800,000.00	5,577,355.00
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,009,936.75
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,649,626.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,683,607.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,417,185.00
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,260,106.40
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,003,237.05
IRISH 0.9% 05/15/28	400,000.00	394,964.00
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	505,772.80
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	755,936.25
IRISH 1% 05/15/26	1,650,000.00	1,679,906.25
IRISH 2.4% 05/15/30	1,450,000.00	1,636,499.00
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	1,014,074.60
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,353,987.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,050,000.00	1,241,073.75
IRISH 4.4% 06/18/19	400,000.00	419,968.00
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,274,729.60
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,047,759.25
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	869,456.00
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	892,470.90
NETHER 0.25% 01/15/20	1,950,000.00	1,978,577.25
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,688,014.25
NETHER 0.5% 07/15/26	3,400,000.00	3,428,339.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,650,000.00	1,682,628.75
NETHER 0.75% 07/15/28	1,100,000.00	1,112,171.50
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,822,239.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	897,516.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,132,539.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,600,000.00	1,767,096.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,261,699.00
NETHER 2.75% 01/15/47	1,630,000.00	2,268,234.65
NETHER 2% 07/15/24	2,450,000.00	2,731,639.75
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,288,773.75
NETHER 3.5% 07/15/20	2,800,000.00	3,043,656.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,601,577.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,980,000.00	3,102,412.50

NETHER 4% 01/15/37	1,940,000.00	2,949,100.70
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,156,468.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,672,038.00
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	271,224.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,380,244.50
OBL 0.25% 10/16/20	4,600,000.00	4,695,289.00
OBL 0% 04/14/23	1,100,000.00	1,110,818.50
OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,848,412.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,647,556.00
OBL 0% 10/08/21	3,050,000.00	3,099,440.50
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,061,130.00
RAGB 0.5% 04/20/27	1,100,000.00	1,087,696.50
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,472,616.70
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	499,712.50
RAGB 0% 09/20/22	640,000.00	644,441.60
RAGB 1.2% 10/20/25	1,850,000.00	1,956,772.75
RAGB 1.5% 02/20/47	470,000.00	470,641.55
RAGB 1.5% 11/02/86	280,000.00	247,899.40
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,907,745.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,529,318.00
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	974,063.50
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	541,907.50
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,117,335.70
RAGB 3.15% 06/20/44	1,030,000.00	1,425,458.20
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,505,504.00
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,446,273.55
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,264,307.00
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	789,395.55
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,912,846.25
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,694,258.00
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	671,220.00
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,277,558.50
RFGB 0.375% 09/15/20	650,000.00	663,039.00
RFGB 0.5% 04/15/26	550,000.00	551,570.25
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	345,248.75
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	528,365.70
RFGB 0.875% 09/15/25	650,000.00	673,081.50
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	544,271.40
RFGB 0% 09/15/23	600,000.00	598,281.00
RFGB 1.125% 04/15/34	420,000.00	423,129.00
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	698,759.75
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	829,078.25

RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	769,203.65
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	863,366.40
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	664,806.00
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	751,100.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	889,656.00
RFGB 4.375% 07/04/19	750,000.00	790,222.50
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,418,941.00
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,100,979.00
SPGB 0.35% 07/30/23	480,000.00	475,747.20
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,064,042.50
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,361,679.50
SPGB 0.75% 07/30/21	750,000.00	766,503.75
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,081,630.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,100,000.00	3,121,390.00
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,424,038.60
SPGB 1.4% 04/30/28	1,920,000.00	1,910,620.80
SPGB 1.45% 10/31/27	2,300,000.00	2,312,282.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,095,673.75
SPGB 1.6% 04/30/25	1,950,000.00	2,043,297.75
SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,128,047.25
SPGB 1.95% 07/30/30	2,250,000.00	2,311,110.00
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,829,509.25
SPGB 2.35% 07/30/33	1,500,000.00	1,573,785.00
SPGB 2.7% 10/31/48	950,000.00	975,973.00
SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,594,080.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,100,000.00	2,266,036.50
SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,406,298.30
SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,653,691.00
SPGB 4.2% 01/31/37	2,830,000.00	3,750,386.75
SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,152,193.50
SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,103,596.25
SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,201,104.10
SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,264,157.00
SPGB 4.7% 07/30/41	2,550,000.00	3,640,609.50
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,752,338.75
SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,345,458.50
SPGB 4.9% 07/30/40	2,200,000.00	3,197,579.00
SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,235,920.00
SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,793,691.00
SPGB 5.15% 10/31/44	1,750,000.00	2,669,581.25
SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,179,620.00
SPGB 5.5% 04/30/21	3,300,000.00	3,820,212.00
SPGB 5.75% 07/30/32	3,420,000.00	5,111,583.30

	SPGB 5.85% 01/31/22	4,250,000.00	5,124,246.25
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,250,520.70
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,508,745.00
	ユーロ 小計	667,660,000.00	752,502,807.50 (97,118,012,335)
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,434,795.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,350,000.00	2,310,473.00
	UKT 1.25% 07/22/27	3,950,000.00	3,885,852.00
	UKT 1.5% 01/22/21	5,730,000.00	5,836,148.25
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,633,904.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,520,000.00	2,320,731.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,000,000.00	1,008,690.00
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	788,008.00
	UKT 1.75% 07/22/19	5,470,000.00	5,537,527.15
	UKT 1.75% 07/22/57	1,590,000.00	1,597,965.90
	UKT 1.75% 09/07/22	3,150,000.00	3,252,831.75
	UKT 1.75% 09/07/37	1,400,000.00	1,378,447.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,913,501.25
	UKT 2.5% 07/22/65	2,250,000.00	2,847,712.50
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,409,924.00
	UKT 2% 07/22/20	2,600,000.00	2,668,497.00
	UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,371,623.75
	UKT 3.25% 01/22/44	3,350,000.00	4,283,159.25
	UKT 3.5% 01/22/45	3,300,000.00	4,422,495.00
	UKT 3.5% 07/22/68	2,350,000.00	3,790,362.00
	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,072,519.50
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	571,199.75
	UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	800,602.50
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,186,630.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,844,190.00
	UKT 4.25% 06/07/32	2,050,000.00	2,704,339.50
	UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,774,967.00
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	840,270.45
	UKT 4.25% 12/07/40	2,080,000.00	2,998,840.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,205,870.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,794,998.15
	UKT 4.25% 12/07/55	2,370,000.00	3,993,473.70
	UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,367,396.80
UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,870,262.50	
UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,837,447.75	
UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,439,675.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,852,232.50	

	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,275,434.50	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,617,257.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,368,198.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,798,612.50	
	UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,880,429.00	
イギリスポンド 小計		95,680,000.00	115,787,494.90 (16,990,657,001)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	425,396.00	
	SWISS 2% 04/28/21	800,000.00	862,556.00	
	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	666,630.25	
	SWISS 4% 04/08/28	720,000.00	1,003,168.80	
スイスフラン 小計		2,470,000.00	2,957,751.05 (328,576,564)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,650,000.00	7,757,367.75	
	SGB 1.5% 11/13/23	11,500,000.00	12,434,662.50	
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,748,963.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,350,000.00	8,502,075.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,700,000.00	8,041,218.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	16,177,545.30	
	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,665,420.00	
スウェーデンクローナ 小計		66,620,000.00	75,327,252.30 (946,863,561)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,610,000.00	4,553,204.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,650,441.75	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,900,000.00	6,971,380.50	
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,912,224.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	11,000,000.00	11,849,750.00	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,012,953.25	
ノルウェークローネ 小計		41,360,000.00	42,949,955.05 (582,830,890)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	1,600,000.00	1,631,752.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,800,000.00	6,837,638.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,163,541.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	13,090,000.00	14,606,803.75	
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,961,369.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,900,000.00	28,745,210.00	
	DGB 4% 11/15/19	12,590,000.00	13,433,781.80	
デンマーククローネ 小計		68,280,000.00	84,380,096.05 (1,461,463,263)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,197,305.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,064,223.50	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	1,999,500.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	3,200,000.00	3,202,048.00	

	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,425,730.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,858,469.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,530,000.00	2,424,157.45	
	POLGB 2% 04/25/21	4,040,000.00	4,051,716.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	4,570,000.00	4,666,084.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,727,048.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,750,000.00	4,004,137.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,411,906.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,743,910.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	736,797.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,097,826.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,288,799.25	
	ポーランドズロチ 小計	50,920,000.00	51,899,659.00 (1,566,331,708)	
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,824,749.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,222,086.40	
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	398,030.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,553,418.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	820,000.00	782,981.10	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,474,132.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,540,610.25	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,036,503.75	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,650,000.00	1,636,923.75	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,370,471.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,480,063.75	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,239,020.75	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,200,000.00	1,207,962.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,629,750.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,506,312.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	4,948,414.60	
	ACGB 4.5% 04/15/20	4,090,000.00	4,269,673.70	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,482,378.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,452,698.25	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,450,000.00	3,937,105.50	
ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,347,488.50		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,481,042.30		
	オーストラリアドル 小計	59,830,000.00	62,821,816.30 (5,229,287,988)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	243,188.75	
	SIGB 1.625% 10/01/19	410,000.00	408,975.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	360,000.00	354,637.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	550,000.00	536,577.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	874,567.50	

	SIGB 2.375% 06/01/25	700,000.00	697,242.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,300,000.00	1,309,015.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	669,634.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	595,878.90	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	827,455.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	286,827.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	477,825.50	
	SIGB 2% 07/01/20	760,000.00	760,839.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,143,967.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	606,351.85	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	830,263.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,022,399.50	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	828,124.00	
	シンガポールドル 小計	12,300,000.00	12,473,770.85 (1,023,223,422)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,452,875.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,647,998.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	1,998,040.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,246,172.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,603,944.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,151,173.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,252,823.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,095,534.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,042,762.50	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	751,065.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,508,872.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,091,958.55	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,655,882.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,067,455.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,893,198.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,361,035.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,668,603.75	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,950,000.00	2,958,466.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	622,505.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,300,173.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,228,545.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,812,933.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,630,447.50	
MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	390,772.00		
MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,623,517.50		
MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,863,949.00		
MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	638,220.00		

マレーシアリングット 小計		44,180,000.00	43,558,920.80 (1,196,563,554)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000.00	28,801,476.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,866,682.10	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,753,530.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,099,067.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	4,200,000.00	4,181,520.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,518,076.50	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,590,964.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,775,222.80	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	14,857,100.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	25,650,000.00	23,052,937.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,407,037.75	
	SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,875,274.75	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,209,520.50	
	SAGB 9% 01/31/40	11,800,000.00	10,953,881.00	
南アフリカランド 小計		187,980,000.00	171,942,291.40 (1,440,876,401)	
合計			241,310,483,562 (241,310,483,562)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 178銘柄	100.0%	44.1%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 287銘柄	100.0%	40.2%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
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%
マレーシアリングット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%

南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
----------	-----------	--------	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 6月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,098,035,461
金銭信託	281,599
コール・ローン	17,407,430
株式	49,966,028,309
投資信託受益証券	68,963,250
投資証券	218,221,266
派生商品評価勘定	10,132,818
未収入金	14,695,531
未収配当金	108,596,940
前払金	3,880,773
差入委託証拠金	128,585,937
流動資産合計	51,634,829,314
資産合計	51,634,829,314
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,017,471
未払金	121,369,053
未払解約金	18,761,348
未払利息	46
その他未払費用	1,020
流動負債合計	154,148,938
負債合計	154,148,938
純資産の部	
元本等	
元本	17,360,701,477
剰余金	
剰余金又は欠損金()	34,119,978,899
元本等合計	51,480,680,376
純資産合計	51,480,680,376
負債純資産合計	51,634,829,314

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 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	(1) 受取配当金

	2018年 6月11日現在
	<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 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,360,701,477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 2.9654円 (1万口当たり純資産額) (29,654円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	2018年 6月11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

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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)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つた場合、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	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 8月25日
期首元本額	15,460,216,475円
期中追加設定元本額	3,257,041,154円
期中一部解約元本額	1,356,556,152円
期末元本額	17,360,701,477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	6,588,194,935円
世界経済インデックスファンド	2,919,939,579円
DC新興国株式インデックス・オープン	3,603,497,376円
DC世界経済インデックスファンド	2,352,740,825円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	91,181,671円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	254,774,482円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	322,765,427円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	368,173,696円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,328,373円
SMT インデックスバランス・オープン	130,992,796円
SMT 世界経済インデックス・オープン	8,709,976円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	145,774,610円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,057,627円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	383,061円
グローバル経済コア	528,764,302円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	8,422,741円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	279,759,712
投資信託受益証券	5,058,784
投資証券	37,214,711
合計	247,603,785

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,216,879,355	-	1,212,998,582	3,880,773
合計		1,216,879,355	-	1,212,998,582	3,880,773

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	317,996	-	329,842	11,846
	アメリカドル	317,996	-	329,842	11,846
	売建	317,996	-	333,722	15,726
	ブラジルリアル	317,996	-	333,722	15,726
	合計	635,992	-	663,564	3,880

(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

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	469,919	4.54	2,136,251.77	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	43,400	1.37	59,458.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	37,814	67.02	2,534,294.28	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	141.30	1,217,582.10	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	6.06	655,758.86	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	119,005	4.50	536,474.54	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	63.30	1,400,892.30	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.81	267,663.30	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49,894	18.29	912,561.26	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	27.14	420,914.26	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	13.02	242,432.40	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,736	30.65	145,158.40	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	16.33	413,965.50	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	51.46	277,986.92	
	51JOB INC-ADR	1,655	110.21	182,397.55	
	DP WORLD LTD	21,152	23.50	497,072.00	
	CHINA LODGING GROUP-SPON ADR	2,598	47.90	124,444.20	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	11,374	105.00	1,194,270.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	29,537	46.80	1,382,331.60	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	41.70	1,388,860.20	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	31,722	48.89	1,550,888.58	
	JD.COM INC-ADR	58,667	39.92	2,341,986.64	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	11.98	434,143.22	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	18.25	565,184.25	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	4.75	444,543.00	
	CREDICORP LTD	5,824	230.00	1,339,520.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	217,842	13.93	3,034,539.06	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.43	295,695.37	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	65.14	131,647.94	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.49	67,994.64	
	58.COM INC-ADR	7,312	79.91	584,301.92	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	96,258	205.07	19,739,628.06	
	AUTOHOME INC-ADR	4,490	112.04	503,059.60	
	BAIDU INC - SPON ADR	23,220	263.59	6,120,559.80	
	FANG HOLDINGS LTD-ADR	12,536	4.75	59,546.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	39.81	175,363.05	
MOMO INC-SPON ADR	10,135	52.01	527,121.35		
NETEASE INC-ADR	6,861	243.58	1,671,202.38		
SINA CORP	4,772	94.98	453,244.56		
WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	106.54	408,900.52		

	YY INC-ADR	4,344	109.14	474,104.16
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.70	386,583.80
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.04	114,640.55
	アメリカドル 小計	2,100,825		57,415,167.89 (6,281,793,518)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	12.24	15,068,186.64
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	58.98	17,740,712.16
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	346.29	3,436,928.25
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	55.78	5,402,404.56
	ALFA S.A.B. -A	242,900	20.81	5,054,749.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	66.47	2,492,625.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	317.00	4,908,745.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	174.35	5,418,798.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	182.33	3,095,963.40
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	190,790	70.28	13,408,721.20
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	116.19	1,266,471.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	50.23	23,536,773.40
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	117.41	3,953,781.75
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	119.63	5,179,979.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	171.97	27,418,896.80
	GRUMA S.A.B. -B	14,210	226.32	3,216,007.20
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	35.73	4,730,652.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	31.75	5,772,150.00
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	27.77	4,712,569.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	219,300	107.44	23,561,592.00
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	28.79	7,269,475.00	
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,721,740	15.57	42,377,491.80	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	83.10	3,132,870.00	
	メキシコペソ 小計	6,618,610		232,156,542.16 (1,251,323,762)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	35.80	658,720.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	18.00	4,559,400.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	326,340	15.25	4,976,685.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	48.78	1,399,986.00
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	42.97	382,433.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	8.13	266,664.00
	FIBRIA CELULOSE SA	22,500	71.53	1,609,425.00
	GERDAU SA-PREF	87,000	14.32	1,245,840.00
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	44.73	1,802,619.00
	VALE SA	267,478	50.89	13,611,955.42
	EMBRAER SA	69,700	22.63	1,577,311.00
	WEG SA	66,872	16.50	1,103,388.00

CCR SA	101,100	9.91	1,001,901.00	
LOCALIZA RENT A CAR	34,302	24.00	823,248.00	
RUMO SA	97,700	13.64	1,332,628.00	
KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.80	1,492,387.20	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	16.19	1,031,562.04	
LOJAS RENNER S.A.	60,370	29.25	1,765,822.50	
MAGAZINE LUIZA SA	4,700	105.49	495,803.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,800	17.38	152,944.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	15.37	637,855.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	75.84	819,072.00	
RAIA DROGASIL SA	17,000	65.30	1,110,100.00	
AMBEV SA	406,600	18.96	7,709,136.00	
BRF SA	38,800	21.50	834,200.00	
JBS SA	111,900	8.80	984,720.00	
M DIAS BRANCO SA	6,300	38.85	244,755.00	
NATURA COSMETICOS SA	10,700	34.69	371,183.00	
ODONTOPREV S.A.	12,400	13.12	162,688.00	
HYPERA SA	35,300	26.26	926,978.00	
BANCO BRADESCO S.A.	96,969	25.05	2,429,073.45	
BANCO BRADESCO SA-PREF	273,361	27.50	7,517,427.50	
BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	26.95	1,862,245.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	271,721	41.15	11,181,319.15	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	370,067	9.42	3,486,031.14	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	20.84	3,594,962.52	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	25.46	1,433,398.00	
PORTO SEGURO SA	7,300	41.66	304,118.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	10.00	570,630.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	55.45	304,975.00	
CIELO SA	99,269	16.42	1,629,996.98	
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	45.27	1,439,586.00	
TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.90	940,410.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	14.64	259,128.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	12.90	161,250.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	6.81	449,405.52	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	24.10	629,010.00	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	12.87	342,342.00	
ENGIE BRASIL SA	13,400	34.74	465,516.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	24,000	58.45	1,402,800.00	
ブラジルリアル 小計	4,192,607		95,495,033.42 (2,817,103,485)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	10,236.00	457,856,280.00
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	2,450.90	206,561,852.00

	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	32,768.00	237,895,680.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	7,398.60	163,560,850.20	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	6,092.50	323,469,102.50	
	CENCOSUD SA	137,988	1,727.40	238,360,471.20	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,024.70	74,814,278.10	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,727.30	41,487,687.60	
	BANCO DE CHILE	2,284,160	100.85	230,357,536.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,504	43,819.00	109,722,776.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	50.19	315,184,215.99	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	6.50	109,020,256.40	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,700.90	124,315,096.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	383.40	62,589,283.20	
	COLBUN SA	475,888	147.23	70,064,990.24	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	120.36	260,288,249.16	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	68.41	175,217,027.98	
	チリペソ 小計	31,071,181		3,200,765,633.37 (555,012,760)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	3,045.00	1,088,060,715.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	9,520.00	304,744,720.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	19,300.00	342,053,900.00	
	BANCOLOMBIA SA	13,742	33,140.00	455,409,880.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	33,120.00	1,267,767,360.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,240.00	376,597,920.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	37,200.00	541,334,400.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	35,320.00	443,654,520.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	14,640.00	739,481,040.00	
	コロンビアペソ 小計	840,413		5,559,104,455.00 (212,913,700)	
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	22.70	98,926.60	
	OPAP SA	17,668	9.65	170,496.20	
	JUMBO SA	8,599	14.50	124,685.50	
	ALPHA BANK AE	94,467	1.86	175,708.62	
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.94	140,039.32	
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.26	106,404.12	
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	2.77	51,673.57	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.28	208,612.04	
	ユーロ 小計	714,489		1,076,545.97 (138,939,022)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	110.40	1,280,971.20	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	10.32	1,204,911.60	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	4.45	213,657.85	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	21.34	508,126.74	

	KOC HOLDING AS	62,460	14.05	877,563.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.35	187,780.80	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	22.28	219,146.08	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	13.47	837,712.77	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	63.00	205,254.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	24.38	164,565.00	
	ARCELIK AS	15,358	15.18	233,134.44	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	66.60	1,037,428.20	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	24.24	272,215.20	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	35.12	155,125.04	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	19.11	183,952.86	
	AKBANK T.A.S.	176,098	7.43	1,308,408.14	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.40	2,015,932.80	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	7.24	379,600.44	
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	5.77	641,445.13	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	5.17	268,545.31	
	YAPI VE KRED-RTS	109,792	1.44	158,100.48	
	YAPI VE KREDI BANKASI	109,792	2.53	277,773.76	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	8.99	552,399.54	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	11.70	1,112,623.20	
	トルコリラ 小計	1,451,812		14,296,373.58	(350,118,188)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	909.00	6,783,867.00	
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	77.00	2,057,209.00	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	260.00	1,170,000.00	
	CEZ AS	13,737	564.00	7,747,668.00	
	チェココルナ 小計	52,417		17,758,744.00	(88,971,307)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	2,716.00	89,280,352.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,510.00	83,630,780.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	10,180.00	199,008,820.00	
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		371,919,952.00	(150,181,276)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	58.88	324,782.08	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	87.36	2,307,527.04	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	6.04	884,841.88	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	47.62	132,669.32	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	91.00	379,561.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	96.28	1,264,348.96	
	CCC SA	3,138	245.00	768,810.00	
	LPP SA	124	8,995.00	1,115,380.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	23.82	559,817.64	

	DINO POLSKA SA	1,583	102.20	161,782.60	
	ALIOR BANK SA	8,830	70.00	618,100.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	79.40	159,594.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	8.36	276,022.12	
	BANK PEKAO SA	15,510	120.50	1,868,955.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	359.00	860,882.00	
	M BANK SA	747	430.80	321,807.60	
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	39.50	3,021,947.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	38.55	1,964,161.05	
	CD PROJEKT SA	6,704	150.20	1,006,940.80	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	4.97	276,620.26	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	18,973	25.90	491,400.70	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.45	663,533.20	
	ポーランドズロチ 小計	561,662		19,429,484.75 (586,381,849)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.48	341,040.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	7.98	829,920.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,175,400	7.47	16,250,238.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	250,500	20.85	5,222,925.00	
	CNOOC LTD-R	1,538,000	13.20	20,301,600.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.31	1,885,980.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	6.55	11,488,700.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	11.56	1,641,520.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.25	1,445,000.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	8.20	475,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	48.45	5,329,500.00	
	BBMG CORPORATION - H	131,000	3.35	438,850.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	4.92	1,653,120.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	9.77	3,224,100.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	130,000	9.78	1,271,400.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	4.52	359,792.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	11.86	984,380.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	8.75	1,452,500.00	
	MMG LIMITED	168,000	6.45	1,083,600.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	12.12	1,563,480.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	5.61	1,116,390.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	6.60	597,300.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.51	2,558,790.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.08	629,920.00	
	BOC AVIATION LTD	8,500	48.95	416,075.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	8.47	2,642,640.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	29.00	4,625,500.00	

CHINA INTL MARINE CO-H	26,500	12.00	318,000.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	109,500	8.90	974,550.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.46	1,938,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.49	1,613,300.00
CITIC LTD	502,000	11.84	5,943,680.00
CRRC CORP LTD-H	313,050	6.81	2,131,870.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	16.98	4,890,240.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	21.05	736,750.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	2.39	341,770.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.91	488,880.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	20.20	767,600.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	7.91	565,565.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	12.62	536,350.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	143,800	10.74	1,544,412.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	26,400	11.08	292,512.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	39,500	38.60	1,524,700.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	281,000	10.86	3,051,660.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	9.67	1,141,060.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	11.52	1,244,160.00
CAR INC	42,000	8.50	357,000.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	6.67	440,220.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	17.22	1,679,759.34
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	8.56	1,506,560.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	227,000	1.50	340,500.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.38	376,680.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	4.23	619,695.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	7.20	734,400.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.36	772,480.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	52,000	16.86	876,720.00
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	4.36	479,600.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.75	682,000.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	8.50	994,500.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	15.72	3,930,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	54.10	2,677,950.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	4.48	1,120,000.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	45,500	8.80	400,400.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	9.15	2,433,900.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	28.95	787,440.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	23.60	9,204,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	7.62	1,552,575.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	9.48	2,392,221.12
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	13.30	1,223,600.00

ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	47.25	5,244,750.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	29.25	3,393,000.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.32	538,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	96.45	6,751,500.00
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	108,000	3.87	417,960.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	3.38	398,840.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	1.00	780,000.00
CHINA LITERATURE LTD	11,800	78.80	929,840.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.86	510,803.88
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	27.60	1,159,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	10.04	1,957,800.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	3.26	335,780.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	28.70	7,375,900.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	36.20	5,140,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	6.37	767,585.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	17.92	2,652,160.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	47.20	1,321,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.76	700,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	379,000	7.79	2,952,410.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	76.75	5,103,875.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	7.24	2,070,640.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	6.38	689,040.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	22.85	2,933,940.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	36.05	3,590,580.00
3SBIO INC	84,500	20.10	1,698,450.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	17.90	1,790,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	24.40	9,272,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	11.74	1,849,050.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	7.11	1,180,260.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	64,000	25.65	1,641,600.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	8.18	666,670.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	48.35	2,683,425.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	2.08	667,680.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	528,000	12.56	6,631,680.00
SSY GROUP LTD	114,000	8.80	1,003,200.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	13.50	499,500.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	39,000	95.70	3,732,300.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,245,000	4.15	9,316,750.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,588,200	4.18	27,538,676.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	6.32	5,988,042.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	5.33	5,069,896.00

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,761,620	8.08	62,713,889.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.91	871,930.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	357,423	32.55	11,634,118.65
CHINA MINSHENG BANKING-H	459,500	7.37	3,386,515.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	5.29	735,310.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,981,515	6.59	39,418,183.85
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	65,000	5.41	351,650.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	2.85	2,371,200.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	16.84	1,044,080.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.84	1,589,940.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	2.61	2,419,470.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	63,600	16.58	1,054,488.00
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	1,148,000	0.97	1,113,560.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	19.26	3,832,740.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	8.44	1,190,040.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	13.00	1,372,800.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	19,000	18.16	345,040.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	9.77	2,704,336.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	15.20	1,602,080.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	667,000	22.80	15,207,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	205,200	35.30	7,243,560.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	205,000	1.78	364,900.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	28.70	4,070,348.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	37.20	2,492,400.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	4.00	2,768,000.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	408,859	14.34	5,863,038.06
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	78.50	35,050,250.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	52.00	556,400.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	16.04	2,277,680.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	23.60	5,616,800.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.40	2,543,200.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	28.80	9,418,752.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	219,111	31.10	6,814,352.10
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	30.80	3,720,640.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.10	1,683,600.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	608,285	17.24	10,486,833.40
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	3.64	2,029,300.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	7.20	921,600.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	12.26	686,560.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	18.68	1,285,184.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	14.18	992,600.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	4.31	672,360.00

KWG PROPERTY HOLDING LTD	89,000	12.38	1,101,820.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	12.50	1,175,000.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	24.60	3,038,100.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	108,000	3.19	344,520.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	25.20	3,339,000.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	2.18	456,710.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	5.40	1,012,991.40
SOHO CHINA LTD	113,000	4.12	465,560.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	31.65	6,678,150.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	358,000	1.70	608,600.00
YUZHOU PROPERTIES CO	100,000	5.45	545,000.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	136,000	8.64	1,175,040.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	25.60	1,689,600.00
TENCENT HOLDINGS LTD	474,900	415.00	197,083,500.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	23.75	1,258,750.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	127.10	7,626,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	12.88	1,094,800.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	57,000	5.80	330,600.00
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	45,000	31.10	1,399,500.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	10.30	710,700.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	25.05	528,555.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	4.15	2,398,700.00
MEITU INC	143,000	8.15	1,165,450.00
SUNNY OPTICAL TECH	57,000	168.30	9,593,100.00
ZTE CORP-H	48,508	25.60	1,241,804.80
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	5.24	681,200.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	528,000	71.50	37,752,000.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.70	4,070,000.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	442,000	10.32	4,561,440.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	42.80	1,669,200.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.68	1,909,440.00
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.16	2,898,720.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	33.65	4,576,400.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	6.73	1,702,690.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	2.08	343,200.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	30.15	2,592,900.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	15.72	2,757,288.00
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	2.58	356,040.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	61,000	78.00	4,758,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	13.02	2,890,440.00
HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	5.60	1,444,800.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	3.10	948,600.00

	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	7.26	333,960.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	0.80	828,000.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	10.32	2,734,800.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	146,000	2.62	382,520.00	
	香港ドル 小計	72,309,300		883,471,821.50 (12,315,597,191)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	3.40	758,091.20	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	25.12	630,512.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.39	1,762,739.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.47	645,021.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.54	492,768.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.80	374,360.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.78	352,618.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.49	416,442.54	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	3.20	207,360.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.85	474,306.90	
	MISC BHD	125,040	6.12	765,244.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.50	245,000.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	6.47	219,980.00	
	GENTING BHD	205,300	8.78	1,802,534.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.11	1,145,151.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	1.69	200,265.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	36.02	392,618.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.55	124,465.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.54	133,560.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.63	831,733.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.92	1,365,616.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	145.80	1,006,020.00	
	PPB GROUP BERHAD	43,900	19.84	870,976.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.23	874,696.58	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	72,000	6.19	445,680.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.05	1,387,265.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	17,800	10.90	194,020.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	4.43	312,758.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.82	497,364.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	421,219	6.32	2,662,104.08	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	19.10	1,170,677.20	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	19.60	292,686.80		
MALAYAN BANKING BHD	348,360	9.80	3,413,928.00		
PUBLIC BANK BERHAD	228,020	24.60	5,609,292.00		
RHB BANK BHD	53,119	5.73	304,371.87		

	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.71	263,040.75	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.35	225,782.10	
	SP SETIA BHD	180,947	3.21	580,839.87	
	AXIATA GROUP BERHAD	278,374	4.63	1,288,871.62	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.57	1,424,469.00	
	MAXIS BHD	135,500	5.80	785,900.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.88	273,741.76	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.86	1,348,430.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	14.62	4,305,224.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.99	249,841.35	
	マレーシアリングット 小計	6,165,561		43,128,366.12 (1,184,736,217)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	21.50	2,547,750.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	38.75	2,662,125.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	6.50	3,723,200.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	136.00	16,959,200.00	
	PTT PCL-NVDR	789,000	51.00	40,239,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	87.50	10,508,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	59.50	6,063,050.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	89.50	20,131,593.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	446.00	6,021,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	68.50	29,324,850.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	7.80	3,051,360.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.65	3,546,375.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	35.25	5,703,802.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	14.30	3,312,380.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	63.25	2,201,100.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	55.50	3,762,900.00	
	CP ALL PCL-NVDR	372,000	79.25	29,481,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	25.75	8,773,025.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	17.20	4,128,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	25.00	11,392,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	191.00	4,889,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	203.00	3,288,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	202.00	25,532,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	194.50	10,036,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	17.90	4,425,775.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	136.00	20,128,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.46	3,287,790.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	74.25	9,808,425.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	132,300	11.30	1,494,990.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	65.50	2,115,650.00	

	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	193.00	20,438,700.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	6.80	4,132,421.20	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	241.00	5,591,200.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	85.50	2,530,800.00	
	タイパーツ 小計	8,240,038		331,233,912.20 (1,129,507,640)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	64.00	15,228,160.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	12.98	7,665,988.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	11.12	3,841,404.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	59.35	13,671,866.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	917.50	20,923,587.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	86.95	5,498,718.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	284.00	7,227,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	131.00	8,302,780.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	99.30	5,942,608.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	137.10	23,817,149.10	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	51,502	80.00	4,120,160.00	
	SECURITY BANK CORP	30,810	200.60	6,180,486.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	966.50	21,620,605.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,000.00	6,135,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.01	3,685,857.00	
	AYALA LAND INC	637,000	40.80	25,989,600.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.90	3,126,200.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	20.35	1,892,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	37.70	33,460,635.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,660.00	2,971,400.00	
PLDT INC	6,225	1,319.00	8,210,775.00		
ABOITIZ POWER CORP	89,500	38.20	3,418,900.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	338.00	9,839,180.00		
	フィリピンペソ 小計	5,041,483		242,771,409.10 (502,536,816)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,935.00	1,548,967,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	34,800.00	4,485,720,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	185,300	19,100.00	3,539,230,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	16,125.00	3,063,750,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	8,275.00	1,941,315,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	4,580.00	642,116,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	2,350.00	922,140,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	4,610.00	569,335,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	6,900.00	11,876,280,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	2,300.00	1,225,900,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	9,000.00	1,669,500,000.00	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,460.00	1,495,066,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	70,250.00	2,163,700,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,640.00	3,341,156,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,850.00	1,424,850,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,950.00	2,982,245,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	45,400.00	5,384,440,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,360.00	1,704,624,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	22,250.00	18,494,200,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	5,950.00	1,169,175,000.00	
	BANK MANDIRI	1,424,996	6,950.00	9,903,722,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,050.00	6,522,110,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	3,030.00	2,710,638,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	3,140.00	15,342,354,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,720.00	1,175,448,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	590.00	950,136,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	3,610.00	16,400,591,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	4,900.00	653,660,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,080.00	1,646,320,000.00	
	インドネシアルピア 小計	24,783,396		124,948,688,700.00 (987,094,640)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	58,600.00	247,702,200.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	111,500.00	379,211,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	210,000.00	1,102,920,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	25,550.00	273,538,300.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	134,000.00	188,806,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	60,800.00	440,313,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	428,500.00	335,515,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	99,300.00	104,364,300.00	
	LG CHEM LTD	3,844	375,500.00	1,443,422,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	228,000.00	109,212,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	381,000.00	422,910,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	117,500.00	132,422,500.00	
	POSCO	6,275	360,000.00	2,259,000,000.00	
	CJ CORP	1,230	151,000.00	185,730,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	84,700.00	335,750,800.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	6,380.00	52,762,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	34,000.00	146,472,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	18,650.00	62,328,300.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	46,500.00	158,007,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	36,350.00	102,688,750.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	46,400.00	175,252,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	67,200.00	428,736,000.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	121,500.00	403,137,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	377,000.00	305,370,000.00
KCC CORP	870	350,500.00	304,935,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	46,400.00	240,166,400.00
LG CORP	7,072	77,100.00	545,251,200.00
LOTTE CORP	2,370	58,900.00	139,593,000.00
POSCO DAEWOO CORP	1,560	23,550.00	36,738,000.00
SAMSUNG C&T CORP	6,354	124,000.00	787,896,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	10,311	16,800.00	173,224,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,510.00	279,004,010.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	283,000.00	783,627,000.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	40,050.00	37,687,050.00
S-1 CORPORATION	960	92,600.00	88,896,000.00
CJ LOGISTICS	324	154,000.00	49,896,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	134,500.00	195,697,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,378	31,750.00	75,501,500.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,320.00	158,195,520.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	46,800.00	330,688,800.00
HANON SYSTEMS	10,825	11,200.00	121,240,000.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	230,000.00	1,282,710,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	141,000.00	1,857,816,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	97,600.00	282,259,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	88,600.00	266,065,800.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	33,100.00	682,753,700.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	93,900.00	373,909,800.00
HANSSEM CO LTD	615	116,000.00	71,340,000.00
HLB INC	2,398	104,600.00	250,830,800.00
LG ELECTRONICS INC	8,015	89,900.00	720,548,500.00
KANGWON LAND INC	8,683	28,100.00	243,992,300.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	20,350.00	103,174,500.00
CJ E&M CORP	2,024	90,700.00	183,576,800.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	125,000.00	269,000,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	117,000.00	142,974,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	216,000.00	223,344,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	415,500.00	220,215,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	196,000.00	107,604,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	26,250.00	39,926,250.00
EMART	1,661	248,500.00	412,758,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	41,500.00	54,406,500.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	372,500.00	187,367,500.00
KT&G CORP	10,696	98,400.00	1,052,486,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	148,500.00	295,960,500.00

OTTOGI CORPORATION	68	888,000.00	60,384,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	338,000.00	971,074,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	173,500.00	123,185,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,392,000.00	1,044,000,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	758,000.00	102,330,000.00
PACIFIC CORP	2,115	129,500.00	273,892,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,499	99,100.00	247,650,900.00
CELLTRION INC	6,864	269,500.00	1,849,848,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	88,100.00	97,967,200.00
HANMI PHARM CO LTD	472	450,000.00	212,400,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	616	68,100.00	41,949,600.00
MEDY-TOX INC	317	742,900.00	235,499,300.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	421,000.00	658,023,000.00
SILLAJEN INC	4,157	80,300.00	333,807,100.00
VIROMED CO LTD	1,015	248,300.00	252,024,500.00
YUHAN CORPORATION	600	229,000.00	137,400,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	10,000.00	232,160,000.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	10,800.00	132,580,800.00
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	45,800.00	1,210,997,800.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	16,150.00	291,442,900.00
KB FINANCIAL GROUP INC	34,088	56,000.00	1,908,928,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37,696	47,450.00	1,788,675,200.00
WOORI BANK	45,214	16,600.00	750,552,400.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	94,200.00	433,508,400.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	9,460.00	294,130,320.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	16,400.00	185,287,200.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	39,200.00	74,440,800.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	37,500.00	216,600,000.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	61,100.00	257,169,900.00
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	5,630.00	68,798,600.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	35,350.00	152,641,300.00
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,975	41,650.00	165,558,750.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	261,500.00	660,549,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	104,500.00	553,850,000.00
KAKAO CORP	3,347	113,000.00	378,211,000.00
NAVER CORP	2,391	701,000.00	1,676,091,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	365,000.00	602,250,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	151,000.00	372,215,000.00
PEARL ABYSS CORP	338	213,100.00	72,027,800.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	233,500.00	728,753,500.00
LG DISPLAY CO LTD	18,774	22,350.00	419,598,900.00
LG INNOTEK CO LTD	857	150,500.00	128,978,500.00

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	146,000.00	666,636,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	399,440	49,650.00	19,832,196,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	71,650	40,350.00	2,891,077,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	225,500.00	1,065,262,000.00	
	KT CORP	3,800	27,850.00	105,830,000.00	
	SK TELECOM	1,647	230,000.00	378,810,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	34,050.00	833,101,350.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	63,900.00	91,504,800.00	
	SK HYNIX INC	48,768	88,400.00	4,311,091,200.00	
	韓国ウォン 小計	1,218,575		74,041,772,000.00 (7,567,069,098)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	124.00	13,545,760.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	33.85	10,059,407.60	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.40	27,334,368.40	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	247,061	116.00	28,659,076.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	108.50	42,187,404.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	370,752	85.50	31,699,296.00	
	TAIWAN CEMENT	297,929	45.00	13,406,805.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	555.00	6,660,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	432,028	29.65	12,809,630.20	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,019	417.00	5,428,923.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	24.20	2,686,200.00	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	10.15	1,321,560.45	
	EVA AIRWAYS CORP	143,931	15.25	2,194,947.75	
	EVERGREEN MARINE	119,812	14.80	1,773,217.60	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	23.70	4,194,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	46.95	8,313,013.95	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	369.00	4,404,753.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	140.00	4,608,240.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	35.50	1,420,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	136.00	3,463,104.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	280.50	1,963,500.00	
	POU CHEN	153,780	37.65	5,789,817.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	65.00	2,395,055.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	280.50	7,293,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	316.00	14,391,904.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	62.70	2,241,901.20	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	75.00	28,079,625.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	307.50	3,997,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	18.05	7,154,478.50	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	11.50	14,452,970.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	22.35	30,781,246.95	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	673,363	21.85	14,712,981.55
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	716,984	21.05	15,092,513.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	816,242	18.05	14,733,168.10
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	27.10	24,453,386.90
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,134,205	11.45	12,986,647.25
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	14.95	13,529,585.55
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	9.69	1,860,102.09
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	18.20	13,203,044.40
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,429	111.00	15,254,619.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	53.80	29,648,211.60
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	14.60	11,273,433.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	55.00	40,257,305.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	153,922	32.70	5,033,249.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	12.20	7,512,406.20
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	47.60	2,004,912.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	36.70	2,045,437.80
ACER INC	255,803	26.80	6,855,520.40
ADVANTECH CO LTD	56,402	209.50	11,816,219.00
ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	281.50	15,508,398.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	13.30	7,848,197.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,700	346.00	17,542,200.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,649	73.70	2,111,431.30
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	12.05	9,338,750.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.95	8,613,612.00
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	113.50	21,213,490.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	77.20	7,168,020.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	219.00	3,066,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,365,311	88.30	120,556,961.30
HTC CORPORATION	37,430	60.20	2,253,286.00
INVENTEC CO LTD	136,511	24.60	3,358,170.60
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	4,545.00	36,541,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	40.00	6,018,080.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	75,000	112.50	8,437,500.00
PEGATRON CORP	159,474	67.90	10,828,284.60
QUANTA COMPUTER INC	196,270	56.20	11,030,374.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	47.35	3,698,035.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	21,000	407.50	8,557,500.00
WISTRON CORP	235,771	23.40	5,517,041.40
WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	43.55	6,801,943.85
YAGEO CORPORATION	19,000	1,180.00	22,420,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	71.00	1,556,462.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	110.00	39,304,650.00

	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	77.60	12,183,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	110.50	16,818,100.00	
	ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	259,315	77.50	20,096,912.50	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	542.00	9,756,000.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	127,000	48.70	6,184,900.00	
	MEDIATEK INC	129,804	330.00	42,835,320.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	99.80	10,279,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	145.50	5,826,547.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	278.00	3,224,522.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	92.00	4,394,840.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	114.00	3,185,616.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,053,389	227.00	466,119,303.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	16.40	16,022,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	66.60	3,596,400.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	251.00	5,522,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	20.50	4,182,000.00	
	新台湾ドル 小計	27,045,108		1,596,502,396.39 (5,859,163,794)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	409.85	27,099,282.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	289.90	12,153,767.60	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	311.30	18,499,002.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	117,608	175.00	20,581,400.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	173.70	17,858,791.80	
	PETRONET LNG LTD	49,423	225.80	11,159,713.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	237,229	984.35	233,516,366.15	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	206.00	7,660,110.00	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,278.85	31,920,096.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,028.60	28,123,981.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	242.15	19,134,935.15	
	JSW STEEL LTD	80,284	343.25	27,557,483.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,893	1,070.35	3,096,522.55	
	SHREE CEMENT LTD	901	16,224.40	14,618,184.40	
	TATA STEEL LTD	25,839	600.50	15,516,319.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	3,715.15	27,321,213.10	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	712.90	18,690,812.20	
	VEDANTA LTD	110,508	246.30	27,218,120.40	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	145.00	20,822,435.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	77.55	3,954,662.25	
	EICHER MOTORS LTD	939	29,513.00	27,712,707.00	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	552.90	12,979,880.40	
	LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,343.95	47,648,403.30	
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,009.70	5,409,972.60	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	380.50	23,791,143.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,337	1,362.70	4,547,329.90
INTERGLOBE AVIATION LTD	3,372	1,186.30	4,000,203.60
BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,874.05	27,202,883.25
BHARAT FORGE LTD	13,392	652.45	8,737,610.40
BOSCH LTD	431	18,450.25	7,952,057.75
HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,635.15	11,810,602.35
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	911.65	57,386,544.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	8,932.45	84,849,342.55
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	310.05	15,882,311.25
TATA MOTORS LTD	147,050	309.95	45,578,147.50
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	896.00	24,925,824.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	557.35	27,481,256.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	7,480	1,593.55	11,919,754.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,739	5,917.65	16,208,443.35
ITC LTD	272,605	267.90	73,030,879.50
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	9,888.85	23,683,795.75
UNITED SPIRITS LTD	3,561	3,355.00	11,947,155.00
DABUR INDIA LTD	58,111	382.35	22,218,740.85
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	1,168.55	21,763,075.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,595.60	95,241,364.00
MARICO LTD	42,465	343.65	14,593,097.25
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	572.35	11,639,309.60
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	364.35	3,827,861.10
CIPLA LTD	31,308	559.65	17,521,522.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,062.90	16,092,682.90
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	556.75	8,928,043.00
LUPIN LTD	16,340	810.05	13,236,217.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,408.20	16,137,348.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	528.25	43,818,337.50
AXIS BANK LTD	141,543	537.40	76,065,208.20
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	129,894	1,840.45	239,063,412.30
ICICI BANK LTD	190,983	288.25	55,050,849.75
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,203.90	32,406,580.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	496.95	13,900,188.45
STATE BANK OF INDIA	132,502	273.00	36,173,046.00
YES BANK LTD	152,956	337.65	51,645,593.40
BAJAJ FINANCE LTD	17,670	2,186.85	38,641,639.50
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	487.60	7,907,896.80
RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	114.90	5,534,503.20
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,446.05	17,550,708.85
BAJAJ FINSERV LTD	2,289	6,025.50	13,792,369.50

	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	928.70	42,570,679.30
	INFOSYS LTD	148,301	1,260.05	186,866,675.05
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	81,948	1,747.10	143,171,350.80
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	706.95	33,972,482.25
	VAKRANGEE LTD	36,538	35.75	1,306,233.50
	WIPRO LTD	89,034	264.00	23,504,976.00
	BHARTI AIRTEL LTD	124,727	377.55	47,090,678.85
	BHARTI INFRATEL LTD	45,240	298.40	13,499,616.00
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	64.15	9,125,658.25
	GAIL INDIA LTD	53,170	342.40	18,205,408.00
	NTPC LTD	145,475	161.45	23,486,938.75
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	65,391	197.90	12,940,878.90
	TATA POWER CO LTD	93,250	77.95	7,268,837.50
	インドルピー 小計	4,478,613		2,596,949,453.40 (4,233,027,609)
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	15,948	109.00	1,738,332.00
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	36.98	754,355.02
	DOHA BANK QSC	12,309	27.41	337,389.69
	MASRAF AL RAYAN	26,948	34.69	934,826.12
	QATAR ISLAMIC BANK	8,258	123.00	1,015,734.00
	QATAR NATIONAL BANK	35,741	162.97	5,824,710.77
	QATAR INSURANCE CO	10,545	39.00	411,255.00
	BARWA REAL ESTATE CO	8,751	34.87	305,147.37
	EZDAN HOLDING GROUP	67,796	9.08	615,587.68
	OOREDOO QSC	7,280	75.75	551,460.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	189.99	718,542.18
	カタールリアル 小計	217,757		13,207,339.83 (397,408,855)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	132.67	2,605,373.46
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	345.44	1,102,644.48
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	111.32	5,388,110.64
	GOLD FIELDS LTD	64,581	47.50	3,067,597.50
	KUMBA IRON ORE LTD	1,758	315.22	554,156.76
	MONDI LTD	9,893	367.00	3,630,731.00
	SAPPI LIMITED	49,985	91.00	4,548,635.00
	SASOL LTD	48,270	492.49	23,772,492.30
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	202.75	5,616,580.50
	NASPERS LTD-N SHS	36,465	3,339.99	121,792,735.35
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	200.26	2,491,234.40
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	242.50	5,165,007.50
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	185.03	4,446,640.96
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	83.75	3,966,986.25

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	56.62	4,738,188.08	
	BID CORP LTD	26,440	263.00	6,953,720.00	
	CLICKS GROUP LTD	14,682	203.36	2,985,731.52	
	PICK N PAY STORES LTD	52,108	75.74	3,946,659.92	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	232.00	7,995,416.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	192.61	2,814,609.93	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	108.72	957,279.60	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	329.73	4,294,073.79	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	79,877	26.99	2,155,880.23	
	NETCARE LTD	60,221	29.90	1,800,607.90	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	259.01	7,802,676.25	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	61,049	162.63	9,928,398.87	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	884.11	2,848,602.42	
	NEDBANK GROUP LTD	14,966	270.62	4,050,098.92	
	STANDARD BANK GROUP LTD	112,744	204.62	23,069,677.28	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	59.25	598,662.00	
	FIRSTRAND LTD	284,395	61.50	17,490,292.50	
	INVESTEC LTD	28,883	95.47	2,757,460.01	
	PSG GROUP LTD	18,494	215.00	3,976,210.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,886	240.06	1,172,933.16	
	REMGRO LTD	46,153	203.88	9,409,673.64	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	72.80	5,416,174.40	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	147.00	5,144,412.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	123.75	770,467.50	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	18.34	1,248,550.52	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	38.70	1,563,789.60	
	SANLAM LTD	113,378	73.38	8,319,677.64	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	130.00	4,018,820.00	
	MTN GROUP LTD	132,522	116.23	15,403,032.06	
	TELKOM SA LTD	11,353	52.85	600,006.05	
	VODACOM GROUP	42,279	144.45	6,107,201.55	
	南アフリカランド 小計	1,972,513		358,487,909.44 (3,004,128,681)	
アラブ首長国連 邦ディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	296,657	2.14	634,845.98	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	7.48	1,380,359.20	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.13	659,656.44	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	12.40	1,333,409.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.09	567,397.38	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	2.47	447,586.23	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	5.35	163,415.75	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.15	386,232.45	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	5.57	1,674,464.54	

	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	17.00	2,341,325.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,818,544		9,588,692.17 (286,126,574)	
香港・オフショア 人民元	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	15.61	265,370.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	11.37	294,483.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	7.94	317,600.00	
	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	4.47	282,951.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	11,600	24.49	284,084.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	777.95	466,770.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	68.29	300,476.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,800	80.39	305,482.00	
	CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	29.53	301,206.00	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	3,200	81.15	259,680.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	75,200	3.59	269,968.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	37,900	7.03	266,437.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,500	16.99	297,325.00	
		香港・オフショア人民元 小計	310,600		3,911,832.00 (66,892,327)
	合 計	201,273,103		49,966,028,309 (49,966,028,309)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	ブラジルレ アル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	896,000.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,132,856.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	308,881.30	
		ブラジルリアル 小計	99,662	2,337,737.30 (68,963,250)	
	投資信託受益証券合計	99,662	68,963,250 (68,963,250)		
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,616,696.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	8,616,696.00 (46,443,991)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	269,903.70	
		トルコリラ 小計	135,630	269,903.70 (6,609,941)	
	南アフリカ ランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	813,079.20	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	1,412,284.46	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,907,259.60	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,345,022.90	

	REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,857,959.65	
	RESILIENT REIT LTD	23,098	1,374,100.02	
	南アフリカランド 小計	1,024,432	19,709,705.83 (165,167,334)	
	投資証券合計	1,468,462	218,221,266 (218,221,266)	
	合計		287,184,516 (287,184,516)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 43銘柄	100.0%			12.5%
メキシコペソ	株式 23銘柄	96.4%			2.5%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.1%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	97.6%			5.6%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.4%		0.1%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 24銘柄	98.1%			0.7%
	投資証券 1銘柄			1.9%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.0%			1.2%
香港ドル	株式 200銘柄	100.0%			24.5%
マレーシアリングギット	株式 45銘柄	100.0%			2.4%
タイバーツ	株式 34銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%			1.0%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式 115銘柄	100.0%			15.1%
新台湾ドル	株式 89銘柄	100.0%			11.7%
インドルピー	株式 79銘柄	100.0%			8.4%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%			0.8%

南アフリカランド	株式	45銘柄	94.8%			6.0%
	投資証券	6銘柄			5.2%	0.3%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	10銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人 民元	株式	13銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 6月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	904,744,564
金銭信託	5,188,274
コール・ローン	320,720,610
国債証券	41,175,168,806
派生商品評価勘定	3,623
未収利息	751,286,282
前払費用	215,183,863
流動資産合計	43,372,296,022
資産合計	43,372,296,022
負債の部	
流動負債	
前受収益	110,008
未払金	68,322,999
未払解約金	13,176,538
未払利息	849
その他未払費用	11,343
流動負債合計	81,621,737
負債合計	81,621,737
純資産の部	
元本等	
元本	26,413,348,921
剰余金	
剰余金又は欠損金()	16,877,325,364
元本等合計	43,290,674,285
純資産合計	43,290,674,285
負債純資産合計	43,372,296,022

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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）

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,413,348,921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 1.6390円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (16,390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

	2018年 6月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2018年 6月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 8月25日
期首元本額	17,944,275,245円
期中追加設定元本額	9,862,804,167円
期中一部解約元本額	1,393,730,491円
期末元本額	26,413,348,921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	3,792,180,737円
世界経済インデックスファンド	4,835,664,638円
DC 新興国債券インデックス・オープン	3,622,175,717円
DC 世界経済インデックスファンド	3,813,080,686円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,875,482,430円
コア投資戦略ファンド（安定型）	200,114,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	657,518,583円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	110,774,156円
分散投資コア戦略ファンドA	124,099,856円
分散投資コア戦略ファンドS	377,748,017円

区分	2018年 6月11日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	137,156,992円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,564,551,511円
コア投資戦略ファンド(切替型)	129,073,783円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	187,787,922円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	93,330,899円
S M T インデックスバランス・オープン	211,114,888円
外国債券S M T Bセレクション(S M A専用)	3,405,469,341円
S M T 世界経済インデックス・オープン	15,248,600円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	81,922,878円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	93,690,896円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	660,528円
グローバル経済コア	946,718,064円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	137,783,447円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	936,259,253
合計	936,259,253

(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

(2018年 6月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	99,495,850	-	99,492,227	3,623
	マレーシアリン ギット	99,495,850	-	99,492,227	3,623
	合計	99,495,850	-	99,492,227	3,623

(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	14,179,352.00		
		MBONO 10% 12/05/24	77,350,000.00	86,021,708.50		
		MBONO 5.75% 03/05/26	48,800,000.00	43,003,048.00		
		MBONO 5% 12/11/19	78,200,000.00	75,193,601.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	76,000,000.00	72,581,140.00		
		MBONO 6.5% 06/10/21	88,650,000.00	85,667,814.00		
		MBONO 7.25% 12/09/21	10,000,000.00	9,828,200.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	54,700,000.00	53,565,522.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	35,800,000.00	35,457,573.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	52,600,000.00	51,515,125.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	37,050,000.00	36,567,609.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	31,400,000.00	32,905,473.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	33,250,198.00		
		MBONO 8% 06/11/20	85,000,000.00	85,482,375.00		
		MBONO 8% 11/07/47	27,000,000.00	27,148,770.00		
		MBONO 8% 12/07/23	32,500,000.00	32,749,600.00		
		メキシコペソ 小計			778,300,000.00	775,117,108.50 (4,177,881,214)
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000.00	15,671,336.10	
			BLTN 0% 01/01/22	11,550,000.00	8,167,836.60	
			BLTN 0% 04/01/20	7,400,000.00	6,339,594.80	
			BLTN 0% 07/01/20	37,550,000.00	31,373,550.70	
			BLTN 0% 07/01/21	16,800,000.00	12,616,144.80	
			BLTN 0% 10/01/19	9,750,000.00	8,769,393.75	
BNTNF 10% 01/01/21			14,800,000.00	14,962,939.83		
BNTNF 10% 01/01/23			20,050,000.00	19,576,367.82		
BNTNF 10% 01/01/25			11,950,000.00	11,333,289.73		
BNTNF 10% 01/01/27			11,650,000.00	10,699,644.80		
BNTNF 10% 01/01/29			1,850,000.00	1,673,494.14		

	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,440,250.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	514,125.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,790,750.00	
ブラジルリアル 小計		164,950,000.00	144,928,718.07 (4,275,397,183)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	6,150,000,000.00	6,400,059,000.00	
チリペソ 小計		6,150,000,000.00	6,400,059,000.00 (1,109,770,230)	
コロンビア ペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	22,150,000,000.00	21,018,467,250.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000.00	20,673,786,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	36,200,000,000.00	45,312,264,000.00	
コロンビアペソ 小計		77,950,000,000.00	87,004,517,250.00 (3,332,273,010)	
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	4,750,000.00	4,940,973.75	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	5,250,000.00	5,374,293.75	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	5,600,000.00	5,913,152.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	4,200,000.00	4,508,427.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,050,000.00	6,645,713.25	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	2,150,000.00	2,380,490.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,300,000.00	6,297,407.00	
ペルーヌエボソル 小計		33,300,000.00	36,060,457.50 (1,209,107,139)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	13,900,000.00	12,354,389.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	15,450,000.00	15,487,389.00	
ウルグアイペソ 小計		29,350,000.00	27,841,778.50 (97,446,224)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,320,016.00	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	8,700,000.00	7,962,718.50	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	8,001,408.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	10,750,000.00	8,651,331.25	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,500,000.00	5,593,217.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	7,700,000.00	6,459,376.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	5,200,000.00	4,214,600.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	8,194,992.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	8,550,000.00	7,675,890.75	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	5,950,000.00	4,320,711.50	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	5,750,000.00	4,974,008.75	
	TURKGB 8.5% 07/10/19	5,450,000.00	4,980,809.50	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	3,825,552.50	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,050,000.00	3,900,392.75	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,309,253.50	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	6,650,000.00	5,426,433.25	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	6,700,000.00	5,790,140.00	

	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,441,010.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	9,650,000.00	7,502,923.25	
	トルコリラ 小計	127,850,000.00	105,544,785.00 (2,584,791,784)	
チェココル ナ	CZGB 0.25% 02/10/27	27,800,000.00	24,115,944.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	25,300,000.00	23,991,484.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	30,000,000.00	25,785,600.00	
	CZGB 0% 02/10/20	13,500,000.00	13,350,082.50	
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	43,641,551.50	
	CZGB 1% 06/26/26	21,100,000.00	19,679,126.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	29,600,000.00	30,877,980.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	37,800,000.00	39,464,334.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	33,200,000.00	35,305,876.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	41,600,000.00	45,418,464.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	26,700,000.00	30,432,660.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	32,600,000.00	40,594,172.00	
		チェココルナ 小計	362,300,000.00	372,657,274.00 (1,867,012,942)
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	155,000,000.00	152,066,625.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	496,000,000.00	497,175,520.00	
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	230,948,750.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	354,462,680.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	235,000,000.00	230,652,500.00	
	HGB 2% 10/30/19	60,000,000.00	61,361,400.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	572,000,000.00	605,070,180.00	
	HGB 3% 06/26/24	495,000,000.00	515,671,200.00	
	HGB 3% 10/27/27	358,000,000.00	353,712,950.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	497,000,000.00	593,917,485.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	423,000,000.00	510,802,110.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	274,563,315.00	
	HGB 7% 06/24/22	433,000,000.00	525,040,645.00	
	ハンガリーフォリント 小計	4,532,000,000.00	4,905,445,360.00 (1,980,818,836)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	12,050,000.00	12,035,238.75	
	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000.00	13,256,349.75	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,297,425.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	6,950,000.00	6,954,448.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	12,450,000.00	11,849,536.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	11,800,000.00	11,104,862.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,900,000.00	2,778,678.50	
	POLGB 2% 04/25/21	9,200,000.00	9,226,680.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000.00	8,525,558.75	

	POLGB 3.25% 07/25/25	9,350,000.00	9,469,539.75
	POLGB 4% 10/25/23	8,800,000.00	9,396,376.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	6,250,000.00	6,769,656.25
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,854,610.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,317,481.75
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,400,000.00	7,172,448.00
	ポーランドズロチ 小計	128,300,000.00	130,008,889.00 (3,923,668,270)
ロシアルーブル	RFLB 6.4% 05/27/20	98,800,000.00	98,230,418.00
	RFLB 6.5% 02/28/24	42,000,000.00	40,872,720.00
	RFLB 6.8% 12/11/19	81,200,000.00	81,307,590.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	151,000,000.00	147,867,505.00
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	164,310,048.00
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	176,306,130.00
	RFLB 7.5% 08/18/21	128,200,000.00	130,604,391.00
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	65,693,628.00
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	63,984,375.00
	RFLB 7.7% 03/23/33	165,200,000.00	167,673,044.00
	RFLB 7.75% 09/16/26	175,000,000.00	179,215,750.00
	RFLB 7% 01/25/23	65,200,000.00	65,415,812.00
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,696,872.00
	RFLB 7% 12/15/21	89,000,000.00	89,294,590.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	151,000,000.00	158,580,955.00
RFLB 8.5% 09/17/31	107,400,000.00	116,566,053.00	
	ロシアルーブル 小計	1,825,050,000.00	1,853,619,881.00 (3,243,834,791)
マレーシアリンギット	MGS 3.492% 03/31/20	12,750,000.00	12,737,505.00
	MGS 3.62% 11/30/21	14,100,000.00	14,067,006.00
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,561,215.75
	MGS 3.659% 10/15/20	5,100,000.00	5,105,202.00
	MGS 3.8% 08/17/23	4,750,000.00	4,710,147.50
	MGS 3.899% 11/16/27	8,300,000.00	8,047,887.50
	MGS 3.9% 11/30/26	8,350,000.00	8,109,019.00
	MGS 3.955% 09/15/25	5,950,000.00	5,852,777.00
	MGS 4.059% 09/30/24	6,550,000.00	6,526,551.00
	MGS 4.16% 07/15/21	2,250,000.00	2,275,368.75
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,710,619.00
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,115,523.75
MGS 4.762% 04/07/37	5,800,000.00	5,706,910.00	
	マレーシアリンギット 小計	87,200,000.00	86,525,732.25 (2,376,861,864)
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	85,500,000.00	85,432,882.50
	THAIGB 2.125% 12/17/26	103,000,000.00	99,916,180.00

	THA1GB 2.55% 06/26/20	53,450,000.00	54,397,935.75	
	THA1GB 2% 12/17/22	94,000,000.00	94,042,770.00	
	THA1GB 3.4% 06/17/36	66,000,000.00	67,791,570.00	
	THA1GB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,188,280.00	
	THA1GB 3.65% 06/20/31	144,000,000.00	154,184,400.00	
	THA1GB 3.65% 12/17/21	137,000,000.00	145,367,275.00	
	THA1GB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	97,700,195.00	
	THA1GB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	113,254,725.00	
	タイバーツ 小計	950,950,000.00	1,002,276,213.25 (3,417,761,887)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	23,799,875.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	15,000,000.00	14,998,500.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	21,491,800.00	
	フィリピンペソ 小計	60,000,000.00	60,290,175.00 (124,800,662)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,725,312,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	13,010,130,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	20,284,232,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,906,462,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	25,500,000,000.00	24,133,710,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	25,700,000,000.00	23,867,204,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	24,335,612,500.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	20,000,000,000.00	19,604,900,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	20,000,000,000.00	19,628,700,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	30,800,000,000.00	30,959,852,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	36,246,528,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	30,500,000,000.00	31,571,770,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	17,176,684,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	32,500,000,000.00	33,814,787,500.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	50,200,000,000.00	52,776,766,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	22,000,000,000.00	23,050,720,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,000,000,000.00	42,584,400,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	21,900,000,000.00	24,012,255,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,049,637,000.00	
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	36,079,875,000.00		
	インドネシアルピア 小計	485,200,000,000.00	501,819,538,000.00 (3,964,374,350)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	65,250,000.00	71,185,466.25	
	SAGB 6.25% 03/31/36	30,300,000.00	21,629,806.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	20,558,345.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	21,000,000.00	20,421,975.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	9,000,000.00	8,960,400.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	26,100,000.00	25,610,494.50	

	SAGB 7% 02/28/31	36,300,000.00	29,802,481.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	30,400,000.00	27,427,032.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000.00	28,098,323.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	41,300,000.00	37,118,375.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000.00	52,539,549.75	
	SAGB 8.875% 02/28/35	22,800,000.00	21,341,826.00	
	SAGB 8% 01/31/30	32,300,000.00	29,233,599.50	
	SAGB 9% 01/31/40	24,200,000.00	22,464,739.00	
	南アフリカランド 小計	458,200,000.00	416,392,413.00 (3,489,368,420)	
	合計		41,175,168,806 (41,175,168,806)	

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%	10.1%
ブラジルリアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.4%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.7%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	8.1%
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%	0.2%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	6.3%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.5%
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 15銘柄	100.0%	9.5%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	7.9%
マレーシアリンギット	国債証券 13銘柄	100.0%	5.8%
タイバーツ	国債証券 10銘柄	100.0%	8.3%
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%	9.6%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.5%

(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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2018年6月12日から2018年12月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2018年 6月11日現在）	第2期中間計算期間 （2018年12月11日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	72,354	-
コール・ローン	4,472,687	8,350,835
親投資信託受益証券	539,936,958	722,591,256
未収入金	1,555,657	-
流動資産合計	546,037,656	730,942,091
資産合計	546,037,656	730,942,091
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,164
未払受託者報酬	74,548	182,992
未払委託者報酬	596,361	1,463,864
未払利息	11	23
その他未払費用	7,463	18,338
流動負債合計	678,383	1,666,381
負債合計	678,383	1,666,381
純資産の部		
元本等		
元本	543,341,082	735,893,074
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,018,191	6,617,364
（分配準備積立金）	7,154,469	6,184,378
元本等合計	545,359,273	729,275,710
純資産合計	545,359,273	729,275,710
負債純資産合計	546,037,656	730,942,091

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年 8月25日 至 2018年 2月24日	第2期中間計算期間 自 2018年 6月12日 至 2018年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	7,350,792	6,819,350
営業収益合計	7,350,792	6,819,350
営業費用		
支払利息	981	3,145
受託者報酬	56,201	182,992
委託者報酬	449,457	1,463,864
その他費用	5,564	18,372
営業費用合計	512,203	1,668,373
営業利益又は営業損失（ ）	7,862,995	8,487,723
経常利益又は経常損失（ ）	7,862,995	8,487,723
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,862,995	8,487,723
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,297,986	665,432
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	2,018,191
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,286,145	881,034
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,286,145	881,034
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,840,480	363,434
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,840,480	363,434
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,284,684	6,617,364

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期中間計算期間は2018年 6月12日から2018年12月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年 6月11日現在)	第2期中間計算期間 (2018年12月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	543,341,082口	735,893,074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 - 円	元本の欠損 6,617,364円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たり純資産額) (10,037円)	1口当たり純資産額 0.9910円 (1万口当たり純資産額) (9,910円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第2期中間計算期間 (2018年12月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第2期中間計算期間 (2018年12月11日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日	第2期中間計算期間 自 2018年 6月12日 至 2018年12月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	543,341,082円
期中追加設定元本額	755,425,234円	294,868,405円
期中一部解約元本額	212,584,152円	102,316,413円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,660,974,129
株式	232,020,983,450
未収配当金	109,487,025
前払金	75,581,100
差入委託証拠金	67,275,000
流動資産合計	236,934,300,704
資産合計	236,934,300,704
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,584,880
未払金	2,061,470,650
未払解約金	23,364,044
未払利息	13,068
その他未払費用	55,115
流動負債合計	2,160,487,757
負債合計	2,160,487,757
純資産の部	
元本等	
元本	164,183,780,859
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,590,032,088
元本等合計	234,773,812,947
純資産合計	234,773,812,947
負債純資産合計	236,934,300,704

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2018年12月11日現在
	<p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 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）

	2018年12月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	164,183,780,859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 1.4299円 (1万口当たり純資産額) (14,299円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	131,918,382,031円
期中追加設定元本額	39,877,219,972円
期中一部解約元本額	7,611,821,144円
期末元本額	164,183,780,859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）	619,484,106円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,643,319,564円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,343,313円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,919,968,578円
世界経済インデックスファンド	1,761,186,273円
日本株式インデックス・オープン	5,732,917,625円
DCマイセレクション25	5,871,782,025円
DCマイセレクション50	18,128,738,968円
DCマイセレクション75	16,405,474,214円
DC日本株式インデックス・オープン	5,443,479,473円
DCマイセレクションS25	2,365,166,132円
DCマイセレクションS50	7,247,336,378円
DCマイセレクションS75	4,744,435,307円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,894,778,399円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	354,030,155円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	570,255,499円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	375,671,028円
DC世界経済インデックスファンド	1,370,980,076円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	552,637,753円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	23,263,031円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	47,928,202円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,670,006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）	333,370,459円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,630,550円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	112,361,320円

区分	2018年12月11日現在
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	426,577,634円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	68,981,674円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	627,052,234円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,787,374,191円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	718,939,288円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,175,075,571円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	658,460,002円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	50,417,973円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	809,696,446円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	214,516,323円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	452,295,936円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	590,110,432円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,687,458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)	922,774,279円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,200,692,196円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,250,496,474円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	919,432,566円
分散投資コア戦略ファンドS	1,929,253,756円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	192,500,011円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	193,001,780円
コア投資戦略ファンド(切替型)	779,350,301円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,641,932円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	8,454,513円
SMT インデックスバランス・オープン	65,799,289円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	704,216,160円
SMT 世界経済インデックス・オープン	7,168,629円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	48,598,378円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	6,191,045円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,255,131円
グローバル経済コア	309,186,256円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	6,820,728円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	37,520,275円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	577,422円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	11,105,561円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	4,417,258円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,626,021,079円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	681,413,038円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,837,021,100	-	2,761,440,000	75,581,100
合計		2,837,021,100	-	2,761,440,000	75,581,100

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2018年12月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	454,419,858
国債証券	357,002,019,750
地方債証券	24,263,992,299
特殊債券	30,138,672,937
社債券	17,903,329,370
未収入金	300,950,900
未収利息	1,092,492,218
前払費用	61,436,796
流動資産合計	431,217,314,128
資産合計	
431,217,314,128	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	312,911,362
未払利息	1,274
その他未払費用	21,686
流動負債合計	312,934,322
負債合計	
312,934,322	
純資産の部	
元本等	
元本	309,400,631,780
剰余金	
剰余金又は欠損金()	121,503,748,026
元本等合計	430,904,379,806
純資産合計	
430,904,379,806	
負債純資産合計	
431,217,314,128	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2018年12月11日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2018年12月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	309,400,631,780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 100,880,000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 1.3927円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,927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)

金融商品の時価等に関する事項

2018年12月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(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</p>

	2018年12月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	274,944,322,915円
期中追加設定元本額	44,108,858,654円
期中一部解約元本額	9,652,549,789円
期末元本額	309,400,631,780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）	3,948,630,952円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,034,247円
S M T 国内債券インデックス・オープン	14,418,600,331円
世界経済インデックスファンド	1,801,506,965円
D C マイセレクション 2 5	19,828,925,043円
D C マイセレクション 5 0	21,764,709,782円
D C マイセレクション 7 5	6,458,413,784円
D C 日本債券インデックス・オープン	449,233,524円
D C 日本債券インデックス・オープン S	78,623,050,535円
D C 日本債券インデックス・オープン P	36,384,244,934円
D C マイセレクション S 2 5	7,920,292,160円
D C マイセレクション S 5 0	8,693,678,568円
D C マイセレクション S 7 5	1,858,817,897円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,229,810,719円

区分	2018年12月11日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,207,882,575円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	403,830,957円
DC世界経済インデックスファンド	1,488,096,221円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	88,978,301円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	8,748,184円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	57,470,985円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,952,241円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	987,888円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	271,458,334円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	412,003,835円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	71,787,769円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	190,347,387円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	5,023,778,640円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,089,359,244円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,059,439,299円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	856,598,114円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	120,240,323円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,444,674,102円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	171,409,486円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,590,360,551円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,065,485,236円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	179,831,795円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,730,424,771円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,176,882,043円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	48,037,115円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	687,239,875円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,593,955円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,342,605円
SMT インデックスバランス・オープン	69,250,967円
SMT 世界経済インデックス・オープン	6,446,509円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	8,350,211円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	19,269,269円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,246,403円
グローバル経済コア	284,026,623円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,289,231円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	276,374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)	67,053,057,681円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,554,203,367
コール・ローン	237,172,056
株式	311,591,895,306
投資信託受益証券	227,503,332
投資証券	8,282,543,439
派生商品評価勘定	1,890,865
未収入金	1,425,786
未収配当金	590,549,316
前払金	580,079,403
差入委託証拠金	1,445,836,616
流動資産合計	331,513,099,486
資産合計	331,513,099,486
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	581,625,333
未払解約金	30,001,376
未払利息	664
その他未払費用	7,688
流動負債合計	611,635,061
負債合計	611,635,061
純資産の部	
元本等	
元本	138,775,435,682
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	192,126,028,743
元本等合計	330,901,464,425
純資産合計	330,901,464,425
負債純資産合計	331,513,099,486

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

	2018年12月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		138,775,435,682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)	2.3844円 (23,844円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	137,398,170,903円
期中追加設定元本額	9,131,522,340円
期中一部解約元本額	7,754,257,561円
期末元本額	138,775,435,682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）	2,320,775,636円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,762,938円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,415,252,183円
世界経済インデックスファンド	7,302,888,151円
外国株式インデックス・オープン	1,009,228,627円
D C マイセレクション 2 5	980,572,494円
D C マイセレクション 5 0	4,714,055,730円
D C マイセレクション 7 5	5,096,748,631円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,054,200,211円
D C マイセレクション S 2 5	386,227,427円
D C マイセレクション S 5 0	1,884,619,427円
D C マイセレクション S 7 5	1,468,182,594円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	113,231,537円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	180,254,468円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	117,402,913円
D C 世界経済インデックスファンド	5,950,593,797円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,767,412,736円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	12,464,355円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,692,257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）	58,076,387円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	71,890,677円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	268,050,766円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	41,625,744円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	378,428,589円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	781,983,876円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	400,467,267円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,628,406,994円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,987,260,917円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	91,289,553円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	386,113,221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）	52,770,099円

区分	2018年12月11日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	128,429,341円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,103,233,783円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	2,308,417,255円
外国株式ファンド・シリーズ1	914,558,291円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,820,124,979円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,271,561,240円
分散投資コア戦略ファンドA	2,148,031,146円
分散投資コア戦略ファンドS	4,431,048,239円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	745,743,115円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	890,490,986円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,766,344,835円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	867,048,327円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	43,031,429円
SMT インデックスバランス・オープン	289,712,370円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,850,381,375円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	30,554,474,429円
SMT 世界経済インデックス・オープン	44,307,282円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	288,236,091円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	42,101,733円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	790,631円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	33,183,156円
グローバル経済コア	1,267,208,215円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,310,285円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	178,873円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	25,054,171円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	11,470,233円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,544,489,729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)	1,300,310,586円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,138,233,355円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2018年12月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,422,311,939	-	10,842,232,536	580,079,403
合計		11,422,311,939	-	10,842,232,536	580,079,403

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2018年12月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	258,639,750	-	258,984,685	344,935
	アメリカドル	155,967,750	-	156,224,685	256,935
	ユーロ	102,672,000	-	102,760,000	88,000
	合計	258,639,750	-	258,984,685	344,935

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	155,843,775
コール・ローン	2,407,242,142
国債証券	251,956,141,180
派生商品評価勘定	15,064,772
未収入金	8,972,054
未収利息	1,739,617,271
前払費用	115,834,078
差入委託証拠金	141,477,272
流動資産合計	256,540,192,544
資産合計	256,540,192,544
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,875,474
前受金	12,681,559
未払金	5,767,214
未払解約金	64,145,840

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
未払利息	6,749
その他未払費用	42,232
流動負債合計	92,519,068
負債合計	92,519,068
純資産の部	
元本等	
元本	93,586,722,130
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,860,951,346
元本等合計	256,447,673,476
純資産合計	256,447,673,476
負債純資産合計	256,540,192,544

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2018年12月11日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2018年12月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,586,722,130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 2.7402円 (1万口当たり純資産額) (27,402円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	92,353,094,819円
期中追加設定元本額	11,560,086,488円
期中一部解約元本額	10,326,459,177円
期末元本額	93,586,722,130円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,935,366,964円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	791,934,572円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	537,576,418円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,115,575,561円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,870,561円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,229,793,825円
世界経済インデックスファンド	6,684,767,025円
DCマイセレクション25	1,607,320,695円
DCマイセレクション50	1,402,736,425円
DCマイセレクション75	904,749,587円
DC外国債券インデックス・オープン	1,770,487,505円
DCマイセレクションS25	643,726,005円
DCマイセレクションS50	560,812,445円
DCマイセレクションS75	262,588,369円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	49,327,766円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	57,965,399円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	27,325,188円
DC世界経済インデックスファンド	5,468,081,345円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	610,749,874円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	43,966,775円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,707,126円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,192,335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）	60,878,743円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	153,077,795円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	243,525,549円

区分	2018年12月11日現在
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	182,912,462円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	554,303,948円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,439,301,797円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	680,137,398円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,410,054,572円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	909,430,358円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	97,482,576円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	707,664,570円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	217,651,281円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	260,753,558円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	340,148,951円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,080,475,681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)	967,695,909円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	939,054,179円
外国債券ファンド・シリーズ1	453,966,895円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,177,729,382円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,768,990,860円
分散投資コア戦略ファンドA	914,130,892円
分散投資コア戦略ファンドS	2,672,961,737円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	235,118,455円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,418,668,784円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,041,691,622円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	267,410,245円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	115,072,445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)	1,002,309,564円
SMT インデックスバランス・オープン	264,207,400円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	23,006,367,171円
SMT 世界経済インデックス・オープン	40,506,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	91,385,764円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	113,472,559円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	736,208円
グローバル経済コア	1,148,644,212円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,953,435円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,148円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	10,502,232円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	2,745,753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)	838,655,152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)	9,677,948,803円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	355,340,665円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,758,772,115	-	1,771,453,674	12,681,559
	合計	1,758,772,115	-	1,771,453,674	12,681,559

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2018年12月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	2,468,394,679	-	2,460,885,300	7,509,379
	アメリカドル	1,205,546,288	-	1,205,326,200	220,088
	カナダドル	111,833,087	-	110,459,200	1,373,887
	ユーロ	980,069,187	-	977,504,500	2,564,687
	イギリスポンド 売建	170,946,117	-	167,595,400	3,350,717
	イギリスポンド 売建	71,526,723	-	71,509,605	17,118
	イギリスポンド 売建	71,526,723	-	71,509,605	17,118
	合計	2,539,921,402	-	2,532,394,905	7,492,261

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2018年12月11日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	956,536,126
コール・ローン	44,625,209
株式	47,961,846,446
投資信託受益証券	73,427,125
投資証券	175,139,773
派生商品評価勘定	377,222
未収入金	22,243,201
未収配当金	19,809,029
前払金	34,225,390
差入委託証拠金	190,638,539
流動資産合計	49,478,868,060
資産合計	49,478,868,060
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,602,957
未払金	24,358,749
未払解約金	38,651,003
未払利息	125
その他未払費用	837
流動負債合計	97,613,671
負債合計	97,613,671
純資産の部	
元本等	
元本	18,818,890,066
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,562,364,323
元本等合計	49,381,254,389
純資産合計	49,381,254,389
負債純資産合計	49,478,868,060

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年12月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,818,890,066口

		2018年12月11日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6240円 (26,240円)	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2018年12月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>		

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

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

区分	2018年12月11日現在
期首元本額	17,360,701,477円
期中追加設定元本額	1,894,936,054円
期中一部解約元本額	436,747,465円
期末元本額	18,818,890,066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	7,180,569,285円
世界経済インデックスファンド	3,103,940,896円
DC新興国株式インデックス・オープン	3,827,143,720円
DC世界経済インデックスファンド	2,552,389,615円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	171,781,138円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	323,248,749円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	376,338,684円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	376,341,353円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,723,158円
SMT インデックスバランス・オープン	122,523,778円
SMT 世界経済インデックス・オープン	27,393,851円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	178,478,332円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	24,570,527円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	673,081円
グローバル経済コア	527,698,901円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	8,074,998円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年12月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,193,673,583	うち1年超	1,159,448,193	34,225,390
			-		
合計		1,193,673,583	-	1,159,448,193	34,225,390

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2018年12月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	119,551	-	119,289	262
	アメリカドル	119,551	-	119,289	262
	売建	119,551	-	119,634	83
	ブラジルリアル	119,551	-	119,634	83
合計		239,102	-	238,923	345

(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年12月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	832,520,523
コール・ローン	94,723,047
国債証券	43,893,374,573
未収利息	851,971,341
前払費用	103,255,725
流動資産合計	45,775,845,209
資産合計	45,775,845,209
負債の部	
流動負債	
未払金	25,223,250
未払解約金	6,791,818
未払利息	265
その他未払費用	5,491
流動負債合計	32,020,824
負債合計	32,020,824
純資産の部	
元本等	
元本	28,142,731,219
剰余金	
剰余金又は欠損金()	17,601,093,166
元本等合計	45,743,824,385
純資産合計	45,743,824,385
負債純資産合計	45,775,845,209

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
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）

	2018年12月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,142,731,219口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.6254円
	(1万口当たり純資産額) (16,254円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<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</p> <p>売買目的有価証券</p>

	2018年12月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2018年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	26,413,348,921円
期中追加設定元本額	3,266,465,999円
期中一部解約元本額	1,537,083,701円
期末元本額	28,142,731,219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	4,122,478,583円
世界経済インデックスファンド	5,340,925,248円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,860,668,342円
DC世界経済インデックスファンド	4,346,490,125円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,872,082,419円
コア投資戦略ファンド(安定型)	138,847,350円
コア投資戦略ファンド(成長型)	492,238,225円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	99,613,139円
分散投資コア戦略ファンドA	131,787,645円
分散投資コア戦略ファンドS	411,089,023円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	178,893,199円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,953,716,541円

区分	2018年12月11日現在
コア投資戦略ファンド(切替型)	79,323,611円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	210,159,658円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	92,674,432円
SMT インデックスバランス・オープン	212,922,142円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,254,823,474円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,169,986円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	99,460,529円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	129,878,449円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,179,667円
グローバル経済コア	938,993,925円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,520,592円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	397,527円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	125,397,388円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

【純資産額計算書】

（2018年12月28日現在）

資産総額	686,970,890円
負債総額	172,065円
純資産総額（ - ）	686,798,825円
発行済口数	705,955,190口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9729円
（1万口当たり純資産額）	（9,729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

（2018年12月28日現在）

資産総額	240,726,543,053円
負債総額	5,278,900,566円
純資産総額（ - ）	235,447,642,487円
発行済口数	173,315,160,114口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3585円
（1万口当たり純資産額）	（13,585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

（2018年12月28日現在）

資産総額	437,254,540,322円
負債総額	9,296,667,345円
純資産総額（ - ）	427,957,872,977円
発行済口数	305,858,507,412口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3992円
（1万口当たり純資産額）	（13,992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

(2018年12月28日現在)

資産総額	311,507,164,586円
負債総額	304,867,247円
純資産総額(-)	311,202,297,339円
発行済口数	139,390,412,887口
1口当たり純資産額(/)	2.2326円
(1万口当たり純資産額)	(22,326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

(2018年12月28日現在)

資産総額	253,085,653,348円
負債総額	2,529,215,561円
純資産総額(-)	250,556,437,787円
発行済口数	92,482,644,082口
1口当たり純資産額(/)	2.7092円
(1万口当たり純資産額)	(27,092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

(2018年12月28日現在)

資産総額	48,149,776,370円
負債総額	4,697,966円
純資産総額(-)	48,145,078,404円
発行済口数	18,830,462,528口
1口当たり純資産額(/)	2.5568円
(1万口当たり純資産額)	(25,568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

(2018年12月28日現在)

資産総額	45,472,645,108円
負債総額	744,581円
純資産総額（ - ）	45,471,900,527円
発行済口数	28,150,800,616口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6153円
（1万口当たり純資産額）	（16,153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ます。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2018年12月28日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間ににおける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

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

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

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。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、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2019年 3月11日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年12月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	528	11,339,014
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	306,406
単位型公社債投資信託	0	0
合計	607	11,645,420

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

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

(単位:千円)

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				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	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)		当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	"	-	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・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。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 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29年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499
----------------	---	--------	--------	-------

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日現在)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成30年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの			
その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806

固定資産

有形固定資産

建物	1	35,878
器具備品	1	94,797
その他有形固定資産	1	1,967
有形固定資産合計		132,642

無形固定資産

476,662

投資その他の資産

投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590
その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284

固定資産合計

920,589

資産合計

32,413,396

負債の部

流動負債

未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	2	107,652
流動負債合計		4,638,109

固定負債

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

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	75,000
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	24,405,169
利益剰余金合計	26,580,169
株主資本合計	27,230,169
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	789
評価・換算差額等合計	789
純資産合計	27,230,959
負債・純資産合計	32,413,396

中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	1	2,088,498
営業利益		2,433,271
営業外収益	2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774

法人税等合計
中間純利益

730,051

1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	500	-	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	607	607	607
当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

重要な会計方針

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。

なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に及ぼす

影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末
（2018年9月30日）

1	有形固定資産の減価償却累計額	
	建物	66,454千円
	器具備品	342,351千円
	その他有形固定資産	3,136千円
	計	411,942千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	19,715千円
	無形固定資産	44,989千円
2	営業外収益の主要項目	
	受取利息	819千円
	貸倒引当金戻入	17,088千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
-------	---------	-----------	-----------	----------

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

2018年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	23,034,588	23,034,588	-
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	-
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	-
(4)投資有価証券 其他有価証券	37,331	37,331	-
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	-
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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

(4)投資有価証券

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

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

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

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（4）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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

（関連情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

（共通支配下の取引等）

1．取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

2．実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定であります。

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）

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

1. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的
資本規模の充実を図るため、会社法第450条第1項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。
2. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領
 - (1) 減少すべきその他資本剰余金の額
その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。
 - (2) その他資本剰余金の額の減少方法
減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。
資本金の額は2,000,000千円になります。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常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

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2018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） （2018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。
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。
株式会社東京スター銀行	26,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ごうぎん証券株式会社	3,000	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。
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。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社山陰合同銀行	20,705	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年 6月 1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2018年8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2017年8月25日から2018年6月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2018年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内	知 明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2019年2月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2018年6月12日から2018年12月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2018年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年6月12日から2018年12月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。