

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年2月9日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【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】	(1)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、平成29年8月8日に提出した有価証券届出書（平成29年12月28日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>及び<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新・訂正後>に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」及び「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容です。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

##### （1）ファンドの目的及び基本的性格

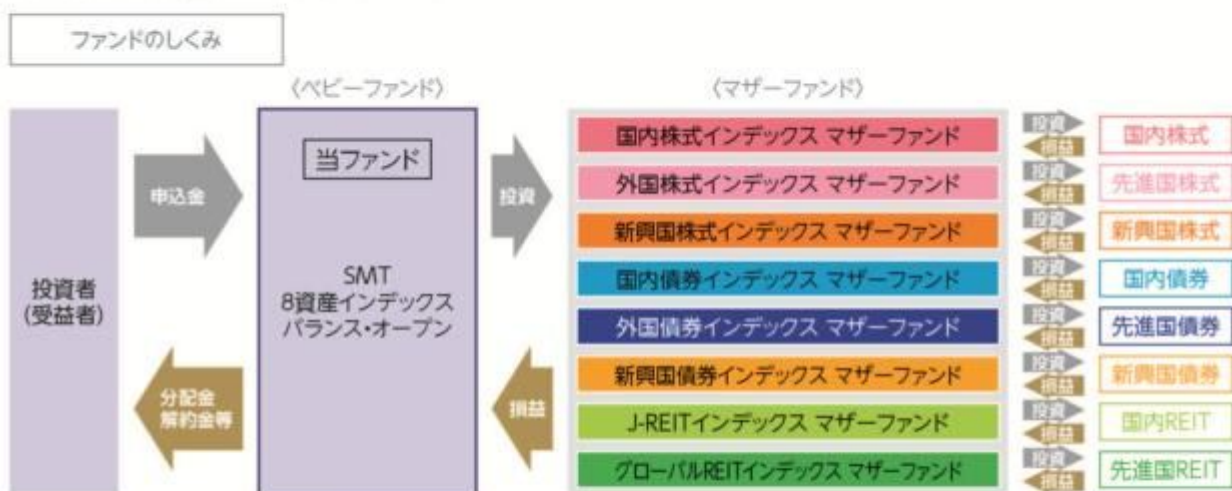
<ファンドの特色>を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

<ファンドの特色>

**特色1** 国内及び海外の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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



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

#### ? ファミリーファンド方式とは

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

#### ? DR(預託証券)とは

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

#### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2

8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

マザーファンド	インデックス
1 国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)
2 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)
3 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)
4 国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
5 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)
6 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・ディバースィファイド(円換算ベース)
7 J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
8 グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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

詳しくは下記をご覧ください。

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

「MSCI コクサイ・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。

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

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

「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。

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

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

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

## 分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

## (3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

(前略)

委託会社の概況(平成29年5月31日現在)

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

委託会社の概況(平成29年11月30日現在)

(後略)

## 2 投資方針

## (1) 投資方針

< 訂正前 >

(前略)

投資態度

(中略)

ハ．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)
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)



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）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券インデックス マザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
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・ディバーシファイド（円換算ベース）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

（後略）

&lt;訂正後&gt;

（前略）

投資態度

（中略）

八．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）
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）
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）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
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・ディバーシファイド（円換算ベース）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

（後略）

（２）投資対象

&lt;訂正前&gt;

（前略）

（参考）マザーファンドの概要

（中略）

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

## １．基本方針

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

## ２．運用方法

（中略）

(2)投資態度

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

（後略）

<訂正後>

（前略）

（参考）マザーファンドの概要

（中略）

「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

（中略）

(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。

（後略）

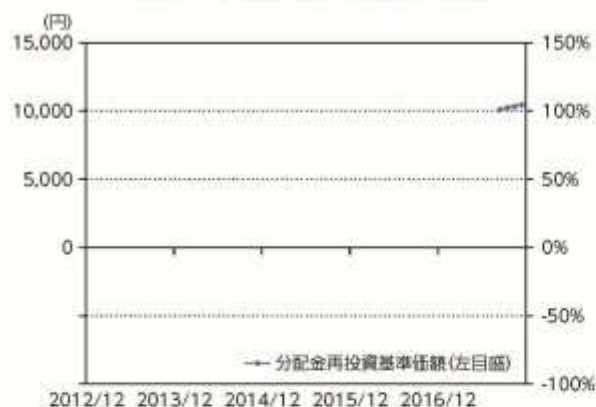
3 投資リスク

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>



## 〔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

\*当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。

\*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

\*2012年12月～2017年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>#1</sup>

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>#2</sup>

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>#3</sup>

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>#4</sup>

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>#5</sup>

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

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

#1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、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債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、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。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

## (5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

( 前略 )

上記は、平成29年11月8日現在のもので、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。

（後略）

&lt;訂正後&gt;

（前略）

上記は、平成29年11月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

## 5 運用状況

以下は、平成29年11月30日現在の状況について記載してあります。

## S M T 8 資産インデックスバランス・オープン

## （1）投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,406,641	99.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,011	0.99
合計(純資産総額)		2,430,652	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	国内株式インデックス マザーファンド	205,637	1.5957	328,151	1.5919	327,353	13.47
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	127,596	2.4253	309,468	2.4308	310,160	12.76
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	102,563	3.0286	310,629	3.0131	309,032	12.71
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	172,201	1.7833	307,095	1.7622	303,452	12.48
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	196,947	1.4600	287,552	1.5209	299,536	12.32
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	107,119	2.7852	298,351	2.7768	297,448	12.24
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	167,510	1.7072	285,987	1.7134	287,011	11.81
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	196,802	1.3851	272,610	1.3854	272,649	11.22

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### (3) 運用実績

#### 純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成29年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
平成29年 8月末日	504,332		10,087	
9月末日	2,692,452		10,232	
10月末日	3,195,641		10,335	
11月末日	2,430,652		10,451	

#### 分配の推移

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	平成29年 8月25日～平成29年11月10日	0

#### 収益率の推移

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	平成29年 8月25日～平成29年11月10日	4.3

(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	平成29年 8月25日～平成29年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	184,106,621,200	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,756,705,941	1.48
合計(純資産総額)		186,863,327,141	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	875,000	6,016.84	5,264,741,435	7,044.00	6,163,500,000	3.30
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,015,300	699.01	3,505,783,375	792.10	3,972,619,130	2.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	319,700	8,785.52	2,808,733,532	9,485.00	3,032,354,500	1.62

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	3.27
		食料品	4.42
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.17
		医薬品	4.31
		石油・石炭製品	0.62

ゴム製品	0.95
ガラス・土石製品	1.00
鉄鋼	1.15
非鉄金属	0.96
金属製品	0.70
機械	5.40
電気機器	13.74
輸送用機器	8.63
精密機器	1.59
その他製品	2.12
電気・ガス業	1.57
陸運業	3.90
海運業	0.23
空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.67
卸売業	4.40
小売業	4.61
銀行業	7.18
証券、商品先物取引業	0.98
保険業	2.23
その他金融業	1.20
不動産業	2.25
サービス業	4.15
小計	98.52
合計	98.52

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	165円		2,849,904,540	2,965,050,000	1.59

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	191,511,497,645	58.38
	イギリス	21,760,078,826	6.63
	ドイツ	12,681,891,844	3.87
	フランス	12,459,669,554	3.80
	カナダ	12,243,967,704	3.73
	スイス	11,499,072,524	3.51
	オーストラリア	7,820,297,628	2.38
	オランダ	6,312,964,244	1.92
	アイルランド	4,486,081,622	1.37
	スペイン	4,353,768,103	1.33
	スウェーデン	3,571,523,923	1.09
	香港	3,022,968,433	0.92
	イタリア	2,574,444,549	0.78
	シンガポール	2,534,531,217	0.77
	デンマーク	2,332,904,044	0.71
	ジャージー	1,565,019,308	0.48
	バミューダ	1,533,899,799	0.47
	ベルギー	1,481,380,220	0.45
	フィンランド	1,236,078,302	0.38
	ノルウェー	898,342,102	0.27
	ケイマン	887,667,842	0.27
	キュラソー	760,563,158	0.23
	イスラエル	581,909,083	0.18
	ルクセンブルク	446,334,088	0.14
	オーストリア	331,520,532	0.10
	ニュージーランド	209,332,502	0.06
	ポルトガル	204,211,757	0.06
	パナマ	199,958,088	0.06
	リベリア	194,010,037	0.06
	英ヴァージン諸島	75,883,795	0.02
パプアニューギニア	71,272,270	0.02	
マン島	48,083,820	0.01	
モーリシャス	13,245,512	0.00	
	小計	309,904,374,075	94.48
投資信託受益証券	オーストラリア	187,877,888	0.06
	香港	60,722,096	0.02
	シンガポール	22,255,146	0.01
	小計	270,855,130	0.08
投資証券	アメリカ	6,015,658,131	1.83



	オーストラリア	711,819,612	0.22
	フランス	442,862,523	0.14
	イギリス	297,529,711	0.09
	香港	181,209,288	0.06
	シンガポール	128,447,273	0.04
	カナダ	65,120,076	0.02
	小計	7,842,646,614	2.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,000,577,249	3.05
合計(純資産総額)		328,018,453,068	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,882,933,447	2.10
	買建	カナダ	412,636,250	0.13
	買建	ドイツ	1,638,923,728	0.50
	買建	イギリス	855,770,061	0.26
	買建	オーストラリア	370,353,584	0.11

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

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

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

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

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

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	410,453	17,216.48	7,066,556,892	18,990.23	7,794,598,516	2.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	577,311	7,843.50	4,528,138,829	9,338.24	5,391,072,714	1.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	31,930	111,553.61	3,561,907,039	130,120.30	4,154,741,291	1.27
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	186,097	17,079.78	3,178,496,098	19,623.31	3,651,840,331	1.11
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	212,084	14,223.62	3,016,603,709	15,665.71	3,322,446,546	1.01
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	279,283	9,567.94	2,672,165,640	11,622.94	3,246,091,367	0.99
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	333,839	9,117.50	3,043,779,920	9,218.35	3,077,445,914	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	24,569	108,809.51	2,673,340,950	114,477.00	2,812,585,487	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,417	111,237.63	2,604,851,757	116,238.42	2,721,955,292	0.83
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	782,115	2,604.04	2,036,660,309	3,168.77	2,478,345,677	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	373,086	5,870.29	2,190,126,559	6,350.99	2,369,466,947	0.72
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,267	9,428.53	2,303,080,911	9,669.85	2,362,027,326	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	98,049	18,602.54	1,823,960,543	21,272.69	2,085,766,227	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	200,955	9,783.08	1,965,959,947	10,015.02	2,012,570,153	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	482,995	4,270.22	2,062,497,565	4,087.58	1,974,282,634	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	149,192	11,738.35	1,751,269,107	13,130.01	1,958,893,795	0.60
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	469,558	3,603.52	1,692,065,401	4,057.33	1,905,151,995	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	75,819	19,926.97	1,510,843,090	24,973.70	1,893,481,264	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	93,822	17,356.54	1,628,425,765	19,860.86	1,863,385,841	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	370,336	4,060.69	1,503,820,433	4,924.59	1,823,755,740	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	216,295	6,959.42	1,505,288,938	8,408.23	1,818,658,540	0.55
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	320,438	5,081.46	1,628,295,283	5,591.29	1,791,663,387	0.55
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,185	10,613.37	1,540,902,994	12,309.81	1,787,200,200	0.54
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,577,916	1,016.23	1,603,526,839	1,117.25	1,762,930,690	0.54
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	174,408	8,949.31	1,560,832,061	9,527.57	1,661,684,603	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	393,079	3,529.57	1,387,401,811	4,199.63	1,650,787,933	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	318,834	5,085.94	1,621,573,623	5,098.27	1,625,503,411	0.50

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	55,064	30,309.51	1,668,963,085	28,207.07	1,553,194,323	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	371,337	4,582.84	1,701,779,914	4,167.13	1,547,413,081	0.47
アメリカ	株式	DOWDUPONT INC	素材	183,235	6,826.81	1,250,911,220	8,042.94	1,473,749,760	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.44
		素材	4.80
		資本財	7.24
		商業・専門サービス	0.95
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.55
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.81
		メディア	2.21
		小売	3.86
		食品・生活必需品小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	5.21
		家庭用品・パーソナル用品	2.00
		ヘルスケア機器・サービス	4.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.94
		銀行	9.44
		各種金融	4.45
		保険	4.14
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	9.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.99		
電気通信サービス	2.44		
公益事業	3.18		
半導体・半導体製造装置	2.85		
		小計	94.48
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.39
合計			96.95

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	468	アメリカドル	60,100,536	6,734,265,059	61,427,340	6,882,933,447	2.10
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	4,710,732.5	410,304,801	4,737,500	412,636,250	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	40	スイスフラン	3,679,800	418,871,634	3,726,000	424,130,580	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	255	ユーロ	9,182,117.5	1,219,477,025	9,146,850	1,214,793,148	0.37
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	4,249,578	360,661,685	4,363,775	370,353,584	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	77	イギリスポンド	5,732,508.75	861,768,040	5,692,610	855,770,061	0.26

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

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

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

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

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	7,745,617,142	16.15
	韓国	7,464,872,225	15.56

	台湾	5,436,381,924	11.33
	中国	4,504,108,702	9.39
	インド	4,134,821,103	8.62
	ブラジル	3,156,522,926	6.58
	南アフリカ	2,878,385,953	6.00
	香港	1,617,855,386	3.37
	ロシア	1,580,628,180	3.30
	メキシコ	1,379,249,938	2.88
	タイ	1,050,961,449	2.19
	マレーシア	1,041,939,656	2.17
	インドネシア	1,020,745,540	2.13
	ポーランド	615,311,000	1.28
	フィリピン	532,199,772	1.11
	チリ	513,668,508	1.07
	バミューダ	474,699,719	0.99
	トルコ	426,196,246	0.89
	アラブ首長国連邦	312,409,041	0.65
	カタール	242,610,998	0.51
	コロンビア	185,614,189	0.39
	アメリカ	158,626,520	0.33
	ハンガリー	151,102,707	0.32
	ギリシャ	138,031,640	0.29
	オランダ	110,769,007	0.23
	チェコ	86,798,810	0.18
	マン島	53,464,588	0.11
	エジプト	45,092,102	0.09
	ペルー	26,690,882	0.06
	マルタ共和国	7,550,308	0.02
	小計	47,092,926,161	98.18
投資信託受益証券	ブラジル	88,965,156	0.19
投資証券	南アフリカ	142,470,273	0.30
	メキシコ	54,060,083	0.11
	トルコ	9,215,244	0.02
	小計	205,745,600	0.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		576,709,564	1.20
合計(純資産総額)		47,964,346,481	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
-------	---------------	------	---------	-----------------

株価指数先物取引	買建	アメリカ	646,887,060	1.35
----------	----	------	-------------	------

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		280,445,200	0.58
	売建		67,224,000	0.14

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

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



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

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

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

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	101.05	5,598,703,700	100.97	5,593,738,000	0.100	2022/3/20	1.65
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,360,000,000	100.97	4,402,608,100	101.06	4,406,216,000	0.100	2022/9/20	1.30
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	4,060,000,000	100.61	4,084,766,000	100.78	4,091,992,800	0.100	2027/3/20	1.21
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	100.93	3,825,474,400	100.77	3,819,410,400	0.100	2021/3/20	1.13
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,680,000,000	103.40	3,805,431,900	103.40	3,805,340,800	0.400	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.89	3,642,318,700	101.00	3,646,244,400	0.100	2022/6/20	1.08
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.81	3,639,385,400	100.68	3,634,800,700	0.100	2020/9/20	1.07

日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	3,520,000,000	100.64	3,542,563,200	100.50	3,537,670,400	0.100	2019/12/20	1.04
日本	国債証券	第118回利付国債（5年）	3,510,000,000	100.73	3,535,658,100	100.54	3,528,989,100	0.200	2019/6/20	1.04
日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	3,300,000,000	100.66	3,322,077,000	100.45	3,314,916,000	0.200	2019/3/20	0.98
日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.99	3,231,872,000	100.87	3,228,064,000	0.100	2021/9/20	0.95
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.70	3,162,074,200	100.56	3,157,678,200	0.100	2020/3/20	0.93
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,030,000,000	102.61	3,109,220,800	102.66	3,110,598,000	0.300	2025/12/20	0.92
日本	国債証券	第377回利付国債（2年）	3,050,000,000	100.49	3,065,027,300	100.40	3,062,383,000	0.100	2019/6/15	0.90
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	2,920,000,000	103.44	3,020,581,600	103.44	3,020,448,000	0.400	2025/9/20	0.89
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	100.87	2,985,900,000	100.71	2,981,252,800	0.100	2020/12/20	0.88
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	104.75	2,922,757,000	104.43	2,913,792,300	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,600,000,000	100.83	2,621,710,000	101.03	2,626,988,000	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第379回利付国債（2年）	2,600,000,000	100.50	2,613,131,700	100.45	2,611,700,000	0.100	2019/8/15	0.77
日本	国債証券	第381回利付国債（2年）	2,580,000,000	100.47	2,592,204,000	100.49	2,592,771,000	0.100	2019/10/15	0.77
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	2,560,000,000	100.81	2,580,736,000	100.62	2,576,102,400	0.200	2019/9/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,530,000,000	100.81	2,550,594,200	100.98	2,554,869,900	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,450,000,000	104.57	2,562,045,400	104.06	2,549,568,000	1.200	2020/12/20	0.75
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	2,530,000,000	100.46	2,541,827,700	100.76	2,549,253,300	0.100	2027/6/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	103.33	2,531,708,200	103.40	2,533,447,000	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,400,000,000	104.09	2,498,160,000	103.92	2,494,224,000	0.500	2024/9/20	0.74
日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	2,340,000,000	103.60	2,424,414,800	103.15	2,413,710,000	1.100	2020/6/20	0.71
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	103.99	2,412,756,000	103.72	2,406,350,400	0.600	2023/3/20	0.71
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	104.82	2,400,584,100	104.38	2,390,439,400	0.800	2022/9/20	0.71
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	105.45	2,372,625,000	104.98	2,362,185,000	0.800	2023/6/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □. 種類別投資比率

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

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	107,469,286,052	42.10
	フランス	25,753,578,867	10.09
	イタリア	24,824,577,694	9.72
	ドイツ	18,067,255,322	7.08
	イギリス	17,420,892,847	6.82
	スペイン	14,596,848,846	5.72
	ベルギー	6,440,408,717	2.52
	オランダ	5,531,425,908	2.17
	カナダ	5,304,387,365	2.08
	オーストラリア	5,271,118,346	2.06
	オーストリア	3,944,438,825	1.55
	メキシコ	2,129,377,451	0.83
	アイルランド	1,990,790,101	0.78
	デンマーク	1,654,927,467	0.65
	ポーランド	1,560,853,951	0.61
	フィンランド	1,540,518,897	0.60
	南アフリカ	1,296,063,675	0.51
	スウェーデン	1,168,026,250	0.46
	マレーシア	1,107,723,471	0.43
	シンガポール	950,291,715	0.37
ノルウェー	721,643,450	0.28	
スイス	442,063,096	0.17	
	小計	249,186,498,313	97.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,107,246,301	2.39

合計(純資産総額)	255,293,744,614	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,949,079,700	1.55

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	30,000,000	11,604.47	3,481,341,218	11,433.76	3,430,128,485	3.125	2019/5/15	1.34
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	16,900,000	11,529.93	1,948,558,985	11,374.75	1,922,334,043	2.500	2024/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	11,097.95	1,942,141,953	10,973.52	1,920,366,087	1.750	2023/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	17,050,000	10,273.86	1,751,693,897	10,501.50	1,790,506,268	2.500	2046/2/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	14,150,000	11,158.93	1,578,989,304	11,362.10	1,607,737,440	2.875	2043/5/15	0.63
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	14,763.52	1,623,987,464	14,589.84	1,604,882,680	3.500	2020/4/25	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,806.74	1,416,809,028	11,881.56	1,425,788,305	3.125	2044/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,520.89	1,388,757,708	10,449.99	1,379,399,769	1.500	2026/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	11,055.67	1,359,847,693	10,956.44	1,347,642,786	2.000	2025/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	11,180.57	1,285,765,906	11,121.31	1,278,951,341	1.250	2019/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,600.10	1,276,011,980	11,449.19	1,259,411,048	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	11,164.00	1,250,368,594	11,060.86	1,238,817,373	1.750	2022/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,818.56	1,168,408,688	9,940.52	1,182,922,867	2.250	2046/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	11,081.81	1,163,590,509	11,032.08	1,158,368,514	2.000	2024/6/30	0.45

アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,311.96	1,148,164,419	11,190.63	1,135,848,960	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	9,900,000	11,110.25	1,099,915,678	11,331.49	1,121,817,709	2.875	2045/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	11,082.86	1,124,910,462	11,028.59	1,119,402,868	1.750	2022/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	11,253.51	1,125,351,765	11,185.79	1,118,579,396	1.625	2019/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	11,197.15	1,119,715,650	11,106.15	1,110,615,453	1.500	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/19	10,000,000	11,121.52	1,112,152,275	11,077.50	1,107,750,536	0.875	2019/4/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,993.22	1,099,322,550	10,889.00	1,088,900,040	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,956.85	1,073,772,193	10,881.44	1,066,381,377	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,181.76	1,067,858,479	11,069.71	1,057,158,026	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,177.54	1,067,455,810	11,053.99	1,055,656,868	1.750	2022/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	11,085.73	1,053,144,908	10,993.94	1,044,424,580	1.375	2021/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	8,750,000	11,750.07	1,028,131,567	11,552.38	1,010,833,405	3.375	2019/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,291.72	1,016,255,403	11,102.11	999,189,928	1.875	2022/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,135.35	1,002,182,029	11,079.24	997,131,611	1.000	2019/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,239.89	1,005,970,583	11,081.41	991,786,814	2.250	2027/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/23	9,000,000	10,954.34	985,890,671	10,856.16	977,054,935	1.625	2023/10/31	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.61
合計	97.61

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	41	アメリカ ドル	4,788,226.6	536,520,790	4,781,625	535,781,081	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカ ドル	3,120,990.75	349,707,014	3,111,718.75	348,668,086	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカ ドル	2,450,032.75	274,526,170	2,435,000	272,841,750	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	26	ユーロ	2,918,439	387,597,884	2,916,810	387,381,536	0.15
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,554,618	472,088,817	3,549,690	471,434,329	0.18
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	41	ユーロ	6,661,804	884,754,188	6,661,680	884,737,720	0.35

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

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

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

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	3,191,382,121	10.03
	ブラジル	3,149,639,051	9.90
	インドネシア	3,067,258,729	9.64
	ポーランド	2,903,376,629	9.12
	タイ	2,554,983,734	8.03
	南アフリカ	2,527,807,066	7.94
	ロシア	2,381,437,354	7.48
	コロンビア	2,146,700,845	6.75
	トルコ	2,121,710,941	6.67
	マレーシア	1,838,320,458	5.78
	ハンガリー	1,478,239,635	4.65
	チェコ	1,228,312,070	3.86
	ペルー	872,523,965	2.74
	チリ	769,740,678	2.42
	フィリピン	95,525,060	0.30
	ウルグアイ	88,968,445	0.28
	小計	30,415,926,781	95.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,407,469,839	4.42
合計(純資産総額)		31,823,396,620	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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



## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	19,500,000,000	4.66	909,103,854	4.67	912,496,942	9.850	2027/6/28	2.87
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000	3.96	776,311,920	3.95	775,924,447	7.750	2021/4/14	2.44
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	4,200,000,000	18.37	771,699,222	18.32	769,740,678	5.500	2020/8/5	2.42
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	3,538.83	523,747,613	3,530.58	522,527,178	10.000	2021/1/1	1.64
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000	2,903.81	518,330,212	2,919.62	521,152,527	0.000	2020/1/1	1.64
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000	3.52	457,054,962	3.53	458,279,456	4.375	2023/3/21	1.44
メキシコ	国債証券	MBONO 5% 12/11/19	78,200,000	579.87	453,464,569	579.74	453,358,471	5.000	2019/12/11	1.42
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	49,000,000	879.70	431,053,049	879.08	430,753,708	10.500	2026/12/21	1.35
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	11,100,000	3,500.67	388,575,050	3,470.32	385,206,329	10.000	2023/1/1	1.21
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	63,000,000	592.98	373,581,926	591.82	372,848,738	6.500	2021/6/10	1.17
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	94,700,000	357.24	338,306,810	356.73	337,827,931	3.875	2019/6/13	1.06
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000	370.67	337,311,557	370.07	336,765,302	3.650	2021/12/17	1.06
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	11,800,000	2,760.29	325,714,244	2,772.12	327,110,589	0.000	2020/7/1	1.03
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000	3,118.25	321,180,409	3,125.50	321,927,385	2.250	2022/4/25	1.01
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000	0.93	314,485,340	0.93	316,249,937	8.375	2026/9/15	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	10,500,000	2,963.71	311,190,243	2,984.60	313,383,441	2.500	2026/7/25	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	44,350,000	700.15	310,517,565	697.71	309,435,809	10.000	2024/12/5	0.97
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000	0.91	292,343,264	0.91	294,162,624	8.375	2024/3/15	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	69,000,000	424.92	293,195,380	423.86	292,470,245	4.875	2029/6/22	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000	375.09	279,448,993	373.88	278,546,888	3.625	2023/6/16	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000	345.28	272,773,663	345.30	272,787,252	1.875	2022/6/17	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/19	8,650,000	3,124.59	270,277,811	3,143.34	271,899,071	0.000	2019/4/1	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000	3,253.01	271,626,719	3,250.10	271,383,968	3.250	2019/7/25	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000	353.25	271,122,138	352.85	270,819,835	2.550	2020/6/26	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000	3,097.14	260,160,398	3,102.20	260,585,102	1.750	2021/7/25	0.82
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	7,450,000	3,443.86	256,567,603	3,403.49	253,560,080	10.000	2027/1/1	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	65,400,000	385.27	251,967,496	385.45	252,086,733	3.850	2025/12/12	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	40,250,000	614.96	247,521,604	616.53	248,155,070	7.750	2042/11/13	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	41,700,000	590.13	246,085,036	588.74	245,505,442	6.500	2022/6/9	0.77

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000	3,552.13	239,769,425	3,553.63	239,870,319	10.000	2019/1/1	0.75
------	------	--------------------	-----------	----------	-------------	----------	-------------	--------	----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.58
合計	95.58

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### J-REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,732	536,083.26	5,753,245,631	563,000	6,042,116,000	7.01
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,476	519,091.34	5,438,000,893	546,000	5,719,896,000	6.64
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,796	137,710.45	4,378,641,563	141,700	4,505,493,200	5.23
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,321	199,106.22	4,245,143,921	199,300	4,249,275,300	4.93
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,444	160,008.08	3,911,237,699	159,300	3,893,929,200	4.52
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,383	153,312.04	3,278,271,460	157,700	3,372,099,100	3.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	13,940	232,822.2	3,245,541,603	241,100	3,360,934,000	3.90
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	11,399	258,135.25	2,942,483,745	269,400	3,070,890,600	3.56
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,261	263,033.25	2,698,984,261	273,700	2,808,435,700	3.26
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,997	359,542.23	2,515,717,004	377,500	2,641,367,500	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,988	75,108.92	2,402,584,273	78,200	2,501,461,600	2.90
日本	投資証券	GLP投資法人	19,403	111,523.15	2,163,883,698	121,500	2,357,464,500	2.74
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,790	444,063.05	2,127,062,046	465,500	2,229,745,000	2.59
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,239	590,075.32	1,911,253,985	632,000	2,047,048,000	2.38
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,770	439,556.19	1,657,126,843	457,000	1,722,890,000	2.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,683	437,052.41	1,609,664,031	454,000	1,672,082,000	1.94
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,906	131,210.34	1,562,190,339	137,600	1,638,265,600	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,383	203,410.49	1,501,779,711	207,500	1,531,972,500	1.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,011	464,055.78	1,397,271,960	491,500	1,479,906,500	1.72
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	30,396	46,605.86	1,416,631,770	48,150	1,463,567,400	1.70
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,925	130,611.53	1,296,319,494	135,000	1,339,875,000	1.56
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,390	548,025.19	1,309,780,214	556,000	1,328,840,000	1.54
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	7,921	159,511.51	1,263,490,695	164,000	1,299,044,000	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,527	157,912.93	1,188,610,691	165,300	1,244,213,100	1.44
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,525	113,509.86	1,194,691,356	116,900	1,230,372,500	1.43
日本	投資証券	プレミア投資法人	10,010	99,411.82	995,112,374	105,600	1,057,056,000	1.23
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	12,466	78,310.84	976,223,036	83,000	1,034,678,000	1.20
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,431	131,618.3	978,055,602	138,900	1,032,165,900	1.20
日本	投資証券	日本リート投資法人	2,978	326,023.25	970,897,265	337,000	1,003,586,000	1.16
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,042	230,023.04	929,753,141	240,900	973,717,800	1.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.68
合計	97.68

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 投資状況

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

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

アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,210	14,727.85	503,839,817	14,801.80	506,369,749	0.82
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	356,340	1,427.38	508,633,782	1,398.06	498,187,907	0.81

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.24
合計	99.24

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	440,000.00	49,293,200	49,288,800	0.08
	ユーロ	買建	40,000.00	5,312,480	5,312,400	0.01
	オーストラリアドル	買建	70,000.00	5,938,870	5,938,800	0.01
	アメリカドル	売建	100,000.00	11,161,000	11,204,000	0.02
	ユーロ	売建	34,000.00	4,497,180	4,515,540	0.01
	オーストラリアドル	売建	49,000.00	4,156,866	4,158,140	0.01
	香港ドル	売建	600,000.00	8,581,800	8,604,000	0.01
	シンガポールドル	売建	50,000.00	4,146,900	4,159,000	0.01

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

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

#### 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：2017年11月30日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,451円
純資産総額	0.02億円

※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	2017年11月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

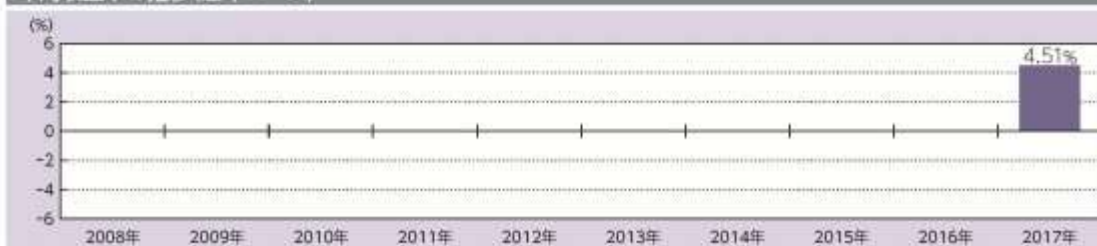
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	13.5%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 銀行業	-	-	0.4%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.8%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス 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	12.7%	TENCENT HOLDINGS LTD SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	ケイマン島 韓国	株式	ソフトウェア・サービス ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
グロー/ユーロ インデックス マザーファンド	12.5%	SIMON PROPERTY GROUP PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
J-REIT インデックス マザーファンド	12.3%	日本ビルファンド投資法人 ジャパコリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
外国債券 インデックス マザーファンド	12.2%	T 3.125% 05/15/19 T 2.5% 05/15/24	アメリカ	国債	-	3.125% 2.500%	2019/05/15 2024/05/15	0.2% 0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	11.8%	COLOM 9.85% 06/28/27 COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	国債	-	9.850% 7.750%	2027/06/28 2021/04/14	0.3% 0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	11.2%	第131回利付国債(5年) 第133回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20 2022/09/20	0.2% 0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第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(平成29年 8月25日から平成29年11月10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

## S M T 8 資産インデックスバランス・オープン

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

		第1期 (平成29年11月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		36,675
親投資信託受益証券		3,271,498
流動資産合計		3,308,173
資産合計		3,308,173
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		241
未払委託者報酬		2,078
その他未払費用		6
流動負債合計		2,325
負債合計		2,325
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		3,170,810
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		135,038
(分配準備積立金)		60,513
元本等合計		3,305,848
純資産合計		3,305,848
負債純資産合計		3,308,173

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

		第1期 自 平成29年 8月25日 至 平成29年11月10日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益		63,020
営業収益合計		63,020
<b>営業費用</b>		
支払利息		7
受託者報酬		241
委託者報酬		2,078



第1期	
自 平成29年 8月25日	
至 平成29年11月10日	
その他費用	6
営業費用合計	2,332
営業利益又は営業損失（ ）	60,688
経常利益又は経常損失（ ）	60,688
当期純利益又は当期純損失（ ）	60,688
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（ ）	175
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	77,091
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,091
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,566
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,566
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	135,038

## (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5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5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、平成29年 8月25日から平成29年11月10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 (平成29年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数		3,170,810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)	1.0426円 (10,426円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期		
自 平成29年 8月25日		
至 平成29年11月10日		
分配金の計算過程		
項目		

第1期 自 平成29年 8月25日 至 平成29年11月10日		
費用控除後の配当等収益額	A	14,868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	45,645円
収益調整金額	C	74,525円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	135,038円
当ファンドの期末残存口数	F	3,170,810口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	425円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 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 平成29年 8月25日 至 平成29年11月10日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第1期 (平成29年11月10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。

	第1期 (平成29年11月10日現在)
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 平成29年 8月25日 至 平成29年11月10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	2,791,330円
期中一部解約元本額	120,520円

## ( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成29年11月10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	62,939
合計	62,939

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	270,349	393,817	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	233,923	417,388	
	新興国株式インデックス マザーファンド	139,539	422,942	
	国内株式インデックス マザーファンド	275,289	440,187	
	外国株式インデックス マザーファンド	173,124	420,120	
	国内債券インデックス マザーファンド	269,218	373,001	
	外国債券インデックス マザーファンド	146,201	407,359	
	新興国債券インデックス マザーファンド	232,237	396,684	
合計		1,739,880	3,271,498	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,204,930,351
株式	181,456,431,420
派生商品評価勘定	136,707,220
未収入金	2,813,987,319
未収配当金	1,407,239,644
差入委託証拠金	38,949,400
流動資産合計	188,058,245,354
資産合計	188,058,245,354
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,436,780
前受金	131,283,400
未払解約金	3,088,042,370
未払利息	3,954
流動負債合計	3,224,766,504
負債合計	3,224,766,504
純資産の部	
元本等	
元本	115,589,713,212
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	69,243,765,638
元本等合計	184,833,478,850
純資産合計	184,833,478,850
負債純資産合計	188,058,245,354

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10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> <p>先物取引</p>

平成29年11月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<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。 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 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)

平成29年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,589,713,212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 1.5990円 (1万口当たり純資産額) (15,990円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

平成29年11月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>

	平成29年11月10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

	平成29年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	119,170,463,069円
期中追加設定元本額	5,043,258,357円
期中一部解約元本額	8,624,008,214円
期末元本額	115,589,713,212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)	709,594,326円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,673,613,126円
SBI資産設計オープン(分配型)	22,768,722円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,340,464,754円
世界経済インデックスファンド	1,783,298,484円
日本株式インデックス・オープン	6,516,055,958円
DCマイセレクション25	5,359,773,087円
DCマイセレクション50	15,549,397,523円
DCマイセレクション75	14,863,470,715円
DC日本株式インデックス・オープン	4,883,311,163円
DCマイセレクションS25	2,213,165,619円
DCマイセレクションS50	6,252,984,408円
DCマイセレクションS75	4,174,344,219円
DC日本株式インデックス・オープンS	4,573,898,345円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	414,291,992円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	566,831,333円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	329,366,396円
DC世界経済インデックスファンド	1,293,868,380円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	308,443,783円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	27,680,696円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	80,243,436円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	47,447,624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)	466,361,776円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,668,350円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	165,888,204円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	618,915,766円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	89,367,159円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	734,178,167円



区分	平成29年11月10日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,316,433,673円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	856,020,649円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,071,975,007円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	727,123,578円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	116,037,038円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	966,431,248円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,997,451,384円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	549,427,127円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	753,365,982円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	62,047,672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）	1,084,000,373円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,604,771,813円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,502,591,611円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	125,402,269円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	156,189,610円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	215,375,937円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,359,291円
SMT インデックスバランス・オープン	87,721,347円
SMT 世界経済インデックス・オープン	69,124円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	14,908,188円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,714,904円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	275,289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）	11,306,326,587円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	22,741,274,885
合計	22,741,274,885

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成29年11月10日現在）

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

	買建	3,325,359,560	-	3,456,630,000	131,270,440
	合計	3,325,359,560	-	3,456,630,000	131,270,440

## (注)1. 時価の算定方法

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

## 2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,100	3,620.00	11,222,000	
日本水産	89,000	617.00	54,913,000	
マルハニチロ	15,000	3,170.00	47,550,000	
カネコ種苗	2,700	1,709.00	4,614,300	
サカタのタネ	11,700	3,570.00	41,769,000	
ホクト	8,000	2,013.00	16,104,000	
ホクリヨウ	1,100	1,113.00	1,224,300	
住石ホールディングス	20,600	156.00	3,213,600	
日鉄鉱業	2,200	8,100.00	17,820,000	
三井松島産業	4,000	1,474.00	5,896,000	
国際石油開発帝石	384,500	1,353.00	520,228,500	
日本海洋掘削	2,800	2,354.00	6,591,200	
石油資源開発	12,500	2,560.00	32,000,000	
K & O エナジーグループ	4,700	1,936.00	9,099,200	
ショーボンドホールディングス	7,500	7,070.00	53,025,000	
ミライト・ホールディングス	24,300	1,454.00	35,332,200	
タマホーム	5,900	739.00	4,360,100	
サンヨーホームズ	1,400	792.00	1,108,800	
ファーストコーポレーション	1,800	1,231.00	2,215,800	
ベステラ	1,100	2,056.00	2,261,600	
インベスターズクラウド	1,400	6,430.00	9,002,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,414.00	2,545,200	
安藤・間	60,900	910.00	55,419,000	
東急建設	30,500	1,085.00	33,092,500	
コムシスホールディングス	27,800	2,872.00	79,841,600	
ミサワホーム	6,700	1,100.00	7,370,000	
ピーアールホールディングス	7,800	467.00	3,642,600	
高松コンストラクショングループ	5,100	3,075.00	15,682,500	
東建コーポレーション	3,000	13,660.00	40,980,000	

ソネック	1,000	834.00	834,000	
ヤマウラ	3,800	957.00	3,636,600	
大成建設	80,400	6,260.00	503,304,000	
大林組	237,200	1,525.00	361,730,000	
清水建設	242,000	1,287.00	311,454,000	
飛島建設	72,300	169.00	12,218,700	
長谷工コーポレーション	92,300	1,687.00	155,710,100	
松井建設	8,800	1,043.00	9,178,400	
銭高組	1,100	6,130.00	6,743,000	
鹿島建設	348,000	1,239.00	431,172,000	
不動テトラ	60,100	189.00	11,358,900	
大末建設	2,600	1,080.00	2,808,000	
鉄建建設	4,800	3,765.00	18,072,000	
西松建設	18,300	3,365.00	61,579,500	
三井住友建設	57,000	670.00	38,190,000	
大豊建設	29,000	572.00	16,588,000	
前田建設工業	56,400	1,570.00	88,548,000	
佐田建設	5,200	472.00	2,454,400	
ナカノフドー建設	6,100	632.00	3,855,200	
奥村組	13,000	4,585.00	59,605,000	
東鉄工業	9,500	3,740.00	35,530,000	
イチケン	1,500	2,455.00	3,682,500	
浅沼組	28,000	431.00	12,068,000	
戸田建設	92,000	927.00	85,284,000	
熊谷組	12,400	3,115.00	38,626,000	
青木あすなる建設	5,200	1,000.00	5,200,000	
北野建設	17,000	451.00	7,667,000	
植木組	1,000	2,750.00	2,750,000	
三井ホーム	10,000	715.00	7,150,000	
矢作建設工業	10,800	1,029.00	11,113,200	
ピーエス三菱	9,400	886.00	8,328,400	
日本ハウスホールディングス	15,100	618.00	9,331,800	
大東建託	28,600	20,380.00	582,868,000	
新日本建設	9,500	1,059.00	10,060,500	
N I P P O	18,000	2,488.00	44,784,000	
東亜道路工業	1,600	4,400.00	7,040,000	
前田道路	25,000	2,491.00	62,275,000	
日本道路	2,100	6,530.00	13,713,000	
東亜建設工業	6,400	2,509.00	16,057,600	
若築建設	4,300	1,894.00	8,144,200	
東洋建設	24,800	620.00	15,376,000	
五洋建設	94,000	752.00	70,688,000	
世紀東急工業	10,600	617.00	6,540,200	

福田組	2,600	6,860.00	17,836,000
住友林業	50,600	1,876.00	94,925,600
日本基礎技術	8,800	404.00	3,555,200
日成ビルド工業	11,700	1,265.00	14,800,500
巴コーポレーション	9,900	495.00	4,900,500
大和ハウス工業	233,600	4,302.00	1,004,947,200
ライト工業	15,200	1,248.00	18,969,600
積水ハウス	257,300	2,162.00	556,282,600
日特建設	6,700	622.00	4,167,400
北陸電気工事	4,400	1,018.00	4,479,200
ユアテック	12,500	1,031.00	12,887,500
西部電気工業	1,300	2,571.00	3,342,300
四電工	1,200	3,085.00	3,702,000
中電工	10,200	3,265.00	33,303,000
関電工	31,500	1,146.00	36,099,000
きんでん	52,600	1,893.00	99,571,800
東京エネシス	9,000	1,338.00	12,042,000
トーエネック	2,200	3,330.00	7,326,000
住友電設	6,200	2,452.00	15,202,400
日本電設工業	12,100	2,410.00	29,161,000
協和エクシオ	28,400	2,393.00	67,961,200
新日本空調	6,100	1,603.00	9,778,300
N D S	1,200	4,240.00	5,088,000
九電工	15,600	4,915.00	76,674,000
三機工業	16,800	1,349.00	22,663,200
日揮	68,200	2,030.00	138,446,000
中外炉工業	2,400	2,214.00	5,313,600
ヤマト	6,600	831.00	5,484,600
太平電業	5,300	2,810.00	14,893,000
高砂熱学工業	21,800	2,018.00	43,992,400
三晃金属工業	900	4,145.00	3,730,500
朝日工業社	1,700	3,575.00	6,077,500
明星工業	14,300	843.00	12,054,900
大気社	10,500	3,450.00	36,225,000
ダイダン	5,300	2,998.00	15,889,400
日比谷総合設備	8,800	2,594.00	22,827,200
東芝プラントシステム	17,100	1,980.00	33,858,000
O S J Bホールディングス	34,900	345.00	12,040,500
東洋エンジニアリング	9,300	1,454.00	13,522,200
千代田化工建設	51,400	792.00	40,708,800
新興プランテック	15,200	1,117.00	16,978,400
日本製粉	23,500	1,719.00	40,396,500
日清製粉グループ本社	86,700	2,071.00	179,555,700

日東富士製粉	500	4,210.00	2,105,000
昭和産業	6,500	2,898.00	18,837,000
鳥越製粉	6,300	967.00	6,092,100
中部飼料	8,700	2,131.00	18,539,700
フィード・ワン	47,600	265.00	12,614,000
東洋精糖	1,200	1,193.00	1,431,600
日本甜菜製糖	4,000	2,444.00	9,776,000
三井製糖	5,600	4,170.00	23,352,000
塩水港精糖	8,400	267.00	2,242,800
日新製糖	3,400	2,079.00	7,068,600
森永製菓	16,600	5,890.00	97,774,000
中村屋	1,800	5,020.00	9,036,000
江崎グリコ	19,800	5,710.00	113,058,000
名糖産業	3,400	1,514.00	5,147,600
不二家	4,500	2,662.00	11,979,000
山崎製パン	57,900	2,068.00	119,737,200
第一屋製パン	1,200	1,221.00	1,465,200
モロゾフ	1,200	7,380.00	8,856,000
亀田製菓	4,400	5,280.00	23,232,000
寿スピリッツ	6,800	4,985.00	33,898,000
カルビー	32,300	3,845.00	124,193,500
森永乳業	14,200	4,480.00	63,616,000
六甲バター	3,500	2,589.00	9,061,500
ヤクルト本社	42,400	9,260.00	392,624,000
明治ホールディングス	46,800	9,790.00	458,172,000
雪印メグミルク	17,100	3,085.00	52,753,500
プリマハム	50,000	750.00	37,500,000
日本ハム	61,000	2,805.00	171,105,000
林兼産業	2,500	960.00	2,400,000
丸大食品	38,000	537.00	20,406,000
S Foods	4,900	4,560.00	22,344,000
伊藤ハム米久ホールディングス	45,600	1,009.00	46,010,400
サッポロホールディングス	25,900	3,485.00	90,261,500
アサヒグループホールディングス	148,400	5,350.00	793,940,000
キリンホールディングス	340,500	2,690.00	915,945,000
宝ホールディングス	57,200	1,245.00	71,214,000
オエノンホールディングス	20,100	334.00	6,713,400
養命酒製造	2,200	2,321.00	5,106,200
コカ・コーラボトラーズジャパン	49,700	4,065.00	202,030,500
サントリー食品インターナショナル	54,200	4,950.00	268,290,000
ダイトーグループホールディングス	3,600	5,620.00	20,232,000
伊藤園	23,500	4,055.00	95,292,500
キーコーヒー	7,000	2,141.00	14,987,000

ユニカフェ	2,100	1,127.00	2,366,700
ジャパンフーズ	1,000	1,428.00	1,428,000
日清オイリオグループ	8,400	3,330.00	27,972,000
不二製油グループ本社	19,200	3,035.00	58,272,000
かどや製油	800	6,340.00	5,072,000
J - オイルミルズ	3,700	3,915.00	14,485,500
キッコーマン	55,300	3,965.00	219,264,500
味の素	162,900	2,162.00	352,189,800
キュービー	40,200	2,827.00	113,645,400
ハウス食品グループ本社	27,000	3,455.00	93,285,000
カゴメ	28,400	3,980.00	113,032,000
焼津水産化学工業	3,400	1,229.00	4,178,600
アリアケジャパン	6,500	8,770.00	57,005,000
ピエトロ	900	1,652.00	1,486,800
エバラ食品工業	1,500	2,095.00	3,142,500
ニチレイ	33,700	3,060.00	103,122,000
東洋水産	38,900	4,600.00	178,940,000
イトアンド	1,000	2,658.00	2,658,000
大冷	800	2,038.00	1,630,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	4,485.00	897,000
日清食品ホールディングス	30,900	7,250.00	224,025,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,360.00	10,880,000
一正蒲鉾	2,700	1,300.00	3,510,000
フジッコ	7,700	2,565.00	19,750,500
ロック・フィールド	7,600	2,021.00	15,359,600
日本たばこ産業	438,300	3,799.00	1,665,101,700
ケンコーマヨネーズ	4,700	3,020.00	14,194,000
わらべや日洋ホールディングス	4,600	2,865.00	13,179,000
なとり	4,000	2,006.00	8,024,000
イフジ産業	1,200	802.00	962,400
北の達人コーポレーション	6,800	912.00	6,201,600
ユーグレナ	27,300	1,132.00	30,903,600
ミヨシ油脂	2,700	1,489.00	4,020,300
理研ビタミン	2,700	4,260.00	11,502,000
片倉工業	8,500	1,325.00	11,262,500
グンゼ	5,500	5,220.00	28,710,000
東洋紡	27,400	2,058.00	56,389,200
ユニチカ	21,600	869.00	18,770,400
富士紡ホールディングス	4,100	3,540.00	14,514,000
倉敷紡績	75,000	367.00	27,525,000
シキボウ	3,700	1,438.00	5,320,600
日本毛織	20,900	1,028.00	21,485,200
トーア紡コーポレーション	3,100	637.00	1,974,700

ダイドーリミテッド	8,400	440.00	3,696,000
帝国繊維	7,800	2,373.00	18,509,400
帝人	60,500	2,426.00	146,773,000
東レ	536,300	1,169.00	626,934,700
サカイオーベックス	1,900	2,222.00	4,221,800
住江織物	20,000	313.00	6,260,000
日本フェルト	4,100	509.00	2,086,900
イチカワ	5,000	349.00	1,745,000
日東製網	800	1,835.00	1,468,000
アツギ	5,100	1,300.00	6,630,000
ダイニック	2,800	1,184.00	3,315,200
セーレン	17,000	2,157.00	36,669,000
ソトー	2,900	1,150.00	3,335,000
東海染工	1,200	1,488.00	1,785,600
小松精練	11,600	910.00	10,556,000
ワコールホールディングス	20,500	3,320.00	68,060,000
ホギメディカル	4,700	7,970.00	37,459,000
レナウン	20,000	183.00	3,660,000
クラウドシアホールディングス	2,100	580.00	1,218,000
T S Iホールディングス	28,100	921.00	25,880,100
三陽商会	4,000	2,178.00	8,712,000
オンワードホールディングス	44,000	924.00	40,656,000
ルック	13,000	368.00	4,784,000
ゴールドウイン	2,100	7,720.00	16,212,000
デサント	17,000	1,493.00	25,381,000
キング	4,000	606.00	2,424,000
ヤマトインターナショナル	5,400	451.00	2,435,400
特種東海製紙	4,300	4,480.00	19,264,000
王子ホールディングス	311,000	680.00	211,480,000
日本製紙	33,100	2,189.00	72,455,900
三菱製紙	10,500	795.00	8,347,500
北越紀州製紙	41,300	719.00	29,694,700
中越パルプ工業	2,900	2,220.00	6,438,000
巴川製紙所	11,000	317.00	3,487,000
大王製紙	29,500	1,480.00	43,660,000
阿波製紙	1,800	711.00	1,279,800
レンゴー	71,300	745.00	53,118,500
トーモク	4,200	2,203.00	9,252,600
ザ・パック	5,200	3,870.00	20,124,000
クラレ	124,400	2,351.00	292,464,400
旭化成	461,100	1,506.50	694,647,150
共和レザー	4,400	960.00	4,224,000
昭和電工	49,200	3,925.00	193,110,000

住友化学	544,000	839.00	456,416,000
住友精化	3,100	6,950.00	21,545,000
日産化学工業	43,000	4,410.00	189,630,000
ラサ工業	2,600	2,289.00	5,951,400
クレハ	6,100	6,940.00	42,334,000
多木化学	1,000	5,200.00	5,200,000
テイカ	5,600	3,060.00	17,136,000
石原産業	13,300	1,676.00	22,290,800
片倉コープアグリ	1,800	1,389.00	2,500,200
日東エフシー	4,400	854.00	3,757,600
日本曹達	51,000	786.00	40,086,000
東ソー	106,900	2,631.00	281,253,900
トクヤマ	21,500	3,575.00	76,862,500
セントラル硝子	15,100	2,298.00	34,699,800
東亜合成	43,400	1,433.00	62,192,200
大阪ソーダ	6,500	2,961.00	19,246,500
関東電化工業	17,700	1,184.00	20,956,800
デンカ	27,200	3,930.00	106,896,000
信越化学工業	123,100	12,450.00	1,532,595,000
日本カーバイド工業	2,300	2,168.00	4,986,400
堺化学工業	5,100	2,680.00	13,668,000
エア・ウォーター	61,000	2,286.00	139,446,000
大陽日酸	56,900	1,453.00	82,675,700
日本化学工業	2,700	2,478.00	6,690,600
東邦アセチレン	1,100	1,646.00	1,810,600
日本パーカラライジング	37,800	1,812.00	68,493,600
高压ガス工業	11,000	903.00	9,933,000
チタン工業	800	2,823.00	2,258,400
四国化成工業	10,700	1,843.00	19,720,100
戸田工業	1,500	4,735.00	7,102,500
ステラ ケミファ	3,800	3,760.00	14,288,000
保土谷化学工業	2,400	6,710.00	16,104,000
日本触媒	11,600	8,380.00	97,208,000
大日精化工業	5,700	6,000.00	34,200,000
カネカ	100,000	965.00	96,500,000
三菱瓦斯化学	63,600	3,125.00	198,750,000
三井化学	67,200	3,540.00	237,888,000
J S R	74,300	2,273.00	168,883,900
東京応化工業	12,800	4,835.00	61,888,000
大阪有機化学工業	4,800	1,374.00	6,595,200
三菱ケミカルホールディングス	495,200	1,201.50	594,982,800
K Hネオケム	11,300	3,035.00	34,295,500
ダイセル	99,700	1,304.00	130,008,800



住友ベークライト	60,000	963.00	57,780,000
積水化学工業	153,600	2,271.00	348,825,600
日本ゼオン	62,300	1,559.00	97,125,700
アイカ工業	20,800	3,840.00	79,872,000
宇部興産	37,200	3,330.00	123,876,000
積水樹脂	11,400	2,448.00	27,907,200
タキロンシーアイ	15,000	831.00	12,465,000
旭有機材	4,300	1,798.00	7,731,400
日立化成	36,500	3,235.00	118,077,500
ニチバン	3,700	2,708.00	10,019,600
リケンテクノス	15,900	685.00	10,891,500
大倉工業	18,000	802.00	14,436,000
積水化成成品工業	9,300	1,423.00	13,233,900
群栄化学工業	1,800	3,795.00	6,831,000
タイガースポリマー	3,700	837.00	3,096,900
ミライアル	2,500	1,631.00	4,077,500
ダイキアクシス	2,500	1,258.00	3,145,000
ダイキョーニシカワ	14,600	1,880.00	27,448,000
竹本容器	900	1,977.00	1,779,300
日本化薬	48,000	1,731.00	83,088,000
カーリットホールディングス	6,900	851.00	5,871,900
日本精化	6,100	1,057.00	6,447,700
扶桑化学工業	5,300	3,365.00	17,834,500
A D E K A	31,800	1,866.00	59,338,800
日油	28,600	3,140.00	89,804,000
ハリマ化成グループ	5,800	900.00	5,220,000
花王	173,600	7,145.00	1,240,372,000
第一工業製薬	14,000	857.00	11,998,000
日華化学	2,400	1,208.00	2,899,200
ニイタカ	1,100	1,913.00	2,104,300
三洋化成工業	4,700	5,740.00	26,978,000
有機合成薬品工業	5,000	299.00	1,495,000
大日本塗料	8,500	1,770.00	15,045,000
日本ペイントホールディングス	57,000	4,065.00	231,705,000
関西ペイント	77,700	2,904.00	225,640,800
神東塗料	5,700	241.00	1,373,700
中国塗料	21,200	939.00	19,906,800
日本特殊塗料	4,700	2,259.00	10,617,300
藤倉化成	9,300	700.00	6,510,000
太陽ホールディングス	5,700	5,620.00	32,034,000
D I C	29,200	4,060.00	118,552,000
サカタインクス	15,100	2,114.00	31,921,400
東洋インキS Cホールディングス	73,000	673.00	49,129,000

T & K T O K A	5,000	1,304.00	6,520,000
富士フィルムホールディングス	146,600	4,551.00	667,176,600
資生堂	131,500	4,974.00	654,081,000
ライオン	98,300	1,953.00	191,979,900
高砂香料工業	4,400	3,615.00	15,906,000
マングラム	13,800	3,595.00	49,611,000
ミルボン	4,700	7,360.00	34,592,000
ファンケル	17,200	3,160.00	54,352,000
コーセー	12,000	16,020.00	192,240,000
コタ	3,100	1,491.00	4,622,100
シーズ・ホールディングス	9,600	4,230.00	40,608,000
シーボン	900	2,832.00	2,548,800
ポーラ・オルビスホールディングス	30,100	3,955.00	119,045,500
ノエビアホールディングス	4,700	7,690.00	36,143,000
アジュバンコスメジャパン	1,600	993.00	1,588,800
エステー	5,100	2,750.00	14,025,000
アグロ カネショウ	2,900	2,172.00	6,298,800
コニシ	11,600	2,029.00	23,536,400
長谷川香料	9,400	2,326.00	21,864,400
星光 P M C	4,100	1,230.00	5,043,000
小林製薬	19,800	7,040.00	139,392,000
荒川化学工業	6,300	2,485.00	15,655,500
メック	4,900	2,150.00	10,535,000
日本高純度化学	2,000	2,721.00	5,442,000
タカラバイオ	18,500	1,495.00	27,657,500
J C U	4,300	5,980.00	25,714,000
新田ゼラチン	4,900	773.00	3,787,700
O A T アグリオ	1,100	2,144.00	2,358,400
デクセリアルズ	18,100	1,421.00	25,720,100
アース製薬	5,300	5,410.00	28,673,000
北興化学工業	7,200	696.00	5,011,200
大成ラミック	2,200	3,095.00	6,809,000
クミアイ化学工業	32,100	750.00	24,075,000
日本農薬	18,400	644.00	11,849,600
アキレス	5,400	2,320.00	12,528,000
有沢製作所	11,800	1,152.00	13,593,600
日東電工	53,300	11,265.00	600,424,500
レック	4,200	2,576.00	10,819,200
きもと	12,200	278.00	3,391,600
藤森工業	5,900	3,705.00	21,859,500
前澤化成工業	4,800	1,230.00	5,904,000
J S P	4,100	3,580.00	14,678,000
エフピコ	5,800	5,990.00	34,742,000

天馬	5,500	2,404.00	13,222,000
信越ポリマー	14,500	1,162.00	16,849,000
東リ	17,700	415.00	7,345,500
ニフコ	13,000	7,660.00	99,580,000
日本バルカー工業	5,700	2,646.00	15,082,200
ユニ・チャーム	149,700	2,797.00	418,710,900
協和発酵キリン	88,400	2,103.00	185,905,200
武田薬品工業	260,000	6,412.00	1,667,120,000
アステラス製薬	725,400	1,495.00	1,084,473,000
大日本住友製薬	52,300	1,704.00	89,119,200
塩野義製薬	101,000	6,258.00	632,058,000
田辺三菱製薬	86,100	2,423.00	208,620,300
わかもと製薬	8,000	286.00	2,288,000
あすか製薬	8,000	1,966.00	15,728,000
日本新薬	18,500	7,960.00	147,260,000
バイオフェルミン製薬	1,200	3,070.00	3,684,000
中外製薬	73,600	5,480.00	403,328,000
科研製薬	12,700	5,800.00	73,660,000
エーザイ	84,500	6,386.00	539,617,000
ロート製薬	38,800	2,702.00	104,837,600
小野薬品工業	180,800	2,538.00	458,870,400
久光製薬	20,900	6,500.00	135,850,000
持田製薬	4,900	8,240.00	40,376,000
参天製薬	133,600	1,775.00	237,140,000
扶桑薬品工業	2,500	2,813.00	7,032,500
日本ケミファ	900	5,010.00	4,509,000
ツムラ	25,200	4,375.00	110,250,000
日医工	18,600	1,685.00	31,341,000
キッセイ薬品工業	13,100	3,265.00	42,771,500
生化学工業	13,700	1,638.00	22,440,600
栄研化学	5,700	4,545.00	25,906,500
日水製薬	3,000	1,485.00	4,455,000
鳥居薬品	4,400	3,115.00	13,706,000
JCRファーマ	5,000	4,365.00	21,825,000
東和薬品	3,400	5,900.00	20,060,000
富士製薬工業	2,400	4,240.00	10,176,000
沢井製薬	12,500	6,450.00	80,625,000
ゼリア新薬工業	15,100	2,158.00	32,585,800
第一三共	202,000	2,652.00	535,704,000
キョーリン製薬ホールディングス	19,700	2,182.00	42,985,400
大幸薬品	3,700	2,570.00	9,509,000
ダイト	4,400	2,921.00	12,852,400
大塚ホールディングス	146,700	4,715.00	691,690,500

大正製薬ホールディングス	15,800	8,670.00	136,986,000
ペプチドリーム	29,000	3,230.00	93,670,000
日本コークス工業	59,600	126.00	7,509,600
昭和シェル石油	66,100	1,475.00	97,497,500
ニチレキ	9,000	1,341.00	12,069,000
ユシロ化学工業	4,000	1,660.00	6,640,000
ビーピー・カストロール	3,000	2,043.00	6,129,000
富士石油	17,100	537.00	9,182,700
MORESCO	2,500	2,072.00	5,180,000
出光興産	59,300	3,565.00	211,404,500
JXTGホールディングス	1,126,500	638.00	718,707,000
コスモエネルギーホールディングス	20,400	3,270.00	66,708,000
横浜ゴム	40,900	2,378.00	97,260,200
東洋ゴム工業	41,800	2,396.00	100,152,800
ブリヂストン	249,500	5,000.00	1,247,500,000
住友ゴム工業	69,200	1,918.00	132,725,600
藤倉ゴム工業	6,200	960.00	5,952,000
オカモト	25,000	1,074.00	26,850,000
フコク	3,100	1,081.00	3,351,100
ニッタ	7,300	4,535.00	33,105,500
住友理工	13,700	1,168.00	16,001,600
三ツ星ベルト	17,000	1,448.00	24,616,000
バンドー化学	13,500	1,226.00	16,551,000
日東紡績	10,500	3,290.00	34,545,000
旭硝子	72,200	4,705.00	339,701,000
日本板硝子	33,700	996.00	33,565,200
石塚硝子	1,000	2,569.00	2,569,000
日本山村硝子	30,000	193.00	5,790,000
日本電気硝子	30,600	4,655.00	142,443,000
オハラ	2,800	2,136.00	5,980,800
住友大阪セメント	137,000	487.00	66,719,000
太平洋セメント	44,600	4,565.00	203,599,000
日本ヒューム	7,200	757.00	5,450,400
日本コンクリート工業	15,400	489.00	7,530,600
三谷セキサン	3,700	2,805.00	10,378,500
アジアパイルホールディングス	9,200	650.00	5,980,000
東海カーボン	64,200	1,140.00	73,188,000
日本カーボン	3,700	4,575.00	16,927,500
東洋炭素	4,600	3,120.00	14,352,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	5,070.00	21,294,000
TOTO	54,300	5,720.00	310,596,000
日本碍子	86,200	2,201.00	189,726,200
日本特殊陶業	60,600	2,590.00	156,954,000

MARUWA	2,500	7,160.00	17,900,000
品川リフラクトリーズ	1,900	3,385.00	6,431,500
黒崎播磨	1,400	4,375.00	6,125,000
ヨータイ	4,400	525.00	2,310,000
イソライト工業	3,700	1,170.00	4,329,000
東京窯業	9,200	406.00	3,735,200
ニッカトー	2,500	711.00	1,777,500
フジミインコーポレーテッド	6,300	2,601.00	16,386,300
ニチアス	39,000	1,344.00	52,416,000
ニチハ	10,700	4,030.00	43,121,000
新日鐵住金	312,400	2,731.50	853,320,600
神戸製鋼所	127,800	1,107.00	141,474,600
中山製鋼所	9,700	776.00	7,527,200
合同製鐵	3,800	2,157.00	8,196,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	188,500	2,554.50	481,523,250
日新製鋼	19,300	1,700.00	32,810,000
東京製鐵	37,400	994.00	37,175,600
共英製鋼	7,900	1,910.00	15,089,000
大和工業	14,800	3,200.00	47,360,000
東京鐵鋼	2,900	2,139.00	6,203,100
大阪製鐵	4,600	2,477.00	11,394,200
淀川製鋼所	10,200	3,375.00	34,425,000
東洋鋼鋳	17,700	480.00	8,496,000
丸一鋼管	24,700	3,165.00	78,175,500
モリ工業	2,300	3,470.00	7,981,000
大同特殊鋼	12,400	7,200.00	89,280,000
日本高周波鋼業	2,600	957.00	2,488,200
日本冶金工業	57,700	217.00	12,520,900
山陽特殊製鋼	8,100	3,005.00	24,340,500
愛知製鋼	3,900	4,650.00	18,135,000
日立金属	75,200	1,537.00	115,582,400
日本金属	1,800	2,823.00	5,081,400
大太平洋金属	4,300	3,150.00	13,545,000
新日本電工	41,800	454.00	18,977,200
栗本鐵工所	3,500	2,365.00	8,277,500
虹技	1,000	2,166.00	2,166,000
日本鑄鉄管	7,000	183.00	1,281,000
三菱製鋼	5,200	2,735.00	14,222,000
日亜鋼業	10,200	341.00	3,478,200
日本精線	1,100	5,390.00	5,929,000
シンニッタン	5,400	738.00	3,985,200
新家工業	1,600	2,207.00	3,531,200
大紀アルミニウム工業所	11,600	955.00	11,078,000

日本軽金属ホールディングス	204,300	329.00	67,214,700
三井金属鉱業	18,900	5,930.00	112,077,000
東邦亜鉛	3,900	6,410.00	24,999,000
三菱マテリアル	46,100	4,245.00	195,694,500
住友金属鉱山	89,300	4,688.00	418,638,400
D O W Aホールディングス	17,700	4,805.00	85,048,500
古河機械金属	11,600	2,326.00	26,981,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,300	1,817.00	13,264,100
東邦チタニウム	12,700	1,046.00	13,284,200
U A C J	10,600	3,140.00	33,284,000
古河電気工業	23,300	5,960.00	138,868,000
住友電気工業	261,100	1,931.50	504,314,650
フジクラ	84,400	970.00	81,868,000
昭和電線ホールディングス	8,800	1,102.00	9,697,600
東京特殊電線	900	2,887.00	2,598,300
タツタ電線	14,000	818.00	11,452,000
沖電線	800	3,635.00	2,908,000
カナレ電気	1,200	2,524.00	3,028,800
平河ヒューテック	3,600	1,251.00	4,503,600
リョービ	8,600	2,931.00	25,206,600
アーレスティ	8,700	893.00	7,769,100
アサヒホールディングス	11,200	2,393.00	26,801,600
稲葉製作所	3,900	1,440.00	5,616,000
宮地エンジニアリンググループ	2,000	2,673.00	5,346,000
トーカロ	4,900	5,070.00	24,843,000
アルファC o	2,500	2,227.00	5,567,500
S U M C O	64,300	2,841.00	182,676,300
川田テクノロジーズ	1,400	6,770.00	9,478,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,000	4,545.00	4,545,000
東洋製罐グループホールディングス	47,700	1,917.00	91,440,900
ホッカシホールディングス	18,000	447.00	8,046,000
コロナ	3,900	1,358.00	5,296,200
横河ブリッジホールディングス	13,000	2,406.00	31,278,000
駒井ハルテック	1,500	2,776.00	4,164,000
高田機工	600	3,355.00	2,013,000
三和ホールディングス	67,000	1,481.00	99,227,000
文化シャッター	20,600	1,019.00	20,991,400
三協立山	9,700	1,642.00	15,927,400
アルインコ	5,100	1,256.00	6,405,600
東洋シャッター	1,900	625.00	1,187,500
L I X I Lグループ	102,900	2,960.00	304,584,000
日本ファイルコン	5,400	800.00	4,320,000
ノーリツ	15,600	2,092.00	32,635,200

長府製作所	7,900	2,753.00	21,748,700
リンナイ	12,400	10,010.00	124,124,000
ダイニチ工業	3,800	844.00	3,207,200
日東精工	9,700	660.00	6,402,000
三洋工業	900	2,207.00	1,986,300
岡部	14,200	1,010.00	14,342,000
ジーテクト	7,700	2,246.00	17,294,200
東プレ	13,000	3,295.00	42,835,000
高周波熱錬	13,500	1,226.00	16,551,000
東京製綱	5,000	1,598.00	7,990,000
サンコール	3,900	701.00	2,733,900
モリテック スチール	4,100	650.00	2,665,000
パイオラックス	10,300	3,300.00	33,990,000
エイチワン	5,100	1,586.00	8,088,600
日本発條	69,500	1,256.00	87,292,000
中央発條	800	3,710.00	2,968,000
アドバネクス	1,100	3,300.00	3,630,000
立川ブラインド工業	3,100	1,295.00	4,014,500
三益半導体工業	6,200	2,139.00	13,261,800
日本ドライケミカル	900	2,427.00	2,184,300
日本製鋼所	22,900	3,250.00	74,425,000
三浦工業	30,300	2,865.00	86,809,500
タクマ	23,800	1,591.00	37,865,800
ツガミ	19,000	1,133.00	21,527,000
オークマ	8,200	7,130.00	58,466,000
東芝機械	40,000	765.00	30,600,000
アマダホールディングス	107,900	1,440.00	155,376,000
アイダエンジニアリング	18,000	1,328.00	23,904,000
滝澤鉄工所	2,200	2,166.00	4,765,200
富士機械製造	20,900	2,274.00	47,526,600
牧野フライス製作所	34,000	1,107.00	37,638,000
オーエスジー	31,700	2,475.00	78,457,500
ダイジェット工業	1,000	1,861.00	1,861,000
旭ダイヤモンド工業	21,000	1,202.00	25,242,000
D M G 森精機	38,800	2,468.00	95,758,400
ソディック	15,200	1,588.00	24,137,600
ディスコ	9,400	26,580.00	249,852,000
日東工器	4,300	2,935.00	12,620,500
日進工具	1,800	2,424.00	4,363,200
パンチ工業	2,900	2,135.00	6,191,500
富士ダイス	2,600	932.00	2,423,200
豊和工業	4,000	1,520.00	6,080,000
O K K	2,900	1,214.00	3,520,600

東洋機械金属	5,400	892.00	4,816,800
島精機製作所	8,900	7,310.00	65,059,000
NCホールディングス	2,200	885.00	1,947,000
フリー	5,000	1,062.00	5,310,000
ヤマシンフィルタ	1,900	4,915.00	9,338,500
日阪製作所	10,000	1,070.00	10,700,000
やまびこ	13,500	1,536.00	20,736,000
平田機工	1,900	14,220.00	27,018,000
ペガサスミシン製造	6,500	758.00	4,927,000
ナブテスコ	38,400	4,470.00	171,648,000
三井海洋開発	7,400	2,767.00	20,475,800
レオン自動機	6,200	1,690.00	10,478,000
S M C	22,100	46,880.00	1,036,048,000
新川	5,700	873.00	4,976,100
ホソカワミクロン	2,600	7,080.00	18,408,000
ユニオンツール	3,200	4,140.00	13,248,000
オイレス工業	9,000	2,246.00	20,214,000
日精エー・エス・ビー機械	2,400	5,260.00	12,624,000
サトーホールディングス	9,200	3,175.00	29,210,000
技研製作所	3,500	3,130.00	10,955,000
日本エアーテック	2,400	880.00	2,112,000
日精樹脂工業	6,000	1,526.00	9,156,000
オカダアイオン	2,100	1,967.00	4,130,700
ワイエイシイホールディングス	2,300	1,054.00	2,424,200
小松製作所	340,900	3,746.00	1,277,011,400
住友重機械工業	40,500	4,925.00	199,462,500
日立建機	33,100	3,890.00	128,759,000
日工	2,200	2,283.00	5,022,600
巴工業	3,000	2,162.00	6,486,000
井関農機	7,200	2,467.00	17,762,400
T O W A	5,500	2,263.00	12,446,500
丸山製作所	1,700	2,035.00	3,459,500
北川鉄工所	3,500	3,110.00	10,885,000
ローツェ	3,500	2,825.00	9,887,500
タカキタ	2,500	741.00	1,852,500
クボタ	380,900	1,987.50	757,038,750
荏原実業	2,200	1,845.00	4,059,000
三菱化工機	2,500	2,388.00	5,970,000
月島機械	14,200	1,351.00	19,184,200
帝国電機製作所	4,900	1,250.00	6,125,000
新東工業	16,900	1,368.00	23,119,200
澁谷工業	6,200	4,315.00	26,753,000
アイチ コーポレーション	12,500	828.00	10,350,000



小森コーポレーション	17,900	1,557.00	27,870,300
鶴見製作所	6,100	1,911.00	11,657,100
住友精密工業	12,000	398.00	4,776,000
酒井重工業	1,400	3,895.00	5,453,000
荏原製作所	29,100	4,060.00	118,146,000
石井鐵工所	1,200	1,771.00	2,125,200
西島製作所	7,400	1,173.00	8,680,200
北越工業	7,900	1,204.00	9,511,600
ダイキン工業	96,300	13,085.00	1,260,085,500
オルガノ	2,600	2,846.00	7,399,600
トーヨーカネツ	3,000	4,340.00	13,020,000
栗田工業	38,300	3,425.00	131,177,500
椿本チエイン	42,000	922.00	38,724,000
大同工業	2,800	1,739.00	4,869,200
木村化工機	6,500	437.00	2,840,500
アネスト岩田	11,900	1,154.00	13,732,600
ダイフク	35,300	5,860.00	206,858,000
サムコ	1,900	1,154.00	2,192,600
加藤製作所	3,400	3,745.00	12,733,000
油研工業	1,500	2,743.00	4,114,500
タダノ	34,200	1,809.00	61,867,800
フジテック	22,600	1,661.00	37,538,600
C K D	19,600	2,496.00	48,921,600
キトー	5,300	1,497.00	7,934,100
平和	21,900	2,173.00	47,588,700
理想科学工業	7,000	2,180.00	15,260,000
S A N K Y O	17,700	3,650.00	64,605,000
日本金銭機械	6,500	1,128.00	7,332,000
マースエンジニアリング	4,500	2,315.00	10,417,500
福島工業	4,400	4,485.00	19,734,000
オーイズミ	3,000	546.00	1,638,000
ダイコク電機	3,200	1,730.00	5,536,000
竹内製作所	11,800	2,433.00	28,709,400
アマノ	21,800	2,796.00	60,952,800
J U K I	10,500	2,134.00	22,407,000
サンデンホールディングス	8,600	2,210.00	19,006,000
蛇の目マシン工業	6,400	856.00	5,478,400
マックス	10,800	1,614.00	17,431,200
グローリー	21,100	4,125.00	87,037,500
新晃工業	7,200	2,090.00	15,048,000
大和冷機工業	11,300	1,330.00	15,029,000
セガサミーホールディングス	70,000	1,459.00	102,130,000
日本ピストンリング	2,600	2,287.00	5,946,200

リケン	3,300	6,060.00	19,998,000
T P R	7,900	3,995.00	31,560,500
ツバキ・ナカシマ	7,100	2,603.00	18,481,300
ホシザキ	22,200	10,540.00	233,988,000
大豊工業	5,700	1,762.00	10,043,400
日本精工	145,000	1,743.00	252,735,000
N T N	163,400	572.00	93,464,800
ジェイテクト	75,200	2,058.00	154,761,600
不二越	66,000	738.00	48,708,000
日本トムソン	22,500	687.00	15,457,500
T H K	44,000	4,380.00	192,720,000
ユーシン精機	3,100	3,085.00	9,563,500
前澤給装工業	2,800	1,864.00	5,219,200
イーグル工業	8,700	2,083.00	18,122,100
前澤工業	4,700	414.00	1,945,800
日本ピラー工業	7,100	1,657.00	11,764,700
キッツ	31,500	900.00	28,350,000
マキタ	92,000	4,805.00	442,060,000
日立造船	56,400	624.00	35,193,600
三菱重工業	118,300	4,342.00	513,658,600
I H I	54,300	3,565.00	193,579,500
スター精密	11,300	1,989.00	22,475,700
日清紡ホールディングス	43,100	1,338.00	57,667,800
イビデン	43,300	1,799.00	77,896,700
コニカミノルタ	165,300	1,066.00	176,209,800
ブラザー工業	86,200	3,020.00	260,324,000
ミネベアミツミ	131,100	2,374.00	311,231,400
日立製作所	1,695,000	883.40	1,497,363,000
三菱電機	705,800	1,903.00	1,343,137,400
富士電機	213,000	841.00	179,133,000
東洋電機製造	3,000	1,983.00	5,949,000
安川電機	81,800	4,585.00	375,053,000
シンフォニアテクノロジー	46,000	456.00	20,976,000
明電舎	60,000	456.00	27,360,000
オリジン電気	2,100	1,899.00	3,987,900
山洋電気	3,400	7,870.00	26,758,000
デンヨー	6,500	1,947.00	12,655,500
東芝テック	51,000	724.00	36,924,000
芝浦メカトロニクス	10,000	467.00	4,670,000
マブチモーター	19,700	6,150.00	121,155,000
日本電産	84,900	16,205.00	1,375,804,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,600	2,386.00	6,203,600
東光高岳	3,600	1,841.00	6,627,600

ダブル・スコープ	10,300	2,026.00	20,867,800
ダイヘン	39,000	1,088.00	42,432,000
ヤーマン	9,000	1,363.00	12,267,000
JVCケンウッド	52,000	370.00	19,240,000
ミマキエンジニアリング	6,400	933.00	5,971,200
第一精工	3,300	2,911.00	9,606,300
日新電機	16,500	1,435.00	23,677,500
大崎電気工業	15,100	831.00	12,548,100
オムロン	75,000	6,630.00	497,250,000
日東工業	11,300	1,923.00	21,729,900
I D E C	9,000	2,619.00	23,571,000
不二電機工業	800	1,387.00	1,109,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	127,000	572.00	72,644,000
サクサホールディングス	1,800	2,080.00	3,744,000
メルコホールディングス	3,400	3,520.00	11,968,000
テクノメディカ	1,600	1,990.00	3,184,000
日本電気	91,300	3,065.00	279,834,500
富士通	726,000	869.60	631,329,600
沖電気工業	28,700	1,589.00	45,604,300
岩崎通信機	3,100	835.00	2,588,500
電気興業	4,000	2,853.00	11,412,000
サンケン電気	41,000	698.00	28,618,000
ナカヨ	1,400	1,983.00	2,776,200
アイホン	4,000	1,929.00	7,716,000
ルネサスエレクトロニクス	36,600	1,488.00	54,460,800
セイコーエプソン	105,100	2,727.00	286,607,700
ワコム	54,900	677.00	37,167,300
アルバック	11,900	8,490.00	101,031,000
アクセル	3,100	788.00	2,442,800
E I Z O	6,500	5,020.00	32,630,000
ジャパンディスプレイ	145,000	214.00	31,030,000
日本信号	19,500	1,233.00	24,043,500
京三製作所	17,000	692.00	11,764,000
能美防災	9,400	2,166.00	20,360,400
ホーチキ	5,100	2,686.00	13,698,600
エレコム	6,100	2,533.00	15,451,300
パナソニック	806,300	1,748.50	1,409,815,550
アンリツ	51,500	1,064.00	54,796,000
富士通ゼネラル	21,600	2,220.00	47,952,000
日立国際電気	13,800	3,160.00	43,608,000
ソニー	471,100	5,252.00	2,474,217,200
T D K	36,900	8,840.00	326,196,000
帝国通信工業	3,200	1,176.00	3,763,200

タムラ製作所	27,200	809.00	22,004,800
アルプス電気	60,800	3,670.00	223,136,000
池上通信機	22,000	168.00	3,696,000
パイオニア	117,600	231.00	27,165,600
日本電波工業	6,500	797.00	5,180,500
鈴木	2,800	1,088.00	3,046,400
日本トリム	1,500	4,880.00	7,320,000
ローランド ディー . ジー .	3,600	3,145.00	11,322,000
フォスター電機	8,300	2,814.00	23,356,200
クラリオン	37,000	454.00	16,798,000
S M K	18,000	528.00	9,504,000
ヨコオ	4,600	1,431.00	6,582,600
ホシデン	17,900	1,773.00	31,736,700
ヒロセ電機	11,400	17,160.00	195,624,000
日本航空電子工業	18,000	2,187.00	39,366,000
T O A	7,600	1,331.00	10,115,600
マクセルホールディングス	14,100	2,544.00	35,870,400
古野電気	8,500	751.00	6,383,500
ユニデンホールディングス	19,000	343.00	6,517,000
アルパイン	16,800	2,645.00	44,436,000
スミダコーポレーション	7,300	2,037.00	14,870,100
アイコム	3,900	2,585.00	10,081,500
リオン	3,000	2,129.00	6,387,000
本多通信工業	2,800	2,414.00	6,759,200
船井電機	7,100	867.00	6,155,700
横河電機	70,600	2,138.00	150,942,800
新電元工業	2,500	8,020.00	20,050,000
アズビル	21,200	5,040.00	106,848,000
東亜ディーケーケー	3,600	865.00	3,114,000
日本光電工業	29,500	2,458.00	72,511,000
チノー	2,400	1,345.00	3,228,000
共和電業	8,000	456.00	3,648,000
日本電子材料	2,800	582.00	1,629,600
堀場製作所	14,000	7,550.00	105,700,000
アドバンテスト	39,400	2,493.00	98,224,200
小野測器	3,100	745.00	2,309,500
エスベック	6,300	2,606.00	16,417,800
キーエンス	34,600	67,820.00	2,346,572,000
日置電機	3,700	2,498.00	9,242,600
シスメックス	54,900	8,090.00	444,141,000
日本マイクロニクス	12,400	1,206.00	14,954,400
メガチップス	5,600	3,430.00	19,208,000
O B A R A G R O U P	4,100	8,050.00	33,005,000

澤藤電機	800	2,750.00	2,200,000
コーセル	9,800	1,607.00	15,748,600
イリソ電子工業	5,900	6,810.00	40,179,000
新日本無線	4,300	921.00	3,960,300
オブテックスグループ	5,800	4,650.00	26,970,000
千代田インテグレ	3,400	2,694.00	9,159,600
アイ・オー・データ機器	3,000	1,064.00	3,192,000
レーザーテック	15,500	2,638.00	40,889,000
スタンレー電気	54,100	4,330.00	234,253,000
岩崎電気	2,800	1,755.00	4,914,000
ウシオ電機	42,900	1,670.00	71,643,000
岡谷電機産業	3,900	511.00	1,992,900
ヘリオス テクノ ホールディング	6,100	1,163.00	7,094,300
日本セラミック	7,200	3,215.00	23,148,000
遠藤照明	3,600	1,311.00	4,719,600
古河電池	5,100	1,165.00	5,941,500
双信電機	3,200	763.00	2,441,600
山一電機	5,100	2,474.00	12,617,400
図研	4,600	1,956.00	8,997,600
日本電子	26,000	619.00	16,094,000
カシオ計算機	56,800	1,646.00	93,492,800
ファナック	67,100	27,800.00	1,865,380,000
日本シイエムケイ	12,500	1,100.00	13,750,000
エンプラス	3,200	4,795.00	15,344,000
大真空	2,600	1,910.00	4,966,000
ローム	31,700	11,780.00	373,426,000
浜松ホトニクス	51,400	3,775.00	194,035,000
三井ハイテック	9,300	2,414.00	22,450,200
新光電気工業	26,800	877.00	23,503,600
京セラ	115,900	7,959.00	922,448,100
太陽誘電	31,700	2,005.00	63,558,500
村田製作所	74,100	16,505.00	1,223,020,500
ユーシン	10,500	778.00	8,169,000
双葉電子工業	11,600	2,479.00	28,756,400
北陸電気工業	2,900	1,575.00	4,567,500
ニチコン	22,300	1,572.00	35,055,600
日本ケミコン	5,700	4,490.00	25,593,000
K O A	9,800	2,442.00	23,931,600
市光工業	10,600	973.00	10,313,800
小糸製作所	42,300	7,760.00	328,248,000
ミツバ	13,000	1,572.00	20,436,000
S C R E E Nホールディングス	13,400	10,900.00	146,060,000
キャノン電子	6,500	2,636.00	17,134,000

キヤノン	380,000	4,425.00	1,681,500,000
リコー	212,200	1,016.00	215,595,200
MUTOHホールディングス	1,000	2,565.00	2,565,000
東京エレクトロン	47,100	22,610.00	1,064,931,000
トヨタ紡織	20,600	2,182.00	44,949,200
芦森工業	1,500	3,265.00	4,897,500
ユニプレス	13,600	3,010.00	40,936,000
豊田自動織機	57,100	6,900.00	393,990,000
モリタホールディングス	11,300	1,987.00	22,453,100
三櫻工業	8,900	997.00	8,873,300
デンソー	156,600	6,547.00	1,025,260,200
東海理化電機製作所	18,600	2,321.00	43,170,600
三井造船	25,800	1,689.00	43,576,200
川崎重工業	55,000	3,930.00	216,150,000
名村造船所	21,200	719.00	15,242,800
サノヤスホールディングス	8,600	294.00	2,528,400
三菱ロジスネクスト	8,900	987.00	8,784,300
近畿車輛	1,100	2,746.00	3,020,600
日産自動車	832,900	1,093.00	910,359,700
いすゞ自動車	204,800	1,741.50	356,659,200
トヨタ自動車	858,100	7,108.00	6,099,374,800
日野自動車	101,100	1,381.00	139,619,100
三菱自動車工業	261,800	852.00	223,053,600
エフテック	4,500	1,826.00	8,217,000
レシップホールディングス	2,500	924.00	2,310,000
GMB	1,100	2,139.00	2,352,900
ファルテック	1,200	1,418.00	1,701,600
武蔵精密工業	7,500	3,500.00	26,250,000
日産車体	28,000	1,153.00	32,284,000
新明和工業	31,100	1,093.00	33,992,300
極東開発工業	13,400	1,998.00	26,773,200
日信工業	14,300	2,223.00	31,788,900
トビー工業	5,800	3,400.00	19,720,000
ティラド	2,600	3,855.00	10,023,000
曙ブレーキ工業	32,800	360.00	11,808,000
タチエス	12,000	2,265.00	27,180,000
NOK	37,900	2,863.00	108,507,700
フタバ産業	21,600	1,078.00	23,284,800
KYB	7,300	6,750.00	49,275,000
大同メタル工業	8,900	1,034.00	9,202,600
プレス工業	37,500	690.00	25,875,000
ミクニ	9,000	652.00	5,868,000
太平洋工業	14,600	1,490.00	21,754,000

ケーヒン	16,200	2,288.00	37,065,600
河西工業	8,700	1,778.00	15,468,600
アイシン精機	58,100	5,710.00	331,751,000
富士機工	7,200	738.00	5,313,600
マツダ	221,800	1,558.00	345,564,400
今仙電機製作所	6,500	1,398.00	9,087,000
本田技研工業	635,300	3,768.00	2,393,810,400
スズキ	140,000	6,116.00	856,240,000
S U B A R U	219,300	3,661.00	802,857,300
安永	3,400	2,923.00	9,938,200
ヤマハ発動機	99,800	3,400.00	339,320,000
ショーワ	18,300	1,421.00	26,004,300
T B K	8,400	541.00	4,544,400
エクセディ	8,500	3,395.00	28,857,500
豊田合成	25,600	2,752.00	70,451,200
愛三工業	12,400	1,311.00	16,256,400
盟和産業	1,100	1,320.00	1,452,000
ヨロズ	7,100	2,351.00	16,692,100
エフ・シー・シー	11,500	2,760.00	31,740,000
シマノ	28,400	15,100.00	428,840,000
テイ・エス テック	16,400	4,455.00	73,062,000
ジャムコ	3,500	2,860.00	10,010,000
テルモ	108,200	4,925.00	532,885,000
クリエートメディック	2,400	1,124.00	2,697,600
日機装	24,400	1,066.00	26,010,400
島津製作所	84,400	2,613.00	220,537,200
J M S	6,500	643.00	4,179,500
長野計器	5,600	1,438.00	8,052,800
ブイ・テクノロジー	1,700	19,210.00	32,657,000
東京計器	4,500	1,531.00	6,889,500
愛知時計電機	900	4,400.00	3,960,000
インターアクション	2,700	811.00	2,189,700
オーバル	7,000	295.00	2,065,000
東京精密	12,800	4,685.00	59,968,000
マニー	8,600	3,185.00	27,391,000
ニコン	123,000	2,349.00	288,927,000
トプコン	37,900	2,487.00	94,257,300
オリンパス	105,100	4,335.00	455,608,500
理研計器	6,800	2,414.00	16,415,200
タムロン	5,700	2,495.00	14,221,500
H O Y A	145,200	6,312.00	916,502,400
シード	800	3,525.00	2,820,000
ノーリツ鋼機	7,200	2,060.00	14,832,000

エー・アンド・デイ	6,500	640.00	4,160,000
シチズン時計	84,300	818.00	68,957,400
リズム時計工業	2,700	2,292.00	6,188,400
大研医器	6,300	773.00	4,869,900
メニコン	4,800	5,160.00	24,768,000
松風	3,500	1,411.00	4,938,500
セイコーホールディングス	10,900	2,755.00	30,029,500
ニプロ	48,900	1,573.00	76,919,700
中本パックス	700	3,565.00	2,495,500
スノーピーク	1,100	2,942.00	3,236,200
パラマウントベッドホールディングス	7,400	5,240.00	38,776,000
トランザクション	3,200	1,115.00	3,568,000
S H O - B I	2,400	450.00	1,080,000
ニホンフラッシュ	3,300	2,054.00	6,778,200
前田工織	7,100	2,070.00	14,697,000
永大産業	9,000	553.00	4,977,000
アートネイチャー	7,500	809.00	6,067,500
ダンロップスポーツ	4,400	1,510.00	6,644,000
バンダイナムコホールディングス	73,000	4,015.00	293,095,000
アイフィスジャパン	1,600	588.00	940,800
共立印刷	11,700	350.00	4,095,000
S H O E I	3,200	3,970.00	12,704,000
フランスベッドホールディングス	8,400	1,091.00	9,164,400
パイロットコーポレーション	12,300	5,650.00	69,495,000
萩原工業	3,900	1,870.00	7,293,000
トッパン・フォームズ	15,100	1,232.00	18,603,200
フジシールインターナショナル	15,800	3,790.00	59,882,000
タカラトミー	29,500	1,652.00	48,734,000
廣済堂	6,600	449.00	2,963,400
A s - m e エステール	2,100	835.00	1,753,500
アーク	29,700	113.00	3,356,100
タカノ	3,100	1,214.00	3,763,400
プロネクサス	6,600	1,362.00	8,989,200
ホクシン	5,000	214.00	1,070,000
ウッドワン	2,400	1,682.00	4,036,800
大建工業	5,500	2,953.00	16,241,500
凸版印刷	199,000	1,105.00	219,895,000
大日本印刷	92,400	2,541.00	234,788,400
図書印刷	4,700	1,123.00	5,278,100
共同印刷	2,200	3,685.00	8,107,000
N I S S H A	14,000	4,070.00	56,980,000
光村印刷	600	2,344.00	1,406,400
宝印刷	3,700	1,751.00	6,478,700



アシックス	70,100	1,600.00	112,160,000
ツツミ	2,200	2,027.00	4,459,400
小松ウオール工業	2,400	2,269.00	5,445,600
ヤマハ	47,500	4,010.00	190,475,000
河合楽器製作所	2,400	2,418.00	5,803,200
クリナップ	6,600	894.00	5,900,400
ビジョン	42,700	4,095.00	174,856,500
兼松サステック	500	2,241.00	1,120,500
キングジム	5,900	1,028.00	6,065,200
リンテック	16,800	2,960.00	49,728,000
イトーキ	14,900	842.00	12,545,800
任天堂	43,500	43,300.00	1,883,550,000
三菱鉛筆	11,600	2,636.00	30,577,600
タカラスタンダード	14,600	1,876.00	27,389,600
コクヨ	33,900	2,111.00	71,562,900
ナカバヤシ	6,900	726.00	5,009,400
グローブライド	3,200	2,060.00	6,592,000
岡村製作所	24,600	1,451.00	35,694,600
美津濃	7,000	3,325.00	23,275,000
東京電力ホールディングス	563,500	459.00	258,646,500
中部電力	215,900	1,505.00	324,929,500
関西電力	288,000	1,524.50	439,056,000
中国電力	97,600	1,308.00	127,660,800
北陸電力	69,100	1,012.00	69,929,200
東北電力	165,300	1,514.00	250,264,200
四国電力	63,600	1,508.00	95,908,800
九州電力	155,900	1,285.00	200,331,500
北海道電力	70,800	869.00	61,525,200
沖縄電力	11,400	2,980.00	33,972,000
電源開発	56,200	3,240.00	182,088,000
エフオン	3,500	1,473.00	5,155,500
イーレックス	11,100	1,090.00	12,099,000
東京瓦斯	150,600	2,826.00	425,595,600
大阪瓦斯	137,000	2,231.00	305,647,000
東邦瓦斯	35,000	3,295.00	115,325,000
北海道瓦斯	19,000	294.00	5,586,000
広島ガス	14,500	366.00	5,307,000
西部瓦斯	8,600	2,787.00	23,968,200
静岡ガス	20,000	973.00	19,460,000
メタウォーター	4,000	2,836.00	11,344,000
SBSホールディングス	7,000	824.00	5,768,000
東武鉄道	75,400	3,390.00	255,606,000
相鉄ホールディングス	22,600	2,924.00	66,082,400

東京急行電鉄	191,700	1,738.00	333,174,600
京浜急行電鉄	96,700	2,221.00	214,770,700
小田急電鉄	105,000	2,270.00	238,350,000
京王電鉄	39,400	4,805.00	189,317,000
京成電鉄	49,100	3,400.00	166,940,000
富士急行	9,600	3,045.00	29,232,000
新京成電鉄	1,800	2,175.00	3,915,000
東日本旅客鉄道	126,800	11,265.00	1,428,402,000
西日本旅客鉄道	63,700	8,231.00	524,314,700
東海旅客鉄道	63,200	20,695.00	1,307,924,000
西武ホールディングス	90,000	2,057.00	185,130,000
鴻池運輸	10,000	1,779.00	17,790,000
西日本鉄道	19,600	2,919.00	57,212,400
ハマキョウレックス	5,000	3,230.00	16,150,000
サカイ引越センター	3,700	6,240.00	23,088,000
近鉄グループホールディングス	66,900	4,305.00	288,004,500
阪急阪神ホールディングス	89,200	4,395.00	392,034,000
南海電気鉄道	31,700	2,785.00	88,284,500
京阪ホールディングス	29,800	3,355.00	99,979,000
神戸電鉄	1,600	3,810.00	6,096,000
名古屋鉄道	51,400	2,632.00	135,284,800
山陽電気鉄道	5,100	2,893.00	14,754,300
日本通運	26,200	7,090.00	185,758,000
ヤマトホールディングス	117,200	2,251.50	263,875,800
山九	17,100	4,575.00	78,232,500
丸運	3,800	330.00	1,254,000
丸全昭和運輸	24,000	530.00	12,720,000
センコーグループホールディングス	40,200	780.00	31,356,000
トナミホールディングス	1,600	5,320.00	8,512,000
ニッコンホールディングス	25,400	2,915.00	74,041,000
日本石油輸送	800	3,550.00	2,840,000
福山通運	9,800	3,860.00	37,828,000
セイノーホールディングス	50,100	1,654.00	82,865,400
神奈川中央交通	1,700	3,760.00	6,392,000
日立物流	14,700	2,728.00	40,101,600
丸和運輸機関	3,500	2,319.00	8,116,500
C & F ロジホールディングス	7,300	1,502.00	10,964,600
九州旅客鉄道	56,100	3,610.00	202,521,000
日本郵船	56,100	2,838.00	159,211,800
商船三井	42,400	3,755.00	159,212,000
川崎汽船	31,100	2,910.00	90,501,000
N S ユナイテッド海運	3,400	2,813.00	9,564,200
飯野海運	35,000	646.00	22,610,000

共栄タンカー	800	2,226.00	1,780,800
乾汽船	5,100	841.00	4,289,100
日本航空	124,000	4,052.00	502,448,000
A N Aホールディングス	131,000	4,332.00	567,492,000
パスコ	6,000	337.00	2,022,000
ランコム	1,900	6,840.00	12,996,000
日新	5,800	3,165.00	18,357,000
三菱倉庫	23,100	3,090.00	71,379,000
三井倉庫ホールディングス	38,000	343.00	13,034,000
住友倉庫	46,000	798.00	36,708,000
澁澤倉庫	3,700	2,044.00	7,562,800
東陽倉庫	12,100	328.00	3,968,800
日本トランスシティ	16,000	490.00	7,840,000
ケイヒン	1,300	1,653.00	2,148,900
中央倉庫	4,100	1,255.00	5,145,500
川西倉庫	1,400	2,791.00	3,907,400
安田倉庫	6,000	902.00	5,412,000
東洋埠頭	2,000	1,872.00	3,744,000
宇徳	5,700	505.00	2,878,500
上組	42,100	2,711.00	114,133,100
サンリツ	1,700	791.00	1,344,700
キムラユニティー	1,800	1,174.00	2,113,200
キューソー流通システム	1,900	3,130.00	5,947,000
郵船ロジスティクス	6,600	1,498.00	9,886,800
近鉄エクスプレス	12,600	2,391.00	30,126,600
東海運	3,800	418.00	1,588,400
エーアイティー	4,800	1,353.00	6,494,400
内外トランスライン	2,300	1,727.00	3,972,100
日本コンセプト	1,300	1,269.00	1,649,700
N E C ネットエスアイ	7,700	2,981.00	22,953,700
システナ	5,600	3,715.00	20,804,000
デジタルアーツ	3,400	4,650.00	15,810,000
新日鉄住金ソリューションズ	10,900	2,739.00	29,855,100
キューブシステム	4,200	837.00	3,515,400
コア	3,000	1,630.00	4,890,000
ソフトクリエイトホールディングス	3,400	1,567.00	5,327,800
T I S	23,100	3,665.00	84,661,500
ネオス	2,200	441.00	970,200
電算システム	2,500	2,064.00	5,160,000
グリー	42,600	746.00	31,779,600
コーエーテクモホールディングス	11,900	2,365.00	28,143,500
三菱総合研究所	3,000	3,500.00	10,500,000
ボルテージ	1,400	1,044.00	1,461,600

電算	800	2,478.00	1,982,400
A G S	4,000	964.00	3,856,000
ファインデックス	5,900	808.00	4,767,200
ヒト・コミュニケーションズ	1,600	2,031.00	3,249,600
ブレインパッド	1,600	1,252.00	2,003,200
K L a b	13,400	1,768.00	23,691,200
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	5,100	1,748.00	8,914,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,200	1,141.00	1,369,200
ネクソン	77,400	3,165.00	244,971,000
アイスタイル	16,000	782.00	12,512,000
エムアップ	2,400	1,339.00	3,213,600
エイチーム	4,800	2,843.00	13,646,400
テクノスジャパン	6,400	1,002.00	6,412,800
コロプラ	22,400	1,111.00	24,886,400
モバイルクリエイト	5,900	369.00	2,177,100
ブロードリーフ	17,300	908.00	15,708,400
ハーツユナイテッドグループ	3,700	1,649.00	6,101,300
メディアドゥホールディングス	2,300	2,570.00	5,911,000
ブイキューブ	4,200	560.00	2,352,000
サイバーリンクス	1,100	1,398.00	1,537,800
フィックスターズ	1,200	4,070.00	4,884,000
VOYAGE GROUP	3,600	1,389.00	5,000,400
オブティム	1,200	2,602.00	3,122,400
セレス	2,200	1,276.00	2,807,200
ベリサーブ	900	3,625.00	3,262,500
ティーガイア	7,000	2,323.00	16,261,000
セック	700	2,472.00	1,730,400
日本アジアグループ	7,300	499.00	3,642,700
豆蔵ホールディングス	5,200	1,231.00	6,401,200
テクマトリックス	3,900	1,544.00	6,021,600
プロシップ	1,000	2,255.00	2,255,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	188,100	306.00	57,558,600
GMOペイメントゲートウェイ	4,900	8,710.00	42,679,000
ザップラス	3,900	419.00	1,634,100
システムリサーチ	700	2,244.00	1,570,800
インターネットイニシアティブ	11,300	2,142.00	24,204,600
さくらインターネット	8,400	850.00	7,140,000
GMOクラウド	1,600	2,624.00	4,198,400
SRAホールディングス	3,700	3,395.00	12,561,500
Minor iソリューションズ	1,400	1,359.00	1,902,600
朝日ネット	6,500	531.00	3,451,500
アドソル日進	2,700	1,258.00	3,396,600
フリービット	5,300	912.00	4,833,600

コムチュア	3,600	2,370.00	8,532,000
サイバーコム	1,300	1,030.00	1,339,000
メディカル・データ・ビジョン	2,700	2,110.00	5,697,000
g u m i	8,000	1,108.00	8,864,000
ショーケース・ティービー	1,400	1,606.00	2,248,400
モバイルファクトリー	1,400	1,375.00	1,925,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	2,044.00	2,248,400
P C Iホールディングス	1,200	3,360.00	4,032,000
パイブドHD	1,200	1,144.00	1,372,800
アイピーシー	800	965.00	772,000
オープンドア	900	5,040.00	4,536,000
アカツキ	1,400	8,850.00	12,390,000
L I N E	19,500	4,830.00	94,185,000
シンクロ・フード	600	1,666.00	999,600
オークネット	2,300	1,448.00	3,330,400
A O I T Y O H o l d i n g s	5,800	1,210.00	7,018,000
マクロミル	9,000	3,020.00	27,180,000
ソルクシーズ	2,800	834.00	2,335,200
フェイス	2,500	1,315.00	3,287,500
ハイマックス	1,000	1,672.00	1,672,000
野村総合研究所	46,300	5,030.00	232,889,000
サイバネットシステム	5,800	745.00	4,321,000
C Eホールディングス	2,100	744.00	1,562,400
日本システム技術	900	1,374.00	1,236,600
インテージホールディングス	8,000	1,436.00	11,488,000
東邦システムサイエンス	2,400	787.00	1,888,800
ソースネクスト	5,000	788.00	3,940,000
フォーカスシステムズ	4,000	982.00	3,928,000
クレスコ	1,600	5,360.00	8,576,000
フジ・メディア・ホールディングス	72,600	1,698.00	123,274,800
オービック	21,800	7,650.00	166,770,000
ジャストシステム	11,300	2,132.00	24,091,600
T D Cソフト	3,100	1,139.00	3,530,900
ヤフー	499,600	511.00	255,295,600
トレンドマイクロ	33,800	6,060.00	204,828,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,300	1,237.00	2,845,100
日本オラクル	11,200	9,720.00	108,864,000
アルファシステムズ	2,300	2,528.00	5,814,400
フューチャー	9,500	1,151.00	10,934,500
C A C H o l d i n g s	5,300	1,135.00	6,015,500
ソフトバンク・テクノロジー	2,900	1,985.00	5,756,500
トーセ	1,900	3,060.00	5,814,000
オービックビジネスコンサルタント	3,600	5,780.00	20,808,000

伊藤忠テクノソリューションズ	15,800	4,710.00	74,418,000
アイティフォー	8,600	670.00	5,762,000
東計電算	1,300	3,350.00	4,355,000
エクスネット	1,200	913.00	1,095,600
大塚商会	20,800	8,300.00	172,640,000
サイボウズ	9,500	509.00	4,835,500
ソフトブレーン	5,700	416.00	2,371,200
電通国際情報サービス	4,300	2,298.00	9,881,400
デジタルガレージ	12,500	2,353.00	29,412,500
E Mシステムズ	2,400	2,181.00	5,234,400
ウェザーニューズ	2,400	3,725.00	8,940,000
C I J	6,000	713.00	4,278,000
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,765.00	1,412,000
日本エンタープライズ	7,500	259.00	1,942,500
WOWOW	3,400	3,435.00	11,679,000
スカラ	5,000	770.00	3,850,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,000	833.00	4,998,000
ネットワンシステムズ	28,300	1,541.00	43,610,300
システムソフト	17,200	143.00	2,459,600
アルゴグラフィックス	3,200	3,440.00	11,008,000
マーベラス	11,800	1,062.00	12,531,600
エイベックス	12,900	1,462.00	18,859,800
日本ユニシス	19,300	2,125.00	41,012,500
兼松エレクトロニクス	4,400	3,440.00	15,136,000
東京放送ホールディングス	41,800	2,475.00	103,455,000
日本テレビホールディングス	63,600	2,112.00	134,323,200
朝日放送	7,000	918.00	6,426,000
テレビ朝日ホールディングス	19,100	2,441.00	46,623,100
スカパー J S A Tホールディングス	53,100	498.00	26,443,800
テレビ東京ホールディングス	5,700	2,451.00	13,970,700
日本BS放送	2,400	1,269.00	3,045,600
ビジョン	1,800	2,589.00	4,660,200
ワイヤレスゲート	3,300	1,237.00	4,082,100
コネクシオ	5,000	2,113.00	10,565,000
クロップス	1,600	1,040.00	1,664,000
日本電信電話	497,100	5,752.00	2,859,319,200
K D D I	623,700	3,090.00	1,927,233,000
光通信	8,400	15,130.00	127,092,000
N T T ドコモ	512,800	2,835.00	1,453,788,000
エムティーアイ	9,500	680.00	6,460,000
G M O インターネット	25,500	1,899.00	48,424,500
アイドママーケティングコミュニケーション	1,300	681.00	885,300
カドカワ	20,300	1,411.00	28,643,300

学研ホールディングス	2,400	3,270.00	7,848,000
ゼンリン	8,400	3,695.00	31,038,000
昭文社	3,300	752.00	2,481,600
インプレスホールディングス	5,700	157.00	894,900
アイネット	4,000	1,760.00	7,040,000
松竹	4,600	18,260.00	83,996,000
東宝	45,600	3,720.00	169,632,000
東映	2,600	12,140.00	31,564,000
エヌ・ティ・ティ・データ	215,200	1,307.00	281,266,400
ピー・シー・エー	1,100	1,774.00	1,951,400
ビジネスブレイン太田昭和	1,300	1,590.00	2,067,000
D T S	7,200	3,875.00	27,900,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,200	5,200.00	167,440,000
シーイーシー	4,200	2,627.00	11,033,400
カプコン	14,900	3,210.00	47,829,000
アイ・エス・ビー	1,400	1,340.00	1,876,000
ジャステック	4,100	1,352.00	5,543,200
S C S K	16,600	5,140.00	85,324,000
日本システムウエア	2,300	2,517.00	5,789,100
アイネス	8,900	1,068.00	9,505,200
T K C	6,500	4,005.00	26,032,500
富士ソフト	9,600	3,400.00	32,640,000
N S D	11,400	2,365.00	26,961,000
コナミホールディングス	28,300	5,890.00	166,687,000
福井コンピュータホールディングス	2,100	3,190.00	6,699,000
J B C Cホールディングス	5,600	1,010.00	5,656,000
ミロク情報サービス	6,100	2,830.00	17,263,000
ソフトバンクグループ	313,600	9,705.00	3,043,488,000
ハウスイ	600	1,235.00	741,000
高千穂交易	2,700	1,233.00	3,329,100
伊藤忠食品	1,700	5,530.00	9,401,000
エレマテック	3,300	2,758.00	9,101,400
J A L U X	2,000	2,886.00	5,772,000
あらた	3,400	5,360.00	18,224,000
トーメンデバイス	1,000	3,270.00	3,270,000
東京エレクトロン デバイス	2,500	2,075.00	5,187,500
フィールズ	5,300	1,166.00	6,179,800
双日	411,400	327.00	134,527,800
アルフレッサ ホールディングス	77,300	2,365.00	182,814,500
横浜冷凍	16,400	1,079.00	17,695,600
神栄	1,000	1,604.00	1,604,000
山下医科器械	600	1,721.00	1,032,600
ラサ商事	3,000	1,096.00	3,288,000

ラクーン	4,500	636.00	2,862,000
アルコニックス	7,400	2,288.00	16,931,200
神戸物産	4,500	4,835.00	21,757,500
ペッパーフードサービス	3,700	7,200.00	26,640,000
あい ホールディングス	9,900	2,843.00	28,145,700
ディーブイエックス	2,500	1,340.00	3,350,000
ダイワボウホールディングス	5,900	4,445.00	26,225,500
マクニカ・富士エレホールディングス	12,900	2,227.00	28,728,300
ラクト・ジャパン	1,000	3,950.00	3,950,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	13,100	942.00	12,340,200
八洲電機	5,400	1,010.00	5,454,000
メディアスホールディングス	1,100	2,742.00	3,016,200
U K Cホールディングス	4,500	1,982.00	8,919,000
ジューテックホールディングス	1,600	1,418.00	2,268,800
大光	1,600	1,056.00	1,689,600
O C H Iホールディングス	2,000	1,430.00	2,860,000
T O K A Iホールディングス	36,800	871.00	32,052,800
大阪工機	1,100	1,124.00	1,236,400
三洋貿易	3,800	2,606.00	9,902,800
ビューティガレージ	900	1,834.00	1,650,600
ウイン・パートナーズ	5,000	1,289.00	6,445,000
ミタチ産業	1,600	1,472.00	2,355,200
シップヘルスケアホールディングス	14,500	3,510.00	50,895,000
明治電機工業	2,400	1,814.00	4,353,600
デリカフーズホールディングス	1,400	1,492.00	2,088,800
スターティア	1,600	706.00	1,129,600
コメダホールディングス	12,800	1,918.00	24,550,400
富士興産	2,700	598.00	1,614,600
協栄産業	800	2,370.00	1,896,000
小野建	6,100	2,061.00	12,572,100
佐島電機	5,100	1,065.00	5,431,500
エコートレーディング	1,600	705.00	1,128,000
伯東	4,200	1,791.00	7,522,200
コンドーテック	5,500	1,143.00	6,286,500
中山福	4,000	769.00	3,076,000
ナガイレーベン	9,200	2,761.00	25,401,200
三菱食品	7,600	3,370.00	25,612,000
松田産業	5,100	1,724.00	8,792,400
第一興商	10,400	5,290.00	55,016,000
メディバルホールディングス	69,700	2,224.00	155,012,800
S P K	1,500	3,215.00	4,822,500
萩原電気	2,400	3,645.00	8,748,000
アズワン	5,400	6,220.00	33,588,000



スズデン	2,400	1,542.00	3,700,800
尾家産業	2,000	1,267.00	2,534,000
シモジマ	4,300	1,172.00	5,039,600
ドウシシャ	7,400	2,362.00	17,478,800
小津産業	1,500	2,200.00	3,300,000
高速	4,200	1,291.00	5,422,200
たけびし	2,400	1,662.00	3,988,800
黒田電気	8,800	2,707.00	23,821,600
リックス	1,600	1,913.00	3,060,800
丸文	6,200	970.00	6,014,000
ハビネット	4,800	1,993.00	9,566,400
橋本総業ホールディングス	1,400	1,711.00	2,395,400
日本ライフライン	9,900	5,160.00	51,084,000
エクセル	2,800	2,696.00	7,548,800
マルカキカイ	2,300	2,245.00	5,163,500
I D O M	21,100	816.00	17,217,600
日本エム・ディ・エム	4,700	907.00	4,262,900
進和	4,100	2,642.00	10,832,200
エスケイジャパン	1,700	332.00	564,400
ダイトロン	3,200	2,213.00	7,081,600
シークス	4,400	4,775.00	21,010,000
田中商事	2,200	792.00	1,742,400
オーハシテクニカ	3,900	1,704.00	6,645,600
白銅	2,500	2,433.00	6,082,500
伊藤忠商事	510,200	1,980.00	1,010,196,000
丸紅	571,300	770.90	440,415,170
高島	1,200	2,233.00	2,679,600
長瀬産業	41,900	2,090.00	87,571,000
蝶理	4,400	2,051.00	9,024,400
豊田通商	77,600	4,255.00	330,188,000
三共生興	11,900	484.00	5,759,600
兼松	29,600	1,417.00	41,943,200
ツカモトコーポレーション	1,200	1,269.00	1,522,800
三井物産	590,500	1,726.00	1,019,203,000
日本紙パルプ商事	3,600	4,495.00	16,182,000
日立ハイテクノロジーズ	24,200	5,030.00	121,726,000
カメイ	9,100	1,859.00	16,916,900
東都水産	1,100	2,054.00	2,259,400
O U Gホールディングス	1,100	2,722.00	2,994,200
スターゼン	2,700	5,540.00	14,958,000
山善	27,200	1,361.00	37,019,200
椿本興業	1,600	2,825.00	4,520,000
住友商事	438,500	1,785.00	782,722,500

内田洋行	3,200	3,395.00	10,864,000
三菱商事	487,800	2,900.50	1,414,863,900
第一実業	3,200	3,450.00	11,040,000
キャノンマーケティングジャパン	19,900	2,965.00	59,003,500
西華産業	4,300	2,953.00	12,697,900
佐藤商事	6,200	1,227.00	7,607,400
菱洋エレクトロ	6,500	2,183.00	14,189,500
東京産業	6,900	529.00	3,650,100
ユアサ商事	6,600	4,160.00	27,456,000
神鋼商事	1,600	3,335.00	5,336,000
小林産業	4,700	378.00	1,776,600
阪和興業	13,000	4,285.00	55,705,000
正栄食品工業	3,800	4,510.00	17,138,000
カナデン	6,700	1,345.00	9,011,500
菱電商事	5,000	1,729.00	8,645,000
フルサト工業	3,800	1,855.00	7,049,000
岩谷産業	15,400	3,555.00	54,747,000
すてきナイスグループ	3,000	1,609.00	4,827,000
昭光通商	25,000	117.00	2,925,000
ニチモウ	1,100	2,008.00	2,208,800
極東貿易	10,000	420.00	4,200,000
イワキ	10,000	478.00	4,780,000
三愛石油	18,700	1,400.00	26,180,000
稲畑産業	16,700	1,681.00	28,072,700
G S Iクレオス	1,900	1,773.00	3,368,700
明和産業	6,400	495.00	3,168,000
ワキタ	14,800	1,408.00	20,838,400
東邦ホールディングス	20,600	2,340.00	48,204,000
サンゲツ	23,500	2,053.00	48,245,500
ミツウロコグループホールディングス	10,100	840.00	8,484,000
シナネンホールディングス	3,300	2,481.00	8,187,300
伊藤忠エネクス	15,400	1,149.00	17,694,600
サンリオ	19,500	1,849.00	36,055,500
サンワテクノス	4,100	2,064.00	8,462,400
リョーサン	8,700	4,420.00	38,454,000
新光商事	7,600	2,031.00	15,435,600
トーヨー	3,100	2,813.00	8,720,300
三信電気	6,400	1,613.00	10,323,200
東陽テクニカ	8,000	1,039.00	8,312,000
モスフードサービス	9,100	3,485.00	31,713,500
加賀電子	6,300	3,240.00	20,412,000
ソーダニッカ	7,200	583.00	4,197,600
立花エレテック	4,700	1,965.00	9,235,500

フォーバル	3,100	742.00	2,300,200
PALTAC	9,800	4,830.00	47,334,000
三谷産業	7,600	425.00	3,230,000
西本Wismettacホールディングス	1,400	4,220.00	5,908,000
ヤマタネ	3,500	2,102.00	7,357,000
丸紅建材リース	7,000	246.00	1,722,000
日鉄住金物産	5,400	6,010.00	32,454,000
トラスコ中山	14,500	3,160.00	45,820,000
オートバックスセブン	27,600	2,077.00	57,325,200
モリト	5,600	1,098.00	6,148,800
加藤産業	10,900	3,730.00	40,657,000
イノテック	6,000	1,061.00	6,366,000
イエローハット	6,600	3,300.00	21,780,000
JKホールディングス	7,000	908.00	6,356,000
日伝	5,800	2,492.00	14,453,600
北沢産業	5,800	249.00	1,444,200
杉本商事	3,800	1,803.00	6,851,400
因幡電機産業	9,200	5,140.00	47,288,000
バイテックホールディングス	3,200	1,766.00	5,651,200
ミスミグループ本社	80,700	3,285.00	265,099,500
アルテック	5,900	337.00	1,988,300
タキヒヨー	2,300	2,303.00	5,296,900
蔵王産業	1,100	1,750.00	1,925,000
スズケン	31,700	4,425.00	140,272,500
ジェコス	4,800	1,398.00	6,710,400
ルネサスイーストン	6,400	729.00	4,665,600
ローソン	17,600	7,530.00	132,528,000
サンエー	5,300	5,150.00	27,295,000
カワチ薬品	5,400	2,834.00	15,303,600
エービーシー・マート	12,700	5,890.00	74,803,000
ハードオフコーポレーション	3,100	1,168.00	3,620,800
アスクル	7,300	3,100.00	22,630,000
ゲオホールディングス	12,800	1,990.00	25,472,000
アダストリア	10,700	2,422.00	25,915,400
ジーフット	4,300	764.00	3,285,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	708.00	637,200
くらコーポレーション	4,100	5,050.00	20,705,000
キャンドゥ	3,400	1,803.00	6,130,200
パルグループホールディングス	3,600	3,245.00	11,682,000
エディオン	27,100	1,288.00	34,904,800
サーラコーポレーション	12,100	732.00	8,857,200
ワッツ	2,800	1,176.00	3,292,800
ハローズ	2,600	2,675.00	6,955,000

あみやき亭	1,500	5,220.00	7,830,000
ひらまつ	9,700	623.00	6,043,100
ゲンキー	3,000	4,075.00	12,225,000
大黒天物産	1,700	5,210.00	8,857,000
ハニーズホールディングス	6,800	1,190.00	8,092,000
ファーマライズホールディングス	1,700	643.00	1,093,100
アルペン	5,400	2,293.00	12,382,200
クオール	7,100	2,280.00	16,188,000
ジーンズ	4,700	5,650.00	26,555,000
ビックカメラ	40,100	1,430.00	57,343,000
D C Mホールディングス	37,600	1,062.00	39,931,200
MonotaRO	24,700	3,045.00	75,211,500
東京一番フーズ	1,900	608.00	1,155,200
DDホールディングス	1,500	5,060.00	7,590,000
きちり	2,000	741.00	1,482,000
アーランドサービスホールディングス	5,800	2,474.00	14,349,200
J.フロント リテイリング	83,100	1,795.00	149,164,500
ドトール・日レスホールディングス	12,200	2,676.00	32,647,200
マツモトキヨシホールディングス	14,400	8,770.00	126,288,000
ブロンコビリー	3,700	2,992.00	11,070,400
スタートトゥデイ	68,300	3,305.00	225,731,500
トレジャー・ファクトリー	2,100	946.00	1,986,600
物語コーポレーション	2,000	8,230.00	16,460,000
ココカラファイン	7,300	6,830.00	49,859,000
三越伊勢丹ホールディングス	130,000	1,280.00	166,400,000
Hamee	2,200	1,578.00	3,471,600
ウエルシアホールディングス	18,400	4,465.00	82,156,000
クリエイトSDホールディングス	10,300	2,910.00	29,973,000
丸善CHIホールディングス	8,100	348.00	2,818,800
ミサワ	1,400	529.00	740,600
ティーライフ	1,000	1,394.00	1,394,000
エー・ピーカンパニー	1,400	795.00	1,113,000
チムニー	2,200	2,878.00	6,331,600
シュッピン	2,100	2,790.00	5,859,000
ネクステージ	2,300	2,539.00	5,839,700
ジョイフル本田	11,300	3,135.00	35,425,500
鳥貴族	2,600	2,954.00	7,680,400
キリン堂ホールディングス	2,600	1,623.00	4,219,800
ホットランド	4,100	1,422.00	5,830,200
すかいらーく	43,200	1,666.00	71,971,200
綿半ホールディングス	2,600	2,573.00	6,689,800
ヨシックス	1,200	3,000.00	3,600,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	23,200	1,098.00	25,473,600

ブックオフコーポレーション	4,000	809.00	3,236,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,900	911.00	2,641,900
B E E N O S	1,100	1,528.00	1,680,800
あさひ	5,200	1,409.00	7,326,800
日本調剤	2,500	3,690.00	9,225,000
コスモス薬品	3,500	23,740.00	83,090,000
トーエル	3,500	991.00	3,468,500
一六堂	1,700	452.00	768,400
オンリー	1,200	889.00	1,066,800
セブン&アイ・ホールディングス	291,400	4,667.00	1,359,963,800
薬王堂	3,100	3,240.00	10,044,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,800	1,242.00	23,349,600
ツルハホールディングス	14,000	14,400.00	201,600,000
サンマルクホールディングス	5,000	3,545.00	17,725,000
フェリシモ	1,800	1,326.00	2,386,800
トリドールホールディングス	8,600	3,690.00	31,734,000
T O K Y O B A S E	1,400	4,650.00	6,510,000
サツドラホールディングス	1,000	2,012.00	2,012,000
ダイユー・リックホールディングス	3,300	1,057.00	3,488,100
パロックジャパンリミテッド	5,600	965.00	5,404,000
クスリのアオキホールディングス	5,500	6,620.00	36,410,000
スシローグローバルホールディングス	6,300	3,630.00	22,869,000
L I X I L ビバ	6,700	1,730.00	11,591,000
メディカルシステムネットワーク	8,000	556.00	4,448,000
総合メディカル	3,000	6,300.00	18,900,000
はるやまホールディングス	3,300	1,017.00	3,356,100
ノジマ	12,200	2,387.00	29,121,400
カッパ・クリエイト	8,700	1,255.00	10,918,500
ライトオン	5,900	941.00	5,551,900
良品計画	9,200	33,850.00	311,420,000
三城ホールディングス	8,800	474.00	4,171,200
アドヴァン	7,200	1,096.00	7,891,200
アルビス	1,600	4,480.00	7,168,000
コナカ	9,000	610.00	5,490,000
ハウス オブ ローゼ	900	1,676.00	1,508,400
G - 7ホールディングス	2,100	2,455.00	5,155,500
イオン北海道	7,100	675.00	4,792,500
コジマ	12,200	373.00	4,550,600
ヒマラヤ	2,000	1,049.00	2,098,000
コーナン商事	9,900	2,322.00	22,987,800
エコス	2,900	1,244.00	3,607,600
マルシェ	1,900	826.00	1,569,400
ドンキホーテホールディングス	45,100	5,010.00	225,951,000

西松屋チェーン	15,300	1,272.00	19,461,600
ゼンショーホールディングス	36,100	2,011.00	72,597,100
幸楽苑ホールディングス	4,500	1,980.00	8,910,000
ハークスレイ	1,800	1,176.00	2,116,800
サイゼリヤ	10,300	3,400.00	35,020,000
V Tホールディングス	23,700	599.00	14,196,300
魚力	2,000	1,186.00	2,372,000
ポブラ	1,800	681.00	1,225,800
フジ・コーポレーション	1,300	2,184.00	2,839,200
ユナイテッドアローズ	8,600	3,910.00	33,626,000
ハイデイ日高	7,600	3,345.00	25,422,000
京都きもの友禅	4,500	804.00	3,618,000
コロナイド	23,100	2,088.00	48,232,800
ピーシーデポコーポレーション	10,500	882.00	9,261,000
壱番屋	4,900	4,365.00	21,388,500
トップカルチャー	2,700	501.00	1,352,700
P L A N T	1,700	1,292.00	2,196,400
スギホールディングス	15,300	5,920.00	90,576,000
ヴィア・ホールディングス	6,100	767.00	4,678,700
スクロール	10,900	467.00	5,090,300
ヨンドシーホールディングス	7,100	3,065.00	21,761,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22,200	6,570.00	145,854,000
木曽路	8,600	2,727.00	23,452,200
S R Sホールディングス	8,300	930.00	7,719,000
千趣会	12,600	686.00	8,643,600
タカキュー	5,800	213.00	1,235,400
ケーヨー	13,000	734.00	9,542,000
上新電機	8,200	4,130.00	33,866,000
日本瓦斯	12,800	3,910.00	50,048,000
ロイヤルホールディングス	12,400	2,910.00	36,084,000
いなげや	7,800	1,817.00	14,172,600
島忠	18,000	3,190.00	57,420,000
チヨダ	8,200	2,971.00	24,362,200
ライフコーポレーション	5,300	3,035.00	16,085,500
リンガーハット	8,600	2,496.00	21,465,600
M r M a x H D	8,800	742.00	6,529,600
テンアライド	6,400	442.00	2,828,800
A O K Iホールディングス	14,000	1,641.00	22,974,000
オークワ	10,000	1,167.00	11,670,000
コメリ	10,800	3,150.00	34,020,000
青山商事	13,400	4,135.00	55,409,000
しまむら	8,100	12,860.00	104,166,000
はせがわ	3,900	509.00	1,985,100

高島屋	109,000	1,076.00	117,284,000
松屋	14,100	1,220.00	17,202,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,000	2,155.00	71,115,000
近鉄百貨店	2,700	3,735.00	10,084,500
パルコ	6,700	1,547.00	10,364,900
丸井グループ	66,600	1,866.00	124,275,600
アクシアル リテイリング	5,800	4,340.00	25,172,000
イオン	267,600	1,747.00	467,497,200
イズミ	12,600	6,200.00	78,120,000
東武ストア	900	3,060.00	2,754,000
平和堂	14,100	2,490.00	35,109,000
フジ	7,900	2,429.00	19,189,100
ヤオコー	7,900	5,650.00	44,635,000
ゼビオホールディングス	9,500	2,340.00	22,230,000
ケーズホールディングス	29,500	2,668.00	78,706,000
Olympicグループ	4,300	600.00	2,580,000
日産東京販売ホールディングス	10,500	421.00	4,420,500
アインホールディングス	9,900	7,490.00	74,151,000
元気寿司	1,800	3,725.00	6,705,000
ヤマダ電機	233,100	582.00	135,664,200
アークランドサカモト	11,800	1,820.00	21,476,000
ニトリホールディングス	27,600	16,570.00	457,332,000
グルメ杵屋	5,000	1,133.00	5,665,000
愛眼	5,500	359.00	1,974,500
ケーユーホールディングス	3,700	1,053.00	3,896,100
吉野家ホールディングス	22,900	1,875.00	42,937,500
松屋フーズ	3,400	4,250.00	14,450,000
サガミチェーン	9,400	1,372.00	12,896,800
関西スーパーマーケット	5,300	1,383.00	7,329,900
王将フードサービス	5,100	5,040.00	25,704,000
プレナス	7,800	2,343.00	18,275,400
ミニストップ	5,200	2,327.00	12,100,400
アークス	13,100	2,624.00	34,374,400
パローホールディングス	16,200	2,513.00	40,710,600
藤久	600	1,745.00	1,047,000
ベルク	3,100	6,330.00	19,623,000
大庄	3,800	1,703.00	6,471,400
ファーストリテイリング	11,600	40,650.00	471,540,000
サンドラッグ	29,500	4,980.00	146,910,000
サックスパー ホールディングス	6,600	1,389.00	9,167,400
ヤマザワ	1,500	1,744.00	2,616,000
やまや	1,500	2,404.00	3,606,000
ベルーナ	17,100	1,245.00	21,289,500

島根銀行	1,500	1,358.00	2,037,000
じもとホールディングス	47,000	207.00	9,729,000
めぶきフィナンシャルグループ	361,700	479.00	173,254,300
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,400	3,085.00	28,999,000
九州フィナンシャルグループ	114,200	694.00	79,254,800
ゆうちょ銀行	197,200	1,422.00	280,418,400
富山第一銀行	17,700	538.00	9,522,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	423,300	599.00	253,556,700
西日本フィナンシャルホールディングス	47,200	1,274.00	60,132,800
新生銀行	60,300	1,785.00	107,635,500
あおぞら銀行	41,500	4,445.00	184,467,500
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,918,500	746.60	3,672,152,100
りそなホールディングス	764,000	604.50	461,838,000
三井住友トラスト・ホールディングス	136,900	4,334.00	593,324,600
三井住友フィナンシャルグループ	526,900	4,458.00	2,348,920,200
第四銀行	8,500	5,330.00	45,305,000
北越銀行	7,000	2,581.00	18,067,000
千葉銀行	249,000	839.00	208,911,000
群馬銀行	141,400	695.00	98,273,000
武蔵野銀行	11,100	3,525.00	39,127,500
千葉興業銀行	19,100	617.00	11,784,700
筑波銀行	28,900	378.00	10,924,200
七十七銀行	21,800	2,801.00	61,061,800
青森銀行	5,400	3,630.00	19,602,000
秋田銀行	4,500	3,440.00	15,480,000
山形銀行	7,800	2,564.00	19,999,200
岩手銀行	4,900	4,560.00	22,344,000
東邦銀行	62,200	401.00	24,942,200
東北銀行	3,500	1,529.00	5,351,500
みちのく銀行	4,500	1,880.00	8,460,000
ふくおかフィナンシャルグループ	283,000	561.00	158,763,000
静岡銀行	184,000	1,059.00	194,856,000
十六銀行	9,300	3,600.00	33,480,000
スルガ銀行	71,200	2,423.00	172,517,600
八十二銀行	126,000	673.00	84,798,000
山梨中央銀行	43,000	492.00	21,156,000
大垣共立銀行	11,000	3,075.00	33,825,000
福井銀行	6,000	2,936.00	17,616,000
北國銀行	7,900	4,575.00	36,142,500
清水銀行	2,400	3,535.00	8,484,000
富山銀行	1,300	4,330.00	5,629,000
滋賀銀行	65,000	622.00	40,430,000
南都銀行	8,100	3,100.00	25,110,000



百五銀行	66,800	507.00	33,867,600
京都銀行	26,600	5,860.00	155,876,000
紀陽銀行	26,200	1,882.00	49,308,400
三重銀行	3,100	2,599.00	8,056,900
ほくほくフィナンシャルグループ	46,300	1,766.00	81,765,800
広島銀行	102,800	898.00	92,314,400
山陰合同銀行	41,300	1,016.00	41,960,800
中国銀行	48,100	1,578.00	75,901,800
鳥取銀行	2,200	1,775.00	3,905,000
伊予銀行	99,300	921.00	91,455,300
百十四銀行	74,000	402.00	29,748,000
四国銀行	10,700	1,689.00	18,072,300
阿波銀行	56,000	742.00	41,552,000
大分銀行	4,000	4,410.00	17,640,000
宮崎銀行	4,600	3,895.00	17,917,000
佐賀銀行	4,200	2,758.00	11,583,600
十八銀行	43,000	294.00	12,642,000
沖縄銀行	6,800	4,430.00	30,124,000
琉球銀行	13,500	1,695.00	22,882,500
セブン銀行	261,100	404.00	105,484,400
みずほフィナンシャルグループ	9,458,600	203.00	1,920,095,800
高知銀行	2,500	1,299.00	3,247,500
山口フィナンシャルグループ	65,000	1,338.00	86,970,000
長野銀行	2,300	1,953.00	4,491,900
名古屋銀行	5,600	4,315.00	24,164,000
北洋銀行	104,900	368.00	38,603,200
愛知銀行	2,300	6,660.00	15,318,000
第三銀行	3,900	1,835.00	7,156,500
中京銀行	2,900	2,298.00	6,664,200
大光銀行	2,400	2,493.00	5,983,200
愛媛銀行	9,600	1,474.00	14,150,400
トマト銀行	2,700	1,542.00	4,163,400
みなと銀行	6,400	2,084.00	13,337,600
京葉銀行	62,000	517.00	32,054,000
関西アーバン銀行	9,800	1,420.00	13,916,000
栃木銀行	36,000	491.00	17,676,000
北日本銀行	2,200	3,340.00	7,348,000
東和銀行	12,200	1,324.00	16,152,800
福島銀行	6,600	901.00	5,946,600
大東銀行	3,300	1,663.00	5,487,900
トモニホールディングス	57,400	520.00	29,848,000
フィデアホールディングス	67,600	209.00	14,128,400
池田泉州ホールディングス	73,900	431.00	31,850,900

F P G	25,000	1,337.00	33,425,000
S B I ホールディングス	78,800	1,680.00	132,384,000
ジャフコ	10,000	5,720.00	57,200,000
大和証券グループ本社	596,000	728.10	433,947,600
野村ホールディングス	1,256,800	668.50	840,170,800
岡三証券グループ	60,000	723.00	43,380,000
丸三証券	22,300	1,038.00	23,147,400
東洋証券	25,000	311.00	7,775,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	80,100	726.00	58,152,600
光世証券	1,800	1,673.00	3,011,400
水戸証券	22,000	401.00	8,822,000
いちよし証券	14,700	1,329.00	19,536,300
松井証券	34,200	993.00	33,960,600
だいこう証券ビジネス	3,600	767.00	2,761,200
マネックスグループ	74,200	355.00	26,341,000
カブドットコム証券	45,000	363.00	16,335,000
極東証券	9,400	1,684.00	15,829,600
岩井コスモホールディングス	7,200	1,501.00	10,807,200
藍澤証券	13,200	806.00	10,639,200
マネーパートナーズグループ	9,200	449.00	4,130,800
かんぽ生命保険	26,300	2,416.00	63,540,800
S O M P O ホールディングス	136,500	4,586.00	625,989,000
アニコム ホールディングス	4,700	2,931.00	13,775,700
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	182,000	3,785.00	688,870,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	57,200	1,822.00	104,218,400
第一生命ホールディングス	393,800	2,112.00	831,705,600
東京海上ホールディングス	262,300	4,804.00	1,260,089,200
T & D ホールディングス	215,300	1,733.50	373,222,550
アドバンスクリエイト	1,600	1,863.00	2,980,800
全国保証	19,600	4,950.00	97,020,000
クレディセゾン	52,800	2,260.00	119,328,000
アクリーティブ	3,800	424.00	1,611,200
芙蓉総合リース	8,000	7,290.00	58,320,000
興銀リース	13,100	2,827.00	37,033,700
東京センチュリー	14,000	4,855.00	67,970,000
日本証券金融	28,500	622.00	17,727,000
アイフル	116,800	370.00	43,216,000
ポケットカード	5,300	1,070.00	5,671,000
リコーリース	5,500	4,050.00	22,275,000
イオンフィナンシャルサービス	49,400	2,403.00	118,708,200
アコム	139,900	448.00	62,675,200
ジャックス	8,500	2,569.00	21,836,500
オリエントコーポレーション	150,600	178.00	26,806,800

日立キャピタル	19,100	2,843.00	54,301,300
アプラスフィナンシャル	33,400	109.00	3,640,600
オリックス	464,300	1,976.50	917,688,950
三菱UFJリース	176,700	596.00	105,313,200
日本取引所グループ	204,500	2,045.00	418,202,500
イー・ギャランティ	1,800	3,285.00	5,913,000
アサックス	1,000	1,806.00	1,806,000
NECキャピタルソリューション	2,800	2,237.00	6,263,600
いちご	99,500	401.00	39,899,500
日本駐車場開発	84,200	165.00	13,893,000
ヒューリック	145,300	1,207.00	175,377,100
三栄建築設計	2,800	2,432.00	6,809,600
スター・マイカ	2,500	1,621.00	4,052,500
野村不動産ホールディングス	46,300	2,554.00	118,250,200
三重交通グループホールディングス	14,200	471.00	6,688,200
サムティ	5,900	1,736.00	10,242,400
ディア・ライフ	6,900	465.00	3,208,500
エー・ディー・ワークス	93,200	40.00	3,728,000
日本商業開発	3,900	1,636.00	6,380,400
プレサンスコーポレーション	9,500	1,449.00	13,765,500
ユニゾホールディングス	8,100	3,060.00	24,786,000
THEグローバル社	3,300	746.00	2,461,800
日本管理センター	4,600	1,594.00	7,332,400
サンセイランディック	2,100	978.00	2,053,800
エストラスト	1,000	898.00	898,000
フージャースホールディングス	9,000	1,168.00	10,512,000
オープンハウス	11,300	4,445.00	50,228,500
東急不動産ホールディングス	168,600	793.00	133,699,800
飯田グループホールディングス	58,100	2,171.00	126,135,100
ムゲンエステート	4,300	1,250.00	5,375,000
ファーストブラザーズ	1,900	1,177.00	2,236,300
ハウスドゥ	1,100	2,305.00	2,535,500
シーアールイー	1,100	1,528.00	1,680,800
ケイアイスター不動産	2,500	2,224.00	5,560,000
パーク24	38,600	2,629.00	101,479,400
パラカ	2,200	2,417.00	5,317,400
三井不動産	347,600	2,774.00	964,242,400
三菱地所	518,200	2,134.50	1,106,097,900
平和不動産	12,300	2,127.00	26,162,100
東京建物	76,100	1,638.00	124,651,800
ダイビル	18,000	1,301.00	23,418,000
京阪神ビルディング	11,600	830.00	9,628,000
住友不動産	167,000	3,902.00	651,634,000

大京	11,100	2,251.00	24,986,100
テオーシー	24,000	999.00	23,976,000
東京楽天地	1,100	6,050.00	6,655,000
レオパレス21	86,600	883.00	76,467,800
スターツコーポレーション	9,500	2,899.00	27,540,500
フジ住宅	8,900	815.00	7,253,500
空港施設	7,300	648.00	4,730,400
明和地所	3,900	924.00	3,603,600
ゴールドクレスト	5,500	2,537.00	13,953,500
日本エスリード	2,700	2,054.00	5,545,800
日神不動産	9,300	858.00	7,979,400
日本エスコン	12,300	555.00	6,826,500
タカラレーベン	32,700	502.00	16,415,400
サンヨーハウジング名古屋	3,600	1,217.00	4,381,200
イオンモール	44,900	2,073.00	93,077,700
ファースト住建	2,600	1,840.00	4,784,000
トーセイ	8,500	1,152.00	9,792,000
穴吹興産	800	3,030.00	2,424,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	43,300	1,239.00	53,648,700
サンフロンティア不動産	7,500	1,518.00	11,385,000
エフ・ジェー・ネクスト	5,400	964.00	5,205,600
インテリックス	2,200	985.00	2,167,000
ランドビジネス	4,100	339.00	1,389,900
グランディハウス	6,200	497.00	3,081,400
日本空港ビルデング	20,400	4,400.00	89,760,000
日本工営	4,600	4,110.00	18,906,000
LIFULL	23,600	804.00	18,974,400
ジェイエシーリクルートメント	5,500	2,012.00	11,066,000
日本M&Aセンター	23,300	5,530.00	128,849,000
メンバーズ	1,800	689.00	1,240,200
中広	800	752.00	601,600
タケエイ	7,100	1,134.00	8,051,400
トラスト・テック	3,000	3,455.00	10,365,000
コシダカホールディングス	3,600	4,610.00	16,596,000
パソナグループ	5,500	1,802.00	9,911,000
CDS	1,900	1,334.00	2,534,600
リンクアンドモチベーション	12,500	761.00	9,512,500
GCA	7,800	1,027.00	8,010,600
エス・エム・エス	13,400	3,400.00	45,560,000
パーソルホールディングス	62,300	2,835.00	176,620,500
リニカル	4,400	1,387.00	6,102,800
クックパッド	21,300	671.00	14,292,300
エスクリ	2,500	890.00	2,225,000

アイ・ケイ・ケイ	4,100	898.00	3,681,800
学情	3,100	1,448.00	4,488,800
スタジオアリス	3,400	2,633.00	8,952,200
シミックホールディングス	3,800	1,675.00	6,365,000
N J S	1,700	1,463.00	2,487,100
総合警備保障	26,900	6,030.00	162,207,000
カカクコム	51,900	1,654.00	85,842,600
アイロムグループ	2,300	1,793.00	4,123,900
セントケア・ホールディング	1,000	2,678.00	2,678,000
サイネックス	1,100	987.00	1,085,700
ルネサンス	3,300	1,783.00	5,883,900
ディップ	9,600	2,667.00	25,603,200
オプトホールディング	4,800	1,283.00	6,158,400
ツクイ	16,000	881.00	14,096,000
キャリアデザインセンター	1,600	1,673.00	2,676,800
エムスリー	71,000	3,605.00	255,955,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,500	580.00	3,190,000
プラス	500	1,064.00	532,000
アウトソーシング	20,200	1,704.00	34,420,800
ウェルネット	5,600	1,115.00	6,244,000
ワールドホールディングス	2,300	2,850.00	6,555,000
ディー・エヌ・エー	36,400	2,535.00	92,274,000
博報堂D Yホールディングス	93,800	1,502.00	140,887,600
ぐるなび	10,700	1,375.00	14,712,500
エスアールジータカミヤ	8,100	671.00	5,435,100
ジャパンベストレスキューシステム	8,400	451.00	3,788,400
ファンコミュニケーションズ	18,800	1,032.00	19,401,600
ライク	2,700	2,079.00	5,613,300
ビジネス・ブレークスルー	3,300	450.00	1,485,000
W D Bホールディングス	3,100	2,709.00	8,397,900
ティア	3,600	946.00	3,405,600
C D G	700	1,870.00	1,309,000
バリューコマース	6,200	783.00	4,854,600
インフォマート	34,300	684.00	23,461,200
J Pホールディングス	21,500	346.00	7,439,000
E P Sホールディングス	10,200	2,201.00	22,450,200
レッグス	1,800	891.00	1,603,800
プレステージ・インターナショナル	14,100	1,304.00	18,386,400
アミューズ	4,500	3,015.00	13,567,500
ドリームインキュベータ	2,300	2,385.00	5,485,500
クイック	4,200	1,675.00	7,035,000
T A C	4,400	266.00	1,170,400
ケネディクス	93,700	671.00	62,872,700

電通	82,200	4,915.00	404,013,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,300	848.00	2,798,400
ぴあ	2,300	5,440.00	12,512,000
イオンファンタジー	2,200	4,435.00	9,757,000
シーティーエス	7,000	895.00	6,265,000
ネクシィーズグループ	2,700	2,245.00	6,061,500
みらかホールディングス	20,100	5,250.00	105,525,000
アルプス技研	3,000	3,680.00	11,040,000
ダイオーズ	1,400	1,472.00	2,060,800
日本空調サービス	7,200	794.00	5,716,800
オリエンタルランド	79,700	9,627.00	767,271,900
ダスキン	18,200	2,996.00	54,527,200
明光ネットワークジャパン	8,600	1,306.00	11,231,600
ファルコホールディングス	3,500	1,780.00	6,230,000
ラウンドワン	21,000	1,487.00	31,227,000
リゾートトラスト	28,600	2,288.00	65,436,800
ビー・エム・エル	8,700	2,705.00	23,533,500
ワタベウェディング	1,200	660.00	792,000
りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,260.00	13,482,000
リソー教育	11,500	866.00	9,959,000
早稲田アカデミー	1,000	1,700.00	1,700,000
ユー・エス・エス	82,400	2,459.00	202,621,600
東京個別指導学院	2,500	972.00	2,430,000
サイバーエージェント	44,400	3,940.00	174,936,000
楽天	345,800	1,185.00	409,773,000
クリーク・アンド・リバー社	3,600	1,120.00	4,032,000
テー・オー・ダブリュー	6,000	917.00	5,502,000
セントラルスポーツ	2,500	4,120.00	10,300,000
フルキャストホールディングス	6,000	2,185.00	13,110,000
リソルホールディングス	800	4,015.00	3,212,000
テクノプロ・ホールディングス	12,000	5,370.00	64,440,000
アトラ	1,300	686.00	891,800
インターワークス	1,600	1,099.00	1,758,400
Keeper 技研	2,200	1,377.00	3,029,400
ファーストロジック	600	2,389.00	1,433,400
三機サービス	800	1,309.00	1,047,200
デザインワン・ジャパン	1,400	1,257.00	1,759,800
イー・ガーディアン	3,500	2,337.00	8,179,500
リブセンス	4,500	576.00	2,592,000
ジャパンマテリアル	6,200	3,355.00	20,801,000
ベクトル	8,100	1,425.00	11,542,500
ウチヤマホールディングス	3,500	536.00	1,876,000
ライクキッズネクスト	700	2,277.00	1,593,900

キャリアリンク	2,400	569.00	1,365,600
I B J	5,100	974.00	4,967,400
アサンテ	2,500	2,047.00	5,117,500
N・フィールド	3,800	1,538.00	5,844,400
バリューHR	800	4,560.00	3,648,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	5,940.00	7,722,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,800	1,042.00	2,917,600
E R Iホールディングス	2,000	940.00	1,880,000
アピスト	1,000	4,365.00	4,365,000
ウィルグループ	3,000	1,553.00	4,659,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	3,150.00	5,985,000
日本ビューホテル	1,600	1,386.00	2,217,600
リクルートホールディングス	520,400	2,723.00	1,417,049,200
エラン	1,700	1,546.00	2,628,200
土木管理総合試験所	2,100	802.00	1,684,200
日本郵政	382,800	1,302.00	498,405,600
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,223.00	13,819,900
鎌倉新書	1,000	1,811.00	1,811,000
一蔵	900	1,098.00	988,200
L I T A L I C O	1,200	1,698.00	2,037,600
グローバルグループ	800	2,099.00	1,679,200
エボラブルアジア	1,400	2,403.00	3,364,200
ストライク	700	5,080.00	3,556,000
ソラスト	4,100	2,429.00	9,958,900
インソース	900	1,955.00	1,759,500
リログループ	36,900	2,969.00	109,556,100
東祥	4,200	3,335.00	14,007,000
エイチ・アイ・エス	10,500	3,925.00	41,212,500
ラックランド	1,300	2,182.00	2,836,600
共立メンテナンス	12,000	3,940.00	47,280,000
イチネンホールディングス	7,600	1,545.00	11,742,000
建設技術研究所	4,800	1,082.00	5,193,600
スペース	4,000	1,698.00	6,792,000
燦ホールディングス	1,600	2,921.00	4,673,600
スバル興業	500	8,180.00	4,090,000
東京テアトル	2,900	1,471.00	4,265,900
タナベ経営	1,400	1,500.00	2,100,000
ナガワ	1,400	4,900.00	6,860,000
よみうりランド	1,500	5,060.00	7,590,000
東京都競馬	5,100	3,875.00	19,762,500
カナモト	10,300	3,800.00	39,140,000
東京ドーム	27,400	1,071.00	29,345,400
西尾レントオール	6,000	3,835.00	23,010,000

トランス・コスモス	7,500	2,524.00	18,930,000
乃村工藝社	15,800	2,346.00	37,066,800
藤田観光	2,700	3,545.00	9,571,500
KNT - CTホールディングス	4,200	1,653.00	6,942,600
日本管財	7,300	2,011.00	14,680,300
トーカイ	3,300	4,990.00	16,467,000
白洋舎	800	3,635.00	2,908,000
セコム	71,600	8,504.00	608,886,400
セントラル警備保障	3,300	2,077.00	6,854,100
丹青社	13,900	1,344.00	18,681,600
メイテック	7,900	5,850.00	46,215,000
アサツー ディ・ケイ	12,800	3,610.00	46,208,000
応用地質	7,700	1,619.00	12,466,300
船井総研ホールディングス	9,400	3,440.00	32,336,000
進学会ホールディングス	3,200	628.00	2,009,600
オオバ	5,900	514.00	3,032,600
いであ	1,400	1,191.00	1,667,400
学究社	1,900	1,632.00	3,100,800
ベネッセホールディングス	24,700	4,120.00	101,764,000
イオンディライト	8,300	4,155.00	34,486,500
ナック	4,600	977.00	4,494,200
ニチイ学館	12,900	1,360.00	17,544,000
ダイセキ	11,900	2,861.00	34,045,900
ステップ	2,500	1,636.00	4,090,000
合 計	84,904,400		181,456,431,420

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表



	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,557,458,039
コール・ローン	1,475,084,486
株式	309,639,865,358
投資信託受益証券	275,273,570
投資証券	7,937,290,518
派生商品評価勘定	94,256,066
未収入金	5,953,440,344
未収配当金	325,204,059
差入委託証拠金	1,885,978,218
流動資産合計	330,143,850,658
資産合計	330,143,850,658
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,654,080
前受金	91,245,166
未払解約金	1,765,041,091
未払利息	2,645
流動負債合計	1,857,942,982
負債合計	1,857,942,982
純資産の部	
元本等	
元本	135,279,294,476
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	193,006,613,200
元本等合計	328,285,907,676
純資産合計	328,285,907,676
負債純資産合計	330,143,850,658

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

平成29年11月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,279,294,476口

		平成29年11月10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)	2.4267円 (24,267円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成29年11月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		平成29年11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		

	平成29年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	137,154,212,826円
期中追加設定元本額	4,501,637,920円
期中一部解約元本額	6,376,556,270円
期末元本額	135,279,294,476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）	2,362,106,375円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,587,120円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,361,325,665円
世界経済インデックスファンド	6,738,222,644円
外国株式インデックス・オープン	834,741,651円
D C マイセレクション25	915,139,848円

区分	平成29年11月10日現在
DCマイセレクション50	4,391,827,576円
DCマイセレクション75	4,898,124,812円
DC外国株式インデックス・オープン	7,120,532,491円
DCマイセレクションS25	374,576,550円
DCマイセレクションS50	1,748,087,961円
DCマイセレクションS75	1,381,356,346円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	130,874,564円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	180,678,526円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	104,934,188円
DC世界経済インデックスファンド	4,887,838,416円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,653,777,566円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	21,861,140円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,318,670円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	66,482,224円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	109,160,879円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	393,520,289円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	57,855,266円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	475,251,470円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,039,416,594円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	476,927,190円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,295,002,459円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,349,399,383円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	224,878,244円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	459,942,086円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	515,772,847円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	161,483,698円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,510,478,133円
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）	2,765,780,861円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,524,602,370円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,650,105,005円
コア投資戦略ファンド（成長型）	8,478,993,748円
分散投資コア戦略ファンドA	1,814,687,739円
分散投資コア戦略ファンドS	3,622,461,063円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	474,651,002円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	608,765,996円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,487,957,348円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	819,744,177円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	46,065,225円
SMT インデックスバランス・オープン	328,658,525円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,471,808,115円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,412,245,042円
SMT 世界経済インデックス・オープン	400,672円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	88,352,889円

区分	平成29年11月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	10,121,057円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	173,124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）	1,872,002,529円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,530,235,118円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	15,389,882,723	
投資信託受益証券	4,053,353	
投資証券	276,748,934	
合計	15,662,578,304	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成29年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,075,078,293	-	10,166,323,459	91,245,166
合計		10,075,078,293	-	10,166,323,459	91,245,166

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成29年11月10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	467,455,520	-	466,098,700	1,356,820
	アメリカドル	293,673,800	-	292,494,600	1,179,200

カナダドル	12,523,980	-	12,523,000	980
ユーロ	68,712,040	-	68,692,000	20,040
イギリスポンド	35,828,640	-	35,764,800	63,840
スイスフラン	15,972,320	-	15,972,600	280
デンマーククローネ	14,202,400	-	14,200,000	2,400
オーストラリアドル	13,989,440	-	13,931,200	58,240
シンガポールドル	12,552,900	-	12,520,500	32,400
合計	467,455,520	-	466,098,700	1,356,820

## (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	51.40	2,281,132.00	
	ANDEAVOR	11,677	107.00	1,249,439.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	19.77	368,433.72	
	APACHE CORP	29,810	45.24	1,348,604.40	
	BAKER HUGHES A GE CO	31,676	32.74	1,037,072.24	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	28.56	1,024,704.24	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	49.63	778,744.33	
	CHEVRON CORP	149,192	117.24	17,491,270.08	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	125.76	955,650.24	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	144.43	1,703,262.99	
	CONOCOPHILLIPS	97,116	53.53	5,198,619.48	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	46.32	354,209.04	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	105.00	351,330.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	40,715	40.81	1,661,579.15	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,758	111.03	750,340.74	
	EOG RESOURCES INC	45,301	104.78	4,746,638.78	
	EQT CORPORATION	13,878	65.91	914,698.98	
	EXXON MOBIL	333,839	83.97	28,032,460.83	
HALLIBURTON CO	69,072	45.01	3,108,930.72		

HELMERICH & PAYNE	8,315	59.53	494,991.95
HESS CORP	22,081	47.53	1,049,509.93
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	42.20	525,305.60
KINDER MORGAN INC	157,150	17.91	2,814,556.50
MARATHON OIL CORP	65,596	15.78	1,035,104.88
MARATHON PETROLEUM CORP	41,702	61.66	2,571,345.32
MURPHY OIL CORP	13,898	29.80	414,160.40
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	34.55	1,047,245.05
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	32.99	530,248.27
NOBLE ENERGY INC	38,291	28.45	1,089,378.95
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,953	68.70	4,118,771.10
ONEOK INC	30,874	52.99	1,636,013.26
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	27.19	438,683.46
PHILLIPS 66	34,624	94.42	3,269,198.08
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	161.14	2,167,333.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	21.65	214,118.50
RANGE RESOURCES CORP	20,891	18.90	394,839.90
SCHLUMBERGER	109,215	66.89	7,305,391.35
TARGA RESOURCES CORP	16,467	44.36	730,476.12
TECHNIPFMC PLC	36,005	29.36	1,057,106.80
VALERO ENERGY CORP	35,848	81.28	2,913,725.44
WILLIAMS COS	67,038	28.67	1,921,979.46
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,986	160.55	2,727,102.30
ALBEMARLE CORP	8,647	140.84	1,217,843.48
AVERY DENNISON CORP	7,457	105.76	788,652.32
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	32.08	564,800.48
BALL CORP	27,142	40.32	1,094,365.44
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	104.93	1,159,791.29
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	37.14	658,157.94
CROWN HOLDINGS INC	10,321	59.15	610,487.15
DOWDUPONT INC	183,235	70.23	12,868,594.05
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	89.98	1,066,982.84
ECOLAB INC	20,812	130.25	2,710,763.00
FMC CORP	10,402	92.16	958,648.32
FREEPORT-MCMORAN INC	111,396	14.72	1,639,749.12
INT'L PAPER CO	30,605	54.93	1,681,132.65
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	146.74	890,711.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	104.19	2,783,956.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	212.95	1,062,407.55
MONSANTO CO	34,984	117.34	4,105,022.56
MOSAIC CO/THE	27,677	22.50	622,732.50
NEWMONT MINING CORP	42,952	35.88	1,541,117.76
NUCOR CORP	24,915	56.52	1,408,195.80



PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	109.23	787,002.15
PPG INDUSTRIES INC	19,958	115.13	2,297,764.54
PRAXAIR INC	22,656	148.46	3,363,509.76
SEALED AIR CORP	14,689	44.77	657,626.53
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,536	387.03	2,529,628.08
STEEL DYNAMICS INC	18,273	37.19	679,572.87
VULCAN MATERIALS CO	10,740	124.68	1,339,063.20
WESTROCK CO	19,364	59.03	1,143,056.92
WR GRACE & CO	5,635	71.62	403,578.70
3 M COMPANY	46,888	228.39	10,708,750.32
ACUITY BRANDS INC	3,505	160.08	561,080.40
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	51.87	587,687.10
AGCO CORP	4,669	67.35	314,457.15
ALLEGION PLC	7,168	82.08	588,349.44
AMETEK INC	18,866	68.01	1,283,076.66
ARCONIC INC	30,141	24.45	736,947.45
BOEING CO	45,026	262.70	11,828,330.20
CATERPILLAR	46,181	135.34	6,250,136.54
CUMMINS INC	12,421	167.96	2,086,231.16
DEERE&CO	21,115	131.28	2,771,977.20
DOVER CORP	12,008	94.01	1,128,872.08
EATON CORP	35,279	77.86	2,746,822.94
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	61.48	3,130,991.96
FASTENAL CO	23,228	47.54	1,104,259.12
FLOWSERVE CORP	10,826	39.00	422,214.00
FLUOR CORP	11,267	47.05	530,112.35
FORTIVE CORP	24,294	72.63	1,764,473.22
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	64.00	819,840.00
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	198.87	3,989,729.94
GENERAL ELECTRIC CO	682,068	19.99	13,634,539.32
GRAINGER (WW) INC	4,253	206.07	876,415.71
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	35.81	545,243.06
HONEYWELL INTL INC	56,821	145.44	8,264,046.24
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	242.55	854,261.10
IDEX CORP	5,756	127.29	732,681.24
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	156.35	3,834,952.80
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	84.41	1,709,218.09
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	60.28	584,294.04
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	65.69	1,090,454.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	43.54	718,410.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	38.51	2,868,532.88
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	184.76	1,130,176.92

LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	188.90	544,976.50
LOCKHEED MARTIN CORP	20,422	311.08	6,352,875.76
MASCO CORP	24,547	38.62	948,005.14
MIDDLEBY CORP	4,364	108.72	474,454.08
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,972	299.14	3,880,444.08
PACCAR INC	27,548	69.42	1,912,382.16
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	182.34	1,887,948.36
PENTAIR PLC	13,583	68.17	925,953.11
RAYTHEON COMPANY	22,777	184.94	4,212,378.38
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	189.81	1,974,973.05
ROCKWELL COLLIN	13,112	133.49	1,750,320.88
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	257.83	2,088,423.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	47.91	662,499.48
SMITH (A.O.) CORP	12,146	58.67	712,605.82
SNAP-ON INC	4,900	156.81	768,369.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	162.85	1,956,642.75
TEXTRON	21,877	54.40	1,190,108.80
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	265.58	1,081,441.76
UNITED RENTALS INC	6,446	145.09	935,250.14
UNITED TECHNOLOGIES CORP	59,694	118.37	7,065,978.78
WABCO HOLDINGS INC	3,841	145.55	559,057.55
WABTEC CORP	7,158	75.38	539,570.04
XYLEM INC	13,941	66.28	924,009.48
CINTAS CORP	7,034	145.43	1,022,954.62
EQUIFAX INC	9,276	108.95	1,010,620.20
IHS MARKIT LTD	33,011	43.20	1,426,075.20
MANPOWER GROUP	5,123	123.63	633,356.49
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	37.10	1,020,398.40
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	63.77	1,177,257.97
ROBERT HALF INTL INC	9,566	52.55	502,693.30
ROLLINS INC	7,031	44.72	314,426.32
STERICYCLE INC	6,767	64.06	433,494.02
VERISK ANALYTICS INC	12,301	90.82	1,117,176.82
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	69.04	1,408,968.32
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	81.40	2,843,383.40
AMERCO	602	371.36	223,558.72
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	45.77	454,038.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	80.68	923,624.64
CSX CORP	72,941	50.23	3,663,826.43
DELTA AIR LINES INC	15,095	49.19	742,523.05
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	59.87	826,385.61
FEDEX CORP	20,171	217.44	4,385,982.24

HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	102.00	727,668.00
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	105.25	920,200.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	38.65	413,555.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	68.77	399,484.93
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	127.99	2,918,044.01
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	53.46	612,918.90
UNION PACIFIC CORP	63,328	117.07	7,413,808.96
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	58.39	350,515.17
UNITED PARCEL SERVICE B	53,987	112.55	6,076,236.85
AUTOLIV INC	6,639	123.40	819,252.60
BORGWARNER INC	15,953	52.10	831,151.30
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	95.58	2,002,783.32
FORD MOTOR COMPANY	295,438	12.04	3,557,073.52
GENERAL MOTORS CO	105,918	42.11	4,460,206.98
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	29.15	630,427.05
HARLEY-DAVIDSON	14,677	45.85	672,940.45
LEAR CORP	5,287	174.53	922,740.11
TESLA INC	10,212	302.99	3,094,133.88
DR HORTON INC	28,586	45.99	1,314,670.14
GARMIN LTD	9,564	59.72	571,162.08
HANESBRANDS INC	31,136	19.47	606,217.92
HASBRO INC	9,007	88.69	798,830.83
LEGGETT & PLATT INC	10,594	45.88	486,052.72
LENNAR CORP - B SHS	329	49.88	16,410.52
LENNAR CORP-CL A	16,492	58.93	971,873.56
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	64.01	542,292.72
MATTEL INC	27,399	13.93	381,668.07
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	54.53	629,657.91
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	264.61	1,339,455.82
NEWELL BRANDS INC	37,563	30.10	1,130,646.30
NIKE B	103,264	56.13	5,796,208.32
NVR INC	264	3,300.00	871,200.00
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	116.59	546,923.69
PULTE GROUP INC	21,959	31.07	682,266.13
PVH CORP	5,820	124.87	726,743.40
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	86.30	395,081.40
TAPESTRY INC	22,032	40.16	884,805.12
TOLL BROTHERS INC	11,211	45.80	513,463.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	12.01	191,559.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	10.99	178,950.17
VF CORP	26,718	69.36	1,853,160.48
WHIRLPOOL CORP	6,165	162.74	1,003,292.10

ARAMARK	19,980	42.75	854,145.00
BLOCK H & R INC	16,984	25.40	431,393.60
CARNIVAL CORPORATION	27,162	66.18	1,797,581.16
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	275.00	543,125.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	82.14	823,946.34
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	173.21	708,082.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,983	72.05	1,079,525.15
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	67.42	2,079,569.90
MARRIOTT INTL A	25,016	118.81	2,972,150.96
MCDONALD'S CORP	63,898	167.00	10,670,966.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	25.23	445,612.26
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	32.75	1,183,716.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	14,813	56.89	842,711.57
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	126.67	1,758,812.95
STARBUCKS CORP	113,248	57.36	6,495,905.28
VAIL RESORTS INC	2,987	232.58	694,716.46
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	106.94	849,424.42
WYNN RESORTS LTD	6,619	153.59	1,016,612.21
YUM BRANDS INC	25,546	79.53	2,031,673.38
CBS CORP-CL B	28,894	58.08	1,678,163.52
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16,856	341.20	5,751,267.20
COMCAST CORP-CL A	371,337	36.56	13,576,080.72
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	17.17	219,844.68
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	16.10	272,814.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	50.30	916,365.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	18.78	635,402.52
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	88.56	767,195.28
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	29.60	459,273.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	28.53	1,320,111.63
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	40.46	616,327.18
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.48	258,424.32
NEWS CORP-CLASS A	33,479	14.36	480,758.44
OMNICOM GROUP	19,057	67.28	1,282,154.96
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	78.33	497,865.48
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.31	687,671.55
THE WALT DISNEY CO	122,733	102.68	12,602,224.44
TIME WARNER INC	60,604	87.05	5,275,578.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	28.70	2,387,438.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	33,111	28.13	931,412.43
VIACOM INC-CLASS B	26,755	24.78	662,988.90
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	80.45	497,663.70
AMAZON.COM	31,930	1,129.13	36,053,120.90

AUTONATION INC	5,015	51.45	258,021.75
AUTOZONE INC	2,151	605.97	1,303,441.47
BED BATH & BEYOND INC	12,615	20.15	254,192.25
BEST BUY COMPANY INC	21,836	55.93	1,221,287.48
CARMAX INC	14,253	72.18	1,028,781.54
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	26.49	207,972.99
DOLLAR GENERAL CORP	21,092	81.91	1,727,645.72
DOLLAR TREE INC	18,300	94.38	1,727,154.00
EXPEDIA INC	9,800	117.32	1,149,736.00
FOOT LOCKER INC	11,410	30.61	349,260.10
GAP	20,859	26.35	549,634.65
GENUINE PARTS CO	11,245	85.56	962,122.20
HOME DEPOT	93,822	163.27	15,318,317.94
KOHL'S CORP	12,602	41.17	518,824.34
L BRANDS INC	19,499	48.25	940,826.75
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	23.27	816,102.17
LKQ CORP	24,693	36.93	911,912.49
LOWES COMPANIES	66,608	78.08	5,200,752.64
MACY'S INC	25,926	19.50	505,557.00
NETFLIX INC	33,711	193.90	6,536,562.90
NORDSTROM INC	10,094	40.03	404,062.82
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,397	211.09	1,561,432.73
PRICELINE GROUP INC/THE	3,843	1,703.14	6,545,167.02
ROSS STORES INC	30,239	64.57	1,952,532.23
SIGNET JEWELERS LTD	5,407	70.85	383,085.95
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,075	59.90	2,520,292.50
TIFFANY & CO	10,306	91.00	937,846.00
TJX COMPANIES INC	50,039	69.25	3,465,200.75
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	61.88	585,137.28
TRIPADVISOR INC	10,393	31.56	328,003.08
ULTA BEAUTY INC	4,911	199.19	978,222.09
COSTCO WHOLESALE CORP	34,368	169.11	5,811,972.48
CVS HEALTH CORP	80,999	69.02	5,590,550.98
KROGER CO	73,364	21.95	1,610,339.80
SYSCO CORP	40,957	54.02	2,212,497.14
WAL-MART STORES	118,995	90.30	10,745,248.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71,948	69.54	5,003,263.92
ALTRIA GROUP INC	151,614	64.51	9,780,619.14
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	39.60	1,764,853.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,638	56.77	887,769.26
BUNGE LIMITED	11,767	67.60	795,449.20
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	45.64	642,246.08
COCA-COLA CO	318,834	46.23	14,739,695.82

CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.96	1,128,932.28
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,382	218.13	2,919,015.66
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	85.69	1,272,924.95
GENERAL MILLS INC	44,875	51.78	2,323,627.50
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	107.77	1,207,024.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	31.95	749,706.75
INGREDION INC	5,835	130.02	758,666.70
JM SMUCKER CO	9,562	102.60	981,061.20
KELLOGG CO	21,051	63.28	1,332,107.28
KRAFT HEINZ CO/THE	47,604	79.41	3,780,233.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	95.51	885,950.76
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	80.53	1,216,003.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,487	41.35	4,982,137.45
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	58.68	1,824,537.24
PEPSICO INC	112,179	111.48	12,505,714.92
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,970	102.46	12,497,046.20
TYSON FOODS INC	22,220	73.82	1,640,280.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	44.00	839,652.00
CLOROX COMPANY	10,045	130.68	1,312,680.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,693	72.91	4,789,676.63
COTY INC-CL A	39,000	16.80	655,200.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	123.78	2,206,007.16
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	113.29	3,170,987.10
PROCTER & GAMBLE CO	200,955	87.78	17,639,829.90
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	104.15	197,260.10
ABBOTT LABORATORIES	136,305	55.45	7,558,112.25
AETNA INC	26,005	172.53	4,486,642.65
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,229	249.63	1,554,945.27
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	75.27	966,993.69
ANTHEM INC	21,018	215.98	4,539,467.64
BARD C R INC	5,875	335.28	1,969,770.00
BAXTER INTERNATIONAL	38,194	65.39	2,497,505.66
BECTON DICKINSON & CO	17,809	224.48	3,997,764.32
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	28.59	3,084,117.66
CARDINAL HEALTH	25,252	60.56	1,529,261.12
CENTENE CORP	13,787	93.28	1,286,051.36
CERNER CORP	23,088	65.48	1,511,802.24
CIGNA CORP	20,371	197.52	4,023,679.92
DANAHER CORP	49,843	92.98	4,634,402.14
DAVITA INC	11,875	55.11	654,431.25
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	65.56	1,169,197.04
DEXCOM INC	6,289	50.38	316,839.82

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	104.78	1,757,789.28
ENVISION HEALTHCARE	9,978	25.73	256,733.94
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,384	60.75	2,817,828.00
HCA HEALTHCARE INC	23,646	79.41	1,877,728.86
HENRY SCHEIN INC	12,492	69.66	870,192.72
HOLOGIC INC	21,094	39.65	836,377.10
HUMANA INC	11,281	247.46	2,791,596.26
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	150.19	1,095,035.29
INTUITIVE SURGICAL INC	8,650	390.00	3,373,500.00
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	152.09	1,209,571.77
MCKESSON CORP	16,655	140.11	2,333,532.05
MEDNAX INC	8,151	44.65	363,942.15
MEDTRONIC PLC	107,560	80.81	8,691,923.60
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	34.03	241,000.46
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	93.02	979,686.64
RESMED INC	10,895	82.72	901,234.40
STRYKER CORP	26,357	156.62	4,128,033.34
TELEFLEX INC	3,697	257.14	950,646.58
THE COOPER COS INC	4,109	231.95	953,082.55
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,819	211.56	16,040,267.64
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	99.79	723,277.92
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	107.69	756,629.94
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,988	60.58	483,913.04
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	111.84	1,796,485.92
ABBVIE INC	125,153	95.89	12,000,921.17
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	67.47	1,708,542.81
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	116.37	2,063,123.73
ALKERMES PLC	12,547	48.05	602,883.35
ALLERGAN PLC	26,330	173.00	4,555,090.00
AMGEN	57,810	174.00	10,058,940.00
BIOGEN INC	16,758	309.96	5,194,309.68
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	82.40	1,181,698.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	129,430	61.99	8,023,365.70
CELGENE CORP	61,297	102.46	6,280,490.62
GILEAD SCIENCES INC	102,643	73.02	7,494,991.86
ILLUMINA INC	11,395	209.61	2,388,505.95
INCYTE CORP	14,121	102.99	1,454,321.79
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	135.31	672,626.01
JOHNSON & JOHNSON	212,084	140.35	29,765,989.40
LILLY (ELI) & CO	77,966	83.99	6,548,364.34
MALLINCKRODT PLC	9,552	22.20	212,054.40
MERCK & CO	215,091	56.21	12,090,265.11
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	626.82	1,257,400.92

MYLAN NV	36,548	38.08	1,391,747.84
PERRIGO CO PLC	9,792	87.99	861,598.08
PFIZER	469,558	35.20	16,528,441.60
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,874	103.51	1,125,567.74
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,112	406.21	2,482,755.52
SEATTLE GENETICS INC	7,471	57.91	432,645.61
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	117.68	171,577.44
TESARO INC	2,771	91.01	252,188.71
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	11.85	851,730.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,706	191.89	5,892,174.34
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	121.23	393,633.81
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	148.17	2,946,212.28
WATERS CORP	6,513	194.97	1,269,839.61
ZOETIS INC	38,334	69.30	2,656,546.20
BANK OF AMERICA CORP	782,115	26.49	20,718,226.35
BB&T CORP	64,293	46.75	3,005,697.75
CIT GROUP INC	10,713	45.08	482,942.04
CITIGROUP	216,295	72.43	15,666,246.85
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	36.81	1,472,768.10
COMERICA INC	14,625	75.28	1,100,970.00
EAST WEST BANCORP INC	10,794	56.77	612,775.38
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	28.01	1,630,658.17
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	90.99	1,144,472.22
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	13.21	1,154,791.78
JPMORGAN CHASE & CO	279,283	97.63	27,266,399.29
KEY CORP	87,033	17.85	1,553,539.05
M & T BANK CORP	10,792	158.61	1,711,719.12
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	12.00	469,140.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	17.76	486,339.84
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	132.55	5,023,512.45
REGIONS FINL CORP	96,209	15.28	1,470,073.52
SIGNATURE BANK	4,354	124.37	541,506.98
SUNTRUST BANKS	38,353	56.80	2,178,450.40
SVB FINANCIAL GROUP	3,954	208.23	823,341.42
US BANCORP	132,158	52.11	6,886,753.38
WELLS FARGO & CO	373,086	54.00	20,146,644.00
ZIONS BANCORPORATION	15,186	43.97	667,728.42
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	185.11	820,592.63
ALLY FINANCIAL INC	36,028	25.50	918,714.00
AMERICAN EXPRESS	60,354	93.75	5,658,187.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	159.05	1,884,742.50
BANK NEW YORK CO	81,361	50.82	4,134,766.02



BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	98,049	184.49	18,089,060.01
BLACKROCK INC	9,490	466.60	4,428,034.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	88.11	3,372,410.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,588	114.13	866,018.44
CME GROUP INC	27,024	138.04	3,730,392.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	65.47	1,935,620.55
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	43.08	909,332.64
EATON VANCE CORP	10,061	50.65	509,589.65
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	41.33	1,077,473.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,776	240.79	6,688,183.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,132	66.20	3,120,138.40
INVESCO LTD	30,943	35.50	1,098,476.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	26.06	669,898.36
MOODY'S CORP	13,385	143.09	1,915,259.65
MORGAN STANLEY	108,682	48.82	5,305,855.24
MSCI INC	6,934	127.88	886,719.92
NASDAQ INC	9,070	73.73	668,731.10
NAVIENT CORP	23,616	12.14	286,698.24
NORTHERN TRUST CORP	17,320	92.16	1,596,211.20
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	92.72	1,760,938.24
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	83.61	830,414.52
S&P GLOBAL INC	20,491	157.91	3,235,733.81
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	44.00	4,190,956.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	64.73	699,213.46
STATE STREET CORP	29,345	90.77	2,663,645.65
SYNCHRONY FINANCIAL	65,163	32.09	2,091,080.67
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,297	48.38	981,968.86
VOYA FINANCIAL INC	14,081	41.33	581,967.73
AFLAC	30,947	84.08	2,602,023.76
ALLEGHANY CORP	1,276	585.54	747,149.04
ALLSTATE CORP	28,446	98.95	2,814,731.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	105.36	584,642.64
AMERICAN INT'L GROUP	72,177	62.24	4,492,296.48
AON PLC	20,775	143.46	2,980,381.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	95.91	968,882.82
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	63.65	952,967.80
ASSURANT INC	4,769	98.71	470,747.99
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,893	48.77	433,711.61
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	53.92	393,723.84
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	56.50	383,974.00
CHUBB LTD	36,582	151.64	5,547,294.48
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	73.10	907,390.30
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	230.79	773,838.87

FNF GROUP	20,786	38.76	805,665.36
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	55.25	1,583,575.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	74.33	1,322,330.70
LOEWS CORP	22,051	49.34	1,087,996.34
MARKEL CORP	1,132	1,076.52	1,218,620.64
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	82.93	3,386,695.34
METLIFE INC	71,520	52.81	3,776,971.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	68.42	1,584,265.10
PROGRESSIVE CORP	46,702	50.64	2,364,989.28
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	111.95	3,755,474.70
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	151.02	820,189.62
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	138.66	450,506.34
TORCHMARK CORP	8,473	84.50	715,968.50
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	134.53	2,934,233.83
UNUM GROUP	18,574	52.53	975,692.22
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,962	161.50	1,608,863.00
WR BERKLEY CORP	7,296	68.67	501,016.32
XL GROUP LTD	20,644	40.14	828,650.16
CBRE GROUP INC-A	24,306	40.81	991,927.86
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.32	722,484.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	145.25	533,503.25
WEYERHAEUSER CO	58,857	36.27	2,134,743.39
ACCENTURE PLC-CL A	48,671	143.83	7,000,349.93
ACTIVISION BLIZZARD INC	56,005	63.31	3,545,676.55
ADOBE SYSTEMS INC	38,830	181.92	7,063,953.60
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	53.85	763,485.30
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	227.91	915,286.56
ALPHABET INC-CL A	23,417	1,047.72	24,534,459.24
ALPHABET INC-CL C	24,569	1,031.26	25,337,026.94
ANSYS INC	6,865	150.47	1,032,976.55
AUTODESK INC	15,592	122.40	1,908,460.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,479	111.97	3,972,583.63
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	87.83	847,559.50
CA INC	26,520	32.26	855,535.20
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	43.55	940,026.75
CDK GLOBAL INC	10,687	63.59	679,586.33
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	103.63	1,119,307.63
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	84.03	1,051,299.33
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,074	73.94	3,406,711.56
COSTAR GROUP INC	2,453	299.29	734,158.37
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	81.88	1,295,914.76
DXC TECHNOLOGY CO	22,050	94.63	2,086,591.50

EBAY	81,500	35.69	2,908,735.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,208	111.89	2,708,633.12
FACEBOOK INC-A	186,097	179.30	33,367,192.10
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	25,779	92.52	2,385,073.08
FIRST DATA CORP- CLASS A	29,535	16.75	494,711.25
FISERV INC	16,892	128.88	2,177,040.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	177.00	1,267,851.00
FORTINET INC	10,871	39.49	429,295.79
GARTNER INC	7,002	117.34	821,614.68
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	99.32	1,242,791.16
INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,133	150.30	10,540,989.90
INTUIT INC	19,275	152.41	2,937,702.75
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	113.96	681,366.84
LEIDOS HOLDINGS	10,999	61.65	678,088.35
MASTERCARD INC-CLASS A	74,542	149.29	11,128,375.18
MERCADOLIBRE INC	3,264	266.41	869,562.24
MICROSOFT CORP	577,311	84.09	48,546,081.99
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,427	14.99	351,170.73
ORACLE CORP	242,564	49.24	11,943,851.36
PAYCHEX INC	25,506	64.76	1,651,768.56
PAYPAL HOLDINGS INC	89,558	74.10	6,636,247.80
RED HAT INC	13,963	123.50	1,724,430.50
SABRE CORP	17,243	18.79	323,995.97
SALESFORCE.COM INC	53,057	103.60	5,496,705.20
SERVICENOW INC	13,794	125.55	1,731,836.70
SPLUNK INC	10,741	70.78	760,247.98
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	40.01	529,692.39
SYMANTEC CORP	48,508	28.59	1,386,843.72
SYNOPSYS INC	12,264	86.90	1,065,741.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	72.23	910,820.30
TWITTER INC	47,756	19.90	950,344.40
VANTIV INC - CL A	12,864	68.77	884,657.28
VERISIGN INC	7,289	109.42	797,562.38
VISA INC-CLASS A SHARES	145,185	112.14	16,281,045.90
VMWARE INC-CLASS A	5,821	120.97	704,166.37
WESTERN UNION CO	38,757	20.08	778,240.56
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	106.15	1,134,849.65
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	40.38	314,398.68
AMPHENOL CORPORATION	24,215	86.72	2,099,924.80
APPLE INC	410,453	175.88	72,190,473.64
ARISTA NETWORKS INC	3,532	213.55	754,258.60
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	78.59	523,880.94
AVNET INC	10,936	39.44	431,315.84

CDW CORP/DE	12,482	67.16	838,291.12
CISCO SYSTEMS	393,079	34.05	13,384,339.95
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	34.05	508,468.65
CORNING	71,752	31.79	2,280,996.08
F5 NETWORKS INC	5,350	120.96	647,136.00
FLEX LTD	40,465	18.31	740,914.15
FLIR SYSTEMS INC	11,686	46.34	541,529.24
HARRIS CORP	9,931	137.56	1,366,108.36
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	132,071	13.72	1,812,014.12
HP INC	135,166	21.34	2,884,442.44
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	25.35	793,556.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	91.61	1,156,118.20
NETAPP INC	20,821	46.30	964,012.30
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	139.00	1,002,329.00
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	37.41	854,294.76
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	92.92	2,602,596.28
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	40.56	836,428.32
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	87.63	2,066,052.51
XEROX CORP	16,718	29.27	489,335.86
AT&T INC	482,995	34.00	16,421,830.00
CENTURYLINK INC	73,994	15.48	1,145,427.12
SPRINT CORP	64,825	6.17	399,970.25
T-MOBILE US INC	22,516	56.00	1,260,896.00
VERIZON COMMUNICATIONS	320,438	45.07	14,442,140.66
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.02	520,131.78
AES CORP	52,646	10.30	542,253.80
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	44.10	849,189.60
AMEREN CORPORATION	18,723	62.82	1,176,178.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	75.49	2,934,447.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	89.31	1,275,614.73
ATMOS ENERGY CORP	8,018	89.79	719,936.22
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	29.81	937,256.21
CMS ENERGY CORP	21,593	49.28	1,064,103.04
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	87.66	2,098,755.72
DOMINION ENERGY INC	50,217	81.24	4,079,629.08
DTE ENERGY COMPANY	14,355	113.22	1,625,273.10
DUKE ENERGY CORP	54,806	89.63	4,912,261.78
EDISON INTL	26,184	80.34	2,103,622.56
ENTERGY CORP	13,854	86.42	1,197,262.68
EVERSOURCE ENERGY	25,381	64.68	1,641,643.08
EXELON CORP	73,029	41.14	3,004,413.06
FIRSTENERGY CORP	35,696	33.60	1,199,385.60

	NEXTERA ENERGY INC	36,685	155.25	5,695,346.25	
	NISOURCE INC	26,021	27.52	716,097.92	
	OGE ENERGY CORP	15,686	35.53	557,323.58	
	PG&E CORP	41,241	55.95	2,307,433.95	
	PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	89.39	841,696.24	
	PPL CORPORATION	53,473	36.76	1,965,667.48	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	50.27	2,041,263.62	
	SCANA CORP	11,459	44.60	511,071.40	
	SEMPRA ENERGY	18,704	121.38	2,270,291.52	
	SOUTHERN CO	77,804	52.01	4,046,586.04	
	UGI CORP	13,950	47.98	669,321.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	25,287	68.23	1,725,332.01	
	WESTAR ENERGY INC	11,492	54.52	626,543.84	
	XCEL ENERGY INC	40,763	50.51	2,058,939.13	
	ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	11.12	672,348.56	
	ANALOG DEVICES	28,935	89.70	2,595,469.50	
	APPLIED MATERIALS	84,218	55.48	4,672,414.64	
	BROADCOM LTD	31,522	265.64	8,373,504.08	
	INTEL CORP	370,336	46.30	17,146,556.80	
	KLA-TENCOR CORP	12,266	102.40	1,256,038.40	
	LAM RESEARCH CORP	12,814	206.29	2,643,400.06	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,459	20.13	613,139.67	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	53.81	1,174,618.49	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	90.81	1,691,245.44	
	MICRON TECHNOLOGY	82,240	43.50	3,577,440.00	
	NVIDIA CORP	46,747	205.32	9,598,094.04	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	115.31	3,146,002.73	
	QORVO INC	10,609	79.47	843,097.23	
	QUALCOMM	115,987	64.60	7,492,760.20	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	111.12	1,612,351.20	
	TEXAS INSTRUMENTS	78,226	97.05	7,591,833.30	
	XILINX INC	20,299	70.76	1,436,357.24	
	アメリカドル 小計	24,184,268		1,775,977,086.89	(201,378,041,882)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	29.79	354,083.94	
	ARC RESOURCES LTD	27,117	17.77	481,869.09	
	CAMECO CORP	28,709	11.84	339,914.56	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,413	46.19	4,129,986.47	
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	14.44	1,123,475.32	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	11.08	479,143.52	
	ENBRIDGE	127,899	46.48	5,944,745.52	
	ENCANA CORP	76,271	16.10	1,227,963.10	

HUSKY ENERGY INC	31,439	16.93	532,262.27
IMPERIAL OIL	24,763	40.58	1,004,882.54
INTER PIPELINE LTD	30,317	27.04	819,771.68
KEYERA CORP	14,929	38.09	568,645.61
PEMBINA PIPELINE CORP	37,784	45.75	1,728,618.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	18.86	238,258.38
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	34.95	641,332.50
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	20.52	410,605.20
SUNCOR ENERGY	130,278	45.82	5,969,337.96
TOURMALINE OIL CORP	19,965	26.83	535,660.95
TRANSCANADA CORP	69,465	61.75	4,289,463.75
VERMILION ENERGY INC	10,067	48.13	484,524.71
AGNICO EAGLE MINES	17,661	57.47	1,014,977.67
AGRIUM INC	10,925	136.01	1,485,909.25
BARRICK GOLD CORP	94,395	17.89	1,688,726.55
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	56.44	592,620.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	16.17	920,073.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	107.00	1,525,499.00
GOLDCORP INC	68,688	16.97	1,165,635.36
KINROSS GOLD CORP	107,615	5.53	595,110.95
METHANEX CORP	7,099	66.23	470,166.77
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	67,665	24.28	1,642,906.20
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	27.18	1,241,500.86
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.96	281,160.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	81.64	353,256.28
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	26.72	984,311.36
YAMANA GOLD INC	85,214	3.42	291,431.88
BOMBARDIER B	157,835	3.03	478,240.05
CAE INC	18,372	22.88	420,351.36
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	31.16	366,566.24
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	57.03	839,082.39
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,879	102.20	6,017,433.80
CP RAILWAY LIMITED	11,263	223.45	2,516,717.35
LINAMAR CORP	3,889	65.99	256,635.11
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	67.05	1,875,924.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	37.98	670,688.82
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	82.32	1,512,383.04
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	28.84	1,036,711.48
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	162.42	878,529.78
DOLLARAMA INC	9,011	144.45	1,301,638.95
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	64.21	2,187,185.23
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	24.86	285,865.14

	JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	24.51	135,148.14
	LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	68.05	1,248,921.65
	METRO INC	19,179	41.54	796,695.66
	WESTON (GEORGE) LTD	4,775	110.32	526,778.00
	SAPUTO INC	15,941	43.99	701,244.59
	BANK MONTREAL	50,677	98.61	4,997,258.97
	BANK NOVA SCOTIA	93,824	83.59	7,842,748.16
	CANADIAN IMPERIAL BANK	33,314	114.12	3,801,793.68
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	62.60	1,763,003.80
	ROYAL BANK OF CANADA	114,007	100.69	11,479,364.83
	TORONTO-DOMINION BANK	144,182	72.98	10,522,402.36
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,829	53.28	3,667,209.12
	CI FINANCIAL CORP	18,671	28.28	528,015.88
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	9.70	281,164.20
	IGM FINANCIAL INC	7,685	44.70	343,519.50
	ONEX CORP	6,603	94.28	622,530.84
	THOMSON REUTERS CORP	22,284	56.57	1,260,605.88
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	694.22	1,600,177.10
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	35.12	835,434.56
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	60.98	501,865.40
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	103.29	1,081,033.14
	MANULIFE FINANCIAL CORP	153,175	27.47	4,207,717.25
	POWER CORP OF CANADA	29,774	33.02	983,137.48
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	35.99	746,432.60
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	49.65	2,459,462.40
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.02	262,014.30
	CGI GROUP INC - CL A	17,309	66.93	1,158,491.37
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	723.29	1,102,293.96
	OPEN TEXT CORP	19,994	41.60	831,750.40
	SHOPIFY INC - CLASS A	6,105	123.09	751,464.45
	BCE INC	12,539	60.80	762,371.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	66.55	1,922,030.55
	TELUS CORP	16,454	47.52	781,894.08
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	46.35	242,920.35
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.68	399,332.32
	EMERA INC	4,086	48.47	198,048.42
	FORTIS INC	34,128	48.13	1,642,580.64
	HYDRO ONE LTD	21,742	22.98	499,631.16
	カナダドル 小計	3,207,549		139,690,272.23 (12,498,088,656)
ユーロ	ENAGAS	18,299	24.13	441,646.36
	ENI	202,686	14.51	2,940,973.86

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	16.34	651,626.11
NESTE OIL OYJ	9,229	48.51	447,698.79
OMV AG	12,139	52.63	638,875.57
REPSOL SA	95,819	15.84	1,518,252.05
SAIPEM SPA	59,023	3.86	227,946.82
SNAM SPA	173,485	4.38	760,211.27
TENARIS SA	40,648	12.91	524,765.68
TOTAL SA	184,716	48.56	8,970,732.54
VOPAK	6,360	36.02	229,087.20
AIR LIQUIDE	34,122	106.70	3,640,817.40
AKZO NOBEL	19,791	78.57	1,554,978.87
ARCELORMITTAL	53,985	24.32	1,312,915.20
ARKEMA	5,896	106.45	627,629.20
BASF SE	71,827	95.14	6,833,620.78
COVESTRO AG	9,162	81.78	749,268.36
CRH PLC	67,624	30.80	2,082,819.20
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	32.20	433,286.07
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	46.71	269,143.02
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	90.40	1,031,192.80
IMERYS SA	3,000	78.08	234,240.00
K+S AG	14,355	21.36	306,694.57
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	75.66	1,045,015.92
LANXESS	7,293	67.70	493,736.10
LINDE AG	14,602	190.50	2,781,681.00
SOLVAY SA	5,511	124.50	686,119.50
STORA ENSO OYJ R	40,237	13.28	534,347.36
SYMRISE AG	9,083	69.52	631,450.16
THYSSEN KRUPP	29,964	22.68	679,733.34
UMICORE	13,905	37.94	527,555.70
UPM KYMMENE OYJ	40,376	25.66	1,036,048.16
VOESTALPINE AG	8,140	48.70	396,418.00
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,813	33.54	664,528.02
AIRBUS SE	46,178	84.07	3,882,184.46
ALSTOM	11,216	34.37	385,493.92
ANDRITZ AG	5,242	46.57	244,146.15
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	30.60	255,153.88
BOUYGUES ORD	16,815	40.75	685,295.32
BRENNTAG AG	13,290	51.99	690,947.10
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	11.03	845,482.59
DASSAULT AVIATION SA	213	1,327.25	282,704.25
EIFFAGE	6,079	91.50	556,228.50
FERROVIAL SA	36,974	18.26	675,330.11



GEA GROUP AG	13,382	40.46	541,435.72
HOCHTIEF AG	1,354	149.45	202,355.30
KION GROUP AG	5,887	67.23	395,783.01
KONE OYJ-B	26,924	44.95	1,210,233.80
LEGRAND SA	21,312	62.42	1,330,295.04
LEONARDO SPA	35,425	14.11	499,846.75
MAN SE	3,262	94.93	309,661.66
METSO OYJ	9,561	30.92	295,626.12
OSRAM LICHT AG	6,216	68.78	427,536.48
PRYSMIAN SPA	14,715	28.01	412,167.15
REXEL SA	24,339	15.31	372,751.78
SAFRAN SA	24,141	86.91	2,098,094.31
SAINT-GOBAIN	39,044	48.58	1,896,757.52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	71.80	3,217,645.20
SIEMENS	59,846	118.70	7,103,720.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	10.88	190,302.08
THALES SA	8,109	89.75	727,782.75
VINCI S.A.	40,049	85.13	3,409,371.37
WARTSILA OYJ	11,462	55.25	633,275.50
ZODIAC AEROSPACE	17,832	24.77	441,787.80
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.29	435,947.82
EDENRED	18,941	24.52	464,433.32
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	50.74	486,495.12
RELX NV	73,802	19.16	1,414,046.32
SOCIETE BIC SA	2,424	88.81	215,275.44
WOLTERS KLUWER	23,031	42.44	977,550.79
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	53,260	18.45	982,647.00
ADP	2,382	152.00	362,064.00
AENA SME SA	5,610	162.85	913,588.50
ATLANTIA SPA	37,004	27.50	1,017,610.00
BOLLORE	61,805	4.00	247,529.02
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	26.48	448,279.92
DEUTSCHE POST AG-REG	75,335	39.28	2,959,535.47
FRAPORT AG	3,561	81.93	291,752.73
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	10.96	399,798.88
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	6.72	311,742.63
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,678	86.93	2,319,118.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.77	378,168.07
CONTINENTAL AG	8,828	215.90	1,905,965.20
DAIMLER AG	74,980	70.94	5,319,081.20
FERRARI NV	9,947	94.35	938,499.45
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	14.68	1,270,451.24

MICHELIN	13,802	122.25	1,687,294.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	37.45	385,435.40
PEUGEOT SA	40,815	19.68	803,443.27
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	62.35	801,758.65
RENAULT SA	13,675	86.20	1,178,785.00
SCHAEFFLER AG	15,247	14.84	226,265.48
VALEO SA	19,350	59.33	1,148,035.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	157.30	2,324,894.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	161.20	418,152.80
ADIDAS AG	14,964	175.50	2,626,182.00
HERMES INTERNATIONAL	2,561	448.50	1,148,608.50
HUGO BOSS AG	4,852	67.76	328,771.52
KERING	6,060	389.10	2,357,946.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	47.83	637,047.77
LVMH	21,748	249.90	5,434,825.20
SEB SA	2,075	154.95	321,521.25
ACCOR	14,931	41.61	621,353.56
PADDY POWER PLC	6,543	96.62	632,184.66
SODEXO	7,035	107.30	754,855.50
ALTICE NV -A	38,810	10.66	413,714.60
ALTICE NV -B	5,879	10.60	62,317.40
AXEL SPRINGER SE	3,827	59.82	228,931.14
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	21.40	256,346.28
JC DECAUX SA	4,674	34.05	159,173.07
LAGADERE S.C.A	9,057	28.34	256,720.66
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	25.74	493,538.76
PUBLICIS GROUPE	15,618	54.60	852,742.80
RTL GROUP	3,513	63.71	223,844.84
SES	31,369	13.01	408,267.53
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	58.25	291,133.50
VIVENDI	83,098	20.94	1,740,487.61
INDITEX	86,470	29.73	2,570,753.10
ZALANDO SE	9,155	41.11	376,407.82
CARREFOUR	43,442	17.78	772,615.97
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	49.17	181,289.79
COLRUYT SA	4,160	44.64	185,702.40
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.15	191,926.74
JERONIMO MARTINS	20,234	16.04	324,654.53
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	17.24	1,733,223.40
METRO AG	13,712	16.53	226,659.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	59,539	101.50	6,043,208.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	34.22	584,340.72

DANONE (GROUPE)	46,629	69.47	3,239,316.63
HEINEKEN HOLDING NV	7,650	81.08	620,262.00
HEINEKEN NV	18,465	85.31	1,575,249.15
KERRY GROUP PLC-A	12,346	86.60	1,069,163.60
PERNOD-RICARD	17,080	128.35	2,192,218.00
REMY COINTREAU	1,575	110.35	173,801.25
BEIERSDORF AG	7,693	97.82	752,529.26
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	109.50	943,671.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	120.95	1,731,278.30
LOREAL	19,570	188.10	3,681,117.00
UNILEVER NV-CVA	127,303	49.15	6,257,578.96
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	105.60	1,711,036.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	83.66	1,467,396.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	32,066	69.27	2,221,211.82
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	34.20	2,546,532.00
BAYER	64,692	110.70	7,161,404.40
EUROFINS SCIENTIFIC	971	512.00	497,152.00
GRIFOLS SA	22,128	25.69	568,578.96
IPSEN	2,722	101.80	277,099.60
MERCK KGAA	10,480	91.51	959,024.80
ORION OYJ-CLASS B	7,975	33.65	268,358.75
QIAGEN N.V.	17,548	27.06	474,936.62
RECORDATI SPA	7,493	38.92	291,627.56
SANOFI	88,672	77.79	6,897,794.88
UCB (GROUPE)	10,465	60.92	637,527.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	30,932	25.13	777,475.82
BANCO BILBAO VIZCAYA	520,674	7.17	3,735,835.95
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.65	734,872.29
BANCO SANTANDER SA	1,268,017	5.55	7,047,638.48
BANKIA SA	78,000	3.90	304,902.00
BANKINTER SA	58,881	7.68	452,206.08
BNP PARIBAS	87,969	64.62	5,684,556.78
CAIXABANK	277,342	3.88	1,078,583.03
COMMERZBANK AG	80,494	12.00	965,928.00
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	14.17	1,315,921.95
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	36.42	841,708.90
ING GROEP NV-CVA	304,071	15.60	4,743,507.60
INTESA SANPAOLO	1,004,854	2.84	2,861,824.19
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.68	174,460.00
KBC GROEP NV	20,232	71.13	1,439,102.16
MEDIOBANCA	41,923	9.88	414,408.85
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	29.21	364,895.35

SOCIETE GENERALE	61,696	43.90	2,708,454.40
UNICREDIT SPA	155,580	16.59	2,581,072.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	167,110	14.99	2,504,978.90
DEUTSCHE BOERSE	15,552	91.13	1,417,253.76
EURAZEO SA	3,046	78.88	240,268.48
EXOR NV	7,813	53.80	420,339.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	91.93	574,286.71
NATIXIS	69,996	6.61	463,023.54
WENDEL	2,023	140.20	283,624.60
AEGON	133,499	5.32	710,882.17
AGEAS	16,065	40.45	649,909.57
ALLIANZ SE-REG	35,877	200.30	7,186,163.10
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	15.53	1,578,608.97
AXA	151,617	25.29	3,835,152.01
CNP ASSURANCES	11,830	19.85	234,825.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	109.95	517,424.70
MAPFRE SA	90,939	2.73	248,445.34
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,028	197.30	2,373,124.40
NN GROUP NV	25,728	35.32	908,712.96
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.17	284,266.12
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	45.16	1,635,379.08
SCOR SE	13,354	35.69	476,604.26
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.87	178,655.32
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	37.35	1,029,242.31
VONOVIA SE	37,270	39.11	1,457,816.05
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	60.12	2,116,825.20
ATOS SE	7,634	127.00	969,518.00
CAPGEMINI SA	12,238	100.35	1,228,083.30
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	89.79	940,011.51
GEMALTO	6,158	34.15	210,326.49
SAP SE	76,896	96.78	7,441,994.88
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	52.65	500,859.45
INGENICO GROUP	4,681	79.07	370,126.67
NOKIA OYJ	458,694	4.26	1,957,705.99
DEUTSCHE TELEKOM	254,794	15.08	3,842,293.52
ELISA A	12,839	34.11	437,938.29
ILIAD SA	2,053	208.50	428,050.50
KPN (KON.)	261,596	2.95	771,708.20
ORANGE	156,887	14.29	2,242,699.66
PROXIMUS	13,141	28.79	378,395.09
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.72	617,673.92
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.59	278,562.09

	TELEFONICA	359,839	8.67	3,120,163.96
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.26	285,681.22
	E.ON SE	178,193	10.41	1,854,989.13
	ELECTRICITE DE FRANCE	40,498	12.34	499,947.81
	ENDESA	24,774	19.12	473,678.88
	ENEL	632,101	5.33	3,372,258.83
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.98	575,861.16
	ENGIE	137,841	14.88	2,051,074.08
	FORTUM OYJ	32,675	18.40	601,220.00
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	18.14	472,386.93
	IBERDROLA SA	445,028	6.66	2,966,111.62
	INNOGY SE	11,000	41.70	458,700.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.28	601,082.96
	RWE STAMM	42,828	23.05	987,185.40
	SUEZ	28,043	15.49	434,386.07
	TERNA SPA	105,905	5.26	557,589.82
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	21.01	773,751.28
	ASML HOLDING NV	29,106	153.45	4,466,315.70
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	23.27	2,112,043.32
	STMICROELECTRONICS	48,144	19.98	961,917.12
	ユーロ 小計	15,174,400		314,610,719.41 (41,560,076,034)
イギリスポンド	BP PLC	1,540,944	5.14	7,929,697.82
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	350,631	24.55	8,609,744.20
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	293,127	24.90	7,298,862.30
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	7.27	392,580.00
	ANGLO AMERICAN PLC	102,395	14.84	1,519,541.80
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.77	350,313.12
	BHP BILLTON PLC	168,203	14.29	2,404,461.88
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	42.25	432,766.75
	FRESNILLO PLC	17,743	13.23	234,739.89
	GLENCORE PLC	952,174	3.63	3,456,391.62
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	34.07	480,761.77
	MONDI PLC	27,192	18.03	490,271.76
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	69.50	506,933.00
	RIO TINTO PLC REG	96,058	36.78	3,533,013.24
	ASHTREAD GROUP PLC	37,298	19.26	718,359.48
	BAE SYSTEMS PLC	256,884	5.64	1,448,825.76
	BUNZL PLC	27,712	23.08	639,592.96
	COBHAM PLC	197,992	1.33	264,715.30
	DCC PLC	7,320	74.20	543,144.00
	FERGUSON PLC	20,276	53.15	1,077,669.40

IMI PLC	23,923	12.62	301,908.26
MEGGITT PLC	66,268	4.97	329,418.22
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	9.39	1,256,504.07
SMITHS GROUP PLC	28,628	15.20	435,145.60
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	15.37	285,190.35
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	19.81	368,188.66
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.18	161,187.20
CAPITA GROUP PLC	53,334	5.03	268,536.69
EXPERIAN PLC	76,879	16.29	1,252,358.91
G4S PLC	132,555	2.59	344,510.44
INTERTEK GROUP PLC	12,430	53.50	665,005.00
RELX PLC	82,063	17.27	1,417,228.01
EASYJET PLC	11,633	12.70	147,739.10
ROYAL MAIL PLC	75,133	3.83	287,759.39
NEW GKN	148,431	3.21	477,354.09
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	6.12	437,286.24
BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.87	631,311.36
PERSIMMON PLC	22,676	26.62	603,635.12
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.91	518,732.53
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	35.88	380,292.12
CARNIVAL PLC	13,721	49.50	679,189.50
COMPASS GROUP PLC	127,044	16.38	2,080,980.72
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	42.98	600,172.72
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.78	246,461.02
TUI AG-DI	31,155	13.20	411,246.00
WHITBREAD PLC	14,664	35.96	527,317.44
ITV PLC	295,435	1.56	462,060.34
PEARSON	66,305	6.95	461,151.27
SKY PLC	83,042	9.20	763,986.40
WPP PLC	98,371	12.95	1,273,904.45
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	1.54	128,855.52
KINGFISHER PLC	187,310	3.09	580,286.38
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.25	439,875.27
NEXT PLC	11,202	43.69	489,415.38
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.17	364,999.37
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.29	339,983.82
TESCO	656,079	1.76	1,159,947.67
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	31.12	897,656.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	180,173	49.50	8,919,464.36
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	25.93	362,994.07
DIAGEO	196,556	25.70	5,052,471.98
IMPERIAL BRANDS PLC	76,724	31.54	2,419,874.96

TATE & LYLE	40,576	7.02	284,843.52
RECKITT BENCKISER PLC	51,949	65.38	3,396,425.62
UNILEVER PLC	99,877	42.62	4,256,757.74
CONVATEC GROUP PLC	112,565	1.89	212,747.85
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	6.11	183,464.97
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.60	965,967.20
ASTRAZENECA	98,816	49.62	4,903,249.92
GLAXOSMITHKLINE	384,044	13.46	5,171,152.46
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	9.98	121,886.89
SHIRE PLC	72,022	35.47	2,554,620.34
BARCLAYS	1,365,547	1.79	2,450,474.09
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,577,916	7.42	11,712,870.46
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,608,978	0.66	3,740,066.53
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.73	808,849.18
STANDARD CHARTERED PLC	258,738	7.32	1,895,514.58
3I GROUP PLC	79,251	9.40	744,959.40
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	15.83	324,024.27
INVESTEC PLC	54,280	5.18	281,170.40
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,018	37.33	896,591.94
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	8.59	95,469.26
SCHRODERS PLC	8,614	34.42	296,493.88
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.46	512,835.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	4.13	913,279.29
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	18.54	301,367.70
AVIVA PIC	318,261	4.95	1,575,710.21
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.57	406,189.98
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.65	1,289,758.28
OLD MUTUAL PLC	397,509	1.91	762,422.26
PRUDENTIAL	202,092	18.38	3,715,461.42
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.12	530,045.25
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.35	268,113.51
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	26.35	923,198.60
SAGE GROUP PLC	89,321	7.50	669,907.50
WORLDPAY GROUP PLC	157,060	4.02	632,323.56
BT GROUP PLC	663,615	2.49	1,652,401.35
INMARSAT PLC	33,632	5.17	173,877.44
VODAFONE GROUP PLC	2,076,853	2.21	4,606,459.95
CENTRICA PLC	440,558	1.68	740,577.99
NATIONAL GRID PLC	275,549	9.04	2,491,514.05
SEVERN TRENT PLC	18,112	21.75	393,936.00
SSE PLC	80,824	13.94	1,126,686.56
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.40	494,676.00

	イギリスポンド 小計	24,397,369		151,042,314.85 (22,509,836,182)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	648.50	435,792.00	
	GIVAUDAN-REG	740	2,240.00	1,657,600.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	57.40	2,101,069.60	
	SIKA AG-BR	175	7,290.00	1,275,750.00	
	ABB LTD	154,962	25.60	3,967,027.20	
	GEBERIT AG-REG	3,021	434.70	1,313,228.70	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	215.50	405,355.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	221.50	662,063.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	76.00	1,005,024.00	
	SGS SA	437	2,425.00	1,059,725.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	170.60	676,429.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	90.25	3,744,923.75	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	372.50	924,917.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	71.90	283,142.20	
	DUFREY AG-REG	2,548	141.40	360,287.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,580.00	328,640.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	66,550.00	532,400.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,575.00	418,125.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	244,267	83.60	20,420,721.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	174.40	722,016.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	697	689.00	480,233.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	258.40	1,487,608.80	
	NOVARTIS	174,408	81.80	14,266,574.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,064	228.90	12,604,149.60	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	127.90	460,567.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	188,727	15.95	3,010,195.65	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	58.50	1,099,975.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	82.60	280,592.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,299	658.50	855,391.50	
	UBS GROUP AG	286,036	16.86	4,822,566.96	
BALOISE HOLDING AG	3,877	157.50	610,627.50		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	345.40	848,302.40		
SWISS RE LTD	25,692	93.30	2,397,063.60		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,137	303.40	3,682,365.80		
SWISS PRIME SITE-REG	6,277	85.85	538,880.45		
SWISSCOM	2,064	505.50	1,043,352.00		
	スイスフラン 小計	1,308,124		90,782,684.61 (10,357,396,487)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	212.40	3,014,168.40	
	BOLIDEN AB	20,141	294.40	5,929,510.40	



	ALFA LAVAL AB	25,732	204.20	5,254,474.40	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	170.80	13,714,386.00	
	ATLAS COPCO A	53,833	363.30	19,557,528.90	
	ATLAS COPCO B	29,972	328.20	9,836,810.40	
	SANDVIK AB	87,313	148.10	12,931,055.30	
	SKANSKA B	28,530	183.50	5,235,255.00	
	SKF AB-B	28,335	182.90	5,182,471.50	
	VOLVO B	123,214	163.50	20,145,489.00	
	SECURITAS B	22,844	143.00	3,266,692.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	293.40	5,331,078.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	79.75	3,087,282.00	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	203.90	15,080,851.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	310.60	1,779,738.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	318.80	4,829,501.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	245.00	11,899,895.00	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	158.90	2,517,770.50	
	NORDEA BANK AB	244,135	99.10	24,193,778.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	103.30	12,652,597.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	119.90	14,409,222.30	
	SWEDBANK AB-A	71,353	206.00	14,698,718.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	210.50	2,692,716.00	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	404.20	14,855,158.40	
	KINNEVIK AB - B	18,104	270.10	4,889,890.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	637.50	2,320,500.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	50.70	12,582,168.30	
	HEXAGON AB-B SHS	21,517	411.50	8,854,245.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	538.00	3,332,372.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,524	105.90	3,550,191.60	
	TELIA CO AB	199,107	37.90	7,546,155.30	
	スウェーデンクローナ 小計	1,868,487		275,171,671.30 (3,728,576,146)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	92,696	169.80	15,739,780.80	
	NORSK HYDRO	106,150	60.90	6,464,535.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	374.60	5,045,862.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	232.50	1,620,757.50	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	253.40	1,519,133.00	
	MARINE HARVEST	32,238	154.20	4,971,099.60	
	ORKLA	70,520	80.05	5,645,126.00	
	DNB ASA	80,217	158.60	12,722,416.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	149.70	2,780,527.80	
	TELENOR ASA	60,821	173.50	10,552,443.50	
		487,652		67,061,681.40	

ノルウェークローネ 小計				(935,510,455)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	562.50	4,163,062.50
	NOVOZYMES A/S	17,687	342.90	6,064,872.30
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	426.60	7,559,352.00
	ISS A/S	14,253	245.90	3,504,812.70
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	10,870.00	3,250,130.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	11,200.00	5,689,600.00
	DSV A/S	14,599	493.40	7,203,146.60
	PANDORA A/S	8,431	590.50	4,978,505.50
	CARLSBERG AS-B	8,236	747.50	6,156,410.00
	COLOPLAST-B	10,121	504.50	5,106,044.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	179.50	1,331,890.00
	GENMAB A/S	4,512	1,181.00	5,328,672.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	345.70	1,683,904.70
	NOVO NORDISK A/S-B	145,701	314.70	45,852,104.70
	DANSKE BANK A/S	60,834	245.20	14,916,496.80
	TRYG A/S	9,828	152.80	1,501,718.40
	TDC A/S	72,376	36.72	2,657,646.72
ORSTED A/S	13,830	337.00	4,660,710.00	
デンマーククローネ 小計		418,627		131,609,079.42 (2,336,061,159)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	34.55	712,731.95
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.50	890,857.50
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	8.39	1,125,954.78
	SANTOS	156,437	4.65	727,432.05
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	32.91	1,996,649.70
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.33	397,167.14
	AMCOR	88,486	15.02	1,329,059.72
	BHP BILLITON LTD	250,465	28.63	7,170,812.95
	BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	13.38	524,549.52
	BORAL LIMITED	104,098	7.48	778,653.04
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.88	657,218.88
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.75	564,746.25
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	20.39	761,831.57
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	23.23	1,420,723.57
	ORICA LTD	29,211	18.60	543,324.60
	RIO TINTO LTD	32,522	74.64	2,427,442.08
	SOUTH32 LTD	408,172	3.47	1,416,356.84
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	51.84	477,964.80
	BRAMBLES LTD	129,297	9.67	1,250,301.99
SEEK LTD	26,358	18.95	499,484.10	
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.24	835,711.88	

	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	6.02	205,613.10	
	TRANSURBAN GROUP	162,844	12.80	2,084,403.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	23.85	1,042,841.25	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.15	368,485.20	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	46.43	256,432.89	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	47.45	154,829.35	
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.58	287,307.98	
	TATTS GROUP LTD	124,218	4.17	517,989.06	
	REA GROUP LTD	3,593	74.88	269,043.84	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.75	169,361.25	
	WESFARMERS LTD	89,270	43.11	3,848,429.70	
	WOOLWORTHS LTD	102,821	26.23	2,696,994.83	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.14	375,498.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	15.98	932,832.50	
	COCHLEAR LIMITED	5,007	180.13	901,910.91	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	1.95	273,544.05	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	68.29	836,415.92	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	21.95	697,505.15	
	CSL LIMITED	35,265	145.78	5,140,931.70	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	228,871	30.34	6,943,946.14	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	12.74	453,544.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.17	473,987.78	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	135,283	80.94	10,949,806.02	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	208,480	30.58	6,375,318.40	
	WESTPAC BANKING	262,130	33.17	8,694,852.10	
	AMP LTD	244,230	5.16	1,260,226.80	
	ASX LTD	15,814	54.66	864,393.24	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	13.69	603,290.92	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,804	97.75	2,424,591.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.02	1,281,543.12	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.14	673,567.68	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.09	1,254,201.37	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.18	1,459,419.78	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	15.59	507,672.76	
	TELSTRA CORP	342,339	3.47	1,187,916.33	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.88	185,073.00	
	AGL ENERGY LTD	51,344	25.46	1,307,218.24	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.83	220,622.05	
	オーストラリアドル 小計	5,790,957		94,690,535.72 (8,246,598,755)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	7.07	442,631.49	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.17	524,141.50	

	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.21	334,479.57	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.69	536,706.81	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.75	339,037.25	
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.40	209,919.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.84	314,497.68	
	ニュージーランドドル 小計	560,571		2,701,413.70 (213,006,470)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	98.70	21,022,705.20	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	16.10	1,593,900.00	
	MTR CORP	114,000	45.20	5,152,800.00	
	LI & FUNG	554,800	3.67	2,036,116.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	46.20	5,497,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	32.30	2,212,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	56.50	10,170,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	19.26	1,294,272.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	37.80	7,665,840.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	16.70	1,636,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.49	856,680.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	21.95	2,256,460.00	
	WH GROUP LTD	699,000	7.90	5,522,100.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	33.90	3,700,524.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	282,000	37.25	10,504,500.00	
	HANG SENG BANK	61,100	186.00	11,364,600.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.87	751,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	230.40	21,081,600.00	
	AIA GROUP LTD	943,800	61.25	57,807,750.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	199,996	66.30	13,259,734.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	27.05	2,191,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.82	3,082,860.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	104,495	53.20	5,559,134.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	40.55	2,392,450.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	35.10	1,351,350.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.72	5,760,380.00	
	SINO LAND CO	235,400	13.98	3,290,892.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	129.30	15,128,100.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	77.10	3,122,550.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	27.10	2,607,020.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	75.10	6,834,100.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	56.50	3,672,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.27	1,524,390.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	67.95	3,397,500.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	79.65	10,633,275.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	670,830	14.82	9,941,700.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	67.40	7,481,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	118.10	2,798,970.00	
	香港ドル 小計	7,404,277		276,157,513.60 (4,015,330,247)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	7.60	853,480.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.20	182,400.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.37	367,330.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.56	312,843.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.01	334,665.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	10.83	469,296.39	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.71	241,152.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.32	561,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.69	341,899.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	39.08	386,892.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.40	169,695.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.34	383,432.00	
	DBS GROUP	139,600	24.30	3,392,280.00	
	OCBC BANK	245,300	11.84	2,904,352.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	25.38	2,634,444.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.73	481,579.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.59	671,689.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	12.14	378,768.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	189,100	3.32	627,812.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	8.80	286,000.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.76	2,409,945.68		
STARHUB LTD	38,000	2.83	107,540.00		
	シンガポールドル 小計	3,504,876		18,498,494.57 (1,544,254,326)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,247	286.30	643,316.10	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	14.34	469,721.04	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	515.70	752,922.00	
	BANK HAPOLIM BM	93,717	23.82	2,232,338.94	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	18.64	2,158,400.16	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	62.82	515,124.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	195.80	846,443.40	
	NICE LTD	4,894	293.20	1,434,920.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	5.31	821,885.49	
	イスラエルシェケル 小計	417,997		9,875,071.93 (317,088,559)	
	合 計	88,725,154		309,639,865,358 (309,639,865,358)	

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472,900	200,982.50	
		アメリカドル 小計		472,900	200,982.50 (22,789,405)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	814,200.39	
		LENDLEASE GROUP	44,009	733,189.94	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	661,369.60	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,208,759.93 (192,360,902)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,580,985.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,554,040.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,135,025.00 (60,123,263)	
	投資信託受益証券合計			1,184,840	275,273,570 (275,273,570)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	532,672.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,450	939,445.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,285	5,053,328.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	921,646.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	2,025,800.82	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,550,175.02	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	440,084.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	666,009.72	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	559,240.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	31,470	3,571,845.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,392	1,514,798.08	
		DUKE REALTY CORP	29,929	865,845.97	
		EQUINIX INC	6,083	2,949,403.38	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	2,006,883.72	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,304,535.15	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	862,361.40	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	792,451.76	
		GGP INC	48,203	1,060,466.00	
		HCP INC	36,011	973,017.22	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,187,760.00	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	832,468.07	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	675,211.49	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	528,916.28	
MACERICH CO/THE	10,128	632,088.48			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	920,496.76	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	462,509.40	
	PROLOGIS INC	41,651	2,768,958.48	
	PUBLIC STORAGE	12,201	2,578,925.37	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,220,335.66	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	777,071.44	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,587,630.66	
	SIMON PROPERTY GROUP	24,417	3,937,485.42	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	796,616.25	
	UDR INC	20,960	834,836.80	
	VENTAS INC	27,813	1,802,560.53	
	VEREIT INC	77,798	635,609.66	
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	1,000,581.70	
	WELLTOWER INC	29,615	2,022,112.20	
	アメリカドル 小計	918,178	53,792,184.59 (6,099,495,810)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	206,213.55	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	394,375.40	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	167,803.80	
	カナダドル 小計	30,576	768,392.75 (68,748,099)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	202,217.40	
	GECINA SA	3,549	491,359.05	
	ICADE	2,845	219,008.10	
	KLEPIERRE	18,936	659,256.84	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,071	1,775,216.45	
	ユーロ 小計	35,711	3,347,057.84 (442,146,340)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	84,399	504,706.02	
	HAMMERSON PLC	61,184	323,357.44	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	155,576.21	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	555,932.25	
	SEGRO PLC	81,695	448,097.07	
	イギリスポンド 小計	359,317	1,987,668.99 (296,222,309)	
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	740,900.00	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,223,163.12	
	GPT GROUP	136,015	718,159.20	
	MIRVAC GROUP	306,089	768,283.39	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,766,384.82	
	STOCKLAND	207,412	964,465.80	
	VICINITY CENTERS	291,115	809,299.70	

	WESTFIELD CORP	161,441	1,307,672.10
オーストラリアドル 小計		1,743,096	8,298,328.13 (722,701,396)
香港ドル	LINK REIT	179,500	12,403,450.00
香港ドル 小計		179,500	12,403,450.00 (180,346,163)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	523,375.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	262,405.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	406,609.00
	SUNTEC REIT	173,000	336,485.00
シンガポールドドル 小計		713,800	1,528,874.00 (127,630,401)
投資証券合計		3,980,178	7,937,290,518 (7,937,290,518)
合計			8,212,564,088 (8,212,564,088)

(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 602銘柄	97.0%			63.4%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 38銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.9%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	98.9%			13.1%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.7%			7.1%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.0%			2.6%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.1%		0.1%



	投資証券 8銘柄			7.9%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	94.3%			1.3%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.2%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	92.4%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,170,872,442
コール・ローン	168,957,661
株式	47,011,700,976
投資信託受益証券	90,026,951
投資証券	169,914,898
派生商品評価勘定	6,754,737
未収入金	360,323
未収配当金	24,231,654
差入委託証拠金	144,235,703
流動資産合計	48,787,055,345
資産合計	48,787,055,345
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,332,613
前受金	6,125,894
未払金	1,005,580,342
未払解約金	60,297,684
未払利息	303
流動負債合計	1,073,336,836
負債合計	1,073,336,836
純資産の部	
元本等	
元本	15,742,008,514

平成29年11月10日現在	
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	31,971,709,995
元本等合計	47,713,718,509
純資産合計	47,713,718,509
負債純資産合計	48,787,055,345

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成29年11月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <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)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> <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</p> <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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <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>

	平成29年11月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,742,008,514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 3.0310円 (1万口当たり純資産額) (30,310円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	平成29年11月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	15,460,216,475円
期中追加設定元本額	808,250,521円
期中一部解約元本額	526,458,482円
期末元本額	15,742,008,514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	6,404,751,337円
世界経済インデックスファンド	2,894,954,558円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,250,378,332円
DC 世界経済インデックスファンド	2,141,727,786円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	18,145,965円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,074,863円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	257,077,884円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	358,249,858円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,329,814円
SMT インデックスバランス・オープン	134,460,063円
SMT 世界経済インデックス・オープン	232,979円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	50,692,585円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,792,951円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	139,539円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,069,662,011	
投資信託受益証券	7,382,130	
投資証券	3,740,189	
合計	9,073,303,952	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成29年11月10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	448,496,570	-	454,622,464	6,125,894
	合計	448,496,570	-	454,622,464	6,125,894

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(平成29年11月10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	214,882,830	-	213,645,694	1,237,136
	アメリカドル	39,679,500	-	39,679,500	-
	ブラジルリアル	88,167,680	-	87,701,194	466,486
	マレーシアリン ギット	20,237,250	-	20,280,000	42,750
	南アフリカランド	66,798,400	-	65,985,000	813,400
	売建	88,167,680	-	87,634,314	533,366
	アメリカドル	88,167,680	-	87,634,314	533,366
	合計	303,050,510	-	301,280,008	703,770

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	454,644	4.40	2,003,616.10	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	37,201	56.68	2,108,552.68	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,280	116.70	849,576.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	5.72	618,354.88	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	118,400	5.13	607,984.00	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	49.90	1,104,336.90	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	14.12	239,051.60	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49,894	19.60	977,922.40	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	9,509	21.85	207,771.65	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	9,620	14.15	136,123.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,338	14.80	197,402.40	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	44.09	238,174.18	
	DP WORLD LTD	10,914	23.76	259,316.64	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	11,374	85.42	971,567.08	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	22,188	30.60	678,952.80	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,922	41.06	1,187,537.32	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	31,722	45.90	1,456,039.80	
	JD.COM INC-ADR	54,590	39.80	2,172,682.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	8.47	306,944.33	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	23,524	27.24	640,793.76	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	4.48	419,274.24	
	CREDICORP LTD	5,824	208.80	1,216,051.20	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	202,157	15.88	3,211,263.94	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	264,285	2.11	558,962.77	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.52	69,037.92	
	58.COM INC-ADR	7,312	67.11	490,708.32	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	90,297	185.13	16,716,683.61	
	AUTOHOME INC-ADR	3,833	63.15	242,053.95	
BAIDU INC - SPON ADR	21,592	240.06	5,183,375.52		
MOMO INC-SPON ADR	10,135	28.96	293,509.60		
NETEASE INC-ADR	6,195	312.86	1,938,167.70		

	SINA CORP	4,000	106.79	427,160.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	109.29	419,455.02	
	YY INC-ADR	4,331	90.65	392,605.15	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.92	435,205.68	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	21,667	7.24	156,869.08	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.35	148,506.64	
	アメリカドル 小計	2,005,793		49,281,589.86 (5,588,039,474)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	15.76	19,401,521.36	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	62.45	18,784,460.40	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	412.26	4,091,680.50	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	49.73	4,816,449.96	
	ALFA S.A.B. -A	242,900	20.05	4,870,145.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	63.83	2,393,625.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	343.04	5,311,974.40	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	179.62	5,582,589.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	190.77	3,239,274.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	190,790	77.14	14,717,540.60	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	132.90	1,448,610.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	386,280	45.00	17,382,600.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	123.97	4,174,689.75	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	131.22	5,681,826.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	165.68	26,416,019.20	
	GRUMA S.A.B. -B	14,210	253.81	3,606,640.10	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	44.68	5,915,632.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	29.99	1,073,642.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	33.36	3,089,136.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	169,700	31.38	5,325,186.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	187,400	114.92	21,536,008.00		
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	150,500	33.54	5,047,770.00		
GENTERA SAB DE CV	77,100	19.09	1,471,839.00		
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,721,740	16.64	45,289,753.60		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	103.74	3,910,998.00		
	メキシコペソ 小計	6,426,110		234,579,611.07 (1,398,094,481)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	37.12	683,008.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	17.50	4,432,750.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	297,740	16.72	4,978,212.80	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	74.05	2,125,235.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	50.40	448,560.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	7.85	257,480.00	
	DURATEX SA	21,672	9.59	207,834.48	



FIBRIA CELULOSE SA	24,900	52.10	1,297,290.00
GERDAU SA-PREF	87,000	10.47	910,890.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	21.13	851,539.00
VALE SA	192,785	32.80	6,323,348.00
VALE SA-PREF A	45,915	30.56	1,403,162.40
EMBRAER SA	41,400	15.81	654,534.00
WEG SA	51,440	21.68	1,115,219.20
CCR SA	101,100	16.99	1,717,689.00
LOCALIZA RENT A CAR	11,434	60.84	695,644.56
RUMO SA	97,700	12.21	1,192,917.00
KROTON EDUCATIONAL SA	97,284	18.03	1,754,030.52
LOJAS AMERICANAS SA	10,800	12.60	136,080.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	15.44	983,775.04
LOJAS RENNER S.A.	60,370	34.49	2,082,161.30
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	73.69	795,852.00
RAIA DROGASIL SA	17,000	81.27	1,381,590.00
AMBEV SA	369,000	20.22	7,461,180.00
BRF SA	38,800	43.00	1,668,400.00
JBS SA	109,100	8.00	872,800.00
M DIAS BRANCO SA	6,300	47.29	297,927.00
NATURA COSMETICOS SA	10,700	29.59	316,613.00
ODONTOPREV S.A.	12,400	15.99	198,276.00
QUALICORP SA	20,800	33.75	702,000.00
HYPERMARCAS SA	35,300	32.80	1,157,840.00
BANCO BRADESCO S.A.	72,518	30.50	2,211,799.00
BANCO BRADESCO SA-PREF	235,710	32.71	7,710,074.10
BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	32.26	2,229,166.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	255,021	41.45	10,570,620.45
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	348,625	10.47	3,650,103.75
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	22.83	3,938,243.49
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	28.06	1,579,778.00
PORTO SEGURO SA	7,300	36.52	266,596.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	12.70	724,700.10
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	70.95	390,225.00
CIELO SA	99,269	23.10	2,293,113.90
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	49.32	1,568,376.00
TIM PARTICIPACOES SA	72,900	11.71	853,659.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	23.50	415,950.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	20.44	255,500.00
CIA ENERGETICA DE MIN GE-RTS	10,484	0.48	5,032.32
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	7.00	461,944.00
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	24.00	79,200.00

	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	28.84	752,724.00	
	CPFL ENERGIA SA	16,044	27.55	442,012.20	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	14.62	388,892.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	37.71	505,314.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,800	60.76	777,728.00	
	ブラジルリアル 小計	3,906,385		91,174,589.61 (3,179,257,939)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	32,412	9,522.30	308,636,787.60	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	2,022.40	170,447,872.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	36,554.00	265,382,040.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	8,443.70	186,664,875.90	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	6,006.00	318,876,558.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,822.60	251,496,928.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,596.60	80,146,101.80	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	3,077.90	46,821,014.80	
	BANCO DE CHILE	2,284,160	95.28	217,634,764.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,476	41,426.00	102,570,776.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	48.89	307,020,448.69	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.69	95,419,941.73	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	7,027.60	130,376,035.20	
	AES GENER SA	141,749	214.38	30,388,150.62	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	408.02	66,608,448.96	
	COLBUN SA	475,888	144.19	68,618,290.72	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	133.25	288,163,918.25	
	ENEL CHILE SA	1,939,330	73.01	141,590,483.30	
	ENEL GENERACION CHILE SA	216,099	547.49	118,312,041.51	
	チリペソ 小計	30,794,735		3,195,175,478.68 (574,173,033)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	1,820.00	650,335,140.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	10,560.00	338,036,160.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	20,220.00	358,359,060.00	
	BANCOLOMBIA SA	13,742	28,580.00	392,746,360.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	29,280.00	1,120,779,840.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,275.00	387,227,700.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	38,200.00	555,886,400.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	37,000.00	464,757,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,360.00	674,826,960.00	
	コロンビアペソ 小計	840,413		4,942,954,620.00 (185,855,093)	
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	20.28	88,380.24	
	OPAP SA	17,668	9.60	169,612.80	
	FF GROUP	3,404	16.20	55,144.80	
	JUMBO SA	8,599	13.45	115,656.55	

	ALPHA BANK AE	94,467	1.51	142,645.17	
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.63	94,005.11	
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.25	103,191.92	
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	2.23	41,480.23	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.49	212,873.57	
	ユーロ 小計	717,893		1,022,990.39 (135,137,030)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	126.50	1,467,779.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	9.82	1,146,534.10	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	6.62	317,846.06	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	39.30	935,772.30	
	KOC HOLDING AS	62,460	16.78	1,048,078.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.68	202,026.24	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	19.88	195,539.68	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	10.51	653,627.41	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	58.30	189,941.40	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	34.02	229,635.00	
	ARCELIK AS	15,358	20.56	315,760.48	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	79.55	1,239,150.35	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	24.00	269,520.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	36.90	162,987.30	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	19.20	184,819.20	
	AKBANK T.A.S.	176,098	9.64	1,697,584.72	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	166,475	10.15	1,689,721.25	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	10.11	530,077.41	
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	6.82	758,172.58	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	5.91	306,983.13	
	YAPI VE KREDI BANKASI	109,792	4.47	490,770.24	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	10.71	658,086.66	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	6.15	109,445.40	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	14.08	1,338,951.68	
	トルコリラ 小計	1,286,299		16,138,810.89 (473,028,547)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	925.00	6,903,275.00	
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	78.85	2,106,635.45	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	265.00	1,192,500.00	
	CEZ AS	13,737	478.90	6,578,649.30	
	チェココルナ 小計	52,417		16,781,059.75 (86,758,078)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,328.00	109,398,016.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	6,920.00	58,536,280.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	10,445.00	204,189,305.00	
		60,880		372,123,601.00	

ハンガリーフォリント 小計				(157,557,132)
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	5,516	65.93	363,669.88
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	21,535	122.60	2,640,191.00
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	6.73	985,924.81
	GRUPA AZOTY SA	2,786	75.40	210,064.40
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	93.25	388,945.75
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	120.65	1,584,375.80
	SYNTHOS SA	33,750	4.89	165,037.50
	CCC SA	3,138	248.00	778,224.00
	LPP SA	124	8,255.35	1,023,663.40
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	25.40	596,950.80
	EUROCASH SA	5,057	34.48	174,365.36
	ALIOR BANK SA	8,830	71.20	628,696.00
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	78.70	158,187.00
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	8.32	274,701.44
	BANK PEKAO SA	10,614	123.50	1,310,829.00
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	382.20	916,515.60
	M BANK SA	747	455.25	340,071.75
	PKO BANK POLSKI SA	80,565	38.85	3,129,950.25
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	45.79	2,333,046.29
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.66	315,024.28
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	12.22	775,921.12	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	3.24	184,786.92	
ポーランドズロチ 小計		624,527		19,279,142.35 (601,894,824)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	51,000	3.59	183,090.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	7.66	796,640.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,927,400	5.85	11,275,290.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	250,500	19.90	4,984,950.00
	CNOOC LTD-R	1,389,000	11.12	15,445,680.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.25	1,870,500.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	5.56	9,752,240.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	7.78	871,360.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	5.78	1,965,200.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	32.05	3,525,500.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.53	2,154,900.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	12.42	1,030,860.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	13.50	1,363,500.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	4.62	919,380.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.71	1,975,590.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.44	550,560.00
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	46.50	1,813,500.00

CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	9.24	2,882,880.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	15.98	2,548,810.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	9.50	1,040,250.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.07	1,821,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	10.76	1,829,200.00
CITIC LTD	502,000	11.44	5,742,880.00
CRRG CORP LTD-H	313,050	7.51	2,351,005.50
FOSUN INTERNATIONAL	185,000	19.04	3,522,400.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	24.00	840,000.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.42	574,560.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	23.30	885,400.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	6.54	444,720.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	108,800	9.84	1,070,592.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	39,500	45.00	1,777,500.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	279,000	10.88	3,035,520.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.21	850,780.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	12.98	1,401,840.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	23.35	2,277,722.45
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.89	1,036,640.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	8.92	909,840.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.60	788,800.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	9.32	820,160.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	21.10	5,275,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	73.30	3,628,350.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE-B	47,600	10.30	490,280.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	10.50	2,793,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	31.55	858,160.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	26.20	10,218,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	9.24	1,882,650.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	180,246	20.35	3,668,006.10
MINH GROUP LTD	52,000	46.95	2,441,400.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,000	36.55	2,595,050.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	22.90	2,656,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	69,000	73.55	5,074,950.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	1.28	998,400.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	1.00	593,958.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	8.29	1,616,550.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	197,000	21.25	4,186,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	142,000	23.50	3,337,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	12.64	1,542,080.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	33.40	668,000.00

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	6.73	2,214,170.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	79.75	5,303,375.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	224,000	4.32	967,680.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	5.69	614,520.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	19.50	838,500.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	32.95	3,281,820.00
3SBIO INC	84,500	14.66	1,238,770.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	15.08	1,508,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	15.28	5,806,400.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	41.00	1,066,000.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	2.76	885,960.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	352,000	10.26	3,611,520.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,289,000	3.66	8,377,740.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,245,200	3.86	24,106,472.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	609,475	5.84	3,559,334.00
CHINA CITIC BANK-H	627,200	5.03	3,154,816.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,604,620	6.88	45,439,785.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.65	813,950.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	295,423	30.60	9,039,943.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	459,500	7.46	3,427,870.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	5.48	761,720.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,869,515	6.27	36,801,859.05
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	3.01	2,504,320.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	18.64	1,155,680.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	6.78	2,227,230.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	528,000	3.69	1,948,320.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	17.70	3,522,300.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.51	1,058,910.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	16.82	1,776,192.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	12.10	3,349,280.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	16.96	1,787,584.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	583,000	27.50	16,032,500.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	205,200	39.30	8,064,360.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	28.10	3,985,254.40
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	51.20	3,430,400.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	4.24	2,934,080.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	408,859	16.82	6,877,008.38
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	424,500	73.45	31,179,525.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	30.80	7,330,400.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	3.57	785,400.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	24.75	8,094,240.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	219,111	23.05	5,050,508.55

	CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	28.25	2,118,750.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	421,285	12.34	5,198,656.90	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	460,000	3.30	1,518,000.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	17.00	1,169,600.00	
	LONGFOR PROPERTIES	123,500	18.86	2,329,210.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	16.12	1,055,860.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	4.98	934,203.18	
	SOHO CHINA LTD	113,000	4.57	516,410.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	176,000	35.95	6,327,200.00	
	KINGSOFT CORP LTD	66,000	21.35	1,409,100.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	450,700	387.80	174,781,460.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	20.30	1,075,900.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	163.00	9,780,000.00	
	LENOVO GROUP LTD	578,000	4.57	2,641,460.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	57,000	139.50	7,951,500.00	
	ZTE CORP-H	48,508	28.30	1,372,776.40	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	4.82	626,600.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	482,500	79.65	38,431,125.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.88	4,268,000.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	442,000	11.90	5,259,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	6.54	2,668,320.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,305,000	2.26	2,949,300.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	24.75	3,366,000.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.84	1,477,520.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	208,000	2.50	520,000.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	28.80	2,476,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	15.66	2,746,764.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	58.30	3,264,800.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	11.46	2,544,120.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	5.59	1,442,220.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.57	786,420.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	1.38	1,428,300.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	14.16	3,752,400.00	
	香港ドル 小計	57,775,202		727,855,397.31 (10,583,017,476)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	2.25	501,678.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.44	538,144.00	
	SAPURA ENERGY BHD	282,600	1.46	412,596.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	7.40	1,554,740.00	
	GAMUDA BHD	139,200	4.81	669,552.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.30	355,260.00	

	IJM CORP BHD	198,100	3.12	618,072.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	9.06	1,515,248.76	
	AIRASIA BHD	64,800	3.26	211,248.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.40	450,189.60	
	MISC BHD	125,040	7.45	931,548.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.74	261,800.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	5.18	176,120.00	
	GENTING BHD	205,300	9.48	1,946,244.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.15	1,154,115.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.78	329,430.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	39.86	434,474.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.89	151,767.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.78	150,920.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.47	802,990.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.78	1,357,944.00	
	PPB GROUP BERHAD	43,900	16.70	733,130.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	8.30	298,800.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.64	1,293,252.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.70	261,220.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.38	570,276.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	293,967	6.21	1,825,535.07	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	15.96	978,220.32	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	16.66	248,783.78	
	MALAYAN BANKING BHD	270,360	9.16	2,476,497.60	
	PUBLIC BANK BERHAD	228,020	20.46	4,665,289.20	
	RHB BANK BHD	53,119	4.90	260,283.10	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.99	306,111.75	
	AXIATA GROUP BERHAD	156,574	5.44	851,762.56	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.87	1,517,979.00	
	MAXIS BHD	135,500	6.00	813,000.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.15	433,894.80	
	PETRONAS GAS BHD	80,600	17.70	1,426,620.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	255,675	14.90	3,809,557.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.31	330,598.15	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	124,771	1.33	165,945.43	
	マレーシアリングット 小計	5,491,741		37,790,837.42 (1,022,242,152)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	17.40	2,061,900.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	44.50	3,057,150.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	6.50	3,723,200.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	93.50	11,659,450.00	
	PTT PCL-NVDR	78,900	416.00	32,822,400.00	



THAI OIL PCL-NVDR	48,000	97.75	4,692,000.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	48.50	4,942,150.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,734	80.00	11,898,720.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	472.00	6,372,000.00	
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	474.00	8,863,800.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	52.25	3,542,550.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	305,000	58.00	17,690,000.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	8.10	3,168,720.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.40	3,087,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	43.50	7,038,735.00	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	17.10	959,310.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	13.20	3,057,582.00	
ROBINSON PCL-NVDR	34,800	73.00	2,540,400.00	
CP ALL PCL-NVDR	372,000	70.50	26,226,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	25.50	8,687,850.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.40	4,416,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	20.90	9,524,130.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	214.00	5,478,400.00	
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	199.50	3,231,900.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	90,300	225.00	20,317,500.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	220.00	11,352,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	18.40	4,549,400.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	148.50	21,978,000.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.56	3,421,440.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	82.75	10,931,275.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	82.25	2,656,675.00	
KCE ELECTRONICS - NVDR	24,700	85.25	2,105,675.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	103,000	180.50	18,591,500.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	5.65	3,433,555.85	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	225.00	5,220,000.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	88.75	2,627,000.00	
タイパーツ 小計	7,186,738		295,925,367.85 (1,015,024,011)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	73.90	8,475,591.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	15.58	9,201,548.00	
DMCI HOLDINGS INC	345,450	15.50	5,354,475.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	76.95	17,726,202.00	
SM INVESTMENTS CORP	22,805	980.00	22,348,900.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	102.40	6,475,776.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	253.00	6,438,850.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	137.20	8,695,736.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	99.40	5,210,548.00	

	BDO UNIBANK INC	173,721	145.00	25,189,545.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	95.10	3,913,555.20	
	SECURITY BANK CORP	30,810	260.00	8,010,600.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	1,070.00	23,935,900.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,203.00	7,380,405.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	6.85	5,039,545.00	
	AYALA LAND INC	637,000	44.40	28,282,800.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.69	3,630,220.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	24.65	2,292,450.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	850,850	37.95	32,289,757.50	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	2,050.00	3,669,500.00	
	PLDT INC	6,225	1,715.00	10,675,875.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	42.40	3,794,800.00	
	フィリピンベソ 小計	4,834,648		248,032,578.70 (548,151,998)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,830.00	1,464,915,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	34,100.00	4,395,490,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	21,850.00	4,151,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	10,100.00	2,369,460,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	7,325.00	1,026,965,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	2,140.00	839,736,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	6,725.00	830,537,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	8,275.00	14,242,930,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	630,500	1,655.00	1,043,477,500.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,980.00	1,055,340,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	10,000.00	1,855,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,220.00	1,391,362,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	77,250.00	2,379,300,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,950.00	3,625,705,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,500.00	1,368,500,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,950.00	3,411,345,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	49,300.00	5,846,980,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,600.00	2,005,440,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	20,800.00	17,288,960,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	5,725.00	1,124,962,500.00	
	BANK MANDIRI	1,424,996	7,075.00	10,081,846,700.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	791,600	7,975.00	6,313,010,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	824,700	16,450.00	13,566,315,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,730.00	1,182,282,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	635.00	770,255,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	625.00	1,006,500,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	453,200	1,015.00	459,998,000.00	

	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,928,900	4,160.00	16,344,224,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	6,775.00	903,785,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	3,520.00	607,200,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	1,835.00	1,452,402,500.00	
	インドネシアルピア 小計	21,478,496		124,405,723,700.00 (1,045,008,079)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	67,800.00	286,590,600.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	127,500.00	433,627,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	217,500.00	1,142,310,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	31,150.00	333,491,900.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	134,500.00	189,510,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	57,800.00	418,587,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	520,000.00	407,160,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	74,000.00	77,774,000.00	
	LG CHEM LTD	3,844	414,000.00	1,591,416,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	258,000.00	123,582,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	368,500.00	409,035,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	123,000.00	138,621,000.00	
	POSCO	5,701	319,000.00	1,818,619,000.00	
	CJ CORP	1,230	196,500.00	241,695,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	89,200.00	140,133,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	6,670.00	55,160,900.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	36,150.00	155,734,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	17,500.00	58,485,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	27,750.00	94,294,500.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	44,100.00	124,582,500.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	39,600.00	149,569,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	40,100.00	255,838,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,820	161,500.00	455,430,000.00	
	KCC CORP	326	407,500.00	132,845,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	54,500.00	282,092,000.00	
	LG CORP	7,072	87,700.00	620,214,400.00	
	POSCO DAEWOO CORP	1,560	20,350.00	31,746,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,354	146,000.00	927,684,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	24,326	13,250.00	322,319,500.00	
	SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,160	40,100.00	86,616,000.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,769	286,000.00	791,934,000.00	
	SK NETWORKS CO LTD	26,186	6,510.00	170,470,860.00	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	39,950.00	37,592,950.00	
	S-1 CORPORATION	960	96,000.00	92,160,000.00	
	CJ LOGISTICS	324	154,000.00	49,896,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	149,000.00	216,795,000.00	

KOREAN AIR LINES CO LTD	2,378	30,400.00	72,291,200.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,995.00	148,531,320.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	56,200.00	397,109,200.00
HANON SYSTEMS	10,825	13,150.00	142,348,750.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	268,500.00	1,497,424,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	11,843	155,500.00	1,841,586,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	108,000.00	312,336,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	99,600.00	299,098,800.00
HYUNDAI WIA CORP	1,737	64,800.00	112,557,600.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	35,000.00	721,945,000.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	102,000.00	406,164,000.00
HANSSEM CO LTD	615	166,500.00	102,397,500.00
LG ELECTRONICS INC	8,015	96,000.00	769,440,000.00
KANGWON LAND INC	8,683	35,800.00	310,851,400.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	20,150.00	102,160,500.00
CJ E&M CORP	2,024	87,100.00	176,290,400.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	83,100.00	178,831,200.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	92,000.00	112,424,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	237,500.00	245,575,000.00
SHINSEGAE CO LTD	417	253,000.00	105,501,000.00
BGF RETAIL CO LTD	1,576	79,100.00	124,661,600.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	28,750.00	43,728,750.00
EMART	1,661	232,500.00	386,182,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,600.00	46,671,600.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	400,000.00	201,200,000.00
KT&G CORP	8,747	117,000.00	1,023,399,000.00
LOTTE CORP	2,370	67,500.00	159,975,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	116,500.00	232,184,500.00
OTTOGI CORPORATION	68	770,000.00	52,360,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,436	324,000.00	789,264,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	178,000.00	126,380,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,250,000.00	937,500,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	682,000.00	92,070,000.00
PACIFIC CORP	2,115	153,500.00	324,652,500.00
CELLTRION INC	6,665	171,000.00	1,139,715,000.00
HANMI PHARM CO LTD	365	504,000.00	183,960,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	604	95,100.00	57,440,400.00
MEDY-TOX INC	317	440,000.00	139,480,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	385,000.00	601,755,000.00
YUHAN CORPORATION	572	211,500.00	120,978,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	9,280.00	215,444,480.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,360.00	114,903,360.00
HANA FINANCIAL GROUP	21,772	46,200.00	1,005,866,400.00

	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	15,050.00	271,592,300.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	33,822	57,700.00	1,951,529,400.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	32,668	48,400.00	1,581,131,200.00	
	WOORI BANK	29,912	15,900.00	475,600,800.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	64,000.00	144,320,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	9,950.00	309,365,400.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	13,900.00	157,042,200.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	38,250.00	72,636,750.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	35,800.00	206,780,800.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,209	68,700.00	289,158,300.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	7,500.00	91,650,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	44,900.00	193,878,200.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	271,500.00	685,809,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	132,500.00	702,250,000.00	
	KAKAO CORP	3,347	152,500.00	510,417,500.00	
	NAVER CORP	2,139	825,000.00	1,764,675,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,650	421,000.00	694,650,000.00	
	NETMARBLE GAMES CORP	1,183	186,000.00	220,038,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	204,000.00	636,684,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	18,774	29,900.00	561,342,600.00	
	LG INNOTEK CO LTD	857	170,000.00	145,690,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	103,500.00	472,581,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,759	2,817,000.00	21,857,103,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,433	2,281,000.00	3,268,673,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	221,500.00	1,046,366,000.00	
	KT CORP	3,800	29,250.00	111,150,000.00	
	SK TELECOM	1,647	253,500.00	417,514,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,460	38,250.00	744,345,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	42,700.00	61,146,400.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	810	411,500.00	333,315,000.00	
	SK HYNIX INC	46,200	82,400.00	3,806,880,000.00	
	韓国ウォン 小計	704,249		72,823,564,620.00 (7,398,874,165)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	105.00	11,470,200.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	26.70	7,934,599.20	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.70	27,670,446.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	247,061	93.20	23,026,085.20	
	FORMOSA PLASTICS CORP	311,824	92.10	28,718,990.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	370,752	74.70	27,695,174.40	
	TAIWAN CEMENT	297,929	33.50	9,980,621.50	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	39.65	1,348,100.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	407,028	25.55	10,399,565.40	

HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,019	312.00	4,061,928.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	28.00	3,108,000.00
CHINA AIRLINES LTD	130,203	11.00	1,432,233.00
EVA AIRWAYS CORP	143,931	14.65	2,108,589.15
EVERGREEN MARINE	107,563	17.20	1,850,083.60
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	23.95	4,239,150.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	58.80	10,411,186.80
YULON MOTOR COMPANY	51,000	25.65	1,308,150.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	325.50	3,885,493.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	136.50	4,493,034.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	30.60	1,224,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	151.50	3,857,796.00
MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	131.50	1,518,825.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	304.00	2,128,000.00
POU CHEN	153,780	37.10	5,705,238.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	50.00	1,842,350.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	349.00	9,074,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	280.00	12,752,320.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	74.30	2,656,670.80
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	64.00	23,961,280.00
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	216.00	2,808,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	16.25	6,441,012.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.22	11,587,511.60
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	19.40	26,718,397.80
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	673,363	18.45	12,423,547.35
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	716,984	19.35	13,873,640.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	816,242	16.55	13,508,805.10
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	23.70	21,385,434.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,134,205	9.30	10,548,106.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	13.35	12,081,603.15
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	8.31	1,595,195.91
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	16.30	11,824,704.60
CHAILEASE HOLDING CO LTD	135,429	87.50	11,850,037.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	48.05	26,479,490.10
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	13.25	10,231,027.25
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	718,951	49.20	35,372,389.20
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	153,922	28.45	4,379,080.90
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	9.55	5,880,613.05
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	40.45	1,703,754.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	30.95	1,724,967.30
ACER INC	255,803	15.90	4,067,267.70
ADVANTECH CO LTD	20,402	206.00	4,202,812.00

	ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	263.50	14,516,742.00	
	AU OPTRONICS CORP	590,090	12.40	7,317,116.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,700	329.50	16,705,650.00	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,649	76.00	2,177,324.00	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	12.90	9,997,500.00	
	COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.25	9,606,660.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	143,903	138.50	19,930,565.50	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	93.00	8,635,050.00	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	245.00	3,430,000.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,223,311	108.50	132,729,243.50	
	HTC CORPORATION	37,430	67.40	2,522,782.00	
	INVENTEC CO LTD	136,511	23.50	3,208,008.50	
	LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	5,755.00	46,270,200.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	39.50	5,942,854.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	31,000	77.50	2,402,500.00	
	PEGATRON CORP	159,474	78.00	12,438,972.00	
	QUANTA COMPUTER INC	196,270	72.30	14,190,321.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	37.50	2,928,750.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	85.20	804,714.00	
	WISTRON CORP	235,771	26.65	6,283,297.15	
	WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	41.95	6,552,044.65	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	72.60	1,591,537.20	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	9.72	1,924,560.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	285,315	103.00	29,387,445.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	71.00	11,147,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	108.00	16,437,600.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	518,630	37.10	19,241,173.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	335.00	6,030,000.00	
	MEDIATEK INC	112,804	331.00	37,338,124.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	85.20	4,089,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	117.00	4,685,265.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	352.00	4,082,848.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	96.00	4,585,920.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	116.00	3,241,504.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	159,000	47.85	7,608,150.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,948,389	241.00	469,561,749.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	15.70	15,338,900.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	59.70	3,223,800.00	
	新台湾ドル 小計	26,719,169		1,468,654,978.36 (5,522,142,718)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	522.15	34,524,558.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	283.25	11,874,973.00	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	431.55	25,644,858.75	
INDIAN OIL CORP LTD	58,804	394.60	23,204,058.40	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	189.60	19,493,534.40	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	208,670	900.50	187,907,335.00	
ACC LTD	1,768	1,760.60	3,112,740.80	
AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	271.00	10,077,135.00	
ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,195.60	29,842,176.00	
GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,227.30	33,556,836.60	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	263.30	20,806,229.30	
JSW STEEL LTD	80,284	264.00	21,194,976.00	
SHREE CEMENT LTD	901	18,110.30	16,317,380.30	
TATA STEEL LTD	25,839	703.40	18,175,152.60	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	4,363.35	32,088,075.90	
UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	744.55	19,520,611.90	
VEDANTA LTD	110,508	323.75	35,776,965.00	
ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	115.35	7,286,774.85	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	92.10	4,696,639.50	
EICHER MOTORS LTD	939	30,853.30	28,971,248.70	
HAVELLS INDIA LTD	23,476	516.70	12,130,049.20	
LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,215.90	43,108,518.60	
SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,213.70	6,503,004.60	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	433.40	27,098,768.40	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,337	1,336.85	4,461,068.45	
BAJAJ AUTO LTD	5,458	3,200.00	17,465,600.00	
BHARAT FORGE LTD	13,392	718.15	9,617,464.80	
BOSCH LTD	431	21,126.20	9,105,392.20	
HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,597.75	11,689,089.75	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,474	1,361.30	42,845,556.20	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,037	8,204.80	65,941,977.60	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	361.45	18,515,276.25	
TATA MOTORS LTD	140,787	440.15	61,967,398.05	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	34,784	246.80	8,584,691.20	
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	777.90	21,640,400.10	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	538.15	26,534,562.05	
ITC LTD	272,605	260.05	70,890,930.25	
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	7,799.30	18,679,323.50	
UNITED SPIRITS LTD	3,561	3,116.85	11,099,102.85	
DABUR INDIA LTD	58,111	348.45	20,248,777.95	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	974.55	18,150,019.20	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	48,921	1,252.90	61,293,120.90	
MARICO LTD	42,465	312.40	13,266,066.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	995.70	4,126,180.80	



	AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	789.40	16,053,238.40	
	CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	478.80	5,030,272.80	
	CIPLA LTD	31,308	614.55	19,240,331.40	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,370.10	18,489,150.10	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	592.05	9,494,113.80	
	LUPIN LTD	16,340	830.45	13,569,553.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,422	2,640.05	16,954,401.10	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	533.90	44,287,005.00	
	AXIS BANK LTD	141,543	540.40	76,489,837.20	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	120,033	1,725.85	207,158,953.05	
	ICICI BANK LTD	190,983	311.30	59,453,007.90	
	IDFC BANK LTD	75,550	56.30	4,253,465.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,235.00	33,243,730.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	582.65	16,297,303.15	
	STATE BANK OF INDIA	132,502	313.70	41,565,877.40	
	YES BANK LTD	123,760	304.65	37,703,484.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,190	1,753.00	19,616,070.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	422.25	6,848,050.50	
	POWER FINANCE CORPORATION	37,247	137.85	5,134,498.95	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	164.45	7,921,227.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,263.40	15,333,885.80	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,289	5,006.75	11,460,450.75	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	875.95	40,152,672.05	
	INFOSYS LTD	151,755	954.50	144,850,147.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	36,157	2,736.40	98,940,014.80	
	TECH MAHINDRA LTD	29,432	490.25	14,429,038.00	
	WIPRO LTD	89,034	302.50	26,932,785.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	85,980	504.25	43,355,415.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	36,202	429.20	15,537,898.40	
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	96.65	13,748,945.75	
	GAIL INDIA LTD	39,878	451.10	17,988,965.80	
	NTPC LTD	145,475	178.05	25,901,823.75	
	TATA POWER CO LTD	93,250	83.75	7,809,687.50	
	インドルピー 小計	4,074,647		2,324,279,899.35 (4,090,732,622)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	14.09	320,406.60	
	INDUSTRIES QATAR	15,948	94.19	1,502,142.12	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	26.00	530,374.00	
	DOHA BANK QSC	12,309	27.30	336,035.70	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	35.00	943,180.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	94.00	553,378.00	
	QATAR NATIONAL BANK	17,714	121.49	2,152,073.86	

	QATAR INSURANCE CO	9,170	38.96	357,263.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	28.30	108,275.80	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	8.40	407,811.60	
	OOREDOO QSC	7,280	84.00	611,520.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	176.70	281,129.70	
	カタールリアル 小計	192,361		8,103,590.58 (240,676,640)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	151.00	2,965,338.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	417.00	1,331,064.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,033	138.59	6,656,893.47	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	56.81	3,668,846.61	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	57,653	40.01	2,306,696.53	
	MONDI LTD	9,893	338.86	3,352,341.98	
	SAPPI LIMITED	49,985	93.30	4,663,600.50	
	SASOL LTD	43,699	434.96	19,007,317.04	
	SIBANYE-STILLWATER	160,975	20.05	3,227,548.75	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	176.39	4,886,355.78	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	239,087	58.49	13,984,198.63	
	NASPERS LTD-N SHS	35,016	3,564.91	124,828,888.56	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	208.00	2,587,520.00	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	192.17	4,093,028.83	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	138.93	3,338,765.76	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	70.10	3,320,426.70	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	55.65	4,657,014.60	
	BID CORP LTD	26,440	308.49	8,156,475.60	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	112.01	939,651.89	
	PICK N PAY STORES LTD	52,858	59.00	3,118,622.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	210.08	7,239,987.04	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	166.65	2,435,256.45	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	116.52	1,025,958.60	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	386.50	5,033,389.50	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	78,446	24.80	1,945,460.80	
	NETCARE LTD	60,221	25.08	1,510,342.68	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	315.50	9,504,437.50	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	47,198	142.27	6,714,859.46	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	922.37	2,971,876.14	
	NEDBANK GROUP LTD	14,966	209.00	3,127,894.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	98,518	167.50	16,501,765.00		
BRAIT SE	20,371	47.71	971,900.41		
CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	76.18	769,722.72		
FIRSTRAND LTD	249,465	52.41	13,074,460.65		
INVESTEC LTD	28,883	96.61	2,790,386.63		

	PSG GROUP LTD	8,086	259.62	2,099,287.32	
	REMGRO LTD	46,153	210.00	9,692,130.00	
	RMB HOLDINGS LTD	43,247	63.83	2,760,456.01	
	DISCOVERY LIMITED	21,716	148.52	3,225,260.32	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	112.20	698,557.20	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	19.45	1,324,117.10	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	38.61	1,560,152.88	
	SANLAM LTD	113,378	72.17	8,182,490.26	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	85,801	40.88	3,507,544.88	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	49,578	17.16	850,758.48	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	200.45	6,196,711.30	
	MTN GROUP LTD	132,522	127.16	16,851,497.52	
	TELKOM SA LTD	11,353	53.95	612,494.35	
	VODACOM GROUP	42,279	152.13	6,431,904.27	
	南アフリカランド 小計	2,448,125		360,701,654.70 (2,871,185,171)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	234,432	0.65	154,021.82	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	7.26	1,339,760.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	96,441	5.99	577,681.59	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	10.15	1,091,459.95	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.24	608,119.68	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	3.59	650,540.31	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.23	400,603.89	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	7.80	2,344,851.60	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	17.20	2,368,870.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,693,627		9,535,909.24 (294,850,313)	
	合 計	179,314,455		47,011,700,976 (47,011,700,976)	

## (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	820,960.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,046,349.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	298,944.10	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20,500	415,535.00	
	ブラジルリアル 小計	120,162	2,581,788.10 (90,026,951)		
	投資信託受益証券合計	120,162	90,026,951 (90,026,951)		
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	9,258,168.00	

メキシコペソ 小計		308,400	9,258,168.00 (55,178,681)	
トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	360,775.80	
トルコリラ 小計		135,630	360,775.80 (10,574,338)	
南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	153,979	3,827,917.94	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,488,750.11	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	324,053	3,467,367.10	
	RESILIENT REIT LTD	23,098	3,301,628.12	
南アフリカランド 小計		524,053	13,085,663.27 (104,161,879)	
投資証券合計		968,083	169,914,898 (169,914,898)	
合計			259,941,849 (259,941,849)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 37銘柄	100.0%			11.8%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.2%			3.0%
	投資証券 1銘柄			3.8%	0.1%
ブラジルレアル	株式 54銘柄	97.2%			6.7%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.8%		0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%			1.2%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.8%			1.0%
	投資証券 1銘柄			2.2%	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%			1.3%
香港ドル	株式 135銘柄	100.0%			22.4%
マレーシアリンギット	株式 41銘柄	100.0%			2.2%
タイバーツ	株式 36銘柄	100.0%			2.1%

フィリピンペソ	株式	22銘柄	100.0%			1.2%
インドネシアルピア	株式	31銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式	110銘柄	100.0%			15.7%
新台湾ドル	株式	89銘柄	100.0%			11.7%
インドルピー	株式	77銘柄	100.0%			8.7%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.5%
南アフリカランド	株式	49銘柄	96.5%			6.1%
	投資証券	4銘柄			3.5%	0.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	9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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成29年11月10日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
コール・ローン	1,149,907,793
国債証券	276,404,191,350
地方債証券	18,844,527,193
特殊債証券	23,705,857,967
社債証券	14,122,793,790
未収利息	686,518,306
前払費用	31,149,970
差入委託証拠金	80,000
流動資産合計	334,945,026,369
<b>資産合計</b>	
334,945,026,369	
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
未払金	579,806,444
未払解約金	175,707,328
未払利息	2,062
流動負債合計	755,515,834
<b>負債合計</b>	
755,515,834	
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	241,201,108,612
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	92,988,401,923

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	334,189,510,535
純資産合計	334,189,510,535
負債純資産合計	334,945,026,369

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	241,201,108,612口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 104,154,000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 1.3855円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,855円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	227,377,666,493円
期中追加設定元本額	16,789,091,921円
期中一部解約元本額	2,965,649,802円
期末元本額	241,201,108,612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）	3,172,600,946円
S B I 資産設計オープン（分配型）	21,267,309円
S M T 国内債券インデックス・オープン	10,438,301,009円
世界経済インデックスファンド	1,407,263,009円
D C マイセレクション 2 5	16,959,719,961円
D C マイセレクション 5 0	20,645,282,027円
D C マイセレクション 7 5	5,654,928,917円
D C 日本債券インデックス・オープン	452,512,478円
D C 日本債券インデックス・オープン S	71,984,877,788円
D C 日本債券インデックス・オープン P	32,497,922,699円
D C マイセレクション S 2 5	6,889,733,850円
D C マイセレクション S 5 0	8,201,931,232円
D C マイセレクション S 7 5	1,616,111,565円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,259,397,191円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	988,502,337円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	290,938,529円
D C 世界経済インデックスファンド	991,207,638円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	136,829,955円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	10,080,112円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	102,851,752円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	18,223,345円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	973,098円



区分	平成29年11月10日現在
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	362,795,670円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	557,595,544円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	97,688,915円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	234,033,529円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,900,144,786円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,237,797,604円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,439,295,073円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	993,432,913円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	290,623,715円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,643,950,684円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,624,564,266円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,770,875,117円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,562,414,455円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	190,025,974円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,818,192,393円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,744,191,809円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	36,773,712円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	468,090,027円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	62,832,116円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,271,579円
SMT インデックスバランス・オープン	82,106,201円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	2,788,072円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,707円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	5,397,935円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,710,683円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	269,218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）	19,290,512,928円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	480,779,450
地方債証券	47,920,793
特殊債証券	60,052,563
社債証券	12,924,470
合計	601,677,276

(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371回利付国債(2年)	760,000,000	762,432,000	
	第372回利付国債(2年)	920,000,000	923,174,000	
	第373回利付国債(2年)	140,000,000	140,519,400	
	第374回利付国債(2年)	620,000,000	622,399,400	
	第375回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,345,507,400	
	第376回利付国債(2年)	1,840,000,000	1,848,004,000	
	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	3,064,030,000	
	第378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,688,131,200	
	第379回利付国債(2年)	2,600,000,000	2,613,234,000	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,789,505,200	
	第381回利付国債(2年)	2,080,000,000	2,091,398,400	
	第382回利付国債(2年)	80,000,000	80,449,600	
	第116回利付国債(5年)	3,770,000,000	3,786,173,300	
	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,317,127,000	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,531,621,600	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,560,000	
	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,578,278,400	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	633,326,400	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,539,641,600	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,159,216,800	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,962,948,000	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,635,811,500	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,982,081,600	
	第127回利付国債(5年)	3,790,000,000	3,819,903,100	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,623,379,100	
	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,227,840,000	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,372,321,600	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,593,184,000	
第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,646,713,700		

第133回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,556,889,600	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	214,090,500	
第2回利付国債(40年)	420,000,000	578,961,600	
第3回利付国債(40年)	420,000,000	581,553,000	
第4回利付国債(40年)	630,000,000	876,002,400	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	654,591,000	
第6回利付国債(40年)	390,000,000	510,315,000	
第7回利付国債(40年)	690,000,000	861,216,600	
第8回利付国債(40年)	720,000,000	828,727,200	
第9回利付国債(40年)	970,000,000	803,121,200	
第10回利付国債(40年)	1,100,000,000	1,081,146,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	569,800,000	
第298回利付国債(10年)	550,000,000	559,020,000	
第299回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,264,824,800	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	848,857,600	
第301回利付国債(10年)	340,000,000	349,176,600	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	205,078,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,430,879,900	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	493,224,000	
第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,969,133,600	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,213,102,800	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	724,143,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,027,689,300	
第309回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,662,904,600	
第310回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,456,389,000	
第311回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,109,354,400	
第312回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,135,157,000	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	240,000,000	251,529,600	
第314回利付国債(10年)	310,000,000	322,809,200	
第315回利付国債(10年)	2,070,000,000	2,169,090,900	
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,138,243,400	
第317回利付国債(10年)	710,000,000	743,490,700	
第318回利付国債(10年)	950,000,000	991,144,500	
第319回利付国債(10年)	680,000,000	714,020,400	
第320回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,171,419,200	
第321回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,541,574,300	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	783,240,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,015,027,400	
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,333,504,000	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,390,416,500	
第326回利付国債(10年)	860,000,000	895,027,800	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	773,929,000	
第328回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,784,207,600	

第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,362,635,000
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,514,908,800
第331回利付国債(10年)	580,000,000	603,350,800
第332回利付国債(10年)	2,230,000,000	2,322,924,100
第333回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,178,623,900
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,913,876,000
第335回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,493,288,000
第336回利付国債(10年)	610,000,000	634,802,600
第337回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,385,626,500
第338回利付国債(10年)	2,350,000,000	2,429,735,500
第339回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,806,260,800
第340回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,021,148,800
第341回利付国債(10年)	2,900,000,000	2,977,691,000
第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,626,078,000
第343回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,553,933,800
第344回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,513,260,000
第345回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,026,441,800
第346回利付国債(10年)	4,160,000,000	4,191,033,600
第347回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,546,925,700
第348回利付国債(10年)	870,000,000	875,550,600
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,493,600
第2回利付国債(30年)	160,000,000	203,612,800
第3回利付国債(30年)	120,000,000	151,593,600
第4回利付国債(30年)	110,000,000	148,241,500
第5回利付国債(30年)	50,000,000	63,198,000
第6回利付国債(30年)	190,000,000	246,317,900
第7回利付国債(30年)	180,000,000	231,674,400
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,955,500
第9回利付国債(30年)	240,000,000	278,534,400
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,515,200
第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,612,000
第12回利付国債(30年)	190,000,000	241,015,000
第13回利付国債(30年)	290,000,000	363,752,800
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,694,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	454,665,000
第16回利付国債(30年)	370,000,000	495,781,500
第17回利付国債(30年)	330,000,000	437,375,400
第18回利付国債(30年)	345,000,000	452,419,200
第19回利付国債(30年)	280,000,000	367,460,800
第20回利付国債(30年)	420,000,000	566,466,600
第21回利付国債(30年)	270,000,000	355,079,700
第22回利付国債(30年)	400,000,000	540,792,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	581,772,800
第24回利付国債(30年)	260,000,000	352,305,200

第25回利付国債(30年)	290,000,000	382,669,500	
第26回利付国債(30年)	410,000,000	548,858,800	
第27回利付国債(30年)	600,000,000	816,684,000	
第28回利付国債(30年)	930,000,000	1,269,961,500	
第29回利付国債(30年)	920,000,000	1,241,825,200	
第30回利付国債(30年)	640,000,000	853,945,600	
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,186,182,000	
第32回利付国債(30年)	880,000,000	1,180,572,800	
第33回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,422,265,200	
第34回利付国債(30年)	875,000,000	1,160,486,250	
第35回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,492,595,200	
第36回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,469,653,800	
第37回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,344,896,200	
第38回利付国債(30年)	700,000,000	874,216,000	
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,070,428,800	
第40回利付国債(30年)	600,000,000	751,038,000	
第41回利付国債(30年)	590,000,000	724,992,000	
第42回利付国債(30年)	750,000,000	921,945,000	
第43回利付国債(30年)	750,000,000	922,305,000	
第44回利付国債(30年)	810,000,000	996,445,800	
第45回利付国債(30年)	690,000,000	815,731,800	
第46回利付国債(30年)	840,000,000	993,090,000	
第47回利付国債(30年)	900,000,000	1,087,344,000	
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,274,988,000	
第49回利付国債(30年)	740,000,000	857,593,400	
第50回利付国債(30年)	520,000,000	523,629,600	
第51回利付国債(30年)	790,000,000	693,225,000	
第52回利付国債(30年)	770,000,000	714,175,000	
第53回利付国債(30年)	930,000,000	885,043,800	
第54回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,283,046,400	
第55回利付国債(30年)	970,000,000	971,154,300	
第56回利付国債(30年)	920,000,000	920,000,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	337,520,700	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	83,004,000	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	148,013,600	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	180,643,700	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	307,475,400	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	180,461,800	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	96,057,900	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	140,667,800	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	150,480,400	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	235,028,200	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	107,684,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	119,450,100	

第53回利付国債（20年）	80,000,000	87,296,800	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	219,066,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	152,971,000	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	164,586,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	262,228,800	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	329,316,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	218,392,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	376,806,500	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	254,049,600	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	336,019,200	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	221,264,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	357,235,200	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	246,620,000	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	367,907,100	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	146,368,300	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	217,557,600	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	444,077,400	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	465,328,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	230,014,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	723,586,500	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	412,866,000	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	230,796,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	150,549,100	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	308,699,100	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	333,703,000	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	195,131,100	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	311,971,500	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	255,875,400	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	452,466,300	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	700,824,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	340,007,600	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	547,230,400	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	341,248,800	
第86回利付国債（20年）	210,000,000	250,620,300	
第87回利付国債（20年）	550,000,000	651,788,500	
第88回利付国債（20年）	420,000,000	503,479,200	
第89回利付国債（20年）	350,000,000	416,556,000	
第90回利付国債（20年）	630,000,000	752,648,400	
第91回利付国債（20年）	450,000,000	541,588,500	
第92回利付国債（20年）	880,000,000	1,047,182,400	
第93回利付国債（20年）	410,000,000	485,718,800	
第94回利付国債（20年）	610,000,000	728,346,100	
第95回利付国債（20年）	610,000,000	742,864,100	

第96回利付国債(20年)	320,000,000	383,571,200
第97回利付国債(20年)	400,000,000	485,000,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	529,179,200
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,387,567,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	585,907,200
第101回利付国債(20年)	415,000,000	515,106,300
第102回利付国債(20年)	320,000,000	398,640,000
第103回利付国債(20年)	400,000,000	494,088,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	437,101,200
第105回利付国債(20年)	680,000,000	828,185,600
第106回利付国債(20年)	380,000,000	466,898,400
第107回利付国債(20年)	150,000,000	183,231,000
第108回利付国債(20年)	610,000,000	731,725,500
第109回利付国債(20年)	180,000,000	216,466,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,163,788,000
第111回利付国債(20年)	460,000,000	570,087,200
第112回利付国債(20年)	630,000,000	773,558,100
第113回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,514,523,600
第114回利付国債(20年)	710,000,000	876,601,500
第115回利付国債(20年)	510,000,000	635,745,600
第116回利付国債(20年)	720,000,000	899,992,800
第117回利付国債(20年)	720,000,000	891,252,000
第118回利付国債(20年)	690,000,000	847,292,400
第119回利付国債(20年)	270,000,000	324,877,500
第120回利付国債(20年)	680,000,000	800,910,800
第121回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,485,398,800
第122回利付国債(20年)	200,000,000	240,992,000
第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,245,700,000
第124回利付国債(20年)	390,000,000	480,831,000
第125回利付国債(20年)	310,000,000	391,096,000
第126回利付国債(20年)	570,000,000	704,274,900
第127回利付国債(20年)	580,000,000	708,620,800
第128回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,248,704,400
第129回利付国債(20年)	100,000,000	121,099,000
第130回利付国債(20年)	750,000,000	909,255,000
第131回利付国債(20年)	380,000,000	455,582,000
第132回利付国債(20年)	780,000,000	935,937,600
第133回利付国債(20年)	660,000,000	800,949,600
第134回利付国債(20年)	560,000,000	680,674,400
第135回利付国債(20年)	490,000,000	588,798,700
第136回利付国債(20年)	530,000,000	629,518,100
第137回利付国債(20年)	380,000,000	457,276,800
第138回利付国債(20年)	310,000,000	364,057,800
第139回利付国債(20年)	510,000,000	606,109,500

	第140回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,818,266,500	
	第141回利付国債(20年)	800,000,000	963,864,000	
	第142回利付国債(20年)	460,000,000	560,878,000	
	第143回利付国債(20年)	890,000,000	1,059,723,000	
	第144回利付国債(20年)	740,000,000	870,262,200	
	第145回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,894,676,000	
	第146回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,714,295,000	
	第147回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,645,387,800	
	第148回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,494,637,600	
	第149回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,860,623,800	
	第150回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,556,436,800	
	第151回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,500,279,900	
	第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,533,971,200	
	第153回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,899,355,400	
	第154回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,531,047,200	
	第155回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,700,743,200	
	第156回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,170,983,800	
	第157回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,513,168,000	
	第158回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,435,046,400	
	第159回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,619,424,000	
	第160回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,850,436,000	
	第161回利付国債(20年)	1,110,000,000	1,117,836,600	
	第162回利付国債(20年)	560,000,000	562,990,400	
	国債証券合計	254,455,000,000	276,404,191,350	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,109,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,241,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,535,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,603,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,946,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,001,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	236,270,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,802,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	103,903,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	104,157,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	103,790,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	208,250,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,747,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,182,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,669,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,782,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	104,145,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	208,172,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,993,000	



平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,655,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,494,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	134,565,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,506,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,084,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	206,144,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	205,464,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,601,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	237,064,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,822,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,649,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,087,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,883,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,500,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,155,000	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,160,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,891,000	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,346,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,226,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,339,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,408,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,537,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	106,793,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,464,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,875,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	103,460,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,416,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,714,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	114,130,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	107,515,593	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,912,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,442,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	122,622,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,653,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,165,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,932,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,242,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,932,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,073,000	

平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,704,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,733,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	122,225,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,391,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,904,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,780,270	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,936,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	200,905,280	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,517,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,219,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,811,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,808,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,393,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,722,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,384,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	121,067,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	208,304,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	126,971,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,768,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,582,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	103,220,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	123,517,200	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,579,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,562,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,509,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,549,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,791,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,862,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,096,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	372,500,600	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,045,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,770,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,255,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,514,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,870,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,777,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,496,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,080,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,463,000	

第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,771,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,672,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,790,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,523,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,680,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,384,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,084,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,822,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,078,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,056,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,360,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,666,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,021,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,046,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	207,568,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,956,000	
第13回大田市公募公債(20年)	200,000,000	242,460,000	
平成22年度第5回大田市公募公債	100,000,000	103,318,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	132,756,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	120,120,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	118,775,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,614,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	105,060,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,241,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,778,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,271,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,810,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,820,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	204,722,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,082,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,110,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	112,164,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,900,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,583,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	118,440,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,736,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,076,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,063,800	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	206,574,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	104,171,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,781,000	

	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,772,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,998,950	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	208,274,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,730,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	120,052,000	
	地方債証券合計	17,749,520,000	18,844,527,193	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,150,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,680,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,391,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,353,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,134,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,333,000	
	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	212,960,000	
	第14回道路債券	100,000,000	109,340,000	
	第17回道路債券	100,000,000	107,456,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	476,548,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,349,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,706,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,054,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,426,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,608,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,520,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,956,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,083,000	
	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	137,622,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,844,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,582,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,442,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,167,000	
	第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	142,642,320	

第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,841,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,481,000	
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	102,862,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,836,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,892,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,624,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,646,000	
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	122,511,000	
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	103,930,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,582,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,167,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,654,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,150,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,322,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	312,708,900	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,390,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,241,000	
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	103,945,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,616,000	
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	117,557,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,466,000	
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	313,293,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,368,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,076,000	
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	310,239,000	
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	210,058,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	155,064,040	

第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,108,000	
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	229,708,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	106,380,900	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,236,000	
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	103,935,000	
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	103,651,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,212,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,483,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	315,424,880	
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	100,278,000	
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	300,699,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,998,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	323,502,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,641,900	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,669,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,386,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	134,141,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,480,800	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,164,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,321,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,545,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,970,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,806,790	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,776,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	119,731,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,448,040	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,576,310	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,748,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,545,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,875,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	517,825,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,649,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,406,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,028,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,418,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,853,000	

第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,260,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,116,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,027,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,568,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,585,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,132,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,687,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,382,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	103,608,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,081,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,205,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,106,800	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,464,000	19,497,060	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,082,000	19,219,719	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,460,000	19,748,323	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,812,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,415,000	20,665,520	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,825,000	21,107,479	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,884,000	16,569,553	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,318,000	35,432,360	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,271,000	20,404,905	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,505,000	18,575,955	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,358,000	21,620,603	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,560,000	18,670,143	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,152,000	21,300,865	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,485,000	23,224,306	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,867,000	23,590,511	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,391,000	29,691,296	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,475,000	30,967,986	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,550,000	33,259,174	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,115,000	36,685,224	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,187,000	38,850,725	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,323,000	39,948,673	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,323,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,778,000	84,284,582	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,338,000	19,215,106	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,003,000	43,600,540	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,438,000	19,310,117	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,110,000	

第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,077,000	19,236,278	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,735,000	47,705,404	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,846,000	17,866,530	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,979,000	48,082,551	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,356,000	45,378,524	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,644,000	19,897,622	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,856,000	89,004,758	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,785,000	48,627,790	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,012,000	20,173,252	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,240,000	60,381,331	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,973,000	57,994,316	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,622,000	57,669,907	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,894,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,024,000	123,023,820	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,984,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,070,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,570,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,554,000	130,761,979	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,481,000	66,010,717	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,541,000	66,665,310	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,009,000	68,295,855	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,216,000	61,077,316	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,521,000	61,949,456	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,527,000	67,987,583	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,386,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,619,000	61,077,480	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,044,000	68,657,361	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,371,000	70,083,356	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,523,000	68,985,681	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,028,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,776,000	146,960,748	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,953,000	74,251,178	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,212,000	151,777,980	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,991,000	83,231,211	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,673,000	86,702,611	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,791,000	86,282,944	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,130,000	176,753,331	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,958,000	87,579,803	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,771,000	92,585,320	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,671,000	95,621,251	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,927,000	95,620,033	



	第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,249,000
	第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,298,000	96,442,447
	第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,739,000	97,439,390
	第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,101,000	97,620,490
	第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,707,000	99,062,345
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,136,000	99,616,809
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,457,000	99,601,212
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,834,000	99,964,782
	第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,180,000
	第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	126,576,000
	第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,759,000
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	118,956,000
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	114,523,000
	い第779号商工債	100,000,000	100,208,000
	い第786号商工債	300,000,000	300,771,000
	い第795号商工債	200,000,000	198,906,000
	い第768号農林債	100,000,000	100,361,000
	い第780号農林債	100,000,000	100,507,000
	い第795号農林債	100,000,000	99,754,000
	い第796号農林債	200,000,000	199,342,000
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,228,000
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,879,000
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,390,000
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,473,000
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,758,000
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,250,000
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,865,000
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	207,832,000
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,834,000
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,785,000
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,376,000
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,526,000
	特殊債券合計	22,374,924,000	23,705,857,967
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	99,925,000
	第24回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	100,138,000
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,206,000

第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,972,000	
第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,533,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,190,000	
第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,355,000	
第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,264,000	
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	100,897,000	
第6回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,459,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,354,000	
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,210,000	
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	100,301,000	
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	100,396,000	
第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,148,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,014,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,502,000	
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	99,764,000	
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	100,000,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,147,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,031,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,388,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	103,252,000	
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	99,932,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,568,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,530,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	100,000,000	102,173,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,864,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,935,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保 社債	100,000,000	103,973,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,248,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,046,000	
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	102,570,000	
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	101,079,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,640,000	

第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,955,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,864,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,760,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,350,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,260,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,616,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,952,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,863,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,020,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,034,000	
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	100,116,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,320,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,092,000	
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	100,490,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,703,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,577,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,885,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,466,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,263,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,687,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,019,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,461,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	126,075,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,223,000	
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	104,636,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	119,339,000	
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	102,443,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,268,000	
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	103,907,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
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	103,075,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,412,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,469,000	

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	104,960,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
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	100,754,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,726,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,238,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,937,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,469,000	
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	100,637,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,624,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,499,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,158,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,238,000	
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	103,676,000	
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	104,254,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,104,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,277,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,876,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,469,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,781,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	245,066,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,563,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,825,140	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,956,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,747,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,145,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,899,400	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,506,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,805,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,990,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,412,000	

第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,925,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,100,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	122,262,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,316,300	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,790,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,360,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,694,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,259,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,342,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,225,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,407,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,185,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,759,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,179,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,379,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,169,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,027,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,816,600	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,533,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,410,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,812,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,651,350	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,406,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	113,029,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,417,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,413,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,848,000	
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	101,341,000	
社債券合計	13,696,000,000	14,122,793,790	
合計		333,077,370,300	

(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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	103,474,172
コール・ローン	2,935,239,673
国債証券	250,358,614,108
派生商品評価勘定	8,919,163
未収入金	19,104,419
未収利息	1,865,562,683
前払費用	180,228,086
差入委託証拠金	156,061,108
流動資産合計	255,627,203,412
資産合計	255,627,203,412
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,673,306
前受金	3,216,162
未払金	14,234,408
未払解約金	366,489,012
未払利息	5,264
流動負債合計	393,618,152
負債合計	393,618,152
純資産の部	
元本等	
元本	91,604,625,027
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,628,960,233
元本等合計	255,233,585,260
純資産合計	255,233,585,260
負債純資産合計	255,627,203,412

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10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>

	平成29年11月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,604,625,027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 2.7863円 (1万口当たり純資産額) (27,863円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	平成29年11月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>



## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	83,845,600,457円
期中追加設定元本額	10,937,782,617円
期中一部解約元本額	3,178,758,047円
期末元本額	91,604,625,027円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,253,068,437円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	878,562,071円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	594,572,913円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,919,681,529円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,177,584円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,658,201,923円
世界経済インデックスファンド	5,534,816,154円
D C マイセレクション 2 5	1,392,752,497円
D C マイセレクション 5 0	1,279,788,169円
D C マイセレクション 7 5	856,340,631円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,665,362,792円
D C マイセレクション S 2 5	570,361,434円
D C マイセレクション S 5 0	507,312,506円
D C マイセレクション S 7 5	240,861,836円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	53,875,970円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	52,741,872円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	22,580,635円
D C 世界経済インデックスファンド	3,978,286,938円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	571,230,489円

区分	平成29年11月10日現在
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	59,003,273円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,349,024円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,656,836円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	70,245,402円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	207,634,474円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	330,843,076円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	243,035,709円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	665,458,416円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,897,447,051円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	766,148,263円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,730,054,442円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,029,842,731円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	230,055,384円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	793,613,616円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,012,660,132円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	287,298,256円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	415,059,438円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,314,436,247円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	809,519,976円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	648,497,534円
外国債券ファンド・シリーズ1	644,983,525円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,922,728,162円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,397,961,956円
分散投資コア戦略ファンドA	948,719,563円
分散投資コア戦略ファンドS	2,255,803,351円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	124,876,455円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,448,100,128円
コア投資戦略ファンド(切替型)	945,247,645円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,642,747円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	112,058,415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)	753,773,921円
SMT インデックスバランス・オープン	257,946,260円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	21,657,824,028円
SMT 世界経済インデックス・オープン	340,543円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	24,561,935円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	25,997,859円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	146,201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)	1,085,198,414円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	2,653,118,023円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	7,576,160,236円

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,102,749,853
合計		1,102,749,853

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

(デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(平成29年11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,911,165,573	-	1,914,381,735	3,216,162
	合計	1,911,165,573	-	1,914,381,735	3,216,162

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(平成29年11月10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	2,527,291,405	-	2,523,321,100	3,970,305
	アメリカドル	1,423,502,525	-	1,422,668,000	834,525
	カナダドル	65,897,775	-	66,193,000	295,225
	ユーロ	931,774,745	-	928,663,000	3,111,745
	イギリスポンド	106,116,360	-	105,797,100	319,260
	合計	2,527,291,405	-	2,523,321,100	3,970,305

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.75% 10/31/18	3,300,000.00	3,275,468.46	
		T 0.875% 04/15/19	10,000,000.00	9,901,657.60	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,431,947.95	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,770,151.11	
		T 1.125% 01/31/19	2,850,000.00	2,834,745.68	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,945,168.48	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,548,750.93	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,866,593.40	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,971,903.48	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	896,589.65	
		T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,307,890.05	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,367,116.79	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,434,030.21	
		T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,434,769.35	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,344,413.43	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,482,473.20	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,458,770.68	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,751,782.90	
		T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,529,464.96	
		T 1.25% 12/15/18	2,520,000.00	2,511,594.61	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,968,542.45	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,968,545.45	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,736,394.24	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,094,613.39	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,964,849.70	
		T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,843,557.03	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	991,998.56	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,353,538.78	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,537,289.70	

T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,812,359.70	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,401,739.70	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,958,697.12	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,678,666.80	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,934,380.88	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,605,886.73	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	2,993,448.48	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	1,998,358.74	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,421,630.16	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	1,997,898.50	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,333,465.25	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,396,030.84	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,886,100.32	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,245,437.91	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,158,656.73	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,940,783.30	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,356,782.68	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,981,973.52	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,984,802.45	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,548,071.53	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,698,548.93	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,002,211.12	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,002,690.45	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,840,521.94	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,881,832.15	
T 1.625% 06/30/19	10,000,000.00	10,003,717.20	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,992,962.06	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,986,923.25	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,460,789.70	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,499,534.10	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,759,119.95	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,019,000.48	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,036,883.65	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,439,348.63	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,481,232.62	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,471,365.58	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,099,551.68	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,768,135.59	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,206,728.17	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,458,810.96	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,927,614.05	
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	5,010,788.40	
	10,150,000.00	10,027,051.22	

T 1.75% 09/30/22			
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,999,828.24	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,191,489.54	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,493,113.72	
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,765,465.41	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,951,329.71	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,976,653.84	
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,128,948.36	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,396,884.09	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,913,506.76	
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,418,247.30	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,953,754.20	
T 1% 11/30/18	5,200,000.00	5,170,392.76	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,218,246.03	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,030,790.53	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,387,296.42	
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,633,742.45	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,570,377.22	
T 2.125% 06/30/22	800,000.00	805,099.88	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,782,998.20	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,155,939.92	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,569,487.73	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,017,113.62	
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	2,001,619.26	
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,536,597.82	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,891,376.33	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,092,350.19	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,548,678.70	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,040,617.30	
T 2.25% 08/15/27	7,950,000.00	7,887,279.11	
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,589,965.53	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,181,224.64	
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,896,769.69	
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	2,013,965.34	
T 2.375% 05/15/27	6,500,000.00	6,523,271.56	
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,601,899.61	
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,341,519.92	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,945,740.92	
T 2.5% 02/15/46	17,050,000.00	16,037,677.90	
T 2.5% 05/15/24	16,900,000.00	17,243,657.10	
T 2.5% 05/15/46	1,050,000.00	986,987.93	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,652,345.92	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,633,515.03	

T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,278,637.04
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,667,784.86
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,106,530.12
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,997,034.92
T 2.75% 08/15/47	5,100,000.00	5,044,638.10
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,151,216.99
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,191,069.58
T 2.875% 05/15/43	14,150,000.00	14,422,466.45
T 2.875% 08/15/45	9,900,000.00	10,056,368.81
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,508,724.52
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,593,682.46
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,273,965.64
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,025,103.20
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,820,389.28
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,386,165.61
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,238,347.71
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,001,626.45
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,082,391.35
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,828,340.08
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,037,052.95
T 2% 10/31/21	400,000.00	401,537.18
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,410,446.00
T 2% 11/15/26	6,750,000.00	6,575,980.66
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,537,910.34
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,997,963.00
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,206,331.99
T 3.125% 02/15/42	1,600,000.00	1,709,102.44
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,066,089.10
T 3.125% 05/15/19	30,000,000.00	30,694,264.50
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,533,263.22
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	12,789,684.59
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,564,481.64
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,247,268.51
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	9,049,597.46
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,415,728.27
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,303,406.74
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	5,818,887.03
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,803,297.75
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,794,225.14
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,317,710.08
T 3.75% 08/15/41	3,900,000.00	4,600,820.05
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,110,372.00

T	3.75%	11/15/43	2,300,000.00	2,722,124.86	
T	3.875%	08/15/40	1,650,000.00	1,979,227.75	
T	3%	05/15/42	1,950,000.00	2,038,722.93	
T	3%	05/15/45	3,500,000.00	3,643,464.37	
T	3%	05/15/47	1,700,000.00	1,767,128.44	
T	3%	11/15/44	2,300,000.00	2,395,761.76	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	1,134,888.50	
T	4.25%	11/15/40	1,150,000.00	1,455,049.98	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,278,575.96	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	2,441,068.94	
T	4.375%	05/15/41	4,150,000.00	5,351,810.23	
T	4.375%	11/15/39	2,700,000.00	3,463,503.75	
T	4.5%	02/15/36	1,840,000.00	2,376,884.14	
T	4.5%	05/15/38	1,000,000.00	1,299,964.04	
T	4.5%	08/15/39	250,000.00	325,790.53	
T	4.625%	02/15/40	3,900,000.00	5,172,126.76	
T	5.0%	05/15/37	1,100,000.00	1,511,241.34	
T	5.25%	02/15/29	1,250,000.00	1,607,581.28	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,665,852.17	
T	5.375%	02/15/31	1,600,000.00	2,143,291.80	
T	5.5%	08/15/28	1,200,000.00	1,560,351.26	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	2,182,337.22	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	1,943,960.46	
T	6.25%	05/15/30	400,000.00	567,429.88	
T	6.25%	08/15/23	1,650,000.00	2,024,438.21	
T	8.0%	11/15/21	1,700,000.00	2,102,819.86	
T	8.125%	08/15/19	2,100,000.00	2,337,920.78	
アメリカドル 小計			953,340,000.00	962,566,132.18 (109,145,373,727)	
カナダドル	CAN	0.5%	02/01/19	3,200,000.00	3,167,280.00
	CAN	0.5%	03/01/22	3,100,000.00	2,957,121.00
	CAN	0.5%	11/01/18	2,050,000.00	2,034,030.50
	CAN	0.75%	03/01/21	1,250,000.00	1,217,775.00
	CAN	0.75%	08/01/19	2,770,000.00	2,738,422.00
	CAN	0.75%	09/01/20	2,700,000.00	2,644,407.00
	CAN	0.75%	09/01/21	1,630,000.00	1,581,083.70
	CAN	1.5%	03/01/20	3,900,000.00	3,902,457.00
	CAN	1.5%	06/01/23	2,400,000.00	2,374,236.00
	CAN	1.5%	06/01/26	2,300,000.00	2,232,288.00
	CAN	1.75%	03/01/19	1,400,000.00	1,407,168.00
	CAN	1.75%	09/01/19	2,250,000.00	2,262,870.00
	CAN	1%	06/01/27	1,890,000.00	1,737,373.05
	CAN	1%	09/01/22	1,500,000.00	1,455,030.00



	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,597,228.50	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,850,000.00	1,933,832.75	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,676,186.75	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,450,000.00	1,605,200.75	
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	482,529.60	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,682,307.45	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,890,360.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,620,000.00	3,275,851.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,314,336.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,890,503.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,700,000.00	2,351,780.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,365,680.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,700,000.00	2,448,603.50	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	549,961.20	
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>56,930,000.00</b>	<b>60,775,902.25</b>	<b>(5,437,619,974)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	10,650,000.00	13,304,938.50	
	MBONO 10% 12/05/24	40,000,000.00	46,444,600.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	17,350,000.00	15,831,181.00	
	MBONO 5% 12/11/19	31,100,000.00	29,907,470.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	38,000,000.00	37,189,080.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,700,000.00	35,107,201.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	14,970,700.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	17,638,393.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	24,934,965.75	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,850,000.00	4,993,705.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	17,072,484.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,200,000.00	17,835,066.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	25,300,000.00	25,653,694.00	
	MBONO 8% 06/11/20	26,750,000.00	27,387,586.25	
	MBONO 8% 11/07/47	4,750,000.00	4,977,691.25	
MBONO 8% 12/07/23	19,450,000.00	20,345,964.25		
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>341,950,000.00</b>	<b>353,594,722.50</b>	<b>(2,107,424,546)</b>
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	750,000.00	759,757.50	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,650,000.00	2,753,270.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,710,000.00	1,739,112.75	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	810,640.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,250,000.00	1,212,368.75	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,197,850.50	
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,200,348.50	
	BGB 1% 06/22/31	1,600,000.00	1,596,464.00	
	BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	368,590.25	

BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,701,127.50
BGB 2.25% 06/22/57	400,000.00	438,382.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,799,324.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,150,000.00	1,695,249.50
BGB 3.75% 09/28/20	2,350,000.00	2,645,536.00
BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,357,575.25
BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,137,400.00
BGB 4.0% 03/28/19	1,690,000.00	1,798,954.30
BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,308,880.45
BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,486,221.50
BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,749,815.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,481,040.00
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,683,192.50
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,445,424.75
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,379,615.30
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,582,794.20
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,005,845.00
BTPS 0.35% 06/15/20	2,550,000.00	2,576,711.25
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,808,265.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,413,930.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,279,934.50
BTPS 0.65% 11/01/20	3,900,000.00	3,972,481.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,039,200.00
BTPS 0.9% 08/01/22	2,100,000.00	2,130,880.50
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,515,555.00
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,462,665.00
BTPS 1.25% 12/01/26	2,100,000.00	2,030,259.00
BTPS 1.35% 04/15/22	650,000.00	674,573.25
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,613,619.75
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	3,226,240.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,473,272.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,602,032.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,882,597.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,093,920.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,900,000.00	1,941,781.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,682,212.50
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,869,921.00
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	2,009,175.00
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,309,880.00
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,601,975.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,656,155.25
BTPS 2.7% 03/01/47	2,220,000.00	2,098,754.70

BTPS 2.8% 03/01/67	800,000.00	714,120.00
BTPS 2% 12/01/25	3,300,000.00	3,428,617.50
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,637,970.25
BTPS 3.45% 03/01/48	1,350,000.00	1,450,109.25
BTPS 3.5% 03/01/30	2,760,000.00	3,173,006.40
BTPS 3.5% 12/01/18	4,000,000.00	4,161,960.00
BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,639,902.50
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,741,618.75
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,522,280.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,800,000.00	2,101,788.00
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,011,394.00
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,956,660.00
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,864,610.25
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,821,459.75
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,815,717.75
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	4,417,905.25
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	5,236,722.50
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,672,473.00
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	5,122,929.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,620,394.00
BTPS 4.75% 09/01/28	3,450,000.00	4,390,659.75
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	3,204,276.00
BTPS 4% 02/01/37	3,300,000.00	4,012,156.50
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,559,359.50
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,906,352.50
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,893,810.50
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,191,350.00
BTPS 5.5% 11/01/22	2,350,000.00	2,906,597.50
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,881,236.50
BTPS 5% 03/01/22	2,600,000.00	3,107,065.00
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,331,328.25
BTPS 5% 08/01/34	2,950,000.00	3,985,435.25
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,873,634.50
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,508,453.25
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,632,555.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,061,108.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,174,592.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,433,312.50
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,318,688.00
DBR 0.5% 02/15/26	4,450,000.00	4,585,947.50
DBR 0.5% 08/15/27	2,300,000.00	2,327,761.00
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,061,318.00
DBR 1.25% 08/15/48	400,000.00	398,742.00

DBR 1.5% 02/15/23	2,000,000.00	2,192,690.00	
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,240,309.50	
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,869,478.00	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,583,726.25	
DBR 1.75% 02/15/24	450,000.00	504,123.75	
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,408,020.00	
DBR 1% 08/15/24	3,580,000.00	3,842,825.70	
DBR 1% 08/15/25	2,450,000.00	2,630,271.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,709,037.50	
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,216,070.00	
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,675,531.25	
DBR 2.5% 07/04/44	2,900,000.00	3,781,005.50	
DBR 2.5% 08/15/46	3,050,000.00	4,005,946.25	
DBR 2% 01/04/22	5,200,000.00	5,744,128.00	
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,371,740.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,000,000.00	3,260,850.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,879,604.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	3,070,242.00	
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,213,424.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,368,725.75	
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,846,255.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,150,000.00	4,843,707.75	
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,018,432.25	
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,523,408.90	
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	4,030,375.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	3,506,060.00	
DBR 5.5% 01/04/31	1,950,000.00	3,149,903.25	
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,363,928.25	
DBR 6.25% 01/04/24	2,600,000.00	3,630,913.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,450,000.00	2,423,073.25	
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,908,864.00	
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,580,027.50	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,741,869.25	
FRTR 0.5% 05/25/25	4,900,000.00	5,000,646.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,580,000.00	5,622,463.80	
FRTR 0.5% 11/25/19	5,950,000.00	6,089,825.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	650,000.00	650,104.00	
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,045,765.00	
FRTR 0% 05/25/22	4,500,000.00	4,555,327.50	
FRTR 1.25% 05/25/36	3,350,000.00	3,302,748.25	
FRTR 1.5% 05/25/31	4,350,000.00	4,620,439.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,650,000.00	6,237,261.00	

FRTR 1.75% 05/25/66	950,000.00	903,393.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	1,650,000.00	1,746,492.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,550,000.00	5,062,216.25	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,334,532.50	
FRTR 1% 05/25/27	2,750,000.00	2,854,293.75	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,543,212.50	
FRTR 1% 11/25/25	4,250,000.00	4,481,306.25	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,950,000.00	5,662,725.75	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,603,521.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,250,000.00	5,050,508.75	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,942,625.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,950,000.00	5,966,804.25	
FRTR 2% 05/25/48	1,600,000.00	1,694,992.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,536,888.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,150,000.00	7,043,318.25	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	12,115,235.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,341,538.25	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,950,000.00	4,530,630.25	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,435,266.00	
FRTR 3% 04/25/22	4,800,000.00	5,515,752.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,250,000.00	5,628,735.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,480,888.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,010,000.00	6,429,052.55	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,250,000.00	5,077,783.75	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,264,368.75	
FRTR 4% 04/25/60	1,550,000.00	2,525,322.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,250,000.00	4,815,833.75	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,160,637.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,778,796.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,768,965.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,475,065.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,322,148.80	
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	783,427.50	
IRISH 1.7% 05/15/37	540,000.00	554,310.00	
IRISH 1% 05/15/26	1,360,000.00	1,404,689.60	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,240,000.00	1,433,303.60	
IRISH 2% 02/18/45	1,110,000.00	1,160,621.55	
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,384,232.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,089,126.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,050,000.00	1,134,504.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,337,597.60	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,907,787.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	900,988.00	

IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	919,062.30	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,939,615.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,700,359.70	
NETHER 0.5% 07/15/26	2,350,000.00	2,385,684.75	
NETHER 0.75% 07/15/27	1,290,000.00	1,322,759.55	
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,830,645.00	
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	902,632.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	1,400,000.00	1,433,222.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,663,530.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,970,000.00	3,333,127.05	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,285,730.50	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,351,044.05	
NETHER 2% 07/15/24	1,750,000.00	1,983,861.25	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,336,743.75	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,270,000.00	3,637,286.40	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,660,515.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,020,000.00	3,136,140.90	
NETHER 4% 01/15/37	1,880,000.00	2,877,387.00	
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,187,895.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,388,140.25	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	280,837.00	
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,396,001.25	
OBL 0.25% 10/16/20	2,750,000.00	2,824,470.00	
OBL 0.5% 04/12/19	4,740,000.00	4,828,211.40	
OBL 0% 04/17/20	1,600,000.00	1,627,728.00	
OBL 0% 10/07/22	1,650,000.00	1,678,982.25	
OBL 0% 10/08/21	2,350,000.00	2,398,363.00	
OBL 1% 02/22/19	1,450,000.00	1,483,915.50	
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,068,705.75	
RAGB 0.5% 04/20/27	700,000.00	698,159.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,300,000.00	2,362,468.00	
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	502,320.00	
RAGB 0% 09/20/22	560,000.00	567,089.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,600,000.00	1,718,488.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	410,000.00	408,249.30	
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	173,893.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,200,000.00	1,329,210.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,941,441.25	
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	990,161.25	
RAGB 2.1% 09/20/17	600,000.00	629,937.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	880,000.00	1,058,204.40	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,180,000.00	1,635,426.90	

RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,540,682.00
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,504,831.00
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,296,801.00
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	702,548.70
RAGB 3.9% 07/15/20	1,240,000.00	1,389,575.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,600,000.00	2,433,304.00
RAGB 4.35% 03/15/19	2,100,000.00	2,242,222.50
RAGB 4.85% 03/15/26	850,000.00	1,174,003.00
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,321,631.00
RFGB 0.375% 09/15/20	650,000.00	667,553.25
RFGB 0.5% 04/15/26	650,000.00	659,204.00
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	348,918.50
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	534,829.50
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	577,192.00
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	547,662.60
RFGB 0% 09/15/23	600,000.00	601,572.00
RFGB 1.5% 04/15/23	900,000.00	980,572.50
RFGB 1.625% 09/15/22	720,000.00	786,027.60
RFGB 2.625% 07/04/42	610,000.00	801,170.95
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	883,587.60
RFGB 2% 04/15/24	520,000.00	585,761.80
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	768,407.50
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	841,783.30
RFGB 4.375% 07/04/19	920,000.00	997,450.20
RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,032,116.00
SPGB 0.25% 01/31/19	2,950,000.00	2,971,240.00
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,064,749.75
SPGB 0.75% 07/30/21	3,600,000.00	3,693,258.00
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,103,380.00
SPGB 1.3% 10/31/26	2,100,000.00	2,097,921.00
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,443,839.00
SPGB 1.45% 10/31/27	2,300,000.00	2,283,244.50
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,071,472.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,950,000.00	2,036,853.00
SPGB 1.95% 04/30/26	2,500,000.00	2,642,837.50
SPGB 1.95% 07/30/30	2,750,000.00	2,769,456.25
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,823,705.00
SPGB 2.35% 07/30/33	600,000.00	612,948.00
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,352,375.00
SPGB 2.75% 10/31/24	3,700,000.00	4,167,828.00
SPGB 2.9% 10/31/46	1,650,000.00	1,679,832.00
SPGB 3.45% 07/30/66	750,000.00	809,831.25
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,456,161.00

	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,692,534.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	3,599,890.00	
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,252,462.50	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,137,695.00	
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,286,807.65	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,295,214.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,150,000.00	2,957,475.50	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,813,887.75	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,500,000.00	2,865,425.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,100,000.00	2,948,316.00	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,307,920.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,804,032.50	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,750,000.00	2,555,008.75	
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,000,000.00	3,767,130.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,300,000.00	3,926,439.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,670,000.00	3,940,973.40	
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,750,000.00	4,648,350.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,290,112.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,514,168.25	
	ユーロ 小計	665,250,000.00	772,382,553.55 (102,031,735,323)	
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,463,827.50	
	UKT 0.75% 07/22/23	700,000.00	695,383.50	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,400,000.00	2,390,796.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	4,430,000.00	4,563,143.65	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,674,399.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,550,000.00	1,433,850.75	
	UKT 1.75% 07/22/19	5,470,000.00	5,588,863.10	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,000,000.00	2,036,760.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,989,308.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,200,000.00	1,185,462.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,969,725.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,950,000.00	2,503,429.50	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,461,316.00	
	UKT 2% 07/22/20	5,100,000.00	5,303,872.50	
	UKT 2% 09/07/25	2,690,000.00	2,880,761.35	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,725,949.00	
	UKT 3.5% 01/22/45	4,300,000.00	5,791,476.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,350,000.00	3,856,021.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,118,009.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	583,159.50	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	818,400.00		



	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,239,800.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,692,006.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,621,765.25	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,700,000.00	2,439,007.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,847,167.20	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,430,000.00	3,529,684.35	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,234,598.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,670,000.00	2,672,091.85	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,289,641.60	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,423,061.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	3,050,000.00	4,304,983.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,904,674.75	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,914,536.25	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	3,192,262.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,883,297.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,329,537.25	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,658,705.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,438,868.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,852,687.50	
	UKT 8% 06/07/21	1,050,000.00	1,327,021.50	
	イギリスポンド 小計	94,500,000.00	116,829,311.10 (17,411,072,233)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	432,678.00	
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,094,215.00	
	SWISS 3% 05/12/19	540,000.00	571,911.30	
	SWISS 4% 02/11/23	710,000.00	879,601.25	
	SWISS 4% 04/08/28	640,000.00	910,902.40	
	スイスフラン 小計	3,290,000.00	3,889,307.95 (443,731,144)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	4,500,000.00	4,472,887.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	11,250,000.00	12,156,581.25	
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,665,504.75	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,180,000.00	9,472,849.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	6,100,000.00	8,276,693.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	13,670,000.00	15,949,814.25	
	SGB 4.25% 03/12/19	13,300,000.00	14,208,656.00	
	SGB 5% 12/01/20	11,800,000.00	13,776,323.00	
	スウェーデンクローナ 小計	77,150,000.00	86,979,309.25 (1,178,569,640)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,660,000.00	5,679,385.50	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,200,000.00	3,254,384.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,900,000.00	5,031,075.00	
	NGB 2% 05/24/23	9,600,000.00	10,039,296.00	

	NGB 3.75% 05/25/21	10,400,000.00	11,436,568.00	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,144,516.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	10,850,000.00	11,501,976.50	
ノルウェークローネ 小計		50,160,000.00	53,087,201.00 (740,566,453)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/18	6,100,000.00	6,156,242.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,100,000.00	4,115,580.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,233,600.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	14,190,000.00	15,983,048.40	
	DGB 3% 11/15/21	12,950,000.00	14,733,474.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,050,000.00	28,786,708.50	
	DGB 4% 11/15/19	14,340,000.00	15,684,375.00	
デンマーククローネ 小計		75,330,000.00	92,693,027.90 (1,645,301,245)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	4,200,000.00	4,165,665.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	4,650,000.00	4,557,511.50	
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,750,000.00	3,700,462.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	2,700,000.00	2,664,090.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,500,000.00	4,220,482.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,650,000.00	3,379,954.75	
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,473,487.50	
	POLGB 3.25% 07/25/19	4,170,000.00	4,292,743.95	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,687,231.20	
	POLGB 4% 10/25/23	3,400,000.00	3,602,725.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,430,000.00	3,747,600.85	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,793,180.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,174,651.25	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,200,000.00	2,511,102.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,294,509.00	
ポーランドズロチ 小計		48,530,000.00	49,265,397.00 (1,538,065,694)	
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,650,000.00	2,633,424.25	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,253,892.20	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	3,006,885.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,000,000.00	959,820.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,493,193.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,350,000.00	3,387,603.75	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,069,596.25	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,387,097.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,528,890.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,263,025.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,050,000.00	1,057,754.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,640,632.50	

	ACGB 3% 03/21/47	1,000,000.00	926,155.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,960,000.00	4,475,196.00
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,970,000.00	4,215,465.10
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,400,000.00	1,678,208.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,350,000.00	5,137,806.75
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,200,000.00	3,347,152.00
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,846,612.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,447,601.25
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	2,978,231.65
オーストラリアドル 小計		57,970,000.00	61,734,241.95 (5,376,435,131)
シンガポ ールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	246,535.00
	SIGB 1.625% 10/01/19	290,000.00	291,088.95
	SIGB 1.75% 04/01/22	560,000.00	562,517.20
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	251,476.25
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	888,413.55
	SIGB 2.375% 06/01/25	200,000.00	205,217.00
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,400,000.00	1,424,395.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	440,000.00	461,674.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	648,051.90
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	588,176.40
	SIGB 2.875% 07/01/29	380,000.00	404,352.30
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	498,341.00
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	405,234.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	767,242.80
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	617,709.35
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	877,468.80
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,150,000.00	1,284,003.75
SIGB 3% 09/01/24	960,000.00	1,024,622.40	
シンガポールドル 小計		10,890,000.00	11,446,520.05 (955,555,493)
マレーシア リングgit	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,457,187.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,650,374.00
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,014,030.00
	MGS 3.502% 05/31/27	1,750,000.00	1,643,740.00
	MGS 3.654% 10/31/19	3,100,000.00	3,120,537.50
	MGS 3.659% 10/15/20	800,000.00	805,476.00
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,226,088.50
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,097,129.00
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,056,700.50
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,517,355.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,092,664.80
	MGS 3.955% 09/15/25	1,890,000.00	1,864,059.75

	MGS 4.048% 09/30/21	3,100,000.00	3,138,548.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,371,221.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,676,169.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,361,973.25	
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	625,511.25	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,248,576.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,824,165.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,250,000.00	1,245,600.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,300,000.00	1,313,383.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,856,576.75	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,035,508.00	
	マレーシアリングット 小計	40,420,000.00	40,242,575.30 (1,088,561,661)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	27,249,247.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,573,490.30	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,523,069.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	6,980,807.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,550,000.00	7,435,806.25	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,355,262.00	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,195,902.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	8,710,000.00	7,579,006.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	14,215,539.75	
	SAGB 8.75% 01/31/44	18,250,000.00	15,684,597.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	11,922,149.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,000,966.50	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	13,733,339.50	
	SAGB 8% 12/21/18	4,850,000.00	4,867,605.50	
SAGB 9% 01/31/40	9,900,000.00	8,799,021.00		
	南アフリカランド 小計	177,380,000.00	158,115,809.55 (1,258,601,844)	
	合計		250,358,614,108 (250,358,614,108)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 183銘柄	100.0%	43.6%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.2%

メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	283銘柄	100.0%	40.8%
イギリスポンド	国債証券	41銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券	5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	23銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	367,246,519
コール・ローン	212,787,524
国債証券	30,411,630,233
未収利息	527,053,505
前払費用	39,370,553
流動資産合計	31,558,088,334
資産合計	31,558,088,334
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	395,407
未払解約金	146,408,100
未払利息	381
流動負債合計	146,803,888
負債合計	146,803,888
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,389,934,192
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	13,021,350,254

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	31,411,284,446
純資産合計	31,411,284,446
負債純資産合計	31,558,088,334

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,389,934,192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 1.7081円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,081円)</p>

（金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

平成29年11月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	17,944,275,245円
期中追加設定元本額	1,118,407,745円
期中一部解約元本額	672,748,798円
期末元本額	18,389,934,192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	3,476,164,332円
世界経済インデックスファンド	4,470,395,185円
DC 新興国債券インデックス・オープン	3,357,187,701円
DC 世界経済インデックスファンド	3,296,051,209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）	1,912,162,764円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	24,983,878円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	103,880,848円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,205,559,435円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	175,279,702円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,552,261円



区分	平成29年11月10日現在
S M T インデックスバランス・オープン	217,190,033円
S M T 世界経済インデックス・オープン	384,616円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	28,175,176円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	29,734,815円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	232,237円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,787,037
合計	5,787,037

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成29年11月10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	119,737,088	-	120,132,495	395,407
	マレーシアリン ギット	119,737,088	-	120,132,495	395,407
合計		119,737,088	-	120,132,495	395,407

## (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	14,741,622.00	
		MBONO 10% 12/05/24	44,350,000.00	51,495,450.25	
		MBONO 5.75% 03/05/26	37,800,000.00	34,490,988.00	
		MBONO 5% 12/11/19	78,200,000.00	75,201,421.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	41,700,000.00	40,810,122.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	63,000,000.00	61,953,885.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	27,100,000.00	27,599,046.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	24,800,000.00	25,580,828.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	40,250,000.00	41,048,358.75	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,600,000.00	25,328,898.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	18,700,000.00	20,465,093.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	16,350,000.00	18,000,205.50	
		MBONO 8.5% 12/13/18	31,200,000.00	31,636,176.00	
		MBONO 8% 06/11/20	34,200,000.00	35,015,157.00	
		MBONO 8% 11/07/47	8,000,000.00	8,383,480.00	
		MBONO 8% 12/07/23	17,300,000.00	18,096,924.50	
		メキシコペソ 小計			519,350,000.00
	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/19	4,850,000.00	4,481,758.90	
		BLTN 0% 01/01/20	17,850,000.00	15,011,011.05	
		BLTN 0% 04/01/19	8,650,000.00	7,827,333.10	
		BLTN 0% 07/01/19	4,500,000.00	3,980,650.50	
		BLTN 0% 07/01/20	11,800,000.00	9,432,790.20	
		BNTNF 10% 01/01/19	6,750,000.00	6,943,800.32	
		BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000.00	15,167,900.75	
		BNTNF 10% 01/01/23	11,100,000.00	11,253,259.46	
		BNTNF 10% 01/01/25	6,850,000.00	6,878,832.71	
		BNTNF 10% 01/01/27	7,450,000.00	7,430,281.03	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	400,000.00	437,750.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	511,875.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,947,500.00	
		ブラジルリアル 小計			97,350,000.00
	チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	4,200,000,000.00	4,435,053,000.00	
チリペソ 小計			4,200,000,000.00	4,435,053,000.00 (796,979,024)	
	コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000.00	12,253,484,250.00	
		COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000.00	20,812,652,000.00	
		COLOM 9.85% 06/28/27	19,500,000,000.00	24,372,757,500.00	

コロンビアペソ 小計		52,050,000,000.00	57,438,893,750.00 (2,159,702,405)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,100,000.00	3,294,137.50
	PERUGB 6.15% 08/12/32	3,850,000.00	4,048,429.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	4,300,000.00	4,675,712.50
	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,800,000.00	3,105,438.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	3,650,000.00	4,138,497.75
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,650,000.00	1,823,274.75
	PERUGB 8.2% 08/12/26	3,300,000.00	4,025,571.00
ペルーヌエボソル 小計		22,650,000.00	25,111,060.50 (878,133,785)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	10,500,000.00	10,471,755.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	11,750,000.00	12,449,477.50
ウルグアイペソ 小計		22,250,000.00	22,921,232.50 (88,934,382)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,485,912.00
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,604,082.50
	TURKGB 10.5% 01/15/20	3,150,000.00	2,998,989.00
	TURKGB 10.5% 08/11/27	4,000,000.00	3,684,020.00
	TURKGB 10.6% 02/11/26	8,950,000.00	8,312,670.50
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,500,000.00	6,130,442.50
	TURKGB 10.7% 08/17/22	5,500,000.00	5,151,052.50
	TURKGB 11% 02/24/27	1,800,000.00	1,704,528.00
	TURKGB 11% 03/02/22	6,050,000.00	5,733,917.75
	TURKGB 7.1% 03/08/23	4,950,000.00	3,968,390.25
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,430,696.50
	TURKGB 8.5% 07/10/19	5,450,000.00	5,081,798.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	2,450,000.00	2,112,573.75
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,050,000.00	4,350,524.50
	TURKGB 8% 03/12/25	6,450,000.00	5,213,889.75
	TURKGB 9.2% 09/22/21	3,000,000.00	2,680,035.00
	TURKGB 9.4% 07/08/20	4,900,000.00	4,513,488.00
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,707,755.00
	TURKGB 9% 07/24/24	5,000,000.00	4,339,750.00
トルコリラ 小計		84,350,000.00	76,204,515.50 (2,233,554,349)
チェココルナ	CZGB 0.45% 10/25/23	14,500,000.00	14,046,077.50
	CZGB 0.95% 05/15/30	17,550,000.00	15,756,039.00
	CZGB 0% 02/10/20	1,850,000.00	1,833,812.50
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	44,142,804.50
	CZGB 1% 06/26/26	17,500,000.00	16,862,475.00
	CZGB 2.4% 09/17/25	16,500,000.00	17,837,985.00
	CZGB 2.5% 08/25/28	17,250,000.00	18,567,900.00

	CZGB 3.75% 09/12/20	17,800,000.00	19,427,721.00
	CZGB 3.85% 09/29/21	33,000,000.00	37,063,620.00
	CZGB 4.7% 09/12/22	15,000,000.00	17,824,425.00
	CZGB 5.7% 05/25/24	24,900,000.00	32,338,252.50
チェココルナ 小計		218,950,000.00	235,701,112.00 (1,218,574,749)
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	155,000,000.00	159,512,825.00
	HGB 1% 09/23/20	139,000,000.00	140,777,115.00
	HGB 2.5% 10/27/21	255,000,000.00	270,951,525.00
	HGB 2% 10/30/19	173,000,000.00	179,621,575.00
	HGB 3.5% 06/24/20	302,000,000.00	326,757,960.00
	HGB 3% 06/26/24	278,000,000.00	301,869,080.00
	HGB 3% 10/27/27	180,000,000.00	191,885,400.00
	HGB 5.5% 06/24/25	397,000,000.00	496,321,460.00
	HGB 5.5% 12/20/18	98,000,000.00	103,907,930.00
	HGB 6.0% 11/24/23	332,000,000.00	421,555,340.00
	HGB 6.5% 06/24/19	210,000,000.00	231,853,650.00
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	285,486,645.00
	HGB 7% 06/24/22	285,000,000.00	361,776,150.00
	ハンガリーフォリント 小計		3,041,000,000.00
ポーランドズロチ	POLGB 0% 04/25/19	3,300,000.00	3,235,402.50
	POLGB 1.5% 04/25/20	6,150,000.00	6,099,723.75
	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000.00	8,232,924.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,163,937.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	10,500,000.00	9,847,792.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,350,000.00	5,880,195.25
	POLGB 2% 04/25/21	7,300,000.00	7,244,702.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000.00	8,595,782.25
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,900,000.00	6,913,558.50
	POLGB 4% 10/25/23	6,450,000.00	6,834,581.25
	POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000.00	5,080,566.75
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,941,780.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,334,825.50
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,000,000.00	2,251,320.00
ポーランドズロチ 小計		90,800,000.00	91,657,091.75 (2,861,534,404)
ロシアルーブル	RFLB 6.4% 05/27/20	62,000,000.00	60,773,640.00
	RFLB 6.7% 05/15/19	91,000,000.00	90,308,855.00
	RFLB 6.8% 12/11/19	46,200,000.00	45,829,476.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	92,000,000.00	89,186,640.00
	RFLB 7.1% 10/16/24	90,000,000.00	88,134,750.00
	RFLB 7.4% 12/07/22	104,400,000.00	104,459,508.00

	RFLB 7.5% 02/27/19	45,800,000.00	45,968,315.00
	RFLB 7.5% 08/18/21	100,400,000.00	100,969,770.00
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	64,990,604.25
	RFLB 7.6% 07/20/22	47,500,000.00	47,991,862.50
	RFLB 7.7% 03/23/33	88,600,000.00	88,555,257.00
	RFLB 7.75% 09/16/26	97,600,000.00	99,106,456.00
	RFLB 7% 01/25/23	42,700,000.00	42,008,260.00
	RFLB 7% 08/16/23	81,200,000.00	79,898,364.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	105,000,000.00	109,569,600.00
	RFLB 8.5% 09/17/31	78,100,000.00	84,333,551.50
	<b>ロシアルーブル 小計</b>	<b>1,236,850,000.00</b>	<b>1,242,084,909.25</b> <b>(2,372,382,176)</b>
<b>マレーシアリングット</b>	MGS 3.418% 08/15/22	3,400,000.00	3,341,775.00
	MGS 3.48% 03/15/23	5,200,000.00	5,104,424.00
	MGS 3.492% 03/31/20	7,000,000.00	7,049,105.00
	MGS 3.62% 11/30/21	3,850,000.00	3,834,138.00
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,580,143.75
	MGS 3.659% 10/15/20	5,100,000.00	5,134,909.50
	MGS 3.759% 03/15/19	1,400,000.00	1,409,135.00
	MGS 3.8% 08/17/23	5,500,000.00	5,450,830.00
	MGS 3.899% 11/16/27	2,800,000.00	2,743,678.00
	MGS 3.9% 11/30/26	2,400,000.00	2,341,224.00
	MGS 3.955% 09/15/25	4,750,000.00	4,684,806.25
	MGS 4.059% 09/30/24	3,500,000.00	3,516,100.00
	MGS 4.16% 07/15/21	2,250,000.00	2,285,685.00
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,718,851.50
	MGS 4.232% 06/30/31	4,200,000.00	4,041,765.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,450,000.00	2,313,988.25
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,161,504.00
	<b>マレーシアリングット 小計</b>	<b>67,100,000.00</b>	<b>66,712,062.25</b> <b>(1,804,561,283)</b>
<b>タイバーツ</b>	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000.00	79,294,670.00
	THAIGB 2.125% 12/17/26	36,000,000.00	35,491,320.00
	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000.00	78,814,575.00
	THAIGB 2% 12/17/22	7,000,000.00	7,051,415.00
	THAIGB 3.4% 06/17/36	38,000,000.00	41,259,830.00
	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000.00	81,235,172.50
	THAIGB 3.65% 06/20/31	60,000,000.00	66,397,200.00
	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000.00	98,055,685.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	65,400,000.00	73,246,365.00
	THAIGB 3.875% 06/13/19	94,700,000.00	98,345,003.00
	THAIGB 4.875% 06/22/29	69,000,000.00	85,231,215.00
		<b>691,350,000.00</b>	<b>744,422,450.50</b>

タイバーツ 小計			(2,553,369,005)
フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,919,400.00
	PHILIP 4.95% 01/15/21	10,000,000.00	10,303,600.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	22,541,500.00
フィリピンペソ 小計		40,000,000.00	42,764,500.00 (94,509,545)
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	8,053,227,000.00
	INDOGB 11% 09/15/25	6,700,000,000.00	8,417,377,500.00
	INDOGB 11% 11/15/20	12,500,000,000.00	14,172,375,000.00
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	8,231,842,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	14,500,000,000.00	14,018,817,500.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	6,500,000,000.00	6,128,427,500.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	25,399,455,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	4,000,000,000.00	4,151,420,000.00
	INDOGB 7.875% 04/15/19	13,200,000,000.00	13,649,328,000.00
	INDOGB 7% 05/15/22	17,000,000,000.00	17,581,825,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	22,200,000,000.00	22,953,246,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/36	16,700,000,000.00	18,309,796,500.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	18,037,394,000.00
	INDOGB 8.25% 07/15/21	26,200,000,000.00	28,057,056,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000.00	35,222,080,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/34	21,000,000,000.00	23,238,180,000.00
	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000.00	37,889,800,000.00
	INDOGB 8.75% 05/15/31	21,900,000,000.00	24,927,456,000.00
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,659,651,000.00
INDOGB 9% 03/15/29	21,500,000,000.00	24,909,255,000.00	
インドネシアルピア 小計		337,300,000,000.00	367,008,009,000.00 (3,082,867,275)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	49,000,000.00	52,567,445.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,300,000.00	11,138,034.50
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	19,734,868.50
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,150,000.00	13,531,291.25
	SAGB 7.25% 01/15/20	16,000,000.00	15,758,000.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	19,100,000.00	18,421,186.00
	SAGB 7% 02/28/31	25,800,000.00	20,391,804.00
	SAGB 8.25% 03/31/32	27,100,000.00	23,581,065.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000.00	26,884,978.50
	SAGB 8.75% 01/31/44	21,200,000.00	18,219,916.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	29,650,000.00	25,522,868.25
	SAGB 8.875% 02/28/35	16,800,000.00	15,102,948.00
	SAGB 8% 01/31/30	22,300,000.00	19,506,590.50
	SAGB 8% 12/21/18	9,450,000.00	9,484,303.50
	SAGB 9% 01/31/40	20,850,000.00	18,531,271.50

	南アフリカランド 小計	348,300,000.00	308,376,570.50 (2,454,677,501)
	合計		30,411,630,233 (30,411,630,233)

## 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%	10.4%
ブラジルレアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.6%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.1%
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%	0.3%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	7.3%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	4.8%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.4%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	7.8%
マレーシアリンギット	国債証券 17銘柄	100.0%	5.9%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.4%
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%	10.1%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	8.1%

(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。

## J-REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,006,411,886
投資証券	80,907,207,600
未収入金	49,985,271
未収配当金	679,984,637
前払金	53,016,640
差入委託証拠金	11,971,500
流動資産合計	82,708,577,534
資産合計	82,708,577,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,016,640
未払解約金	64,880,278
未払利息	1,805
流動負債合計	117,898,723
負債合計	117,898,723
純資産の部	
元本等	
元本	56,695,653,318
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,895,025,493
元本等合計	82,590,678,811
純資産合計	82,590,678,811
負債純資産合計	82,708,577,534

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>



	平成29年11月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成29年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,695,653,318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 1.4567円 (1万口当たり純資産額) (14,567円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成29年11月10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不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年11月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	47,227,444,067円
期中追加設定元本額	10,464,542,493円
期中一部解約元本額	996,333,242円

区分	平成29年11月10日現在
期末元本額	56,695,653,318円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,726,972,021円
SBI資産設計オープン（分配型）	10,313,683円
SMT J-REITインデックス・オープン	11,477,197,180円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,444,127,075円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,375,371,698円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,036,994,367円
分散投資コア戦略ファンドA	1,641,732,611円
分散投資コア戦略ファンドS	2,516,874,727円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,046,331,822円
SMT インデックスバランス・オープン	44,144,210円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	917,836,196円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	1,270,688円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	270,349円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,456,216,691円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,077,010,144
合計	6,077,010,144

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成29年11月10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	不動産投信指数先物取引 買建	1,718,096,140	-	1,665,079,500	53,016,640
合計		1,718,096,140	-	1,665,079,500	53,016,640

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,685	1,610,345,000	
	MCUBS MidCity投資法人	2,245	817,180,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,914	1,563,116,800	
	産業ファンド投資法人	3,013	1,398,032,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,269	2,700,747,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,516	725,866,000	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4,794	2,128,536,000	
	GLP投資法人	19,417	2,164,995,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,045	930,350,000	
	日本プロロジスリート投資法人	13,950	3,247,560,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,684	914,412,000	
	Oneリート投資法人	1,213	275,351,000	
	イオンリート投資法人	10,532	1,195,382,000	
	ヒューリックリート投資法人	7,533	1,189,460,700	
	日本リート投資法人	2,980	971,480,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,145	658,129,500	
	日本ヘルスケア投資法人	538	87,156,000	
	積水ハウス・リート投資法人	6,957	860,580,900	
	トーセイ・リート投資法人	1,783	187,393,300	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,033	912,264,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,367	139,707,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,926	168,717,600	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	611	84,318,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	31,819	4,381,476,300	
	いちごホテルリート投資法人	1,753	197,387,800	
	ラサールロジポート投資法人	8,367	909,492,900	
	スターアジア不動産投資法人	2,303	241,584,700	
マリモ地方創生リート投資法人	619	66,294,900		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,794	580,359,000		
大江戸温泉リート投資法人	1,411	128,401,000		

さくら総合リート投資法人	2,666	240,206,600	
投資法人みらい	1,411	234,084,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,402	324,029,800	
三菱地所物流リート投資法人	1,028	281,980,400	
日本ビルファンド投資法人	10,740	5,756,640,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,483	5,440,677,000	
日本リートファンド投資法人	21,336	4,247,997,600	
オリックス不動産投資法人	21,398	3,280,313,400	
日本プライムリアルティ投資法人	7,002	2,517,219,000	
プレミア投資法人	10,018	995,789,200	
東急リアル・エステート投資法人	7,436	978,577,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,781	653,627,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,461	3,913,760,000	
森トラスト総合リート投資法人	7,927	1,264,356,500	
インヴィンシブル投資法人	30,418	1,417,478,800	
フロンティア不動産投資法人	3,773	1,658,233,500	
平和不動産リート投資法人	6,907	629,227,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,389	1,502,922,600	
福岡リート投資法人	5,383	853,205,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,242	1,912,780,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	8,409	910,694,700	
いちごオフィスリート投資法人	8,588	644,958,800	
大和証券オフィス投資法人	2,393	1,311,364,000	
阪急リート投資法人	4,545	595,395,000	
スターツプロシード投資法人	1,748	283,525,600	
大和ハウスリート投資法人	11,407	2,944,146,700	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,011	2,404,026,100	
日本賃貸住宅投資法人	12,475	976,792,500	
ジャパンエクセレント投資法人	9,932	1,297,119,200	
合計	449,925	80,907,207,600	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成29年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	131,174,142
コール・ローン	43,063,355
投資証券	62,567,080,769
派生商品評価勘定	195,880
未収入金	257,311,726
未収配当金	111,310,130
流動資産合計	63,110,136,002
資産合計	63,110,136,002
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	900
未払解約金	77,914,777
未払利息	77
流動負債合計	77,915,754
負債合計	77,915,754
純資産の部	
元本等	
元本	35,325,721,632
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,706,498,616
元本等合計	63,032,220,248
純資産合計	63,032,220,248
負債純資産合計	63,110,136,002

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

		平成29年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			35,325,721,632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)		1.7843円 (17,843円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成29年11月10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為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>		

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。



## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成29年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 8月25日
期首元本額	36,123,064,799円
期中追加設定元本額	806,595,695円
期中一部解約元本額	1,603,938,862円
期末元本額	35,325,721,632円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	193,104,213円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,638,848,253円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,719,123円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	7,420,825,142円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	17,589,643,393円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,187,943,043円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,910,831,791円
分散投資コア戦略ファンドA	595,925,047円
分散投資コア戦略ファンドS	1,219,116,414円
コア投資戦略ファンド（切替型）	502,440,052円
S M T インデックスバランス・オープン	206,432,387円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	649,333,039円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	233,923円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	591,217,462円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	610,108,350円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,025,256,941
合計	4,025,256,941

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成29年11月10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	105,462,380	-	105,267,400	194,980
	アメリカドル	62,487,500	-	62,353,500	134,000
	ユーロ	13,209,800	-	13,210,000	200
	イギリスポンド	14,901,300	-	14,902,000	700
	オーストラリアドル	14,863,780	-	14,801,900	61,880
	合計	105,462,380	-	105,267,400	194,980

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	39,900	1,167,474.00	
		AGREE REALTY CORP	14,630	715,407.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,600	969,992.00	
		ALEXANDER'S INC	1,790	724,609.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,430	5,602,623.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	18,480	728,481.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	63,740	2,700,663.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	107,060	2,344,614.00	

APARTMENT INVEST & MGMT	75,533	3,414,846.93
APPLE HOSPITALITY REIT INC	102,003	1,961,517.69
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	25,870	385,721.70
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	14,500	132,675.00
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	292,750.80
AVALONBAY COMMUNITIES INC	65,790	12,333,651.30
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	104,400.00
BOSTON PROPERTIES	73,420	9,251,654.20
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,018	1,437,259.32
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,330	2,656,590.30
CAMDEN PROPERTY TRUST	44,610	4,189,325.10
CARETRUST REIT INC	38,680	726,023.60
CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	506,277.20
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	186,907.50
CHATHAM LODGING TRUST	18,110	415,262.30
CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,960	840,378.00
CITY OFFICE REIT INC	13,300	171,437.00
CLIPPER REALTY INC	7,300	80,665.00
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	268,195	3,408,758.45
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	57,860	1,294,906.80
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	7,200	195,552.00
CORECIVIC INC	58,220	1,503,240.40
CORESITE REALTY CORP	15,810	1,840,125.90
CORPORATE OFFICE PPTYS	49,030	1,585,139.90
COUSINS PROPERTIES INC	194,953	1,774,072.30
CUBESMART	87,050	2,519,227.00
CYRUSONE INC	44,450	2,768,346.00
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	43,687	2,611,608.86
DDR CORPORATION	148,209	1,176,779.46
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,570	1,057,341.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	97,480	11,915,955.20
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	73,670	2,952,693.60
DUKE REALTY CORP	168,680	4,879,912.40
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19,000	392,350.00
EASTGROUP PROPERTIES, INC	16,810	1,551,058.70
EDUCATION REALTY TRUST INC	34,626	1,262,810.22
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	63,310	1,294,689.50
EPR PROPERTIES	30,830	2,101,681.10
EQUITY COMMONWEALTH	57,530	1,743,734.30
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	40,870	3,670,126.00
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	174,990	12,228,301.20
ESSEX PROPERTY TRUST	31,420	8,073,369.00
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,690	5,100,510.50

FARMLAND PARTNERS INC	13,000	116,350.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,210	4,496,562.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	55,680	1,757,817.60	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	129,580	3,207,105.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	31,500	821,835.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	570,280.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	97,100	3,575,222.00	
GEO GROUP INC/THE	61,050	1,644,076.50	
GETTY REALTY CORP	17,300	486,476.00	
GGP INC	297,720	6,549,840.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	338,400.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	68,800.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	86,925.00	
GLOBAL NET LEASE INC	32,910	703,615.80	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	45,930	861,646.80	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	74,776	2,169,999.52	
HCP INC	221,480	5,984,389.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	58,510	1,900,404.80	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	94,370	2,878,285.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	316,123.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	48,310	2,496,660.80	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	76,853	2,277,154.39	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	351,850	7,037,000.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	72,820	2,569,817.80	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	40,000	416,000.00	
INFRAREIT INC	19,000	406,030.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	378,228.80	
INVITATION HOMES INC	39,100	911,030.00	
IRON MOUNTAIN INC	124,692	5,066,235.96	
ISTAR INC	35,000	397,950.00	
JBG SMITH PROPERTIES	44,620	1,452,827.20	
KILROY REALTY CORPORATION	47,600	3,532,872.00	
KIMCO REALTY CORP	205,000	3,909,350.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	794,274.10	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	54,070	1,545,861.30	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	107,306	1,110,617.10	
LIBERTY PROPERTY TRUST	69,310	3,100,929.40	
LIFE STORAGE INC	21,660	1,917,559.80	
LTC PROPERTIES INC	19,700	927,673.00	
MACERICH CO/THE	52,940	3,303,985.40	
MACK-CALI REALTY CORP	40,770	908,763.30	

MANULIFE US REAL ESTATE INV	469,000	422,100.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	11,500	126,730.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	176,160	2,397,537.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	53,958	5,698,504.38	
MONMOUTH REIT -CL A	33,500	577,540.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	69,800	2,929,506.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	20,000	517,200.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	18,830	1,439,176.90	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	326,400.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	271,600.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	419,543.46	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	92,556	2,597,121.36	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	198,320.00	
PARAMOUNT GROUP INC	99,000	1,583,010.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	70,830	2,062,569.60	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	32,350	1,187,892.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	349,751.80	
PHYSICIANS REALTY TRUST	86,040	1,556,463.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,387,693.50	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	14,000	294,980.00	
PROLOGIS INC	253,730	16,867,970.40	
PS BUSINESS PARKS INC	9,620	1,289,849.60	
PUBLIC STORAGE	71,370	15,085,476.90	
QTS REALTY TRUST INC	22,270	1,339,540.50	
QUALITY CARE PROPERTIES	43,944	718,484.40	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	39,850	547,539.00	
REALTY INCOME CORP	129,650	7,294,109.00	
REGENCY CENTERS CORP	71,380	4,733,921.60	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	53,940	1,018,387.20	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	106,650	1,369,386.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,790	992,881.20	
RLJ LODGING TRUST	84,201	1,782,535.17	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,000	1,653,000.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	81,790	1,570,368.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	411,179.00	
SELECT INCOME REIT	30,920	785,058.80	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	114,730	2,162,660.50	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	12,000	483,600.00	
SIMON PROPERTY GROUP	148,450	23,939,047.00	
SL GREEN REALTY CORP	47,840	4,724,200.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	219,300	1,890,366.00	

	STAG INDUSTRIAL INC	42,260	1,199,761.40
	STARWOOD WAYPOINT HOMES	60,920	2,289,982.80
	STORE CAPITAL CORP	78,070	2,025,135.80
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	53,900	834,911.00
	SUN COMMUNITIES INC	37,060	3,433,238.40
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	106,990	1,769,614.60
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	43,340	1,029,325.00
	TAUBMAN CENTERS INC	28,590	1,434,932.10
	TERRENO REALTY CORP	25,970	960,890.00
	TIER REIT INC	21,060	402,667.20
	UDR INC	126,870	5,053,232.10
	UMH PROPERTIES INC	14,000	214,900.00
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	434,829.00
	URBAN EDGE PROPERTIES	48,410	1,188,465.50
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	367,290.00
	VENTAS INC	169,600	10,991,776.00
	VEREIT INC	457,600	3,738,592.00
	VORNADO REALTY TRUST	81,960	6,168,309.60
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	91,000	658,840.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	36,940	1,215,326.00
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	56,410	1,835,017.30
	WELLTOWER INC	175,750	12,000,210.00
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	39,000.00
	WHITESTONE REIT	16,110	230,856.30
	WP CAREY INC	50,450	3,594,562.50
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,580	1,054,186.00
	アメリカドル 小計	11,045,206	397,107,523.97 (45,028,022,142)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	75,840.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	22,610	941,706.50
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	483,129.20
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	457,954.20
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	32,850	1,213,807.50
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	17,660	803,883.20
	CHOICE PROPERTIES REIT	20,000	272,600.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	45,000	628,200.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	294,329.82
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	208,926.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	44,000	511,280.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	122,850.00

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,790	402,669.70	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,740	496,350.40	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	67,620	1,474,792.20	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,000	155,880.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	251,820.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	119,533.50	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	188,626.20	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	11,403	285,189.03	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	21,390	244,273.80	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	70,000	475,300.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	73,820	1,879,457.20	
	SLATE OFFICE REI	9,400	76,610.00	
	SLATE RETAIL REIT	7,000	92,120.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	30,610	912,178.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	12,500	92,375.00	
	カナダドル 小計	673,950	13,161,681.45 (1,177,575,639)	
ユーロ	AEDIFICA	8,600	691,268.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	59,957	733,873.68	
	ALTAREA	1,750	333,287.50	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	31,350	507,870.00	
	BEFIMMO S.C.A.	11,560	612,448.80	
	BENI STABILI SPA	547,000	402,318.50	
	COFINIMMO	9,300	1,010,445.00	
	EUROCOMMERCIAL	24,100	838,559.50	
	FONCIERE DES REGIONS	25,620	2,242,774.80	
	GECINA SA	21,800	3,018,210.00	
	GREEN REIT PLC	337,170	509,126.70	
	HAMBORNER REIT AG	40,000	368,240.00	
	HIBERNIA REIT PLC	338,290	504,052.10	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	54,100	784,450.00	
	ICADE	21,120	1,625,817.60	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	159,903.10	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,900	153,318.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	239,200.00	
	KLEPIERRE	98,690	3,435,892.35	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	374,383.44	
	MERCIALYS	28,020	483,345.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	155,780	1,705,791.00	

	NSI NV	9,200	301,300.00	
	RETAIL ESTATES	3,000	207,930.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	47,290	10,401,435.50	
	VASTNED RETAIL	7,300	277,363.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,897	726,524.00	
	WERELDHAVE NV	18,380	723,344.90	
	ユーロ 小計	2,278,106	33,372,472.97 (4,408,503,679)	
イギリスポ ンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	39,000	40,072.50	
	ASSURA PLC	864,900	524,994.30	
	BIG YELLOW GROUP PLC	70,290	534,555.45	
	BRITISH LAND CO PLC	489,810	2,929,063.80	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	220,000	111,100.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	106,820.00	
	DERWENT LONDON PLC	54,240	1,470,446.40	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	280,575.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	162,393	997,093.02	
	HAMMERSON PLC	372,940	1,970,987.90	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	383,580	508,627.08	
	INTU PROPERTIES PLC	428,960	908,108.32	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	356,340	3,383,448.30	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	343,070	605,518.55	
	LXI REIT PLC	68,000	70,550.00	
	NEWRIVER REIT PL	150,000	491,250.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	281,000	323,150.00	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	612,000	233,478.00	
	REGIONAL REIT LTD	130,000	133,250.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	97,990	462,708.78	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	151,875.00	
	SEGRO PLC	466,510	2,558,807.35	
	SHAFTESBURY PLC	108,100	1,073,433.00	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	627,830	926,049.25		
UNITE GROUP PLC	119,000	854,420.00		
WORKSPACE GROUP PLC	54,920	512,129.00		
	イギリスポンド 小計	7,138,873	22,162,511.00 (3,302,879,014)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	159,010	648,760.80	
	ARENA REIT	114,000	262,200.00	
	BWP TRUST	247,960	771,155.60	
	CHARTER HALL GROUP	215,600	1,332,408.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	71,000	297,490.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	159,170	655,780.40	



	CROMWELL PROPERTY GROUP	575,940	587,458.80	
	DEXUS	487,800	4,878,000.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	291,678.00	
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	270,610.00	
	GOODMAN GROUP	755,010	6,583,687.20	
	GPT GROUP	870,285	4,595,104.80	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	105,200	361,888.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	248,820.00	
	INDUSTRIA REIT	75,000	197,250.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	240,300.00	
	INVESTA OFFICE FUND	241,190	1,109,474.00	
	MIRVAC GROUP	1,737,210	4,360,397.10	
	NATIONAL STORAGE REIT	233,217	350,991.58	
	PROPERTYLINK GROUP	250,000	252,500.00	
	RURAL FUNDS GROUP	122,000	273,280.00	
	SCENTRE GROUP	2,534,560	10,493,078.40	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	342,000	803,700.00	
	STOCKLAND	1,136,810	5,286,166.50	
	VICINITY CENTERS	1,539,740	4,280,477.20	
	VIVA ENERGY REIT	230,000	499,100.00	
	WESTFIELD CORP	905,690	7,336,089.00	
	オーストラリアドル 小計	13,596,680	57,267,845.38 (4,987,456,654)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	429,525.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	450,000	594,000.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	141,780.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	690,000	910,800.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	591,100.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	285,360.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	147,460	326,623.90	
	ニュージーランドドル 小計	2,438,460	3,279,188.90 (258,564,044)	
香港ドル	CHAMPION REIT	953,000	5,413,040.00	
	FORTUNE REIT	659,000	6,339,580.00	
	LINK REIT	1,056,000	72,969,600.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,959,520.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,367,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,782,140.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	500,000	2,480,000.00	
	香港ドル 小計	4,674,000	93,311,520.00 (1,356,749,500)	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	396,200.00	

シンガポールドル	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	263,000	235,385.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,125,166	2,981,689.90	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	561,000	676,005.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	518,200	453,425.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,247,328	2,288,846.88	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,314,100	2,667,623.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	256,560	418,192.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	315,900	521,235.00	
	ESR REIT	521,000	291,760.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	274,245.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	258,000	354,750.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	640,484.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,000	339,600.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	558,200	630,766.00	
	KEPPEL DC REIT	369,460	515,396.70	
	KEPPEL REIT	845,300	1,001,680.50	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	414,990.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	866,130	1,355,493.45	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	793,000	927,810.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	585,760	1,156,876.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	995,452	1,294,087.60	
	QUE HOSPITALITY TRUST	590,000	480,850.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	566,280.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	217,735.70	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	210,386.00	
	SPH REIT	232,300	234,623.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	626,300	475,988.00	
	SUNTEC REIT	1,080,200	2,100,989.00	
	シンガポールドル 小計		17,076,896	24,123,393.53
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	72,370	1,043,575.40	
イスラエルシェケル 小計		72,370	1,043,575.40	(33,509,206)
合計		58,994,541	62,567,080,769	(62,567,080,769)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 159銘柄	100.0%	72.0%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	7.0%
イギリスポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.3%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	8.0%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2 ファンドの現況

### SMT 8 資産インデックスバランス・オープン

#### 純資産額計算書

(平成29年11月30日現在)

資産総額	2,431,483円
負債総額	831円
純資産総額( - )	2,430,652円
発行済口数	2,325,845口
1口当たり純資産額( / )	1.0451円
(1万口当たり純資産額)	(10,451円)

(参考)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

資産総額	346,266,672,999円
------	------------------

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成29年11月30日現在）

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成29年11月30日現在)

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

### 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

< 訂正前 >

(1) 資本金の額（平成29年5月31日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成29年8月8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

(1) 資本金の額（平成29年11月30日現在）

（中略）

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成30年2月9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

< 訂正前 >

（前略）

平成29年5月31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	479	9,061,021
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	52	206,711
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	9,267,732

< 訂正後 >

（前略）

平成29年11月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	494	9,669,496
追加型公社債投資信託	0	0

単位型株式投資信託	69	244,603
単位型公社債投資信託	0	0
合計	563	9,914,099

### 3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

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

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

#### (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	16,534,066	20,260,630
前払費用	102,445	143,622
未収委託者報酬	5,528,610	5,252,944
繰延税金資産	121,367	61,677
その他	5,566	5,474
流動資産合計	22,292,056	25,724,348
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 55,487	1 47,993
器具備品	1 90,924	1 73,765
その他	1 3,748	1 2,830
有形固定資産合計	150,160	124,589
無形固定資産		
ソフトウェア	215,175	221,499
その他	5,886	6,656
無形固定資産合計	221,062	228,156
投資その他の資産		
投資有価証券	63,797	71,153



長期前払費用	8,021	9,828
長期貸付金	22,838	19,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	123,235	137,359
その他	235	145
貸倒引当金	22,838	19,838
投資その他の資産合計	220,289	243,485
固定資産合計	591,512	596,231
資産合計	22,883,569	26,320,580

(単位：千円)

	前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	68,500	71,500

その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

## ( 2 ) 損益計算書

( 単位：千円 )

	前事業年度 ( 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日 )	当事業年度 ( 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612

旅費交通費		67,392		61,961
租税公課		73,989		106,691
不動産賃借料		125,339		113,697
減価償却費		126,985		134,710
業務委託費	1	209,510	1	486,690
諸経費		217,580		223,685
一般管理費合計		3,246,214		3,304,885
営業利益		6,525,812		6,261,346

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)		(自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

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

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

## 追加情報

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

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

## 1有形固定資産の減価償却累計額

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

## （損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

(リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

### (注1) 金融商品の時価の算定方法

#### (1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

#### (3) 投資有価証券

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

#### (4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

（単位：千円）



区分	平成28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 其他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

## 2. 事業年度中に売却した其他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## (セグメント情報)

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

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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。

## (報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

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27年4月1日 至平成28年3月31日)	当事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間末  
(平成29年9月30日)

### 資産の部

#### 流動資産

現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472

#### 固定資産

##### 有形固定資産

建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559

##### 無形固定資産

220,928

##### 投資その他の資産

投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747

##### 固定資産合計

586,236

#### 資産合計

28,454,709

### 負債の部

#### 流動負債

未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123

固定負債	
退職給付引当金	464,737
資産除去債務	13,260
その他固定負債	1,569
固定負債合計	479,568
負債合計	4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末  
(平成29年9月30日)

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

## 中間損益計算書

(単位：千円)

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

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

法人税等合計  
中間純利益

886,598

1,978,187

### 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

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

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

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

### 重要な会計方針

第32期中間会計期間

（自 平成29年4月1日  
至 平成29年9月30日）

## 1. 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

定率法によっております。

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

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 貸倒引当金

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

### (2) 賞与引当金

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

### (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

### （中間貸借対照表関係）

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



2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	16,811千円
無形固定資産	41,202千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	1,314千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

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

（単位：千円）

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

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

## (3)投資有価証券

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

## (4)未払金、並びに(5)未払法人税等

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

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

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

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

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

## (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## (セグメント情報等)

## (セグメント情報)

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

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

## (関連情報)

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

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

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

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 5 その他

&lt; 訂正前 &gt;

（前略）

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成29年 8月 8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。

&lt; 訂正後 &gt;

（前略）

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

平成30年 2月 9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。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年1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 8資産インデックスバランス・オープンの平成29年8月25日から平成29年11月10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 8資産インデックスバランス・オープンの平成29年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年 6月 2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成29年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

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

**利害関係**

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

以 上

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