

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年8月10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】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

SMT 8資産インデックスバランス・オープン

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

### （６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

**( 7 ) 【申込期間】**

平成30年 8月11日から平成31年 2月12日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。

以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす



る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

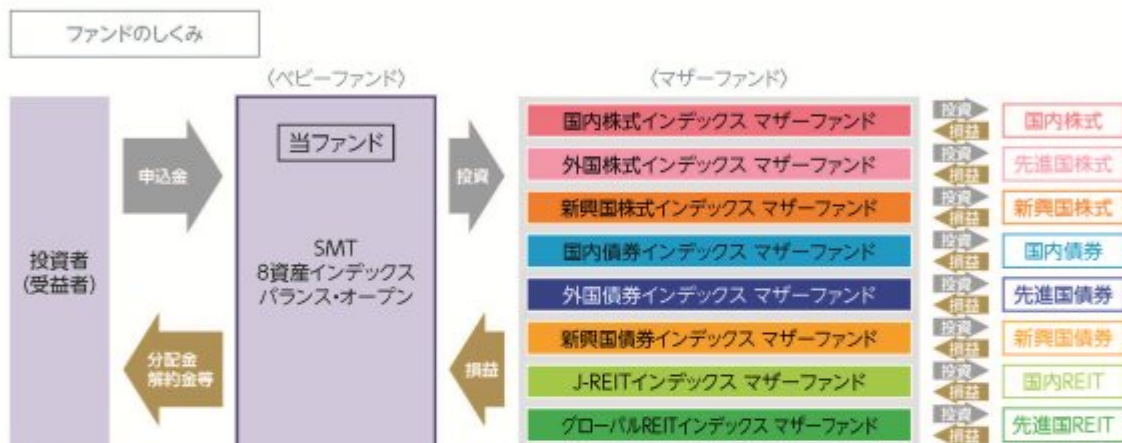
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

#### < ファンドの特色 >

## 特色1

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。



### ? 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

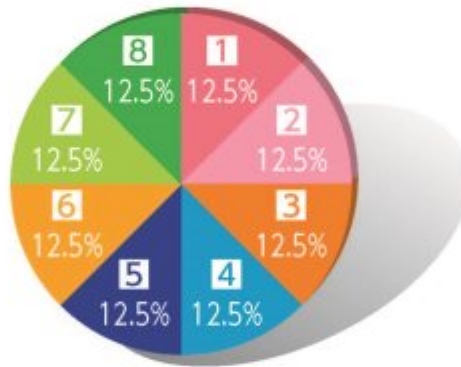
●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※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-BP(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。

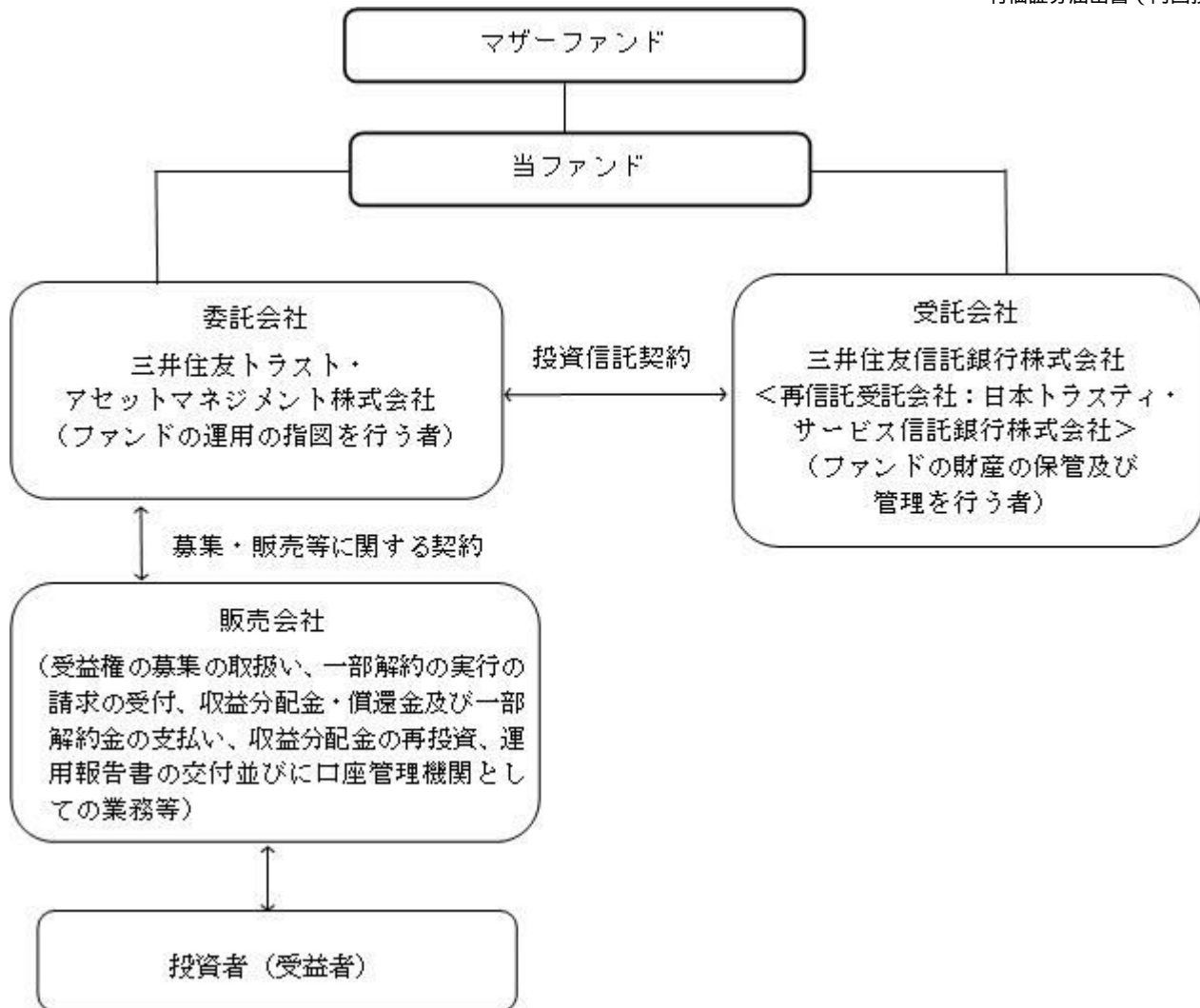
## (2) 【ファンドの沿革】

平成29年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成30年 5月31日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

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

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- 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	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・ディバースファイド（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）

- ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ホ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  1. 有価証券
  2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
  3. 金銭債権
  4. 約束手形

## ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

## 1. 為替手形

## 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の



性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

#### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件の

もとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会

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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

なるよう調整を行うこととします。

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

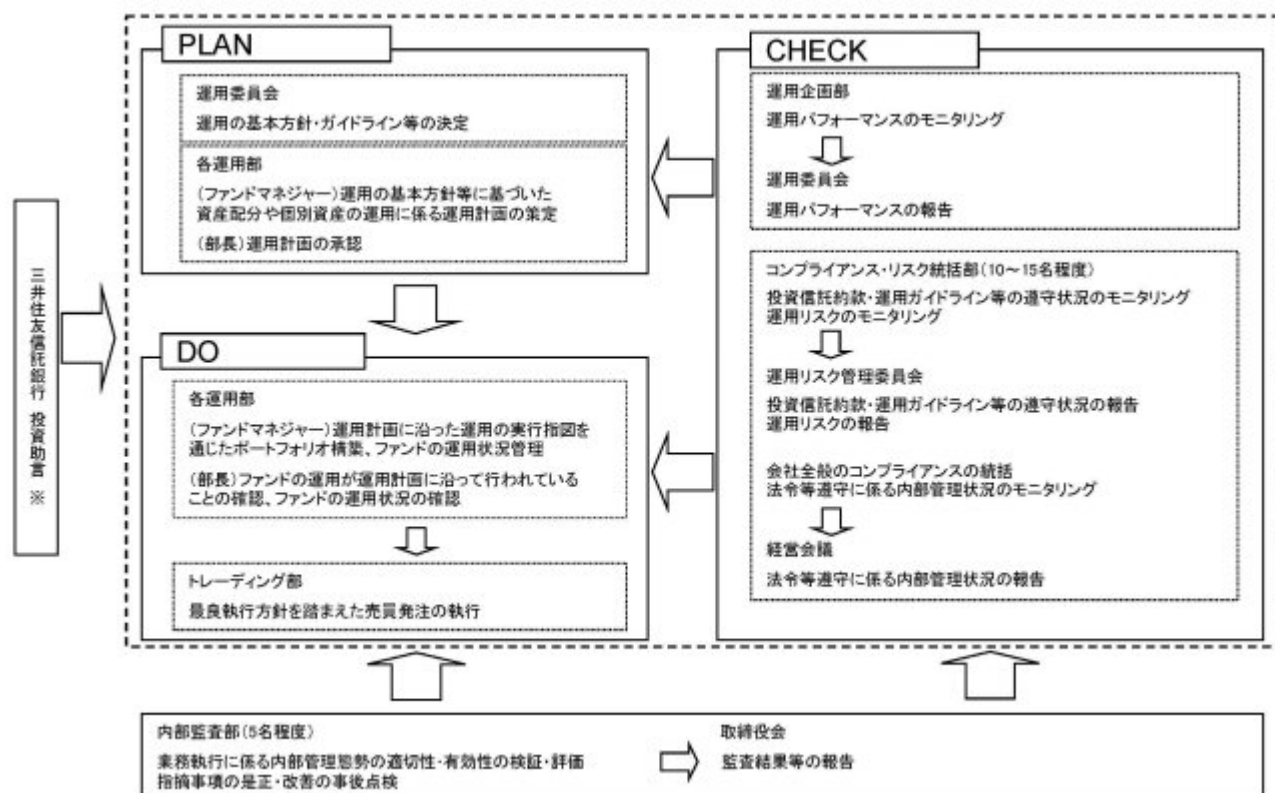
一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (3)【運用体制】

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



ることがあります。



三井住友信託銀行は各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

#### （４）【分配方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

イ．株式等への投資割合

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

50%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

（ハ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商

品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル.の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(八) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ．資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買

を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

##### カントリーリスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

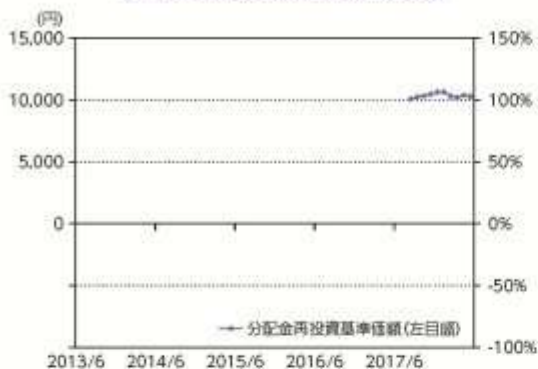
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

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

## 【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

\*2013年6月～2018年5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・グローバル・マーケット・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、指数簿の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

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

#4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募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により開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。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再責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.54%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

## （4）【その他の手数料等】

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



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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成30年 5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2018年 5月31日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 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	8,562,229	99.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		84,789	0.98
合計(純資産総額)		8,647,018	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	J-REITインデックス マザーファンド	710,123	1.6114	1,144,293	1.6130	1,145,428	13.25
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	699,849	1.5975	1,118,009	1.5703	1,098,972	12.71
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	451,033	2.4611	1,110,038	2.4330	1,097,363	12.69
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	645,533	1.6913	1,091,790	1.6882	1,089,788	12.60
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	396,566	2.7017	1,071,403	2.6536	1,052,327	12.17
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	362,823	2.9863	1,083,499	2.8782	1,044,277	12.08
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	623,632	1.6814	1,048,575	1.6403	1,022,943	11.83
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	725,606	1.3913	1,009,536	1.3935	1,011,131	11.69

(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	99.02
合計	99.02

(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	(2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末	(2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
	2017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	
	12月末日	4,060,444		10,617	
	2018年 1月末日	6,554,913		10,632	
	2月末日	6,742,688		10,302	
	3月末日	7,314,688		10,184	
	4月末日	8,167,653		10,372	
	5月末日	8,647,018		10,273	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810

第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
---------	-------------------------	-----------	-----------	-----------

(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	201,591,224,785	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,944,334,762	1.92
合計(純資産総額)		205,535,559,547	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	3,924,605,000	1.91

(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	980,900	6,976.00	6,842,758,400	6,921.00	6,788,808,900	3.30
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,571,400	684.30	3,812,509,020	655.80	3,653,724,120	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	568,200	5,127.00	2,913,161,400	5,106.00	2,901,229,200	1.41
日本	株式	ソニー	電気機器	540,100	5,159.94	2,786,887,300	5,160.00	2,786,916,000	1.36
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	358,500	7,697.00	2,759,374,500	7,765.00	2,783,752,500	1.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	602,400	4,553.00	2,742,727,200	4,503.00	2,712,607,200	1.32
日本	株式	キーエンス	電気機器	39,600	66,390.00	2,629,044,000	66,830.00	2,646,468,000	1.29

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	726,100	3,535.00	2,566,763,500	3,447.00	2,502,866,700	1.22
日本	株式	任天堂	その他製品	49,700	42,400.00	2,107,280,000	45,000.00	2,236,500,000	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	713,000	2,943.00	2,098,359,000	2,945.50	2,100,141,500	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,812,600	193.40	2,091,156,840	189.70	2,051,150,220	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	594,800	2,978.00	1,771,314,400	3,030.00	1,802,244,000	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	76,700	23,735.00	1,820,474,500	23,270.00	1,784,809,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	557,700	3,031.00	1,690,388,700	3,031.00	1,690,388,700	0.82
日本	株式	花王	化学	198,400	8,436.00	1,673,702,400	8,442.00	1,674,892,800	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	97,100	17,130.00	1,663,323,000	16,885.00	1,639,533,500	0.80
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	72,200	22,575.00	1,629,915,000	22,510.00	1,625,222,000	0.79
日本	株式	キヤノン	電気機器	434,400	3,759.00	1,632,909,600	3,714.00	1,613,361,600	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	333,100	4,894.00	1,630,191,400	4,821.00	1,605,875,100	0.78
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	568,600	2,814.00	1,600,040,400	2,818.00	1,602,314,800	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	299,800	5,274.00	1,581,145,200	5,240.00	1,570,952,000	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	144,900	10,750.00	1,557,675,000	10,755.00	1,558,399,500	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,937,000	814.20	1,577,105,400	796.60	1,543,014,200	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	140,700	11,050.00	1,554,735,000	10,890.00	1,532,223,000	0.75
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	501,000	2,934.00	1,469,934,000	2,936.00	1,470,936,000	0.72
日本	株式	小松製作所	機械	389,700	3,625.00	1,412,662,500	3,587.00	1,397,853,900	0.68
日本	株式	ダイキン工業	機械	110,100	12,675.00	1,395,517,500	12,580.00	1,385,058,000	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	829,200	1,676.50	1,390,153,800	1,664.50	1,380,203,400	0.67
日本	株式	パナソニック	電気機器	921,800	1,513.00	1,394,683,400	1,489.50	1,373,021,100	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	84,700	16,130.00	1,366,211,000	16,185.00	1,370,869,500	0.67

(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	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.07
		食料品	4.34
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.39
		医薬品	4.54
		石油・石炭製品	0.68
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.03

非鉄金属	0.83
金属製品	0.64
機械	5.21
電気機器	13.32
輸送用機器	8.34
精密機器	1.68
その他製品	2.23
電気・ガス業	1.71
陸運業	4.22
海運業	0.19
空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.25
卸売業	4.71
小売業	4.90
銀行業	6.71
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	2.24
その他金融業	1.21
不動産業	2.40
サービス業	4.41
小計	98.08
合計	98.08

(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(6月)	買建	212円		3,728,020,000	3,698,340,000	1.80
	大阪取引所	TOPIX先物(9月)	買建	13円		225,457,020	226,265,000	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。

#### 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	196,809,482,790	59.04
	イギリス	21,672,217,919	6.50
	フランス	12,427,163,218	3.73
	ドイツ	12,121,142,289	3.64
	カナダ	12,090,885,516	3.63
	スイス	10,455,799,948	3.14
	オーストラリア	7,639,215,251	2.29
	オランダ	6,225,101,632	1.87
	アイルランド	4,387,137,894	1.32
	スペイン	3,738,830,457	1.12
	スウェーデン	3,224,203,583	0.97
	香港	3,055,231,520	0.92
	イタリア	2,369,640,262	0.71
	デンマーク	2,127,504,219	0.64
	ジャージー	1,583,867,669	0.48
	シンガポール	1,535,099,416	0.46
	バミューダ	1,481,183,280	0.44
	ベルギー	1,319,697,525	0.40
	フィンランド	1,316,213,235	0.39
	ケイマン	906,281,528	0.27
	ノルウェー	876,207,152	0.26
	キュラソー	824,843,666	0.25
	イスラエル	625,243,692	0.19
	ルクセンブルク	456,338,602	0.14
	オーストリア	298,833,667	0.09
	ニュージーランド	239,774,865	0.07
	ポルトガル	197,414,332	0.06
	パナマ	185,653,791	0.06
	リベリア	160,061,212	0.05
	マン島	105,435,632	0.03
	パプアニューギニア	78,839,820	0.02
	英ヴァージン諸島	75,824,149	0.02
モーリシャス	10,547,068	0.00	
	小計	310,620,916,799	93.18
投資信託受益証券	オーストラリア	187,280,272	0.06
	香港	58,935,212	0.02
	シンガポール	15,164,247	0.00
		小計	261,379,731



投資証券	アメリカ	5,564,302,088	1.67
	オーストラリア	683,203,640	0.20
	フランス	380,061,514	0.11
	イギリス	282,107,583	0.08
	香港	171,414,871	0.05
	シンガポール	134,760,332	0.04
	カナダ	61,123,974	0.02
	小計	7,276,974,002	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,200,939,655	4.56
合計(純資産総額)		333,360,210,187	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	10,173,234,087	3.05
	買建	カナダ	687,833,762	0.21
	買建	ドイツ	2,658,711,597	0.80
	買建	イギリス	1,294,645,388	0.39
	買建	オーストラリア	678,821,343	0.20

(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		498,267,200	0.15
	売建		1,530,187,100	0.46

(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	409,491	20,498.64	8,394,011,049	20,381.25	8,345,938,444	2.50
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	584,648	10,691.73	6,250,899,731	10,755.86	6,288,394,961	1.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	32,676	175,023.30	5,719,061,514	176,625.54	5,771,416,243	1.73
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	190,361	20,100.80	3,826,409,150	20,399.72	3,883,312,812	1.16
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	12,028.74	3,331,624,729	11,777.64	3,262,077,891	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	338,335	8,555.77	2,894,718,812	8,859.05	2,997,326,682	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,114	116,924.24	2,936,435,414	116,069.85	2,914,978,464	0.87
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	214,843	13,203.78	2,836,741,640	13,149.43	2,825,064,923	0.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,818	117,839.49	2,806,701,116	117,120.98	2,789,587,716	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	791,346	3,278.39	2,594,342,396	3,205.56	2,536,709,458	0.76
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	373,935	6,026.32	2,253,454,961	6,052.41	2,263,210,177	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	373,750	5,967.63	2,230,401,713	5,894.80	2,203,181,874	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,464	21,104.10	2,141,306,910	21,098.67	2,140,755,453	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,581	26,626.06	2,065,676,749	26,624.97	2,065,592,418	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	151,790	13,282.05	2,016,082,825	13,604.89	2,065,086,557	0.62
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,716	8,451.84	2,102,107,838	8,282.36	2,059,956,196	0.62
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	144,929	14,270.13	2,068,156,541	14,200.56	2,058,074,120	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	93,339	20,310.59	1,895,770,627	20,336.68	1,898,205,655	0.57
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	477,201	3,878.41	1,850,783,994	3,918.63	1,869,976,541	0.56
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	4,702.36	1,848,399,753	4,657.79	1,830,881,401	0.55
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	39,141.78	1,770,695,979	38,935.25	1,761,352,975	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	329,757	5,274.12	1,739,179,308	5,282.82	1,742,046,875	0.52
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	490,614	3,533.83	1,733,749,905	3,540.35	1,736,949,690	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,602,916	1,059.33	1,698,026,110	1,049.21	1,681,805,882	0.50
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	8,077.49	1,638,164,857	8,140.54	1,650,950,964	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	20,780.17	1,561,152,508	20,844.31	1,565,970,628	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	212,257	7,439.42	1,579,070,669	7,248.11	1,538,463,358	0.46

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,690	4,608.87	1,491,848,367	4,688.23	1,517,533,492	0.46
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ロジック・ライフサイエンス	177,940	8,339.58	1,483,946,466	8,200.92	1,459,272,772	0.44
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ロジック・ライフサイエンス	127,922	10,987.39	1,405,529,671	11,197.18	1,432,366,555	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	6.85
		素材	4.79
		資本財	7.07
		商業・専門サービス	1.01
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.43
		耐久消費財・アパレル	1.81
		消費者サービス	1.81
		メディア	1.98
		小売	4.50
		食品・生活必需品小売り	1.38
		食品・飲料・タバコ	4.53
		家庭用品・パーソナル用品	1.79
		ヘルスケア機器・サービス	4.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.43
		銀行	8.71
		各種金融	4.31
		保険	3.79
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	10.82
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.16		
電気通信サービス	2.16		
公益事業	2.83		
半導体・半導体製造装置	3.11		
		小計	93.18
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.18
合計			95.44

(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	687	アメリカドル	93,380,157	10,150,423,066	93,590,010	10,173,234,087	3.05
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	43	カナダドル	8,168,768.5	689,035,623	8,154,520	687,833,762	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	73	スイスフラン	6,405,611	704,937,490	6,268,510	689,849,525	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	454	ユーロ	15,736,521	1,994,289,306	15,535,880	1,968,862,072	0.59
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	55	オーストラリアドル	8,272,000	681,199,199	8,243,125	678,821,343	0.20
	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	117	イギリスポンド	9,029,653.75	1,305,326,746	8,955,765	1,294,645,388	0.39

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,620,000.00	284,715,400	284,689,200	0.09
	カナダドル	買建	150,000.00	12,650,700	12,649,500	0.00
	ユーロ	買建	800,000.00	101,376,800	101,384,000	0.03
	イギリスポンド	買建	150,000.00	21,679,800	21,681,000	0.01
	スイスフラン	買建	170,000.00	18,707,820	18,708,500	0.01
	ノルウェークローネ	買建	1,600,000.00	21,219,200	21,200,000	0.01
	ニュージーランドドル	買建	500,000.00	37,957,500	37,955,000	0.01
	アメリカドル	売建	8,800,000.00	953,920,000	956,472,000	0.29
	カナダドル	売建	680,000.00	56,579,400	57,351,200	0.02
	ユーロ	売建	2,080,000.00	260,126,880	263,598,400	0.08
	イギリスポンド	売建	850,000.00	122,112,700	122,867,500	0.04
	スイスフラン	売建	180,000.00	19,679,220	19,809,000	0.01
	スウェーデンクローナ	売建	2,900,000.00	35,011,700	35,757,000	0.01
	ノルウェークローネ	売建	1,400,000.00	18,296,600	18,550,000	0.01

デンマーククローネ	売建	1,000,000.00	16,804,000	17,030,000	0.01
香港ドル	売建	2,800,000.00	38,690,400	38,752,000	0.01

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

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

## 新興国株式インデックス 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	8,258,112,474	16.61
	韓国	7,396,792,615	14.88
	台湾	5,540,798,419	11.15
	中国	4,779,644,324	9.61
	インド	4,144,356,063	8.34
	ブラジル	2,960,436,540	5.95
	南アフリカ	2,936,747,113	5.91
	香港	1,720,575,295	3.46
	ロシア	1,672,363,049	3.36
	メキシコ	1,262,741,155	2.54
	マレーシア	1,162,263,363	2.34
	タイ	1,151,539,138	2.32
	インドネシア	977,446,856	1.97
	チリ	553,073,741	1.11
	ポーランド	547,131,903	1.10
	フィリピン	488,497,974	0.98
	バミューダ	456,248,865	0.92
	トルコ	379,439,582	0.76
	アラブ首長国連邦	318,042,765	0.64
	カタール	275,839,811	0.55
	コロンビア	209,854,341	0.42
	アメリカ	171,650,794	0.35
	ハンガリー	150,351,389	0.30
	ギリシャ	130,425,947	0.26
	チェコ	86,841,228	0.17
	エジプト	47,813,173	0.10
	マン島	32,800,824	0.07
ペルー	28,487,705	0.06	
ルクセンブルク	13,884,650	0.03	
マルタ共和国	6,792,673	0.01	

	小計	47,860,993,769	96.27
投資信託受益証券	ブラジル	82,291,281	0.17
投資証券	南アフリカ	172,738,958	0.35
	メキシコ	46,171,273	0.09
	トルコ	7,636,837	0.02
	小計	226,547,068	0.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,545,676,958	3.11
合計(純資産総額)		49,715,509,076	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	1,552,651,777	3.12

(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		441,303,464	0.89
	売建		1,200,986	0.00

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	482,500	5,451.85	2,630,519,480	5,470.75	2,639,636,875	5.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	97,658	20,218.69	1,974,517,664	21,520.42	2,101,641,762	4.23

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	411,500	5,641.06	2,321,296,298	5,004.45	2,059,331,175	4.14
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,077,389	874.56	1,816,808,594	800.02	1,661,952,748	3.34
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	37,399	30,759.78	1,150,385,129	26,187.21	979,375,646	1.97
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,069,620	97.32	688,019,458	108.30	765,689,333	1.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	23,402	26,302.74	615,536,866	26,265.18	614,657,766	1.24
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,302,515	87.90	553,991,157	88.77	559,527,828	1.13
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	528,000	1,099.92	580,762,830	971.57	512,992,920	1.03
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	49,668	8,347.26	414,592,115	9,604.50	477,036,306	0.96
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	446,500	1,035.57	462,385,432	1,058.14	472,459,510	0.95
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	1,365,311	381.90	521,419,793	316.38	431,968,017	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	278,478	1,018.83	283,721,971	1,476.87	411,277,781	0.83
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	129,894	2,810.67	365,089,468	2,901.09	376,834,964	0.76
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,588,200	54.15	356,764,085	56.23	370,461,074	0.75
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	237,229	1,463.01	347,069,443	1,484.08	352,067,289	0.71
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	217,842	1,758.26	383,023,713	1,565.28	340,983,726	0.69
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	271,721	1,229.27	334,019,896	1,253.72	340,663,846	0.69
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	148,301	1,576.04	233,729,056	1,962.95	291,108,041	0.59
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	71,650	4,612.18	330,462,840	3,942.90	282,508,785	0.57
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	37,814	6,270.23	237,102,509	7,304.64	276,217,657	0.56
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,538,000	155.44	239,077,076	178.38	274,360,744	0.55
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	406,600	600.21	244,048,921	574.35	233,533,678	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	40,974	4,576.15	187,503,203	5,692.84	233,258,508	0.47
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	273,361	888.72	242,942,246	850.88	232,599,841	0.47
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	469,919	487.13	228,915,136	491.65	231,035,723	0.46
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,721,740	91.35	248,640,747	84.54	230,112,230	0.46
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,175,400	83.20	181,011,549	100.13	217,834,767	0.44
韓国	株式	POSCO	素材	6,275	33,361.51	209,343,523	34,576.20	216,965,655	0.44
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	54,669	4,417.07	241,476,873	3,891.46	212,742,227	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	7.07
		素材	7.16
		資本財	3.49
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.38
		自動車・自動車部品	2.73
		耐久消費財・アパレル	1.02
		消費者サービス	1.21
		メディア	2.34
		小売	1.82
		食品・生活必需品小売り	1.56
		食品・飲料・タバコ	3.30
		家庭用品・パーソナル用品	1.33
		ヘルスケア機器・サービス	0.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.13
		銀行	16.56
		各種金融	2.54
		保険	3.26
		不動産	2.28
		ソフトウェア・サービス	14.08
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.30
電気通信サービス	4.29		
公益事業	2.29		
半導体・半導体製造装置	5.39		
	小計	96.27	
投資信託受益証券			0.17
投資証券			0.46
合計			96.89

(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	255	アメリカドル	14,654,990	1,592,997,413	14,283,825	1,552,651,777	3.12



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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	10,963.95	1,199,422	1,191,464	0.00
	香港ドル	買建	31,800,000.00	439,476,400	440,112,000	0.89
	ブラジルレアル	売建	41,171.98	1,199,422	1,200,986	0.00

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

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

## 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	315,270,425,600	82.85
地方債証券	日本	21,371,570,023	5.62
特殊債券	日本	26,943,968,633	7.08
社債券	日本	13,804,575,470	3.63
	フランス	1,002,938,000	0.26
	オーストラリア	300,936,000	0.08
	オランダ	200,906,000	0.05
	スウェーデン	200,462,000	0.05
	イギリス	100,683,000	0.03
	小計	15,610,500,470	4.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,328,217,097	0.35
合計(純資産総額)		380,524,681,823	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,650,000,000	101.06	5,710,121,000	101.08	5,711,359,000	0.100	2023/3/20	1.50
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.84	5,586,591,400	100.85	5,587,588,600	0.100	2022/3/20	1.47
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.97	4,786,120,200	0.100	2022/9/20	1.26
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,390,000,000	100.66	4,419,017,900	100.66	4,418,974,000	0.100	2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	103.42	3,940,302,000	1.200	2020/12/20	1.04
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	103.26	3,861,924,000	103.25	3,861,811,800	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.89	3,642,381,700	100.91	3,643,067,600	0.100	2022/6/20	0.96
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.55	3,629,999,400	0.100	2020/9/20	0.95
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.85	3,562,089,300	0.600	2023/12/20	0.94
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.37	3,533,164,800	100.37	3,533,129,600	0.100	2019/12/20	0.93
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	100.88	3,429,920,000	100.88	3,429,920,000	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	100.76	3,234,460,200	0.100	2027/12/20	0.85
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	100.76	3,224,448,000	100.76	3,224,416,000	0.100	2021/9/20	0.85
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	101.03	3,202,651,000	0.100	2022/12/20	0.84
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	101.04	3,183,043,500	0.100	2026/6/20	0.84
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	103.33	3,172,507,300	103.33	3,172,415,200	0.400	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.42	3,153,313,600	0.100	2020/3/20	0.83
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,030,000,000	102.65	3,110,446,500	102.65	3,110,385,900	0.300	2025/12/20	0.82
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	2,980,000,000	104.09	3,101,960,400	104.10	3,102,388,600	1.200	2021/6/20	0.82
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	2,920,000,000	104.04	3,037,968,000	104.05	3,038,318,400	1.000	2021/12/20	0.80
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,000,000,000	100.68	3,020,416,600	100.68	3,020,490,000	0.100	2028/3/20	0.79
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.61	2,978,204,000	0.100	2020/12/20	0.78
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	104.13	2,905,366,500	0.600	2024/6/20	0.76
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	2,800,000,000	100.45	2,812,656,000	100.45	2,812,600,000	0.200	2019/9/20	0.74
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,710,000,000	103.64	2,808,779,500	103.64	2,808,698,200	0.500	2024/9/20	0.74
日本	国債証券	第386回利付国債(2年)	2,640,000,000	100.44	2,651,849,200	100.44	2,651,800,800	0.100	2020/3/15	0.70
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,600,000,000	101.09	2,628,496,000	101.09	2,628,470,000	0.100	2026/3/20	0.69
日本	国債証券	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	100.34	2,588,901,000	100.34	2,588,849,400	0.100	2019/10/15	0.68
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	103.17	2,527,861,000	103.17	2,527,812,000	0.400	2025/3/20	0.66
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	2,450,000,000	102.55	2,512,671,000	102.55	2,512,499,500	1.100	2020/6/20	0.66

(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	82.85
地方債証券	5.62
特殊債券	7.08
社債券	4.10
合計	99.65

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス 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	104,535,362,124	42.91
	フランス	24,400,092,426	10.02
	イタリア	21,937,141,494	9.00
	ドイツ	16,825,330,793	6.91
	イギリス	16,824,154,641	6.91
	スペイン	14,206,474,278	5.83
	ベルギー	6,020,271,608	2.47
	カナダ	5,187,736,473	2.13
	オランダ	5,171,955,166	2.12
	オーストラリア	5,160,963,750	2.12
	オーストリア	3,732,581,296	1.53
	アイルランド	2,033,270,712	0.83
	メキシコ	1,865,816,681	0.77
	南アフリカ	1,523,945,453	0.63
	フィンランド	1,511,454,160	0.62
	ポーランド	1,497,483,291	0.61
	デンマーク	1,444,658,459	0.59
マレーシア	1,174,695,343	0.48	

	シンガポール	987,655,591	0.41
	スウェーデン	935,986,238	0.38
	ノルウェー	722,309,529	0.30
	スイス	400,499,627	0.16
	小計	238,099,839,133	97.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,531,947,916	2.27
合計(純資産総額)		243,631,787,049	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	1,167,536,523	0.48
	買建	ドイツ	1,572,083,749	0.65

(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		3,852,719,000	1.58

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	17,150,000	10,481.53	1,797,583,458	10,641.51	1,825,020,660	2.875	2043/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,359.23	1,812,866,392	10,405.29	1,820,926,073	1.750	2023/5/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,677.69	1,596,820,128	9,838.33	1,623,325,317	2.500	2046/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,481.87	1,535,594,227	10,522.05	1,541,481,438	1.875	2022/10/31	0.63
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	13,658.13	1,502,394,922	13,634.18	1,499,760,205	3.500	2020/4/25	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	10,686.70	1,335,838,731	10,706.78	1,338,347,880	1.875	2020/12/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,575.64	1,321,955,267	10,634.03	1,329,254,146	2.375	2024/8/15	0.55

アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,740.66	1,285,767,470	9,808.96	1,294,782,914	1.500	2026/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,239.15	1,259,416,009	10,304.04	1,267,397,357	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,263.56	1,247,023,091	10,340.52	1,256,374,172	2.250	2027/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,390.03	1,241,609,460	10,466.51	1,250,748,172	2.375	2027/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,164.82	1,239,295,823	11,186.58	1,241,710,458	3.625	2021/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/19	11,500,000	10,746.62	1,235,862,183	10,752.35	1,236,520,459	1.250	2019/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	10,887.40	1,197,615,069	10,904.84	1,199,533,438	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,482.38	1,174,027,647	10,517.71	1,177,983,974	1.750	2022/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,443.43	1,138,334,355	10,611.38	1,156,640,856	2.875	2045/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,153.38	1,089,252,599	9,312.04	1,108,133,674	2.250	2046/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,357.33	1,087,519,688	10,413.84	1,093,453,681	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 06/30/19	10,000,000	10,789.42	1,078,942,504	10,796.59	1,079,659,663	1.625	2019/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,475.87	1,063,301,698	10,536.36	1,069,440,763	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,633.70	1,063,370,186	10,650.24	1,065,024,567	1.500	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,434.73	1,059,125,545	10,472.75	1,062,984,409	1.750	2022/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,367.84	1,036,784,654	10,396.36	1,039,636,279	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	10,660.35	1,025,526,200	10,671.66	1,026,613,931	1.250	2020/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,385.93	1,017,821,799	10,412.37	1,020,413,161	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,492.50	1,002,033,875	10,527.10	1,005,338,349	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,474.25	1,000,291,304	10,510.33	1,003,736,822	1.750	2022/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	10,493.18	996,852,610	10,517.14	999,128,880	1.375	2021/4/30	0.41
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000	14,051.12	997,629,902	14,025.14	995,785,347	2.250	2022/10/25	0.41
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000	15,625.74	976,609,103	15,602.61	975,163,589	4.250	2023/10/25	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.73
合計	97.73

(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	44	アメリカ ドル	5,029,715.05	546,730,026	5,010,500	544,641,350	0.22
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	26	アメリカ ドル	3,143,080.61	341,652,862	3,127,718.88	339,983,042	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	18	アメリカ ドル	2,615,478.25	284,302,486	2,602,687.5	282,912,131	0.12

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	23	ユーロ	2,581,158	327,110,153	2,580,485	327,024,864	0.13
ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	24	ユーロ	3,181,344	403,171,725	3,181,680	403,214,306	0.17
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	6,643,984	841,992,093	6,642,820	841,844,579	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	15,770,000.00	1,717,990,360	1,712,306,600	0.70
	カナダドル	買建	2,240,000.00	188,306,333	188,809,600	0.08
	ユーロ	買建	12,970,000.00	1,643,410,905	1,643,817,800	0.67
	イギリスポンド	買建	2,130,000.00	309,021,726	307,785,000	0.13

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	4,046,619,935	9.41
	ブラジル	3,992,796,392	9.29
	インドネシア	3,873,020,073	9.01
	ポーランド	3,653,219,747	8.50
	南アフリカ	3,639,049,599	8.46
	タイ	3,392,315,366	7.89
	コロンビア	3,185,590,586	7.41
	ロシア	3,170,369,076	7.37
	トルコ	2,477,556,642	5.76
	マレーシア	2,432,688,523	5.66
	ハンガリー	1,930,179,381	4.49
	チェコ	1,742,894,098	4.05
	ペルー	1,153,904,498	2.68
	チリ	1,084,920,125	2.52
フィリピン	124,242,874	0.29	

	ウルグアイ	98,908,197	0.23
	小計	39,998,275,112	93.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,003,131,492	6.98
合計(純資産総額)		43,001,406,604	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	33,700,000,000	4.76	1,606,455,691	4.76	1,605,337,479	9.850	2027/6/28	3.73
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	6,020,000,000	18.22	1,096,878,121	18.02	1,084,920,125	5.500	2020/8/5	2.52
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	22,150,000,000	3.60	799,179,877	3.59	796,331,683	4.375	2023/3/21	1.85
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000	4.01	786,718,246	3.99	783,921,424	7.750	2021/4/14	1.82
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	29,850,000	2,431.10	725,684,615	2,472.30	737,983,421	0.000	2020/7/1	1.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	64,250,000	946.88	608,373,418	969.87	623,146,757	10.500	2026/12/21	1.45
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	20,050,000	2,993.92	600,282,099	2,889.00	579,244,540	10.000	2023/1/1	1.35
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	137,000,000	364.66	499,589,083	359.18	492,089,129	3.650	2021/12/17	1.14
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000	785.19	460,518,133	810.33	475,262,777	8.750	2048/2/28	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	635.64	491,669,182	612.73	473,947,169	10.000	2024/12/5	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	88,650,000	538.15	477,070,200	531.68	471,335,911	6.500	2021/6/10	1.10
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000	2,453.05	437,871,194	2,591.51	462,584,962	0.000	2020/1/1	1.08
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	2,989.51	442,447,665	2,992.29	442,859,525	10.000	2021/1/1	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	77,200,000	559.57	431,994,764	553.57	427,358,487	8.000	2020/6/11	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 5% 12/11/19	78,200,000	527.94	412,855,801	528.55	413,332,344	5.000	2019/12/11	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	76,000,000	535.42	406,925,831	525.59	399,448,886	6.500	2022/6/9	0.93
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,500,000,000	0.85	398,812,674	0.82	383,227,007	8.375	2024/3/15	0.89
マレーシア	国債証券	MGS 3.62% 11/30/21	14,100,000	2,731.19	385,098,392	2,714.15	382,695,911	3.620	2021/11/30	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	417.52	396,644,048	400.59	380,564,874	4.875	2029/6/22	0.89
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,800,000	2,161.13	363,071,196	2,217.02	372,460,202	0.000	2021/7/1	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	12,050,000	2,926.43	352,635,467	2,936.42	353,839,619	1.500	2020/4/25	0.82
タイ	国債証券	THAIGB 2.55% 06/26/20	101,750,000	347.90	353,996,155	344.46	350,496,261	2.550	2020/6/26	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	12,450,000	2,770.36	344,909,976	2,808.61	349,672,103	2.500	2026/7/25	0.81

インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,000,000,000	0.87	349,703,640	0.83	334,304,880	8.375	2026/9/15	0.78
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	89,000,000	379.10	337,399,641	369.63	328,974,024	3.850	2025/12/12	0.77
ロシア	国債証券	RFLB 7.75% 09/16/26	175,000,000	178.87	313,037,473	181.19	317,088,187	7.750	2026/9/16	0.74
マレーシア	国債証券	MGS 3.492% 03/31/20	11,550,000	2,738.83	316,335,647	2,723.19	314,529,452	3.492	2020/3/31	0.73
ロシア	国債証券	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000	176.71	305,534,264	178.82	309,195,341	7.400	2022/12/7	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000	369.52	310,404,476	363.27	305,148,816	3.625	2023/6/16	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000	2,900.17	298,718,109	2,943.89	303,221,024	2.250	2022/4/25	0.71

(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	93.02
合計	93.02

(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	99,931,146,360	96.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,267,267,464	3.17
合計(純資産総額)		103,198,413,824	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		3,258,186,000	3.16
-------------	----	----	--	---------------	------

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

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

## 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	11,895	546,196.32	6,497,005,262	610,000	7,255,950,000	7.03
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,222	526,464.69	6,434,451,443	571,000	6,978,762,000	6.76
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,351	139,706.57	5,078,473,741	152,400	5,539,892,400	5.37
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,195	200,103.63	4,641,403,766	197,400	4,578,693,000	4.44
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	27,092	161,199.29	4,367,211,213	166,800	4,518,945,600	4.38
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	24,372	155,625.19	3,792,897,155	171,900	4,189,546,800	4.06
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,372	232,254.39	3,802,468,918	227,000	3,716,444,000	3.60
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,292	257,271.78	3,676,928,386	256,600	3,667,327,200	3.55
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,373	265,370.35	3,018,057,032	284,900	3,240,167,700	3.14
日本	投資証券	G L P 投資法人	25,500	112,660.91	2,872,853,289	121,600	3,100,800,000	3.00
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,755	363,854.48	2,821,691,497	395,500	3,067,102,500	2.97
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,453	75,698.48	2,683,738,234	81,200	2,878,783,600	2.79
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,557	450,658.58	2,504,309,756	484,500	2,692,366,500	2.61
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,790	605,028.72	2,293,058,870	675,000	2,558,250,000	2.48
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,776	64,932.9	1,998,374,954	71,400	2,197,406,400	2.13
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,082	443,124.02	1,808,832,290	490,500	2,002,221,000	1.94
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,178	440,521.9	1,840,500,498	449,000	1,875,922,000	1.82
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,196	132,324.28	1,746,151,284	140,000	1,847,440,000	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,183	205,938.88	1,685,197,902	224,600	1,837,901,800	1.78
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,266	116,905.86	1,667,779,063	121,600	1,734,745,600	1.68
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,649	559,473.48	1,482,045,248	637,000	1,687,413,000	1.64
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	33,689	47,073.38	1,585,855,239	50,000	1,684,450,000	1.63
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	11,000	132,072.97	1,452,802,692	145,000	1,595,000,000	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,665	113,910.56	1,328,766,792	123,000	1,434,795,000	1.39
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,342	158,987.14	1,326,270,754	171,100	1,427,316,200	1.38
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,779	159,611.06	1,401,225,577	161,700	1,419,564,300	1.38
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	8,236	133,659.71	1,100,821,402	149,300	1,229,634,800	1.19
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	13,816	79,264.68	1,095,120,877	87,400	1,207,518,400	1.17
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,656	232,964.43	1,084,682,386	258,500	1,203,576,000	1.17
日本	投資証券	プレミアム投資法人	11,095	100,872.08	1,119,175,823	107,700	1,194,931,500	1.16

(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	96.83
合計	96.83

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

## 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	1,879円		3,139,405,190	3,258,186,000	3.16

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

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

## 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	46,272,740,033	70.49
	オーストラリア	5,333,846,491	8.13
	イギリス	3,737,610,325	5.69
	フランス	2,888,753,715	4.40
	シンガポール	2,352,110,693	3.58
	香港	1,327,112,540	2.02
	カナダ	1,198,153,538	1.83
	スペイン	659,901,359	1.01
	ベルギー	495,869,144	0.76
	ニュージーランド	294,694,161	0.45
	オランダ	294,403,167	0.45
	アイルランド	178,367,051	0.27
	ドイツ	167,884,300	0.26
	イタリア	77,643,162	0.12
	ガーンジー	46,194,148	0.07

	マン島	42,408,122	0.06
	イスラエル	37,356,979	0.06
	小計	65,405,048,928	99.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		236,247,253	0.36
合計(純資産総額)		65,641,296,181	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		146,205,900	0.22

(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	166,830	17,473.81	2,915,156,057	17,564.83	2,930,341,089	4.46
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	286,280	7,181.88	2,056,031,453	7,043.76	2,016,487,613	3.07
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	80,460	22,801.02	1,834,570,858	23,069.40	1,856,164,004	2.83
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	196,900	7,478.17	1,472,452,654	6,937.23	1,365,941,375	2.08
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,850	20,075.56	1,482,580,440	18,028.98	1,331,440,321	2.03
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	109,880	13,061.03	1,435,146,755	11,741.77	1,290,186,127	1.97
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	53,030	27,477.24	1,457,118,479	24,186.42	1,282,605,879	1.95
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	198,190	7,249.94	1,436,866,011	6,254.59	1,239,598,778	1.89
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	190,730	6,863.66	1,309,107,729	5,957.84	1,136,340,158	1.73
香港	投資証券	LINK REIT	1,160,000	956.55	1,109,607,921	954.95	1,107,750,700	1.69
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	82,650	13,637.95	1,127,177,074	13,275.53	1,097,222,637	1.67
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,852,380	339.25	967,691,548	345.04	984,203,736	1.50
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	395,940	2,176.19	861,643,344	2,371.83	939,103,954	1.43
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,670	27,642.12	985,994,584	26,229.31	935,599,488	1.43
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	153,370	6,052.69	928,301,655	5,840.45	895,749,970	1.36
アメリカ	投資証券	GGP INC	341,730	2,380.92	813,632,456	2,243.56	766,694,493	1.17
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	54,790	13,679.59	749,504,797	13,623.37	746,424,497	1.14
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	1,009,690	672.81	679,338,223	727.97	735,028,068	1.12
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	66,660	9,309.52	620,572,734	10,537.37	702,421,617	1.07

アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	91,400	8,099.47	740,292,407	7,548.12	689,898,899	1.05
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	867,940	716.55	621,922,925	765.85	664,716,189	1.01
アメリカ	投資証券	HCP INC	248,410	2,886.58	717,056,843	2,605.53	647,241,943	0.99
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,130	11,317.41	680,516,168	10,216.71	614,330,953	0.94
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	189,170	3,111.85	588,670,260	3,078.38	582,337,901	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	142,040	4,283.62	608,445,592	3,961.02	562,624,417	0.86
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	408,260	1,373.57	560,777,381	1,349.75	551,051,679	0.84
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	149,100	4,316.37	643,571,529	3,641.45	542,940,195	0.83
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	540,530	877.24	474,177,343	974.91	526,969,529	0.80
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	47,900	10,724.32	513,694,998	10,571.07	506,354,492	0.77
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	38,820	14,114.78	547,936,080	12,976.60	503,751,845	0.77

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.64
合計	99.64

(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	1,110,000.00	120,580,500	120,617,400	0.18
	イギリスポンド	買建	110,000.00	15,802,820	15,900,500	0.02
	香港ドル	買建	700,000.00	9,672,600	9,688,000	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：2018年5月31日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,273円
純資産総額	0.09億円

※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	2018年5月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

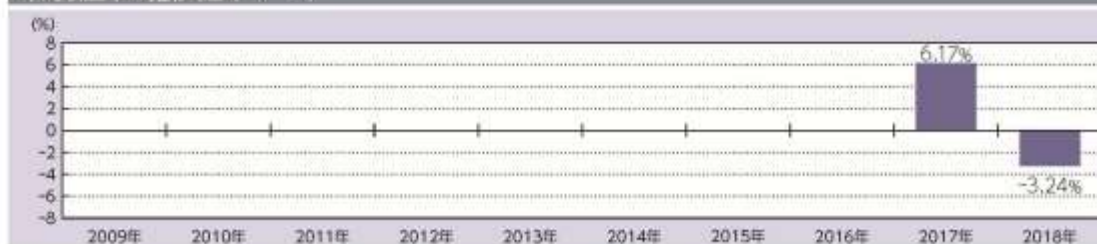
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位紹介銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
J-REIT インデックス マザーファンド	13.2%	日本ビルファンド投資法人 ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
国内株式 インデックス マザーファンド	12.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.7%	三井UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.2%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.3%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.5%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	12.2%	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.875%	2043/05/15	0.1%
外国債券 インデックス マザーファンド	12.2%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
新興国株式 インデックス マザーファンド	12.1%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.6%
新興国株式 インデックス マザーファンド	12.1%	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
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	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
新興国債券 インデックス マザーファンド	11.8%	CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	11.7%	第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.2%
国内債券 インデックス マザーファンド	11.7%	第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2018年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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



#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

無期限とします。（平成29年 8月25日設定）

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

#### (4) 【計算期間】

原則として、毎年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日までとします。

ただし、第1計算期間は平成29年8月25日から平成29年11月10日までとします。

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

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

## < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2017年11月11日から2018年5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】

## 【SMT 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 (2017年11月10日現在)	第2期 (2018年5月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	36,675	95,564
親投資信託受益証券	3,271,498	8,361,845
流動資産合計	3,308,173	8,457,409
資産合計	3,308,173	8,457,409
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	241	1,545
未払委託者報酬	2,078	13,774
その他未払費用	6	96
流動負債合計	2,325	15,415
負債合計	2,325	15,415
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,170,810	8,106,595
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	135,038	335,399
(分配準備積立金)	60,513	108,982
元本等合計	3,305,848	8,441,994
純資産合計	3,305,848	8,441,994
負債純資産合計	3,308,173	8,457,409

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年 8月25日 至 2017年11月10日	自	2017年11月11日 至 2018年 5月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		63,020		43,052
営業収益合計		63,020		43,052
営業費用				
支払利息		7		-
受託者報酬		241		1,545
委託者報酬		2,078		13,774
その他費用		6		96
営業費用合計		2,332		15,415
営業利益又は営業損失（ ）		60,688		58,467
経常利益又は経常損失（ ）		60,688		58,467
当期純利益又は当期純損失（ ）		60,688		58,467
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		8,257
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		135,038
剰余金増加額又は欠損金減少額		77,091		324,567
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		324,567
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,566		73,996
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		73,996
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		135,038		335,399



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2017年11月10日現在)	第2期 (2018年 5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	8,106,595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)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0414円 (10,414円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 8月25日 至 2017年11月10日			第2期 自 2017年11月11日 至 2018年 5月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	14,868円	費用控除後の配当等収益額	A	72,631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	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	74,525円	収益調整金額	C	226,417円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	36,351円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	135,038円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	335,399円
当ファンドの期末残存口数	F	3,170,810口	当ファンドの期末残存口数	F	8,106,595口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	425円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	413円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2017年11月11日 至 2018年 5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2期 (2018年 5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	第1期	第2期
	自 2017年 8月25日 至 2017年11月10日	自 2017年11月11日 至 2018年 5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	3,170,810円
期中追加設定元本額	2,791,330円	6,642,105円
期中一部解約元本額	120,520円	1,706,320円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2017年11月10日現在)	第2期 (2018年 5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	35,373
合計	62,939	35,373

## （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	685,376	1,104,277
	グローバルREITインデックス マザーファンド	622,000	1,052,424
	新興国株式インデックス マザーファンド	349,518	1,043,765
	国内株式インデックス マザーファンド	674,806	1,077,665
	外国株式インデックス マザーファンド	434,721	1,069,544
	国内債券インデックス マザーファンド	699,301	973,077
	外国債券インデックス マザーファンド	381,678	1,031,675
	新興国債券インデックス マザーファンド	600,130	1,009,418
合計		4,447,530	8,361,845

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2018年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,642,913,672
株式	201,885,296,590
派生商品評価勘定	132,461,240
未収配当金	1,872,482,982
差入委託証拠金	111,063,000
流動資産合計	206,644,217,484
資産合計	206,644,217,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,540
前受金	132,512,400
未払金	10,291,573
未払解約金	266,090,112
未払利息	4,276
その他未払費用	38,614
流動負債合計	408,942,515

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
負債合計	408,942,515
純資産の部	
元本等	
元本	129,140,824,094
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,094,450,875
元本等合計	206,235,274,969
純資産合計	206,235,274,969
負債純資産合計	206,644,217,484

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	129,140,824,094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 1.5970円 (1万口当たり純資産額) (15,970円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	2018年 5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株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2018年 5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。

	2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	115,589,713,212円
期中追加設定元本額	19,727,321,565円
期中一部解約元本額	6,176,210,683円
期末元本額	129,140,824,094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）	681,290,438円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,693,469,990円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,717,965円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,132,382,130円
世界経済インデックスファンド	1,888,477,341円
日本株式インデックス・オープン	6,032,247,205円
DCマイセレクション25	5,674,150,800円
DCマイセレクション50	16,535,906,265円
DCマイセレクション75	15,579,309,151円
DC日本株式インデックス・オープン	5,127,758,560円

区分	2018年 5月10日現在
DCマイセレクションS25	2,186,997,174円
DCマイセレクションS50	6,499,003,473円
DCマイセレクションS75	4,338,133,017円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,159,284,496円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	373,685,616円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	557,634,108円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	347,991,277円
DC世界経済インデックスファンド	1,453,298,029円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	374,173,887円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	24,210,316円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	78,138,263円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	46,806,616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)	368,287,469円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,680,266円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	138,575,090円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	491,352,026円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	75,211,851円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	645,367,757円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,081,691,683円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	792,810,375円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,476,623,241円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	660,491,043円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	74,479,421円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	884,034,765円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,166,972,406円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	509,249,118円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	639,104,367円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	60,081,854円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,015,903,454円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,832,066,080円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,446,009,067円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	154,979,070円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	186,443,793円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	227,741,872円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,323,730円
SMT インデックスバランス・オープン	85,466,264円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,092,374円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	42,161,299円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	4,774,802円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	674,806円
グローバル経済コア	313,722,564円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,818,518円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	32,634,247円



区分	2018年 5月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2055	149,100円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	21,912,784,205円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	20,238,615,068	
合計	20,238,615,068	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2018年 5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	4,189,299,300	-	4,321,755,000	132,455,700
合計		4,189,299,300	-	4,321,755,000	132,455,700

## (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	3,500	3,815.00	13,352,500	
日本水産	99,700	602.00	60,019,400	
マルハニチロ	16,900	4,010.00	67,769,000	
カネコ種苗	3,000	1,655.00	4,965,000	
サカタのタネ	13,100	3,990.00	52,269,000	
ホクト	9,000	1,953.00	17,577,000	

ホクリヨウ	1,500	1,234.00	1,851,000
住石ホールディングス	29,800	171.00	5,095,800
日鉄鉱業	2,700	6,440.00	17,388,000
三井松島産業	5,200	1,564.00	8,132,800
国際石油開発帝石	433,500	1,449.00	628,141,500
石油資源開発	14,500	2,780.00	40,310,000
K&Oエナジーグループ	5,900	1,863.00	10,991,700
ヒノキヤグループ	2,300	3,230.00	7,429,000
ショーボンドホールディングス	8,400	8,190.00	68,796,000
ミライト・ホールディングス	27,400	1,712.00	46,908,800
タマホーム	6,600	1,220.00	8,052,000
サンヨーホームズ	1,500	1,189.00	1,783,500
日本アクア	2,600	422.00	1,097,200
ファーストコーポレーション	2,900	1,308.00	3,793,200
ベステラ	1,600	1,659.00	2,654,400
TATERU	7,800	1,914.00	14,929,200
ダイセキ環境ソリューション	2,100	1,094.00	2,297,400
第一カッター興業	1,200	2,412.00	2,894,400
安藤・間	69,300	810.00	56,133,000
東急建設	34,100	1,173.00	39,999,300
コムシスホールディングス	31,300	3,085.00	96,560,500
ミサワホーム	7,500	940.00	7,050,000
ビーアールホールディングス	8,700	420.00	3,654,000
高松コンストラクショングループ	5,800	2,965.00	17,197,000
東建コーポレーション	3,300	10,620.00	35,046,000
ソネック	1,100	846.00	930,600
ヤマウラ	4,200	896.00	3,763,200
大成建設	88,600	5,970.00	528,942,000
大林組	266,900	1,225.00	326,952,500
清水建設	272,300	1,082.00	294,628,600
飛島建設	80,800	187.00	15,109,600
長谷工コーポレーション	103,900	1,663.00	172,785,700
松井建設	9,800	893.00	8,751,400
銭高組	1,300	5,680.00	7,384,000
鹿島建設	391,000	1,034.00	404,294,000
不動テトラ	67,300	185.00	12,450,500
大末建設	2,900	1,019.00	2,955,100
鉄建建設	5,400	3,360.00	18,144,000
西松建設	20,600	3,150.00	64,890,000
三井住友建設	62,600	647.00	40,502,200
大豊建設	32,000	666.00	21,312,000
前田建設工業	63,500	1,287.00	81,724,500

佐田建設	5,800	489.00	2,836,200	
ナカノフドー建設	6,800	645.00	4,386,000	
奥村組	14,700	4,500.00	66,150,000	
東鉄工業	10,700	3,545.00	37,931,500	
イチケン	1,600	2,490.00	3,984,000	
浅沼組	32,000	442.00	14,144,000	
戸田建設	103,000	899.00	92,597,000	
熊谷組	14,000	3,680.00	51,520,000	
青木あすなろ建設	5,900	1,024.00	6,041,600	
北野建設	19,000	401.00	7,619,000	
植木組	1,100	2,675.00	2,942,500	
三井ホーム	12,000	750.00	9,000,000	
矢作建設工業	12,000	899.00	10,788,000	
ピーエス三菱	10,500	720.00	7,560,000	
日本ハウスホールディングス	16,900	586.00	9,903,400	
大東建託	31,700	18,645.00	591,046,500	
新日本建設	10,600	1,249.00	13,239,400	
N I P P O	20,600	2,481.00	51,108,600	
東亜道路工業	1,800	3,885.00	6,993,000	
前田道路	28,000	2,355.00	65,940,000	
日本道路	2,400	5,360.00	12,864,000	
東亜建設工業	6,600	2,852.00	18,823,200	
若築建設	4,800	1,720.00	8,256,000	
東洋建設	27,700	535.00	14,819,500	
五洋建設	105,800	852.00	90,141,600	
世紀東急工業	11,800	711.00	8,389,800	
福田組	2,900	6,320.00	18,328,000	
住友林業	56,900	1,783.00	101,452,700	
日本基礎技術	9,700	404.00	3,918,800	
日成ビルド工業	13,100	1,347.00	17,645,700	
巴コーポレーション	11,000	604.00	6,644,000	
大和ハウス工業	262,900	4,071.00	1,070,265,900	
ライト工業	17,000	1,186.00	20,162,000	
積水ハウス	289,600	1,989.50	576,159,200	
日特建設	7,500	629.00	4,717,500	
北陸電気工事	4,900	1,282.00	6,281,800	
ユアテック	13,900	1,011.00	14,052,900	
西部電気工業	1,500	3,770.00	5,655,000	
四電工	1,400	2,847.00	3,985,800	
中電工	11,500	2,983.00	34,304,500	
関電工	35,400	1,266.00	44,816,400	
きんでん	59,200	1,868.00	110,585,600	

東京エネシス	10,000	1,312.00	13,120,000
トーエネック	2,500	3,285.00	8,212,500
住友電設	7,000	2,079.00	14,553,000
日本電設工業	13,600	2,468.00	33,564,800
協和エクシオ	32,000	2,969.00	95,008,000
新日本空調	6,900	1,632.00	11,260,800
N D S	1,400	6,030.00	8,442,000
九電工	17,500	5,290.00	92,575,000
三機工業	18,800	1,175.00	22,090,000
日揮	76,700	2,506.00	192,210,200
中外炉工業	2,700	2,806.00	7,576,200
ヤマト	7,300	722.00	5,270,600
太平電業	6,000	2,805.00	16,830,000
高砂熱学工業	24,400	2,015.00	49,166,000
三晃金属工業	1,000	3,610.00	3,610,000
朝日工業社	1,900	3,475.00	6,602,500
明星工業	15,900	804.00	12,783,600
大気社	11,700	3,840.00	44,928,000
ダイダン	6,000	2,664.00	15,984,000
日比谷総合設備	9,900	2,233.00	22,106,700
東芝プラントシステム	19,200	2,216.00	42,547,200
O S J Bホールディングス	39,000	307.00	11,973,000
東洋エンジニアリング	10,100	1,048.00	10,584,800
千代田化工建設	57,600	1,056.00	60,825,600
新興プランテック	17,000	1,053.00	17,901,000
日本製粉	26,500	1,776.00	47,064,000
日清製粉グループ本社	97,600	2,422.00	236,387,200
日東富士製粉	600	5,220.00	3,132,000
昭和産業	7,300	2,917.00	21,294,100
鳥越製粉	7,000	974.00	6,818,000
中部飼料	9,700	2,101.00	20,379,700
フィード・ワン	53,200	244.00	12,980,800
東洋精糖	1,300	1,275.00	1,657,500
日本甜菜製糖	4,500	2,404.00	10,818,000
三井製糖	6,300	4,245.00	26,743,500
塩水港精糖	9,300	264.00	2,455,200
日新製糖	3,800	2,119.00	8,052,200
森永製菓	18,700	5,260.00	98,362,000
中村屋	2,100	4,825.00	10,132,500
江崎グリコ	22,300	5,800.00	129,340,000
名糖産業	3,800	1,751.00	6,653,800
井村屋グループ	3,100	3,550.00	11,005,000

不二家	5,100	2,701.00	13,775,100
山崎製パン	65,200	2,335.00	152,242,000
第一屋製パン	1,400	1,210.00	1,694,000
モロゾフ	1,400	6,660.00	9,324,000
亀田製菓	5,000	5,800.00	29,000,000
寿スピリッツ	7,700	5,080.00	39,116,000
カルビー	36,300	3,795.00	137,758,500
森永乳業	16,000	4,475.00	71,600,000
六甲バター	5,300	2,489.00	13,191,700
ヤクルト本社	46,400	7,300.00	338,720,000
明治ホールディングス	52,700	8,610.00	453,747,000
雪印メグミルク	19,200	2,973.00	57,081,600
プリマハム	56,000	672.00	37,632,000
日本ハム	34,500	4,695.00	161,977,500
林兼産業	2,800	840.00	2,352,000
丸大食品	42,000	525.00	22,050,000
S Foods	5,600	4,555.00	25,508,000
伊藤ハム米久ホールディングス	51,300	1,036.00	53,146,800
サッポロホールディングス	29,100	3,080.00	89,628,000
アサヒグループホールディングス	166,900	5,845.00	975,530,500
キリンホールディングス	383,100	2,988.00	1,144,702,800
宝ホールディングス	59,700	1,311.00	78,266,700
オエノンホールディングス	22,500	476.00	10,710,000
養命酒製造	2,400	2,487.00	5,968,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	55,900	4,475.00	250,152,500
サントリー食品インターナショナル	61,000	4,950.00	301,950,000
ダイドーグループホールディングス	4,100	6,290.00	25,789,000
伊藤園	26,400	4,360.00	115,104,000
キーコーヒー	7,800	2,162.00	16,863,600
ユニカフェ	2,400	1,130.00	2,712,000
ジャパンフーズ	1,100	1,466.00	1,612,600
日清オイリオグループ	9,400	3,355.00	31,537,000
不二製油グループ本社	21,600	3,590.00	77,544,000
かどや製油	900	6,320.00	5,688,000
J - オイルミルズ	4,100	3,755.00	15,395,500
キッコーマン	62,300	4,925.00	306,827,500
味の素	183,300	2,104.00	385,663,200
キューピー	44,400	2,642.00	117,304,800
ハウス食品グループ本社	30,400	3,830.00	116,432,000
カゴメ	31,900	3,745.00	119,465,500
焼津水産化学工業	3,800	1,256.00	4,772,800
アリアケジャパン	7,300	9,350.00	68,255,000

ピエトロ	1,000	1,646.00	1,646,000
エバラ食品工業	1,700	2,116.00	3,597,200
ニチレイ	38,000	2,955.00	112,290,000
東洋水産	43,700	4,235.00	185,069,500
イトアンド	2,200	2,121.00	4,666,200
大冷	900	2,029.00	1,826,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,600	944.00	1,510,400
日清食品ホールディングス	34,800	8,000.00	278,400,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,487.00	11,896,000
一正蒲鉾	3,100	1,366.00	4,234,600
フジッコ	8,600	2,515.00	21,629,000
ロック・フィールド	8,500	2,041.00	17,348,500
日本たばこ産業	493,200	2,994.00	1,476,640,800
ケンコーマヨネーズ	5,300	3,815.00	20,219,500
わらべや日洋ホールディングス	5,200	2,744.00	14,268,800
なとり	4,400	2,018.00	8,879,200
イフジ産業	1,400	802.00	1,122,800
ピクルスコーポレーション	1,600	2,050.00	3,280,000
北の達人コーポレーション	24,300	792.00	19,245,600
ユーグレナ	31,700	991.00	31,414,700
ミヨシ油脂	3,000	1,413.00	4,239,000
理研ビタミン	3,000	4,035.00	12,105,000
片倉工業	9,500	1,375.00	13,062,500
ゲンゼ	6,200	6,790.00	42,098,000
東洋紡	30,800	2,034.00	62,647,200
ユニチカ	24,200	708.00	17,133,600
富士紡ホールディングス	4,600	4,130.00	18,998,000
倉敷紡績	84,000	359.00	30,156,000
シキボウ	4,200	1,359.00	5,707,800
日本毛織	23,400	1,141.00	26,699,400
トーア紡コーポレーション	3,500	590.00	2,065,000
ガイドーリミテッド	9,300	469.00	4,361,700
帝国繊維	8,700	2,355.00	20,488,500
帝人	68,400	2,128.00	145,555,200
東レ	603,500	943.00	569,100,500
サカイオーベックス	2,200	2,410.00	5,302,000
住江織物	2,200	2,895.00	6,369,000
日本フェルト	4,500	519.00	2,335,500
イチカワ	6,000	373.00	2,238,000
日東製網	900	1,770.00	1,593,000
アツギ	5,700	1,224.00	6,976,800
ダイニック	3,100	1,039.00	3,220,900

セーレン	19,100	1,884.00	35,984,400
ソトー	3,300	1,052.00	3,471,600
東海染工	1,300	1,450.00	1,885,000
小松精練	12,900	1,066.00	13,751,400
ワコールホールディングス	23,000	3,285.00	75,555,000
ホギメディカル	10,500	4,575.00	48,037,500
レナウン	22,100	163.00	3,602,300
クラウディアホールディングス	2,300	568.00	1,306,400
T S Iホールディングス	30,700	851.00	26,125,700
マツオカコーポレーション	2,000	3,220.00	6,440,000
三陽商会	4,400	2,390.00	10,516,000
ナイガイ	3,200	586.00	1,875,200
オンワードホールディングス	49,900	906.00	45,209,400
ルックホールディングス	15,000	371.00	5,565,000
ゴールドウイン	4,700	7,200.00	33,840,000
デサント	19,000	1,948.00	37,012,000
キング	4,400	567.00	2,494,800
ヤマトインターナショナル	5,800	676.00	3,920,800
特種東海製紙	4,600	4,340.00	19,964,000
王子ホールディングス	350,000	748.00	261,800,000
日本製紙	37,300	2,082.00	77,658,600
三菱製紙	11,600	681.00	7,899,600
北越紀州製紙	46,400	626.00	29,046,400
中越パルプ工業	3,300	1,972.00	6,507,600
巴川製紙所	13,000	284.00	3,692,000
大王製紙	33,100	1,508.00	49,914,800
阿波製紙	2,000	648.00	1,296,000
レンゴー	80,200	949.00	76,109,800
トーモク	4,700	2,169.00	10,194,300
ザ・パック	5,900	3,765.00	22,213,500
クラレ	140,000	1,799.00	251,860,000
旭化成	518,800	1,518.50	787,797,800
共和レザー	4,800	1,027.00	4,929,600
昭和電工	55,400	4,255.00	235,727,000
住友化学	612,000	644.00	394,128,000
住友精化	3,400	5,330.00	18,122,000
日産化学工業	48,400	4,915.00	237,886,000
ラサ工業	2,900	2,328.00	6,751,200
クレハ	7,200	7,620.00	54,864,000
多木化学	1,100	4,675.00	5,142,500
テイカ	6,300	3,155.00	19,876,500
石原産業	14,800	1,252.00	18,529,600

片倉コープアグリ	2,000	1,243.00	2,486,000	
日東エフシー	4,900	752.00	3,684,800	
日本曹達	58,000	633.00	36,714,000	
東ソー	120,200	1,952.00	234,630,400	
トクヤマ	24,100	3,905.00	94,110,500	
セントラル硝子	17,000	2,585.00	43,945,000	
東亜合成	48,800	1,224.00	59,731,200	
大阪ソーダ	8,000	3,150.00	25,200,000	
関東電化工業	19,700	1,028.00	20,251,600	
デンカ	30,600	4,195.00	128,367,000	
信越化学工業	138,500	11,270.00	1,560,895,000	
日本カーバイド工業	2,600	2,160.00	5,616,000	
堺化学工業	5,700	2,912.00	16,598,400	
エア・ウォーター	68,600	2,122.00	145,569,200	
大陽日酸	64,100	1,658.00	106,277,800	
日本化学工業	3,100	3,275.00	10,152,500	
東邦アセチレン	1,200	1,436.00	1,723,200	
日本パーカライズニング	42,500	1,740.00	73,950,000	
高压ガス工業	12,200	1,000.00	12,200,000	
チタン工業	900	2,749.00	2,474,100	
四国化成工業	11,900	1,592.00	18,944,800	
戸田工業	1,700	3,780.00	6,426,000	
ステラ ケミファ	4,200	3,565.00	14,973,000	
保土谷化学工業	2,700	4,710.00	12,717,000	
日本触媒	13,100	7,160.00	93,796,000	
大日精化工業	6,400	4,480.00	28,672,000	
カネカ	112,000	1,085.00	121,520,000	
三菱瓦斯化学	68,600	2,798.00	191,942,800	
三井化学	75,600	3,160.00	238,896,000	
J S R	83,600	2,083.00	174,138,800	
東京応化工業	14,500	4,015.00	58,217,500	
大阪有機化学工業	7,200	1,453.00	10,461,600	
三菱ケミカルホールディングス	557,200	1,039.00	578,930,800	
K Hネオケム	12,700	3,205.00	40,703,500	
ダイセル	112,200	1,232.00	138,230,400	
住友ベークライト	67,000	989.00	66,263,000	
積水化学工業	172,800	1,823.00	315,014,400	
日本ゼオン	70,100	1,403.00	98,350,300	
アイカ工業	23,300	4,075.00	94,947,500	
宇部興産	41,900	3,330.00	139,527,000	
積水樹脂	12,800	2,309.00	29,555,200	
タキロンシーアイ	16,600	707.00	11,736,200	



旭有機材	4,900	1,814.00	8,888,600	
日立化成	41,100	2,410.00	99,051,000	
ニチバン	4,100	3,425.00	14,042,500	
リケンテクノス	17,700	568.00	10,053,600	
大倉工業	20,000	624.00	12,480,000	
積水化成成品工業	10,400	1,374.00	14,289,600	
群栄化学工業	2,000	3,685.00	7,370,000	
タイガースポリマー	4,100	873.00	3,579,300	
ミライアル	2,800	1,617.00	4,527,600	
ダイキアクシス	2,800	1,497.00	4,191,600	
ダイキョーニシカワ	16,300	1,912.00	31,165,600	
竹本容器	1,300	3,230.00	4,199,000	
森六ホールディングス	4,200	3,105.00	13,041,000	
日本化薬	54,000	1,373.00	74,142,000	
カーリットホールディングス	7,700	1,076.00	8,285,200	
日本精化	6,800	1,221.00	8,302,800	
扶桑化学工業	7,900	2,602.00	20,555,800	
トリケミカル研究所	1,900	4,570.00	8,683,000	
A D E K A	35,800	1,983.00	70,991,400	
日油	32,100	3,300.00	105,930,000	
ハリマ化成グループ	6,400	921.00	5,894,400	
花王	195,300	7,663.00	1,496,583,900	
第一工業製薬	16,000	769.00	12,304,000	
石原ケミカル	2,000	2,038.00	4,076,000	
日華化学	2,600	1,245.00	3,237,000	
ニイタカ	1,200	1,842.00	2,210,400	
三洋化成工業	5,200	5,320.00	27,664,000	
有機合成薬品工業	5,500	308.00	1,694,000	
大日本塗料	9,500	1,569.00	14,905,500	
日本ペイントホールディングス	64,200	4,715.00	302,703,000	
関西ペイント	87,400	2,422.00	211,682,800	
神東塗料	6,200	235.00	1,457,000	
中国塗料	23,700	1,075.00	25,477,500	
日本特殊塗料	5,200	2,189.00	11,382,800	
藤倉化成	10,300	701.00	7,220,300	
太陽ホールディングス	6,400	4,585.00	29,344,000	
D I C	32,800	3,685.00	120,868,000	
サカタインクス	16,900	1,603.00	27,090,700	
東洋インキSCホールディングス	82,000	691.00	56,662,000	
T & K T O K A	5,600	1,246.00	6,977,600	
富士フィルムホールディングス	165,000	4,221.00	696,465,000	
資生堂	148,000	7,201.00	1,065,748,000	

ライオン	110,700	2,142.00	237,119,400
高砂香料工業	5,000	3,470.00	17,350,000
マンダム	15,500	3,545.00	54,947,500
ミルボン	10,600	5,040.00	53,424,000
ファンケル	19,300	4,495.00	86,753,500
コーセー	13,400	20,660.00	276,844,000
コタ	3,800	1,573.00	5,977,400
シーズ・ホールディングス	9,600	5,660.00	54,336,000
シーボン	1,000	3,205.00	3,205,000
ポーラ・オルビスホールディングス	33,900	5,070.00	171,873,000
ノエビアホールディングス	5,100	7,650.00	39,015,000
アジュバンコスメジャパン	1,800	982.00	1,767,600
エステー	5,700	2,679.00	15,270,300
アグロ カネショウ	3,200	2,702.00	8,646,400
コニシ	13,000	1,855.00	24,115,000
長谷川香料	10,500	2,409.00	25,294,500
星光P M C	4,600	1,214.00	5,584,400
小林製薬	22,300	9,650.00	215,195,000
荒川化学工業	7,100	1,917.00	13,610,700
メック	5,400	1,913.00	10,330,200
日本高純度化学	2,200	2,542.00	5,592,400
タカラバイオ	20,700	2,133.00	44,153,100
J C U	9,700	2,663.00	25,831,100
新田ゼラチン	5,500	890.00	4,895,000
O A Tアグリオ	1,200	3,720.00	4,464,000
デクセリアルズ	20,300	1,104.00	22,411,200
アース製薬	6,000	5,420.00	32,520,000
北興化学工業	8,000	675.00	5,400,000
大成ラミック	2,400	3,150.00	7,560,000
クミアイ化学工業	35,800	701.00	25,095,800
日本農薬	20,600	687.00	14,152,200
アキレス	6,000	2,248.00	13,488,000
有沢製作所	13,200	1,243.00	16,407,600
日東電工	60,000	8,382.00	502,920,000
レック	4,700	4,045.00	19,011,500
きもと	13,500	319.00	4,306,500
藤森工業	6,700	3,640.00	24,388,000
前澤化成工業	5,400	1,237.00	6,679,800
J S P	4,700	3,410.00	16,027,000
エフピコ	6,600	6,750.00	44,550,000
天馬	6,200	2,058.00	12,759,600
信越ポリマー	16,200	1,089.00	17,641,800

東リ	19,800	372.00	7,365,600
ニフコ	29,200	3,865.00	112,858,000
日本バルカー工業	6,500	3,075.00	19,987,500
ユニ・チャーム	168,400	3,188.00	536,859,200
協和発酵キリン	99,500	2,232.00	222,084,000
武田薬品工業	292,600	4,621.00	1,352,104,600
アステラス製薬	816,200	1,655.50	1,351,219,100
大日本住友製薬	58,900	1,930.00	113,677,000
塩野義製薬	111,900	5,668.00	634,249,200
田辺三菱製薬	96,900	1,911.00	185,175,900
わかもと製薬	9,400	297.00	2,791,800
あすか製薬	9,000	1,645.00	14,805,000
日本新薬	20,800	7,830.00	162,864,000
ピオフェルミン製薬	1,300	2,813.00	3,656,900
中外製薬	82,800	5,770.00	477,756,000
科研製薬	14,300	6,160.00	88,088,000
エーザイ	95,100	7,339.00	697,938,900
ロート製薬	43,600	3,145.00	137,122,000
小野薬品工業	187,600	2,513.50	471,532,600
久光製薬	23,500	8,630.00	202,805,000
持田製薬	5,500	7,620.00	41,910,000
参天製薬	150,500	1,926.00	289,863,000
扶桑薬品工業	2,800	2,947.00	8,251,600
日本ケミファ	1,100	4,790.00	5,269,000
ツムラ	28,400	3,935.00	111,754,000
日医工	20,800	1,737.00	36,129,600
キッセイ薬品工業	14,700	2,855.00	41,968,500
生化学工業	15,300	1,787.00	27,341,100
栄研化学	12,900	2,317.00	29,889,300
日水製薬	3,300	1,411.00	4,656,300
鳥居薬品	5,000	2,802.00	14,010,000
JCRファーマ	5,600	5,490.00	30,744,000
東和薬品	3,800	6,650.00	25,270,000
富士製薬工業	2,700	4,485.00	12,109,500
沢井製薬	16,000	4,625.00	74,000,000
ゼリア新薬工業	16,900	2,326.00	39,309,400
第一三共	227,300	3,835.00	871,695,500
キョーリン製薬ホールディングス	22,100	2,171.00	47,979,100
大幸薬品	4,200	2,110.00	8,862,000
ダイト	4,700	3,680.00	17,296,000
大塚ホールディングス	165,100	5,291.00	873,544,100
大正製薬ホールディングス	17,800	10,290.00	183,162,000

ペプチドリーム	36,300	4,390.00	159,357,000
日本コークス工業	66,100	116.00	7,667,600
昭和シェル石油	74,300	1,628.00	120,960,400
ニチレキ	10,100	1,187.00	11,988,700
ユシロ化学工業	4,400	1,835.00	8,074,000
ビーピー・カストロール	3,400	1,709.00	5,810,600
富士石油	19,000	405.00	7,695,000
MORESCO	2,800	1,976.00	5,532,800
出光興産	66,700	4,060.00	270,802,000
JXTGホールディングス	1,267,500	719.20	911,586,000
コスモエネルギーホールディングス	23,000	3,885.00	89,355,000
横浜ゴム	46,000	2,548.00	117,208,000
東洋ゴム工業	47,000	1,751.00	82,297,000
ブリヂストン	262,900	4,511.00	1,185,941,900
住友ゴム工業	81,800	1,883.00	154,029,400
藤倉ゴム工業	6,800	775.00	5,270,000
オカモト	28,000	1,096.00	30,688,000
フコク	3,400	993.00	3,376,200
ニッタ	8,200	4,265.00	34,973,000
住友理工	15,300	1,200.00	18,360,000
三ツ星ベルト	19,000	1,280.00	24,320,000
バンドー化学	15,000	1,316.00	19,740,000
日東紡績	11,800	2,232.00	26,337,600
旭硝子	80,100	4,775.00	382,477,500
日本板硝子	39,100	942.00	36,832,200
石塚硝子	1,100	2,580.00	2,838,000
日本山村硝子	33,000	188.00	6,204,000
日本電気硝子	34,400	3,215.00	110,596,000
オハラ	3,100	2,459.00	7,622,900
住友大阪セメント	154,000	504.00	77,616,000
太平洋セメント	50,200	4,105.00	206,071,000
日本ヒューム	7,900	837.00	6,612,300
日本コンクリート工業	16,900	451.00	7,621,900
三谷セキサン	4,200	2,532.00	10,634,400
アジアパイルホールディングス	10,100	651.00	6,575,100
東海カーボン	72,100	1,729.00	124,660,900
日本カーボン	4,100	5,720.00	23,452,000
東洋炭素	5,200	3,625.00	18,850,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,700	4,895.00	23,006,500
TOTO	61,100	5,730.00	350,103,000
日本碍子	96,900	2,091.00	202,617,900
日本特殊陶業	68,100	3,000.00	204,300,000

MARUWA	2,700	9,370.00	25,299,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	3,080.00	6,468,000	
黒崎播磨	1,600	5,110.00	8,176,000	
ヨータイ	6,300	797.00	5,021,100	
イソライト工業	4,100	859.00	3,521,900	
東京窯業	10,000	466.00	4,660,000	
ニッカトー	3,600	1,115.00	4,014,000	
フジインコーポレーテッド	7,100	2,325.00	16,507,500	
クニミネ工業	2,200	1,033.00	2,272,600	
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,293.00	2,198,100	
ニチアス	43,000	1,463.00	62,909,000	
ニチハ	12,000	4,780.00	57,360,000	
新日鐵住金	351,500	2,443.00	858,714,500	
神戸製鋼所	143,800	1,177.00	169,252,600	
中山製鋼所	10,700	743.00	7,950,100	
合同製鐵	4,200	2,437.00	10,235,400	
ジェイ エフ イー ホールディングス	212,100	2,345.50	497,480,550	
日新製鋼	21,700	1,475.00	32,007,500	
東京製鐵	42,100	894.00	37,637,400	
共英製鋼	8,800	2,185.00	19,228,000	
大和工業	16,700	3,705.00	61,873,500	
東京鐵鋼	3,200	1,758.00	5,625,600	
大阪製鐵	5,200	2,319.00	12,058,800	
淀川製鋼所	11,500	3,190.00	36,685,000	
東洋鋼鋳	19,000	717.00	13,623,000	
丸一鋼管	27,800	3,870.00	107,586,000	
モリ工業	2,600	3,465.00	9,009,000	
大同特殊鋼	13,900	5,870.00	81,593,000	
日本高周波鋼業	2,900	834.00	2,418,600	
日本冶金工業	64,500	331.00	21,349,500	
山陽特殊製鋼	9,100	2,752.00	25,043,200	
愛知製鋼	4,400	4,680.00	20,592,000	
日立金属	84,600	1,322.00	111,841,200	
日本金属	2,000	2,378.00	4,756,000	
大平洋金属	4,800	3,630.00	17,424,000	
新日本電工	46,600	337.00	15,704,200	
栗本鐵工所	3,900	2,034.00	7,932,600	
虹技	1,200	2,013.00	2,415,600	
日本鑄鉄管	8,000	169.00	1,352,000	
三菱製鋼	5,800	2,522.00	14,627,600	
日亜鋼業	11,300	355.00	4,011,500	
日本精線	1,300	4,845.00	6,298,500	

シンニッタン	12,000	488.00	5,856,000
新家工業	1,800	2,165.00	3,897,000
大紀アルミニウム工業所	12,900	741.00	9,558,900
日本軽金属ホールディングス	229,800	296.00	68,020,800
三井金属鉱業	21,200	4,840.00	102,608,000
東邦亜鉛	4,400	4,905.00	21,582,000
三菱マテリアル	51,900	3,325.00	172,567,500
住友金属鉱山	100,400	4,701.00	471,980,400
D O W Aホールディングス	19,900	4,110.00	81,789,000
古河機械金属	13,000	1,865.00	24,245,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,200	1,994.00	16,350,800
東邦チタニウム	14,100	1,222.00	17,230,200
U A C J	12,000	2,650.00	31,800,000
C Kサンエツ	1,500	4,765.00	7,147,500
古河電気工業	26,200	4,815.00	126,153,000
住友電気工業	293,700	1,664.00	488,716,800
フジクラ	95,000	743.00	70,585,000
昭和電線ホールディングス	9,800	915.00	8,967,000
東京特殊電線	1,100	2,814.00	3,095,400
タツタ電線	15,700	697.00	10,942,900
カナレ電気	1,400	2,401.00	3,361,400
平河ヒューテック	4,000	1,499.00	5,996,000
リョービ	9,700	2,848.00	27,625,600
アーレスティ	9,700	1,063.00	10,311,100
アサヒホールディングス	13,500	2,023.00	27,310,500
稲葉製作所	4,400	1,426.00	6,274,400
宮地エンジニアリンググループ	2,200	2,072.00	4,558,400
トーカロ	21,700	1,379.00	29,924,300
アルファC o	2,800	1,883.00	5,272,400
S U M C O	72,300	2,847.00	205,838,100
川田テクノロジーズ	1,600	6,190.00	9,904,000
R S Technologies	1,200	6,890.00	8,268,000
東洋製罐グループホールディングス	53,700	1,716.00	92,149,200
ホッカンホールディングス	20,000	393.00	7,860,000
コロナ	4,300	1,280.00	5,504,000
横河ブリッジホールディングス	14,500	2,433.00	35,278,500
駒井ハルテック	1,700	2,497.00	4,244,900
高田機工	700	3,460.00	2,422,000
三和ホールディングス	75,300	1,400.00	105,420,000
文化シャッター	23,000	1,078.00	24,794,000
三協立山	10,900	1,643.00	17,908,700
アルインコ	5,700	1,086.00	6,190,200

東洋シャッター	2,000	661.00	1,322,000
LIXILグループ	115,800	2,498.00	289,268,400
日本フィルコン	6,000	639.00	3,834,000
ノーリツ	17,500	2,027.00	35,472,500
長府製作所	8,900	2,531.00	22,525,900
リンナイ	14,000	10,730.00	150,220,000
ダイニチ工業	4,200	847.00	3,557,400
日東精工	10,800	786.00	8,488,800
三洋工業	1,000	2,109.00	2,109,000
岡部	15,800	1,026.00	16,210,800
ジーテクト	8,600	2,114.00	18,180,400
東プレ	14,700	3,395.00	49,906,500
高周波熱錬	15,000	1,105.00	16,575,000
東京製綱	5,600	2,349.00	13,154,400
サンコール	4,400	733.00	3,225,200
モリテック スチール	6,200	740.00	4,588,000
パイオラックス	11,600	3,125.00	36,250,000
エイチワン	7,700	1,280.00	9,856,000
日本発條	78,300	1,207.00	94,508,100
中央発條	1,000	3,605.00	3,605,000
アドバネクス	1,200	2,315.00	2,778,000
立川ブラインド工業	3,500	1,546.00	5,411,000
三益半導体工業	6,700	1,930.00	12,931,000
日本ドライケミカル	1,100	2,519.00	2,770,900
日本製鋼所	25,700	3,495.00	89,821,500
三浦工業	34,100	3,230.00	110,143,000
タクマ	26,600	1,185.00	31,521,000
ツガミ	21,000	1,287.00	27,027,000
オークマ	9,200	6,880.00	63,296,000
東芝機械	45,000	622.00	27,990,000
アマダホールディングス	121,400	1,304.00	158,305,600
アイダエンジニアリング	20,200	1,277.00	25,795,400
滝澤鉄工所	2,400	2,011.00	4,826,400
F U J I	23,400	1,844.00	43,149,600
牧野フライス製作所	40,000	1,045.00	41,800,000
オーエスジー	36,300	2,509.00	91,076,700
ダイジェット工業	1,100	1,943.00	2,137,300
旭ダイヤモンド工業	23,400	1,059.00	24,780,600
D M G 森精機	43,600	2,156.00	94,001,600
ソディック	17,000	1,275.00	21,675,000
ディスコ	10,600	20,590.00	218,254,000
日東工器	4,800	2,914.00	13,987,200

日進工具	2,100	2,934.00	6,161,400
パンチ工業	6,500	1,208.00	7,852,000
富士ダイス	3,900	1,012.00	3,946,800
豊和工業	4,500	1,104.00	4,968,000
OKK	3,200	1,142.00	3,654,400
東洋機械金属	6,100	779.00	4,751,900
島精機製作所	10,000	5,830.00	58,300,000
オプトラン	7,700	2,970.00	22,869,000
NCホールディングス	2,500	836.00	2,090,000
フリー	5,500	982.00	5,401,000
ヤマシンフィルタ	11,900	1,171.00	13,934,900
日阪製作所	11,200	1,179.00	13,204,800
やまびこ	15,100	1,548.00	23,374,800
平田機工	2,900	10,360.00	30,044,000
ペガサスミシン製造	7,200	782.00	5,630,400
ナプテスコ	43,300	3,635.00	157,395,500
三井海洋開発	8,300	3,070.00	25,481,000
レオン自動機	7,000	2,091.00	14,637,000
S M C	24,900	41,600.00	1,035,840,000
新川	5,900	1,046.00	6,171,400
ホソカワミクロン	3,000	7,400.00	22,200,000
ユニオンツール	3,600	4,295.00	15,462,000
オイレス工業	10,100	2,432.00	24,563,200
日精エー・エス・ビー機械	2,600	5,420.00	14,092,000
サトーホールディングス	10,300	3,005.00	30,951,500
技研製作所	5,400	2,501.00	13,505,400
日本エアーテック	2,700	924.00	2,494,800
カワタ	1,600	1,806.00	2,889,600
日精樹脂工業	6,700	1,303.00	8,730,100
オカダアイヨン	2,600	1,593.00	4,141,800
ワイエイシイホールディングス	2,600	1,073.00	2,789,800
小松製作所	383,500	3,582.00	1,373,697,000
住友重機械工業	45,500	4,165.00	189,507,500
日立建機	37,200	3,970.00	147,684,000
日工	2,300	2,504.00	5,759,200
巴工業	3,400	2,107.00	7,163,800
井関農機	8,000	2,208.00	17,664,000
T O W A	6,100	1,450.00	8,845,000
丸山製作所	1,900	1,930.00	3,667,000
北川鉄工所	3,900	2,809.00	10,955,100
ローツェ	3,900	2,613.00	10,190,700
タカキタ	2,700	805.00	2,173,500



クボタ	426,100	1,845.00	786,154,500
荏原実業	2,400	2,422.00	5,812,800
三菱化工機	2,800	2,288.00	6,406,400
月島機械	15,900	1,539.00	24,470,100
帝国電機製作所	5,500	1,643.00	9,036,500
新東工業	18,900	1,161.00	21,942,900
澁谷工業	7,000	3,805.00	26,635,000
アイチ コーポレーション	13,900	749.00	10,411,100
小森コーポレーション	20,200	1,387.00	28,017,400
鶴見製作所	6,800	2,101.00	14,286,800
住友精密工業	13,000	384.00	4,992,000
酒井重工業	1,500	4,560.00	6,840,000
荏原製作所	32,700	4,150.00	135,705,000
石井鐵工所	1,300	1,940.00	2,522,000
西島製作所	8,300	1,044.00	8,665,200
北越工業	8,900	1,124.00	10,003,600
ダイキン工業	108,400	13,120.00	1,422,208,000
オルガノ	2,900	3,505.00	10,164,500
トーヨーカネツ	3,400	3,345.00	11,373,000
栗田工業	43,100	3,225.00	138,997,500
椿本チエイン	47,000	909.00	42,723,000
大同工業	3,200	1,493.00	4,777,600
木村化工機	7,100	507.00	3,599,700
アネスト岩田	13,300	1,158.00	15,401,400
ダイフク	40,500	5,920.00	239,760,000
サムコ	2,200	1,303.00	2,866,600
加藤製作所	3,900	2,596.00	10,124,400
油研工業	1,600	2,949.00	4,718,400
タダノ	38,500	1,497.00	57,634,500
フジテック	25,400	1,487.00	37,769,800
C K D	22,000	2,226.00	48,972,000
キトー	6,000	2,133.00	12,798,000
平和	24,500	2,186.00	53,557,000
理想科学工業	7,900	2,344.00	18,517,600
S A N K Y O	19,900	3,870.00	77,013,000
日本金銭機械	7,300	1,219.00	8,898,700
マースエンジニアリング	5,000	2,493.00	12,465,000
福島工業	4,900	4,965.00	24,328,500
オーイズミ	3,300	565.00	1,864,500
ダイコク電機	3,600	1,768.00	6,364,800
竹内製作所	13,300	2,493.00	33,156,900
アマノ	24,600	2,790.00	68,634,000

JUKI	11,700	1,220.00	14,274,000
サンデンホールディングス	9,600	1,560.00	14,976,000
蛇の目ミシン工業	7,100	734.00	5,211,400
マックス	12,100	1,474.00	17,835,400
グローリー	23,700	3,670.00	86,979,000
新晃工業	8,000	1,738.00	13,904,000
大和冷機工業	12,700	1,262.00	16,027,400
セガサミーホールディングス	78,800	1,814.00	142,943,200
日本ピストンリング	2,900	2,240.00	6,496,000
リケン	3,700	6,160.00	22,792,000
T P R	8,900	3,255.00	28,969,500
ツバキ・ナカシマ	8,000	2,583.00	20,664,000
ホシザキ	25,000	10,330.00	258,250,000
大豊工業	6,400	1,506.00	9,638,400
日本精工	163,100	1,427.00	232,743,700
NTN	183,800	477.00	87,672,600
ジェイテクト	84,600	1,731.00	146,442,600
不二越	74,000	564.00	41,736,000
日本トムソン	25,200	796.00	20,059,200
THK	49,500	3,765.00	186,367,500
ユーシン精機	7,000	1,419.00	9,933,000
前澤給装工業	3,100	1,947.00	6,035,700
イーグル工業	9,800	1,975.00	19,355,000
前澤工業	5,700	479.00	2,730,300
日本ピラー工業	8,000	1,691.00	13,528,000
キッツ	35,100	1,047.00	36,749,700
マキタ	103,600	4,855.00	502,978,000
日立造船	63,000	599.00	37,737,000
三菱重工業	133,200	4,114.00	547,984,800
I H I	61,100	3,930.00	240,123,000
スター精密	12,600	1,935.00	24,381,000
日清紡ホールディングス	48,500	1,478.00	71,683,000
イビデン	48,800	1,667.00	81,349,600
コニカミノルタ	186,300	956.00	178,102,800
ブラザー工業	97,100	2,448.00	237,700,800
ミネベアミツミ	147,600	2,152.00	317,635,200
日立製作所	1,907,000	864.30	1,648,220,100
三菱電機	794,200	1,634.00	1,297,722,800
富士電機	239,000	788.00	188,332,000
東洋電機製造	3,200	1,874.00	5,996,800
安川電機	92,100	4,495.00	413,989,500
シンフォニアテクノロジー	51,000	417.00	21,267,000

明電舎	67,000	422.00	28,274,000
オリジン電気	2,300	1,815.00	4,174,500
山洋電気	3,900	9,750.00	38,025,000
デンヨー	7,300	1,982.00	14,468,600
東芝テック	57,000	637.00	36,309,000
芝浦メカトロニクス	12,000	436.00	5,232,000
マブチモーター	22,200	5,290.00	117,438,000
日本電産	95,600	16,930.00	1,618,508,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	3,230.00	9,690,000
トレックス・セミコンダクター	2,500	1,408.00	3,520,000
東光高岳	4,300	1,919.00	8,251,700
ダブル・スコープ	11,800	1,629.00	19,222,200
ダイヘン	43,000	850.00	36,550,000
ヤーマン	11,600	2,528.00	29,324,800
JVCケンウッド	59,000	354.00	20,886,000
ミマキエンジニアリング	7,600	900.00	6,840,000
第一精工	3,900	2,173.00	8,474,700
日新電機	18,500	1,155.00	21,367,500
大崎電気工業	16,900	812.00	13,722,800
オムロン	84,400	6,030.00	508,932,000
日東工業	12,700	1,887.00	23,964,900
I D E C	9,800	2,652.00	25,989,600
不二電機工業	1,200	1,404.00	1,684,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	143,000	560.00	80,080,000
サクサホールディングス	2,000	2,153.00	4,306,000
メルコホールディングス	3,900	4,230.00	16,497,000
テクノメディカ	1,800	2,034.00	3,661,200
日本電気	102,800	3,060.00	314,568,000
富士通	817,000	679.30	554,988,100
沖電気工業	32,300	1,348.00	43,540,400
岩崎通信機	3,400	835.00	2,839,000
電気興業	4,500	3,255.00	14,647,500
サンケン電気	46,000	736.00	33,856,000
ナカヨ	1,500	1,940.00	2,910,000
アイホン	4,500	1,857.00	8,356,500
ルネサスエレクトロニクス	41,200	1,109.00	45,690,800
セイコーエプソン	118,200	2,040.00	241,128,000
ワコム	61,900	561.00	34,725,900
アルバック	18,300	6,250.00	114,375,000
アクセル	3,900	832.00	3,244,800
E I Z O	7,300	5,020.00	36,646,000
日本信号	21,700	1,087.00	23,587,900

京三製作所	18,500	730.00	13,505,000	
能美防災	10,600	2,488.00	26,372,800	
ホーチキ	5,900	2,194.00	12,944,600	
星和電機	3,200	650.00	2,080,000	
エレコム	7,000	3,025.00	21,175,000	
パナソニック	907,300	1,562.00	1,417,202,600	
シャープ	73,700	3,180.00	234,366,000	
アンリツ	57,900	1,411.00	81,696,900	
富士通ゼネラル	24,300	1,735.00	42,160,500	
ソニー	530,900	5,109.00	2,712,368,100	
T D K	41,600	9,860.00	410,176,000	
帝国通信工業	3,800	1,295.00	4,921,000	
タムラ製作所	30,500	846.00	25,803,000	
アルプス電気	68,600	2,660.00	182,476,000	
池上通信機	25,000	172.00	4,300,000	
パイオニア	131,000	178.00	23,318,000	
日本電波工業	7,800	695.00	5,421,000	
鈴木	3,800	1,089.00	4,138,200	
日本トリム	1,800	4,515.00	8,127,000	
ローランド ディー・ジー・	4,200	2,591.00	10,882,200	
フォスター電機	9,300	1,948.00	18,116,400	
クラリオン	42,000	301.00	12,642,000	
S M K	20,000	394.00	7,880,000	
ヨコオ	5,300	2,067.00	10,955,100	
ホシデン	20,200	1,310.00	26,462,000	
ヒロセ電機	13,500	14,490.00	195,615,000	
日本航空電子工業	20,000	1,837.00	36,740,000	
T O A	8,500	1,264.00	10,744,000	
マクセルホールディングス	15,900	1,721.00	27,363,900	
古野電気	10,000	966.00	9,660,000	
ユニデンホールディングス	22,000	274.00	6,028,000	
アルパイン	18,800	2,211.00	41,566,800	
スミダコーポレーション	8,400	1,398.00	11,743,200	
アイコム	4,400	2,729.00	12,007,600	
リオン	3,500	2,267.00	7,934,500	
本多通信工業	6,600	1,169.00	7,715,400	
船井電機	7,300	754.00	5,504,200	
横河電機	79,500	2,040.00	162,180,000	
新電元工業	2,800	6,800.00	19,040,000	
アズビル	23,800	5,030.00	119,714,000	
東亜ディーケーケー	4,300	1,457.00	6,265,100	
日本光電工業	33,300	3,005.00	100,066,500	

チノー	2,700	1,639.00	4,425,300
共和電業	8,900	443.00	3,942,700
日本電子材料	3,100	846.00	2,622,600
堀場製作所	15,700	9,310.00	146,167,000
アドバンテスト	44,300	2,757.00	122,135,100
小野測器	3,900	842.00	3,283,800
エスペック	7,200	2,704.00	19,468,800
キーエンス	39,000	67,690.00	2,639,910,000
日置電機	4,300	4,245.00	18,253,500
シスメックス	61,900	8,950.00	554,005,000
日本マイクロニクス	14,100	1,291.00	18,203,100
メガチップス	6,400	3,555.00	22,752,000
O B A R A G R O U P	4,700	6,330.00	29,751,000
澤藤電機	1,100	1,972.00	2,169,200
コーセル	11,200	1,460.00	16,352,000
イリソ電子工業	6,700	6,790.00	45,493,000
新日本無線	4,700	950.00	4,465,000
オブテックスグループ	13,100	2,813.00	36,850,300
千代田インテグレ	4,000	2,449.00	9,796,000
アイ・オー・データ機器	3,700	1,121.00	4,147,700
レーザーテック	16,400	3,785.00	62,074,000
スタンレー電気	60,900	3,930.00	239,337,000
岩崎電気	3,300	1,690.00	5,577,000
ウシオ電機	48,500	1,597.00	77,454,500
岡谷電機産業	6,300	631.00	3,975,300
ヘリオス テクノ ホールディング	7,200	786.00	5,659,200
日本セラミック	8,200	2,888.00	23,681,600
遠藤照明	4,400	996.00	4,382,400
古河電池	6,100	998.00	6,087,800
双信電機	4,200	639.00	2,683,800
山一電機	6,000	1,992.00	11,952,000
図研	5,400	1,701.00	9,185,400
日本電子	29,000	967.00	28,043,000
カシオ計算機	63,900	1,723.00	110,099,700
ファナック	75,500	23,030.00	1,738,765,000
日本シイエムケイ	14,400	841.00	12,110,400
エンプラス	3,700	3,305.00	12,228,500
大真空	3,200	1,358.00	4,345,600
ローム	35,700	10,700.00	381,990,000
浜松ホトニクス	57,900	4,375.00	253,312,500
三井ハイテック	10,700	1,568.00	16,777,600
新光電気工業	30,300	933.00	28,269,900

京セラ	130,400	6,750.00	880,200,000
太陽誘電	35,700	2,012.00	71,828,400
村田製作所	83,300	14,440.00	1,202,852,000
ユーシン	11,800	733.00	8,649,400
双葉電子工業	13,100	2,274.00	29,789,400
北陸電気工業	3,500	1,420.00	4,970,000
ニチコン	25,200	1,280.00	32,256,000
日本ケミコン	6,400	2,703.00	17,299,200
K O A	11,100	2,435.00	27,028,500
市光工業	12,200	1,481.00	18,068,200
小糸製作所	47,600	7,490.00	356,524,000
ミツバ	14,800	1,354.00	20,039,200
S C R E E Nホールディングス	15,000	9,740.00	146,100,000
キャノン電子	7,400	2,527.00	18,699,800
キャノン	427,500	3,790.00	1,620,225,000
リコー	238,800	1,042.00	248,829,600
象印マホービン	15,000	1,581.00	23,715,000
M U T O Hホールディングス	1,300	2,487.00	3,233,100
東京エレクトロン	53,000	21,245.00	1,125,985,000
トヨタ紡織	23,000	2,262.00	52,026,000
芦森工業	1,600	2,519.00	4,030,400
ユニプレス	15,300	2,583.00	39,519,900
豊田自動織機	64,300	6,990.00	449,457,000
モリタホールディングス	12,700	2,256.00	28,651,200
三櫻工業	9,900	780.00	7,722,000
デンソー	176,200	5,518.00	972,271,600
東海理化電機製作所	20,800	2,206.00	45,884,800
三井E & Sホールディングス	28,900	1,669.00	48,234,100
川崎重工業	61,900	3,495.00	216,340,500
名村造船所	23,700	640.00	15,168,000
サノヤスホールディングス	9,500	270.00	2,565,000
日本車輛製造	29,000	293.00	8,497,000
三菱ロジスネクスト	10,000	1,199.00	11,990,000
近畿車輛	1,100	2,755.00	3,030,500
日産自動車	937,100	1,110.50	1,040,649,550
いすゞ自動車	230,400	1,645.50	379,123,200
トヨタ自動車	965,600	7,592.00	7,330,835,200
日野自動車	113,700	1,279.00	145,422,300
三菱自動車工業	294,600	858.00	252,766,800
エフテック	5,000	1,436.00	7,180,000
レシップホールディングス	2,800	843.00	2,360,400
G M B	1,300	1,550.00	2,015,000

ファルテック	1,400	1,347.00	1,885,800
武蔵精密工業	8,500	4,170.00	35,445,000
日産車体	31,300	1,109.00	34,711,700
新明和工業	34,900	1,267.00	44,218,300
極東開発工業	15,000	1,736.00	26,040,000
日信工業	16,100	2,081.00	33,504,100
トピー工業	6,500	3,475.00	22,587,500
ティラド	2,900	3,945.00	11,440,500
曙ブレーキ工業	36,600	251.00	9,186,600
タチエス	13,400	2,038.00	27,309,200
N O K	42,700	2,267.00	96,800,900
フタバ産業	24,100	860.00	20,726,000
K Y B	8,300	5,140.00	42,662,000
大同メタル工業	9,900	1,287.00	12,741,300
プレス工業	42,200	616.00	25,995,200
ミクニ	9,900	641.00	6,345,900
太平洋工業	16,500	1,554.00	25,641,000
ケーヒン	18,200	2,230.00	40,586,000
河西工業	9,700	1,495.00	14,501,500
アイシン精機	65,400	5,960.00	389,784,000
マツダ	249,600	1,448.50	361,545,600
今仙電機製作所	7,300	1,220.00	8,906,000
本田技研工業	714,800	3,550.00	2,537,540,000
スズキ	157,500	5,638.00	887,985,000
S U B A R U	246,700	3,692.00	910,816,400
安永	3,800	2,372.00	9,013,600
ヤマハ発動機	112,300	3,410.00	382,943,000
ショーワ	20,500	1,969.00	40,364,500
T B K	9,300	550.00	5,115,000
エクセディ	9,600	3,675.00	35,280,000
豊田合成	28,900	2,889.00	83,492,100
愛三工業	13,900	1,151.00	15,998,900
盟和産業	1,200	1,345.00	1,614,000
日本プラスト	4,300	1,007.00	4,330,100
ヨロズ	8,000	1,844.00	14,752,000
エフ・シー・シー	13,000	2,934.00	38,142,000
シマノ	32,000	14,890.00	476,480,000
テイ・エス テック	18,400	5,000.00	92,000,000
ジャムコ	4,000	2,263.00	9,052,000
テルモ	121,700	6,080.00	739,936,000
クリエートメディック	2,600	1,398.00	3,634,800
日機装	27,300	1,149.00	31,367,700

島津製作所	94,900	2,957.00	280,619,300
JMS	7,300	648.00	4,730,400
長野計器	6,200	1,332.00	8,258,400
ブイ・テクノロジー	1,900	27,550.00	52,345,000
東京計器	5,000	1,211.00	6,055,000
愛知時計電機	1,100	4,260.00	4,686,000
インターアクション	4,200	1,156.00	4,855,200
オーバル	7,700	306.00	2,356,200
東京精密	14,400	4,295.00	61,848,000
マニー	9,700	4,525.00	43,892,500
ニコン	138,400	1,834.00	253,825,600
トプコン	42,700	2,016.00	86,083,200
オリンパス	118,300	4,040.00	477,932,000
理研計器	7,600	2,560.00	19,456,000
タムロン	6,400	2,276.00	14,566,400
HOYA	159,900	5,897.00	942,930,300
シード	1,100	6,760.00	7,436,000
ノーリツ鋼機	8,000	2,865.00	22,920,000
エー・アンド・デイ	7,200	738.00	5,313,600
シチズン時計	94,800	832.00	78,873,600
リズム時計工業	3,000	2,404.00	7,212,000
大研医器	7,000	748.00	5,236,000
メニコン	10,900	2,882.00	31,413,800
シンシア	700	726.00	508,200
松風	3,900	1,427.00	5,565,300
セイコーホールディングス	12,300	2,956.00	36,358,800
ニプロ	55,000	1,303.00	71,665,000
中本パックス	2,000	1,819.00	3,638,000
スノーピーク	2,400	1,472.00	3,532,800
パラマウントベッドホールディングス	8,400	5,160.00	43,344,000
トランザクション	4,300	994.00	4,274,200
SHO-BI	2,600	440.00	1,144,000
ニホンフラッシュ	3,700	2,889.00	10,689,300
前田工織	8,700	1,828.00	15,903,600
永大産業	10,300	558.00	5,747,400
アートネイチャー	8,300	730.00	6,059,000
バンダイナムコホールディングス	82,100	4,095.00	336,199,500
アイフィスジャパン	1,700	710.00	1,207,000
共立印刷	13,000	369.00	4,797,000
SHOEI	3,800	4,200.00	15,960,000
フランスベッドホールディングス	9,300	985.00	9,160,500
パイロットコーポレーション	13,900	6,200.00	86,180,000



萩原工業	4,400	2,002.00	8,808,800
トッパン・フォームズ	16,900	1,202.00	20,313,800
フジシールインターナショナル	17,800	4,325.00	76,985,000
タカラトミー	33,000	1,113.00	36,729,000
廣済堂	7,300	540.00	3,942,000
A s - m e エステール	2,300	880.00	2,024,000
アーク	40,100	121.00	4,852,100
タカノ	3,500	994.00	3,479,000
プロネクサス	7,400	1,350.00	9,990,000
ホクシン	5,500	176.00	968,000
ウッドワン	2,700	1,565.00	4,225,500
大建工業	6,200	2,818.00	17,471,600
凸版印刷	224,000	912.00	204,288,000
大日本印刷	103,900	2,345.00	243,645,500
図書印刷	5,300	1,027.00	5,443,100
共同印刷	2,400	3,400.00	8,160,000
N I S S H A	16,300	2,764.00	45,053,200
光村印刷	700	2,437.00	1,705,900
宝印刷	4,100	2,042.00	8,372,200
アシックス	78,900	1,788.00	141,073,200
ツツミ	2,500	2,096.00	5,240,000
小松ウオール工業	2,700	2,420.00	6,534,000
ヤマハ	53,500	5,850.00	312,975,000
河合楽器製作所	2,700	3,915.00	10,570,500
クリナップ	7,300	824.00	6,015,200
ピジョン	48,000	5,220.00	250,560,000
兼松サステック	600	2,183.00	1,309,800
キングジム	6,600	1,103.00	7,279,800
リンテック	18,900	3,315.00	62,653,500
イトーキ	16,500	686.00	11,319,000
任天堂	48,900	45,500.00	2,224,950,000
三菱鉛筆	13,000	2,260.00	29,380,000
タカラスタндарт	16,300	1,862.00	30,350,600
コクヨ	38,100	2,049.00	78,066,900
ナカバヤシ	7,700	635.00	4,889,500
グローブライド	3,600	3,260.00	11,736,000
オカムラ	27,700	1,690.00	46,813,000
美津濃	7,900	4,025.00	31,797,500
東京電力ホールディングス	634,000	545.00	345,530,000
中部電力	243,000	1,735.50	421,726,500
関西電力	324,100	1,589.00	514,994,900
中国電力	109,800	1,403.00	154,049,400

北陸電力	77,800	1,106.00	86,046,800
東北電力	186,000	1,438.00	267,468,000
四国電力	71,500	1,368.00	97,812,000
九州電力	175,400	1,303.00	228,546,200
北海道電力	79,600	776.00	61,769,600
沖縄電力	12,800	3,165.00	40,512,000
電源開発	63,200	2,989.00	188,904,800
エフオン	3,900	1,452.00	5,662,800
イーレックス	12,400	864.00	10,713,600
レノバ	4,000	1,040.00	4,160,000
東京瓦斯	169,400	2,871.50	486,432,100
大阪瓦斯	154,100	2,396.50	369,300,650
東邦瓦斯	39,300	3,420.00	134,406,000
北海道瓦斯	21,000	306.00	6,426,000
広島ガス	16,100	377.00	6,069,700
西部瓦斯	9,600	2,950.00	28,320,000
静岡ガス	22,400	980.00	21,952,000
メタウォーター	4,500	3,030.00	13,635,000
SBSホールディングス	7,800	1,429.00	11,146,200
東武鉄道	84,500	3,380.00	285,610,000
相鉄ホールディングス	25,400	3,165.00	80,391,000
東京急行電鉄	215,700	1,854.00	399,907,800
京浜急行電鉄	108,800	1,831.00	199,212,800
小田急電鉄	118,100	2,352.00	277,771,200
京王電鉄	44,400	4,900.00	217,560,000
京成電鉄	55,300	3,550.00	196,315,000
富士急行	10,800	3,250.00	35,100,000
新京成電鉄	2,000	2,291.00	4,582,000
東日本旅客鉄道	142,600	10,710.00	1,527,246,000
西日本旅客鉄道	71,700	8,011.00	574,388,700
東海旅客鉄道	71,100	21,350.00	1,517,985,000
西武ホールディングス	101,200	1,876.00	189,851,200
鴻池運輸	11,200	1,929.00	21,604,800
西日本鉄道	22,000	3,050.00	67,100,000
ハマキョウレックス	5,600	3,675.00	20,580,000
サカイ引越センター	4,200	6,020.00	25,284,000
近鉄グループホールディングス	75,200	4,415.00	332,008,000
阪急阪神ホールディングス	100,300	4,265.00	427,779,500
南海電気鉄道	35,700	3,055.00	109,063,500
京阪ホールディングス	33,500	3,615.00	121,102,500
神戸電鉄	1,800	3,980.00	7,164,000
名古屋鉄道	59,900	2,802.00	167,839,800

山陽電気鉄道	5,800	2,776.00	16,100,800
日本通運	29,500	8,200.00	241,900,000
ヤマトホールディングス	131,900	2,898.50	382,312,150
山九	19,300	5,750.00	110,975,000
丸運	4,200	349.00	1,465,800
丸全昭和運輸	27,000	520.00	14,040,000
センコーグループホールディングス	45,200	914.00	41,312,800
トナミホールディングス	1,800	7,360.00	13,248,000
ニッコンホールディングス	28,600	3,055.00	87,373,000
日本石油輸送	900	3,335.00	3,001,500
福山通運	11,000	5,310.00	58,410,000
セイノーホールディングス	56,300	2,126.00	119,693,800
エスライン	2,000	1,228.00	2,456,000
神奈川中央交通	1,900	3,705.00	7,039,500
日立物流	16,500	3,100.00	51,150,000
丸和運輸機関	4,000	4,390.00	17,560,000
C & F ロジホールディングス	8,200	1,446.00	11,857,200
九州旅客鉄道	63,100	3,440.00	217,064,000
S Gホールディングス	71,100	2,339.00	166,302,900
日本郵船	63,200	2,406.00	152,059,200
商船三井	47,800	3,270.00	156,306,000
川崎汽船	35,000	2,415.00	84,525,000
N S ユナイテッド海運	3,800	2,248.00	8,542,400
飯野海運	39,100	522.00	20,410,200
共栄タンカー	900	1,900.00	1,710,000
乾汽船	5,700	855.00	4,873,500
日本航空	139,500	3,985.00	555,907,500
A N Aホールディングス	146,100	4,123.00	602,370,300
パスコ	7,000	336.00	2,352,000
トランコム	2,100	8,290.00	17,409,000
日新	6,500	2,753.00	17,894,500
三菱倉庫	25,900	2,495.00	64,620,500
三井倉庫ホールディングス	43,000	358.00	15,394,000
住友倉庫	52,000	737.00	38,324,000
澁澤倉庫	4,100	1,860.00	7,626,000
東陽倉庫	13,400	376.00	5,038,400
日本トランスシティ	18,000	529.00	9,522,000
ケイヒン	1,400	1,650.00	2,310,000
中央倉庫	4,600	1,144.00	5,262,400
川西倉庫	1,500	2,040.00	3,060,000
安田倉庫	6,700	999.00	6,693,300
東洋埠頭	2,300	1,725.00	3,967,500

宇徳	6,300	513.00	3,231,900
上組	46,900	2,448.00	114,811,200
サンリツ	1,900	799.00	1,518,100
キムラユニティー	2,000	1,163.00	2,326,000
キューソー流通システム	2,200	2,812.00	6,186,400
近鉄エクスプレス	14,100	2,067.00	29,144,700
東海運	4,200	399.00	1,675,800
エーアイティー	5,300	1,246.00	6,603,800
内外トランスライン	2,600	1,770.00	4,602,000
日本コンセプト	1,400	1,507.00	2,109,800
N E C ネットズエスアイ	8,600	2,755.00	23,693,000
システナ	6,300	5,020.00	31,626,000
デジタルアーツ	3,900	5,480.00	21,372,000
新日鉄住金ソリューションズ	12,200	3,045.00	37,149,000
キューブシステム	4,600	839.00	3,859,400
エイジア	1,700	1,464.00	2,488,800
コア	3,400	1,509.00	5,130,600
ソリトンシステムズ	3,500	1,600.00	5,600,000
ソフトクリエイイトホールディングス	3,800	1,707.00	6,486,600
T I S	26,000	4,400.00	114,400,000
ネオス	2,600	405.00	1,053,000
電算システム	2,800	2,015.00	5,642,000
グリー	41,600	633.00	26,332,800
コーエーテクモホールディングス	13,300	2,222.00	29,552,600
三菱総合研究所	3,400	4,405.00	14,977,000
ボルテージ	1,700	899.00	1,528,300
電算	900	2,363.00	2,126,700
A G S	4,500	924.00	4,158,000
ファインデックス	6,500	820.00	5,330,000
ヒト・コミュニケーションズ	1,800	2,057.00	3,702,600
ブレインパッド	1,700	2,694.00	4,579,800
K L a b	15,000	1,871.00	28,065,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,700	2,008.00	11,445,600
イーブックイニシアティブジャパン	1,300	1,253.00	1,628,900
ネクソン	175,200	1,581.00	276,991,200
アイスタイル	19,900	1,160.00	23,084,000
エムアップ	2,700	1,448.00	3,909,600
エイチーム	5,400	2,248.00	12,139,200
テクノスジャパン	7,100	993.00	7,050,300
コロプラ	25,400	826.00	20,980,400
モバイルクリエイイト	6,500	382.00	2,483,000
ブロードリーフ	38,600	540.00	20,844,000

クロス・マーケティンググループ	2,400	629.00	1,509,600
ハーツユナイテッドグループ	4,200	1,820.00	7,644,000
メディアドゥホールディングス	2,600	2,051.00	5,332,600
サイバーリンクス	1,300	1,188.00	1,544,400
フィックスターズ	7,500	1,376.00	10,320,000
VOYAGE GROUP	4,000	1,149.00	4,596,000
オブティム	1,400	2,623.00	3,672,200
セレス	2,500	2,020.00	5,050,000
ペリサーブ	1,100	3,250.00	3,575,000
ティーガイア	7,800	2,955.00	23,049,000
セック	1,100	2,838.00	3,121,800
日本アジアグループ	8,100	562.00	4,552,200
豆蔵ホールディングス	5,800	1,330.00	7,714,000
テクマトリックス	4,300	2,039.00	8,767,700
プロシップ	1,200	2,759.00	3,310,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	211,700	290.00	61,393,000
GMOペイメントゲートウェイ	6,400	11,460.00	73,344,000
ザッパラス	4,100	378.00	1,549,800
システムリサーチ	1,100	2,320.00	2,552,000
インターネットイニシアティブ	12,700	2,022.00	25,679,400
さくらインターネット	9,400	860.00	8,084,000
ヴィンクス	2,300	1,579.00	3,631,700
GMOクラウド	1,800	2,560.00	4,608,000
SRAホールディングス	4,200	3,145.00	13,209,000
Minor iソリューションズ	1,600	1,715.00	2,744,000
朝日ネット	7,200	549.00	3,952,800
eBASE	2,100	1,444.00	3,032,400
アバント	2,200	969.00	2,131,800
アドソル日進	3,100	1,323.00	4,101,300
フリービット	5,600	1,156.00	6,473,600
コムチュア	4,000	3,875.00	15,500,000
サイバーコム	1,400	2,438.00	3,413,200
インフォテリア	4,000	1,336.00	5,344,000
メディカル・データ・ビジョン	6,000	1,527.00	9,162,000
gumi	9,000	995.00	8,955,000
ショーケース・ティービー	1,600	1,431.00	2,289,600
モバイルファクトリー	2,000	1,399.00	2,798,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,227.00	4,417,200
PCIホールディングス	1,400	3,045.00	4,263,000
パイプドHD	1,300	1,019.00	1,324,700
アイビーシー	1,400	1,309.00	1,832,600
ネオジャパン	1,900	1,349.00	2,563,100

オープンドア	3,100	2,040.00	6,324,000
マイネット	2,200	1,253.00	2,756,600
アカツキ	2,100	4,790.00	10,059,000
ベネフィットジャパン	500	1,196.00	598,000
U b i c o mホールディングス	1,300	899.00	1,168,700
L I N E	23,600	4,005.00	94,518,000
シンクロ・フード	2,700	1,025.00	2,767,500
オークネット	3,400	1,423.00	4,838,200
A O I T Y O H o l d i n g s	6,400	1,587.00	10,156,800
マクロミル	9,800	2,641.00	25,881,800
ビーグリー	1,800	1,723.00	3,101,400
オロ	800	2,057.00	1,645,600
ソルクシーズ	3,100	1,295.00	4,014,500
フェイス	2,800	1,124.00	3,147,200
ハイマックス	1,100	1,840.00	2,024,000
野村総合研究所	49,500	5,600.00	277,200,000
サイバネットシステム	6,500	888.00	5,772,000
C Eホールディングス	2,300	913.00	2,099,900
日本システム技術	1,300	1,359.00	1,766,700
インテージホールディングス	9,200	1,227.00	11,288,400
東邦システムサイエンス	2,700	876.00	2,365,200
ソースネクスト	11,000	814.00	8,954,000
フォーカスシステムズ	4,500	939.00	4,225,500
クレスコ	1,800	3,770.00	6,786,000
フジ・メディア・ホールディングス	81,700	1,841.00	150,409,700
オービック	24,600	9,360.00	230,256,000
ジャストシステム	12,700	2,542.00	32,283,400
T D Cソフト	3,500	1,441.00	5,043,500
ヤフー	562,200	407.00	228,815,400
トレンドマイクロ	38,100	6,500.00	247,650,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,500	1,408.00	3,520,000
日本オラクル	12,600	8,980.00	113,148,000
アルファシステムズ	2,600	2,482.00	6,453,200
フューチャー	10,600	1,423.00	15,083,800
C A C H o l d i n g s	5,900	1,098.00	6,478,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	1,686.00	5,563,800
トーセ	2,200	1,206.00	2,653,200
オービックビジネスコンサルタント	4,000	7,760.00	31,040,000
伊藤忠テクノソリューションズ	35,600	2,060.00	73,336,000
アイティフォー	9,500	1,216.00	11,552,000
東計電算	1,400	3,175.00	4,445,000
エックスネット	1,400	892.00	1,248,800

大塚商会	46,900	4,435.00	208,001,500
サイボウズ	10,500	558.00	5,859,000
ソフトブレーン	6,300	529.00	3,332,700
電通国際情報サービス	4,900	3,250.00	15,925,000
デジタルガレージ	14,000	3,815.00	53,410,000
E Mシステムズ	5,400	1,036.00	5,594,400
ウェザーニューズ	2,700	3,540.00	9,558,000
C I J	6,400	757.00	4,844,800
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,869.00	1,495,200
日本エンタープライズ	8,400	230.00	1,932,000
WOWOW	3,800	3,470.00	13,186,000
スカラ	6,400	819.00	5,241,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,600	1,020.00	6,732,000
ネットワンシステムズ	31,900	1,828.00	58,313,200
システムソフト	19,000	143.00	2,717,000
アルゴグラフィックス	3,600	3,835.00	13,806,000
マーベラス	13,300	960.00	12,768,000
エイベックス	14,400	1,499.00	21,585,600
日本ユニシス	21,600	2,630.00	56,808,000
兼松エレクトロニクス	5,000	3,675.00	18,375,000
東京放送ホールディングス	43,100	2,353.00	101,414,300
日本テレビホールディングス	71,600	1,857.00	132,961,200
朝日放送グループホールディングス	7,800	840.00	6,552,000
テレビ朝日ホールディングス	21,500	2,378.00	51,127,000
スカパーJ S A Tホールディングス	59,200	497.00	29,422,400
テレビ東京ホールディングス	6,400	2,929.00	18,745,600
日本BS放送	2,700	1,463.00	3,950,100
ビジョン	2,100	3,175.00	6,667,500
ワイヤレスゲート	3,700	1,600.00	5,920,000
コネクシオ	5,500	2,170.00	11,935,000
クロップス	1,800	944.00	1,699,200
日本電信電話	559,300	5,266.00	2,945,273,800
K D D I	701,800	2,884.00	2,023,991,200
光通信	9,400	17,210.00	161,774,000
N T T ドコモ	559,600	2,792.50	1,562,683,000
エムティーアイ	10,500	684.00	7,182,000
G M O インターネット	28,300	2,183.00	61,778,900
アйдママーケティングコミュニケーション	1,900	668.00	1,269,200
カドカワ	22,700	1,157.00	26,263,900
学研ホールディングス	2,600	5,010.00	13,026,000
ゼンリン	14,100	2,532.00	35,701,200
昭文社	3,700	849.00	3,141,300

インプレスホールディングス	6,400	202.00	1,292,800	
アイネット	4,500	1,651.00	7,429,500	
松竹	5,200	16,010.00	83,252,000	
東宝	51,300	3,840.00	196,992,000	
東映	2,900	12,120.00	35,148,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	242,200	1,241.00	300,570,200	
ピー・シー・エー	1,200	1,774.00	2,128,800	
ビジネスブレイン太田昭和	1,400	2,219.00	3,106,600	
D T S	8,100	4,015.00	32,521,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,200	4,840.00	175,208,000	
シーイーシー	4,700	3,445.00	16,191,500	
カプコン	33,500	2,410.00	80,735,000	
アイ・エス・ピー	1,600	2,163.00	3,460,800	
ジャステック	4,600	1,229.00	5,653,400	
S C S K	18,000	5,020.00	90,360,000	
日本システムウエア	2,600	2,586.00	6,723,600	
アイネス	9,900	1,194.00	11,820,600	
T K C	7,200	4,235.00	30,492,000	
富士ソフト	10,800	4,325.00	46,710,000	
N S D	12,800	2,327.00	29,785,600	
コナミホールディングス	31,900	5,520.00	176,088,000	
福井コンピュータホールディングス	2,300	2,189.00	5,034,700	
J B C Cホールディングス	6,200	1,078.00	6,683,600	
ミロク情報サービス	6,900	3,080.00	21,252,000	
ソフトバンクグループ	352,800	8,355.00	2,947,644,000	
ハウスイ	600	1,170.00	702,000	
高千穂交易	3,000	1,301.00	3,903,000	
伊藤忠食品	1,900	6,180.00	11,742,000	
エレマテック	3,600	2,561.00	9,219,600	
J A L U X	2,200	2,894.00	6,366,800	
あらた	3,900	7,610.00	29,679,000	
トーメンデバイス	1,200	2,914.00	3,496,800	
東京エレクトロン デバイス	2,800	2,114.00	5,919,200	
フィールズ	5,900	1,168.00	6,891,200	
双日	462,900	419.00	193,955,100	
アルフレッサ ホールディングス	86,900	2,460.00	213,774,000	
横浜冷凍	19,900	1,100.00	21,890,000	
神栄	1,100	1,446.00	1,590,600	
ラサ商事	3,400	950.00	3,230,000	
ラクーン	4,800	657.00	3,153,600	
アルコニックス	8,300	1,992.00	16,533,600	
神戸物産	5,100	5,180.00	26,418,000	



ペッパーフードサービス	5,600	6,010.00	33,656,000
あい ホールディングス	12,600	2,957.00	37,258,200
ディーブイエックス	2,800	1,378.00	3,858,400
ダイワボウホールディングス	6,700	5,020.00	33,634,000
マクニカ・富士エレホールディングス	14,900	1,948.00	29,025,200
ラクト・ジャパン	1,500	5,190.00	7,785,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,600	1,069.00	15,607,400
八洲電機	6,000	963.00	5,778,000
メディアスホールディングス	4,300	1,037.00	4,459,100
U K Cホールディングス	5,000	2,293.00	11,465,000
ジューテックホールディングス	1,800	1,151.00	2,071,800
大光	2,000	892.00	1,784,000
O C H Iホールディングス	2,300	1,616.00	3,716,800
T O K A Iホールディングス	41,400	1,180.00	48,852,000
C o m i n i x	1,200	1,005.00	1,206,000
三洋貿易	4,300	2,279.00	9,799,700
ビューティガレージ	1,000	2,335.00	2,335,000
ウイン・パートナーズ	5,600	1,485.00	8,316,000
ミタチ産業	1,800	1,160.00	2,088,000
シップヘルスケアホールディングス	16,300	3,740.00	60,962,000
明治電機工業	2,700	2,039.00	5,505,300
デリカフーズホールディングス	1,500	1,641.00	2,461,500
スターティアホールディングス	1,800	916.00	1,648,800
コメダホールディングス	14,400	2,139.00	30,801,600
富士興産	3,000	662.00	1,986,000
協栄産業	1,000	2,051.00	2,051,000
小野建	6,800	1,879.00	12,777,200
佐島電機	5,700	1,143.00	6,515,100
エコートレーディング	1,800	731.00	1,315,800
伯東	4,800	1,856.00	8,908,800
コンドーテック	6,200	939.00	5,821,800
中山福	4,400	745.00	3,278,000
ナガイレーベン	11,300	2,855.00	32,261,500
三菱食品	8,600	3,110.00	26,746,000
松田産業	5,700	1,898.00	10,818,600
第一興商	11,600	5,760.00	66,816,000
メディバルホールディングス	78,400	2,327.00	182,436,800
S P K	1,700	2,810.00	4,777,000
萩原電気ホールディングス	2,800	3,105.00	8,694,000
アズワン	6,100	7,150.00	43,615,000
スズデン	2,700	1,712.00	4,622,400
尾家産業	2,300	1,382.00	3,178,600

シモジマ	4,800	1,129.00	5,419,200
ドウシシャ	8,300	2,533.00	21,023,900
小津産業	1,700	2,358.00	4,008,600
高速	4,600	1,365.00	6,279,000
たけびし	2,700	1,738.00	4,692,600
リックス	1,800	2,106.00	3,790,800
丸文	6,900	961.00	6,630,900
ハピネット	5,300	1,568.00	8,310,400
橋本総業ホールディングス	1,600	1,762.00	2,819,200
日本ライフライン	22,300	2,568.00	57,266,400
エクセル	2,900	2,875.00	8,337,500
マルカキカイ	2,500	2,068.00	5,170,000
I D O M	23,600	797.00	18,809,200
日本エム・ディ・エム	5,200	1,141.00	5,933,200
進和	4,600	2,574.00	11,840,400
エスケイジャパン	1,900	560.00	1,064,000
ダイトロン	3,600	2,397.00	8,629,200
シークス	9,900	2,146.00	21,245,400
田中商事	2,400	742.00	1,780,800
オーハシテクニカ	4,400	1,788.00	7,867,200
白銅	2,800	2,350.00	6,580,000
伊藤忠商事	574,000	2,033.50	1,167,229,000
丸紅	642,800	866.90	557,243,320
高島	1,400	2,247.00	3,145,800
長瀬産業	47,100	1,961.00	92,363,100
蝶理	5,000	2,106.00	10,530,000
豊田通商	87,300	4,065.00	354,874,500
三共生興	13,200	497.00	6,560,400
兼松	33,200	1,727.00	57,336,400
ツカモトコーポレーション	1,400	1,276.00	1,786,400
三井物産	664,500	1,934.50	1,285,475,250
日本紙パルプ商事	4,100	4,490.00	18,409,000
日立ハイテクノロジーズ	27,200	5,050.00	137,360,000
カメイ	10,100	1,566.00	15,816,600
東都水産	1,200	1,880.00	2,256,000
O U G ホールディングス	1,200	2,678.00	3,213,600
スターゼン	3,100	5,450.00	16,895,000
山善	30,600	1,118.00	34,210,800
椿本興業	1,800	4,075.00	7,335,000
住友商事	493,400	1,925.50	950,041,700
内田洋行	3,600	3,040.00	10,944,000
三菱商事	548,900	3,187.00	1,749,344,300

第一実業	3,600	3,225.00	11,610,000
キヤノンマーケティングジャパン	22,300	2,408.00	53,698,400
西華産業	4,800	2,875.00	13,800,000
佐藤商事	7,000	1,197.00	8,379,000
菱洋エレクトロ	7,200	1,909.00	13,744,800
東京産業	7,700	563.00	4,335,100
ユアサ商事	7,400	3,575.00	26,455,000
神鋼商事	1,800	3,385.00	6,093,000
小林産業	5,200	360.00	1,872,000
阪和興業	14,600	4,795.00	70,007,000
正栄食品工業	4,300	4,400.00	18,920,000
カナデン	7,400	1,362.00	10,078,800
菱電商事	5,600	1,807.00	10,119,200
フルサト工業	4,300	1,853.00	7,967,900
岩谷産業	17,400	4,020.00	69,948,000
すてきナイスグループ	3,300	1,453.00	4,794,900
昭光通商	28,000	110.00	3,080,000
ニチモウ	1,200	1,817.00	2,180,400
極東貿易	11,000	502.00	5,522,000
イワキ	11,000	401.00	4,411,000
三愛石油	20,900	1,756.00	36,700,400
稲畑産業	18,700	1,691.00	31,621,700
G S Iクレオス	2,100	1,687.00	3,542,700
明和産業	7,100	534.00	3,791,400
ワキタ	16,600	1,201.00	19,936,600
東邦ホールディングス	23,200	2,778.00	64,449,600
サンゲツ	26,100	2,248.00	58,672,800
ミツウロコグループホールディングス	11,300	943.00	10,655,900
シナネンホールディングス	3,600	2,748.00	9,892,800
伊藤忠エネクス	17,200	1,091.00	18,765,200
サンリオ	21,900	2,040.00	44,676,000
サンワテクノス	5,100	1,675.00	8,542,500
リョーサン	9,800	4,265.00	41,797,000
新光商事	8,600	1,906.00	16,391,600
トーヨー	3,500	2,600.00	9,100,000
三信電気	7,200	2,193.00	15,789,600
東陽テクニカ	9,000	960.00	8,640,000
モスフードサービス	10,300	3,275.00	33,732,500
加賀電子	7,100	2,616.00	18,573,600
ソーダニッカ	8,000	785.00	6,280,000
立花エレテック	5,300	2,045.00	10,838,500
フォーバル	3,400	878.00	2,985,200

PAL TAC	11,000	6,200.00	68,200,000
三谷産業	8,400	426.00	3,578,400
西本Wismettacホールディングス	2,100	4,715.00	9,901,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	1,567.00	940,200
ヤマタネ	3,900	1,961.00	7,647,900
丸紅建材リース	8,000	242.00	1,936,000
日鉄住金物産	6,100	6,080.00	37,088,000
泉州電業	2,600	3,110.00	8,086,000
トラスコ中山	16,300	2,835.00	46,210,500
オートバックスセブン	31,000	2,053.00	63,643,000
モリト	6,200	1,042.00	6,460,400
加藤産業	12,200	4,010.00	48,922,000
イノテック	6,700	1,387.00	9,292,900
イエローハット	7,400	3,300.00	24,420,000
J Kホールディングス	7,800	918.00	7,160,400
日伝	6,500	2,095.00	13,617,500
北沢産業	6,400	301.00	1,926,400
杉本商事	4,200	2,029.00	8,521,800
因幡電機産業	10,400	4,790.00	49,816,000
バイテックホールディングス	3,600	2,678.00	9,640,800
東テク	2,600	2,694.00	7,004,400
ミスミグループ本社	90,900	3,065.00	278,608,500
アルテック	6,600	361.00	2,382,600
タキヒヨー	2,600	2,398.00	6,234,800
蔵王産業	1,300	1,777.00	2,310,100
スズケン	35,700	4,885.00	174,394,500
ジェコス	5,400	1,148.00	6,199,200
ルネサスイーストン	7,100	684.00	4,856,400
ローソン	19,800	6,940.00	137,412,000
サンエー	5,900	5,630.00	33,217,000
カワチ薬品	6,100	2,628.00	16,030,800
エービーシー・マート	14,300	7,180.00	102,674,000
ハードオフコーポレーション	3,600	1,127.00	4,057,200
アスクル	6,900	3,445.00	23,770,500
ゲオホールディングス	14,300	1,640.00	23,452,000
アダストリア	12,100	1,665.00	20,146,500
ジーフット	4,900	797.00	3,905,300
くらコーポレーション	4,600	7,820.00	35,972,000
キャンドゥ	3,800	1,832.00	6,961,600
パルグループホールディングス	4,100	2,910.00	11,931,000
エディオン	30,500	1,120.00	34,160,000
サーラコーポレーション	13,500	708.00	9,558,000

ワッツ	3,200	1,181.00	3,779,200
ハローズ	3,000	2,729.00	8,187,000
あみやき亭	1,700	5,430.00	9,231,000
ひらまつ	10,900	500.00	5,450,000
大黒天物産	1,900	5,890.00	11,191,000
ハニーズホールディングス	7,700	1,050.00	8,085,000
ファーマライズホールディングス	2,000	723.00	1,446,000
アルペン	6,000	2,317.00	13,902,000
ハブ	2,100	1,148.00	2,410,800
クオール	8,700	2,098.00	18,252,600
ジンズ	5,300	5,860.00	31,058,000
ビックカメラ	41,700	1,832.00	76,394,400
D C Mホールディングス	42,300	1,070.00	45,261,000
Monotaro	27,800	4,210.00	117,038,000
東京一番フーズ	2,100	670.00	1,407,000
DDホールディングス	1,700	2,858.00	4,858,600
きちり	2,300	730.00	1,679,000
アークランドサービスホールディングス	6,600	2,457.00	16,216,200
J.フロント リテイリング	93,500	1,788.00	167,178,000
ドトール・日レスホールディングス	13,700	2,333.00	31,962,100
マツモトキヨシホールディングス	32,400	4,915.00	159,246,000
ブロンコビリー	4,100	4,390.00	17,999,000
スタートトゥデイ	76,900	3,625.00	278,762,500
トレジャー・ファクトリー	2,500	791.00	1,977,500
物語コーポレーション	2,200	12,750.00	28,050,000
ココカラファイン	8,200	7,720.00	63,304,000
三越伊勢丹ホールディングス	146,400	1,322.00	193,540,800
Hamee	2,300	1,613.00	3,709,900
ウエルシアホールディングス	20,700	5,760.00	119,232,000
クリエイトSDホールディングス	11,600	3,255.00	37,758,000
丸善CH Iホールディングス	9,000	357.00	3,213,000
ティーライフ	1,200	1,343.00	1,611,600
エー・ピーカンパニー	1,700	788.00	1,339,600
チムニー	2,400	2,844.00	6,825,600
シュッピン	4,800	1,473.00	7,070,400
ネクステージ	8,300	1,172.00	9,727,600
ジョイフル本田	11,500	3,985.00	45,827,500
鳥貴族	2,900	2,780.00	8,062,000
麒麟堂ホールディングス	2,900	3,085.00	8,946,500
ホットランド	4,600	1,362.00	6,265,200
すかいらく	48,700	1,592.00	77,530,400
綿半ホールディングス	3,000	3,925.00	11,775,000

ヨシックス	1,300	3,340.00	4,342,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	26,100	1,417.00	36,983,700
ブックオフコーポレーション	4,400	825.00	3,630,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,300	1,349.00	4,451,700
B E E N O S	1,900	1,553.00	2,950,700
あさひ	5,900	1,312.00	7,740,800
日本調剤	2,800	3,295.00	9,226,000
コスモス薬品	4,000	24,750.00	99,000,000
トーエル	3,900	1,051.00	4,098,900
一六堂	2,000	420.00	840,000
オンリー	1,300	987.00	1,283,100
セブン&アイ・ホールディングス	327,900	4,762.00	1,561,459,800
薬王堂	3,500	3,975.00	13,912,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	21,200	1,350.00	28,620,000
ツルハホールディングス	17,000	16,090.00	273,530,000
サンマルクホールディングス	5,700	3,105.00	17,698,500
フェリシモ	2,100	1,367.00	2,870,700
トリドールホールディングス	9,700	3,715.00	36,035,500
T O K Y O B A S E	7,100	1,044.00	7,412,400
ウイルプラスホールディングス	900	1,142.00	1,027,800
サツドラホールディングス	1,400	2,375.00	3,325,000
ダイユー・リックホールディングス	3,800	1,095.00	4,161,000
パロックジャパンリミテッド	6,400	1,147.00	7,340,800
クスリのアオキホールディングス	6,200	7,700.00	47,740,000
力の源ホールディングス	1,800	1,900.00	3,420,000
スシローグローバルホールディングス	8,600	5,640.00	48,504,000
L I X I L ビバ	10,000	1,926.00	19,260,000
メディカルシステムネットワーク	9,200	489.00	4,498,800
総合メディカル	6,800	2,435.00	16,558,000
はるやまホールディングス	3,800	1,093.00	4,153,400
ノジマ	13,900	2,711.00	37,682,900
カッパ・クリエイト	9,700	1,474.00	14,297,800
ライトオン	6,700	1,025.00	6,867,500
良品計画	10,400	37,950.00	394,680,000
三城ホールディングス	9,800	516.00	5,056,800
アドヴァン	8,100	1,009.00	8,172,900
アルビス	2,600	3,870.00	10,062,000
コナカ	10,100	592.00	5,979,200
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,815.00	1,815,000
G - 7ホールディングス	2,400	2,453.00	5,887,200
イオン北海道	7,900	809.00	6,391,100

コジマ	13,700	460.00	6,302,000
ヒマラヤ	2,600	1,182.00	3,073,200
コーナン商事	11,200	2,765.00	30,968,000
エコス	3,300	1,847.00	6,095,100
マルシェ	2,200	814.00	1,790,800
ドンキホーテホールディングス	50,700	5,410.00	274,287,000
西松屋チェーン	17,200	1,297.00	22,308,400
ゼンショーホールディングス	40,700	2,679.00	109,035,300
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,794.00	8,970,000
ハークスレイ	2,000	1,137.00	2,274,000
サイゼリヤ	13,000	2,534.00	32,942,000
V Tホールディングス	26,600	492.00	13,087,200
魚力	2,300	1,433.00	3,295,900
ポブラ	2,000	900.00	1,800,000
フジ・コーポレーション	1,400	2,538.00	3,553,200
ユナイテッドアローズ	9,700	4,000.00	38,800,000
ハイデイ日高	10,300	2,795.00	28,788,500
京都きもの友禅	5,200	707.00	3,676,400
コロワイド	26,000	3,020.00	78,520,000
ピーシーデポコーポレーション	11,700	713.00	8,342,100
壱番屋	5,500	4,515.00	24,832,500
トップカルチャー	3,100	492.00	1,525,200
P L A N T	1,900	1,346.00	2,557,400
スギホールディングス	17,200	6,550.00	112,660,000
ヴィア・ホールディングス	9,400	694.00	6,523,600
スクロール	12,200	561.00	6,844,200
ヨンドシーホールディングス	8,000	2,733.00	21,864,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	25,000	10,870.00	271,750,000
木曽路	9,600	2,870.00	27,552,000
S R Sホールディングス	9,300	977.00	9,086,100
タカキュー	6,700	218.00	1,460,600
ケーヨー	14,400	566.00	8,150,400
上新電機	9,300	4,430.00	41,199,000
日本瓦斯	14,400	5,450.00	78,480,000
ロイヤルホールディングス	13,900	2,837.00	39,434,300
いなげや	8,700	1,765.00	15,355,500
島忠	17,800	3,475.00	61,855,000
チヨダ	9,300	2,655.00	24,691,500
ライフコーポレーション	6,000	2,823.00	16,938,000
リンガーハット	9,700	2,658.00	25,782,600
M r M a x H D	9,800	711.00	6,967,800
テンアライド	7,100	481.00	3,415,100

AOKIホールディングス	15,700	1,670.00	26,219,000
オークワ	11,000	1,165.00	12,815,000
コメリ	12,100	2,914.00	35,259,400
青山商事	15,100	4,205.00	63,495,500
しまむら	9,100	12,410.00	112,931,000
はせがわ	4,400	492.00	2,164,800
高島屋	123,000	916.00	112,668,000
松屋	15,700	1,382.00	21,697,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,100	2,066.00	76,648,600
近鉄百貨店	3,000	3,955.00	11,865,000
パルコ	7,600	1,358.00	10,320,800
丸井グループ	74,900	2,242.00	167,925,800
アクシアル リテイリング	6,500	4,150.00	26,975,000
イオン	301,000	2,147.50	646,397,500
イズミ	14,100	6,900.00	97,290,000
東武ストア	1,000	3,065.00	3,065,000
平和堂	15,900	2,600.00	41,340,000
フジ	9,300	2,299.00	21,380,700
ヤオコー	8,900	6,300.00	56,070,000
ゼビオホールディングス	10,700	1,971.00	21,089,700
ケーズホールディングス	68,700	1,371.00	94,187,700
Olympicグループ	4,800	563.00	2,702,400
日産東京販売ホールディングス	11,700	400.00	4,680,000
Genky DrugStores	3,300	4,320.00	14,256,000
アインホールディングス	10,500	7,230.00	75,915,000
元気寿司	2,000	2,961.00	5,922,000
ヤマダ電機	262,400	567.00	148,780,800
アークランドサカモト	13,300	1,738.00	23,115,400
ニトリホールディングス	31,100	18,300.00	569,130,000
グルメ杵屋	6,000	1,182.00	7,092,000
愛眼	6,100	498.00	3,037,800
ケーユーホールディングス	4,200	1,127.00	4,733,400
吉野家ホールディングス	25,700	2,014.00	51,759,800
松屋フーズ	3,800	3,750.00	14,250,000
サガミチェーン	10,500	1,423.00	14,941,500
関西スーパーマーケット	6,000	1,142.00	6,852,000
王将フードサービス	5,800	5,540.00	32,132,000
プレナス	8,800	1,899.00	16,711,200
ミニストップ	5,800	2,230.00	12,934,000
アークス	14,700	2,989.00	43,938,300
パローホールディングス	18,200	2,779.00	50,577,800
藤久	700	1,536.00	1,075,200



ベルク	3,500	5,780.00	20,230,000
大庄	4,300	1,732.00	7,447,600
ファーストリテイリング	10,500	48,650.00	510,825,000
サンドラッグ	33,200	5,510.00	182,932,000
サクスパー ホールディングス	7,500	1,168.00	8,760,000
ヤマザワ	1,700	1,798.00	3,056,600
やまや	1,700	3,930.00	6,681,000
ペルーナ	19,200	1,264.00	24,268,800
島根銀行	1,600	1,325.00	2,120,000
じもとホールディングス	52,500	191.00	10,027,500
めぶきフィナンシャルグループ	407,000	427.00	173,789,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,600	2,924.00	30,994,400
九州フィナンシャルグループ	128,500	556.00	71,446,000
ゆうちょ銀行	221,900	1,512.00	335,512,800
富山第一銀行	19,800	499.00	9,880,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	467,700	626.00	292,780,200
西日本フィナンシャルホールディングス	52,800	1,322.00	69,801,600
関西みらいフィナンシャルグループ	34,100	867.00	29,564,700
三十三フィナンシャルグループ	6,500	2,267.00	14,735,500
新生銀行	67,800	1,742.00	118,107,600
あおぞら銀行	46,700	4,410.00	205,947,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,483,900	719.00	3,942,924,100
りそなホールディングス	859,600	619.00	532,092,400
三井住友トラスト・ホールディングス	154,000	4,681.00	720,874,000
三井住友フィナンシャルグループ	592,900	4,492.00	2,663,306,800
第四銀行	9,600	4,905.00	47,088,000
北越銀行	7,800	2,424.00	18,907,200
千葉銀行	278,000	854.00	237,412,000
群馬銀行	159,100	655.00	104,210,500
武蔵野銀行	12,500	3,620.00	45,250,000
千葉興業銀行	21,300	504.00	10,735,200
筑波銀行	32,100	390.00	12,519,000
七十七銀行	24,600	2,729.00	67,133,400
青森銀行	6,100	3,380.00	20,618,000
秋田銀行	5,000	3,055.00	15,275,000
山形銀行	8,800	2,452.00	21,577,600
岩手銀行	5,500	4,315.00	23,732,500
東邦銀行	70,000	417.00	29,190,000
東北銀行	4,000	1,497.00	5,988,000
みちのく銀行	5,000	1,769.00	8,845,000
ふくおかフィナンシャルグループ	318,000	587.00	186,666,000
静岡銀行	206,800	1,127.00	233,063,600

十六銀行	10,500	2,844.00	29,862,000
スルガ銀行	80,100	1,596.00	127,839,600
八十二銀行	141,800	547.00	77,564,600
山梨中央銀行	49,000	486.00	23,814,000
大垣共立銀行	12,400	2,822.00	34,992,800
福井銀行	6,700	2,516.00	16,857,200
北國銀行	8,900	4,405.00	39,204,500
清水銀行	2,700	3,220.00	8,694,000
富山銀行	1,500	4,270.00	6,405,000
滋賀銀行	74,000	555.00	41,070,000
南都銀行	9,200	2,947.00	27,112,400
百五銀行	74,800	504.00	37,699,200
京都銀行	29,900	6,470.00	193,453,000
紀陽銀行	29,500	1,794.00	52,923,000
ほくほくフィナンシャルグループ	52,100	1,647.00	85,808,700
広島銀行	115,600	846.00	97,797,600
山陰合同銀行	46,400	1,056.00	48,998,400
中国銀行	54,200	1,297.00	70,297,400
鳥取銀行	2,500	1,741.00	4,352,500
伊予銀行	111,800	862.00	96,371,600
百十四銀行	83,000	363.00	30,129,000
四国銀行	12,000	1,536.00	18,432,000
阿波銀行	63,000	716.00	45,108,000
大分銀行	4,500	4,055.00	18,247,500
宮崎銀行	5,200	3,580.00	18,616,000
佐賀銀行	4,800	2,518.00	12,086,400
十八銀行	48,000	300.00	14,400,000
沖縄銀行	7,600	4,545.00	34,542,000
琉球銀行	15,100	1,686.00	25,458,600
セブン銀行	293,800	370.00	108,706,000
みずほフィナンシャルグループ	10,642,900	198.10	2,108,358,490
高知銀行	2,800	1,316.00	3,684,800
山口フィナンシャルグループ	98,000	1,405.00	137,690,000
長野銀行	2,600	1,845.00	4,797,000
名古屋銀行	6,300	4,105.00	25,861,500
北洋銀行	118,100	375.00	44,287,500
愛知銀行	2,600	5,240.00	13,624,000
中京銀行	3,200	2,322.00	7,430,400
大光銀行	2,700	2,395.00	6,466,500
愛媛銀行	10,900	1,287.00	14,028,300
トマト銀行	3,000	1,533.00	4,599,000
京葉銀行	69,000	506.00	34,914,000

栃木銀行	40,200	412.00	16,562,400
北日本銀行	2,400	2,927.00	7,024,800
東和銀行	13,700	1,366.00	18,714,200
福島銀行	7,300	809.00	5,905,700
大東銀行	3,700	1,345.00	4,976,500
トモニホールディングス	64,600	496.00	32,041,600
フィデアホールディングス	75,500	193.00	14,571,500
池田泉州ホールディングス	83,100	432.00	35,899,200
F P G	27,200	1,446.00	39,331,200
マーキュリアインベストメント	2,300	1,069.00	2,458,700
S B Iホールディングス	88,700	2,908.00	257,939,600
ジャフコ	11,300	4,730.00	53,449,000
大和証券グループ本社	671,000	654.50	439,169,500
野村ホールディングス	1,347,900	610.00	822,219,000
岡三証券グループ	67,000	588.00	39,396,000
丸三証券	24,900	1,016.00	25,298,400
東洋証券	29,000	284.00	8,236,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	86,900	744.00	64,653,600
光世証券	2,000	1,409.00	2,818,000
水戸証券	24,200	408.00	9,873,600
いちよし証券	16,400	1,288.00	21,123,200
松井証券	38,500	1,016.00	39,116,000
だいこう証券ビジネス	4,000	592.00	2,368,000
マネックスグループ	82,700	693.00	57,311,100
カブドットコム証券	50,000	403.00	20,150,000
極東証券	10,500	1,521.00	15,970,500
岩井コスモホールディングス	8,100	1,534.00	12,425,400
藍澤證券	14,700	799.00	11,745,300
マネーパートナーズグループ	10,200	449.00	4,579,800
かんぽ生命保険	29,600	2,607.00	77,167,200
S O M P Oホールディングス	153,600	4,690.00	720,384,000
アニコム ホールディングス	5,300	3,570.00	18,921,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	204,800	3,699.00	757,555,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	64,400	2,069.00	133,243,600
第一生命ホールディングス	443,100	2,133.00	945,132,300
東京海上ホールディングス	295,100	5,249.00	1,548,979,900
アドバンテッジリスクマネジメント	2,500	1,393.00	3,482,500
T & Dホールディングス	242,300	1,809.50	438,441,850
アドバンスクリエイト	1,800	2,045.00	3,681,000
全国保証	22,100	5,060.00	111,826,000
ジェイリース	1,500	736.00	1,104,000
イントラスト	1,600	703.00	1,124,800

アルヒ	8,900	1,501.00	13,358,900
クレディセゾン	59,400	1,924.00	114,285,600
アクリーティブ	4,200	336.00	1,411,200
芙蓉総合リース	9,000	8,070.00	72,630,000
興銀リース	14,700	3,100.00	45,570,000
東京センチュリー	15,800	7,330.00	115,814,000
日本証券金融	31,800	682.00	21,687,600
アイフル	131,400	395.00	51,903,000
リコーリース	6,200	3,770.00	23,374,000
イオンフィナンシャルサービス	55,600	2,710.00	150,676,000
アコム	157,400	499.00	78,542,600
ジャックス	9,500	2,473.00	23,493,500
オリエントコーポレーション	168,300	170.00	28,611,000
日立キャピタル	21,500	2,955.00	63,532,500
アプラスフィナンシャル	37,000	118.00	4,366,000
オリックス	522,500	1,950.50	1,019,136,250
三菱UFJリース	198,800	751.00	149,298,800
九州リースサービス	3,300	791.00	2,610,300
日本取引所グループ	224,800	2,064.00	463,987,200
イー・ギャランティ	4,100	2,355.00	9,655,500
アサックス	1,100	1,857.00	2,042,700
NECキャピタルソリューション	3,200	2,050.00	6,560,000
いちご	112,000	488.00	54,656,000
日本駐車場開発	94,000	183.00	17,202,000
ヒューリック	163,500	1,193.00	195,055,500
三栄建築設計	3,100	1,912.00	5,927,200
スター・マイカ	3,800	2,589.00	9,838,200
野村不動産ホールディングス	52,100	2,766.00	144,108,600
三重交通グループホールディングス	15,700	542.00	8,509,400
サムティ	6,700	2,086.00	13,976,200
ディア・ライフ	8,800	596.00	5,244,800
コーセーアールイー	1,800	977.00	1,758,600
エー・ディー・ワークス	103,200	41.00	4,231,200
日本商業開発	4,400	1,829.00	8,047,600
プレサンスコーポレーション	10,700	1,692.00	18,104,400
ユニゾホールディングス	9,200	2,215.00	20,378,000
THEグローバル社	3,700	842.00	3,115,400
日本管理センター	5,200	1,607.00	8,356,400
サンセイランディック	2,300	1,344.00	3,091,200
エストラスト	1,100	1,014.00	1,115,400
フージャースホールディングス	19,300	789.00	15,227,700
オープンハウス	12,800	6,030.00	77,184,000

東急不動産ホールディングス	189,700	849.00	161,055,300
飯田グループホールディングス	65,400	2,089.00	136,620,600
イーランド	1,300	1,218.00	1,583,400
ムゲンエステート	4,800	1,196.00	5,740,800
ビーロッド	1,200	2,153.00	2,583,600
ファーストブラザーズ	2,200	1,396.00	3,071,200
ハウズドゥ	1,300	5,620.00	7,306,000
シーアールイー	1,300	1,799.00	2,338,700
ケイアイスター不動産	2,800	2,862.00	8,013,600
パーク24	43,700	3,100.00	135,470,000
パラカ	2,500	2,425.00	6,062,500
三井不動産	391,200	2,789.50	1,091,252,400
三菱地所	583,100	2,005.50	1,169,407,050
平和不動産	13,800	2,327.00	32,112,600
東京建物	85,600	1,601.00	137,045,600
ダイビル	20,100	1,203.00	24,180,300
京阪神ビルディング	12,900	914.00	11,790,600
住友不動産	188,000	4,402.00	827,576,000
大京	12,400	2,488.00	30,851,200
テーオーシー	26,900	981.00	26,388,900
東京楽天地	1,300	5,640.00	7,332,000
レオパレス21	93,500	980.00	91,630,000
スターツコーポレーション	10,700	3,075.00	32,902,500
フジ住宅	10,000	948.00	9,480,000
空港施設	8,100	651.00	5,273,100
明和地所	4,300	767.00	3,298,100
ゴールドクレスト	6,200	2,119.00	13,137,800
日本エスリード	3,100	2,055.00	6,370,500
日神不動産	10,400	848.00	8,819,200
日本エスコン	14,000	813.00	11,382,000
タカラレーベン	36,400	460.00	16,744,000
サンヨーハウジング名古屋	4,400	1,223.00	5,381,200
イオンモール	50,500	2,160.00	109,080,000
ファースト住建	2,900	1,612.00	4,674,800
カチタス	10,700	3,675.00	39,322,500
トーセイ	9,500	1,348.00	12,806,000
穴吹興産	900	3,270.00	2,943,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	48,700	1,226.00	59,706,200
サンフロンティア不動産	9,400	1,447.00	13,601,800
エフ・ジェー・ネクスト	6,000	985.00	5,910,000
インテリックス	2,300	1,105.00	2,541,500
ランドビジネス	4,600	341.00	1,568,600

グランディハウス	6,800	512.00	3,481,600
日本空港ビルディング	22,900	4,615.00	105,683,500
日本工営	5,100	3,235.00	16,498,500
L I F U L L	26,300	799.00	21,013,700
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	2,273.00	13,865,300
日本M&Aセンター	52,500	3,280.00	172,200,000
メンバーズ	2,600	1,147.00	2,982,200
中広	900	746.00	671,400
タケエイ	7,900	1,331.00	10,514,900
トラスト・テック	3,600	3,805.00	13,698,000
コシダカホールディングス	5,100	6,890.00	35,139,000
パソナグループ	7,200	1,760.00	12,672,000
C D S	2,100	1,480.00	3,108,000
リンクアンドモチベーション	13,900	1,153.00	16,026,700
G C A	8,700	993.00	8,639,100
エス・エム・エス	15,000	3,805.00	57,075,000
パーソルホールディングス	70,100	2,602.00	182,400,200
リニカル	4,900	1,768.00	8,663,200
クックパッド	23,700	631.00	14,954,700
エスクリ	2,800	912.00	2,553,600
アイ・ケイ・ケイ	4,500	801.00	3,604,500
学情	3,500	1,354.00	4,739,000
スタジオアリス	3,800	2,460.00	9,348,000
シミックホールディングス	4,200	2,381.00	10,000,200
N J S	1,900	1,710.00	3,249,000
総合警備保障	30,200	5,530.00	167,006,000
カカクコム	57,200	2,255.00	128,986,000
アイロムグループ	2,600	2,586.00	6,723,600
セントケア・ホールディング	3,300	796.00	2,626,800
サイネックス	1,200	868.00	1,041,600
ルネサンス	3,700	1,917.00	7,092,900
ディップ	10,700	2,617.00	28,001,900
オプトホールディング	5,300	1,691.00	8,962,300
ツクイ	17,900	849.00	15,197,100
キャリアデザインセンター	2,000	2,178.00	4,356,000
エムスリー	79,900	4,270.00	341,173,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	651.00	3,971,100
プラス	500	906.00	453,000
アウトソーシング	22,600	2,034.00	45,968,400
ウェルネット	7,700	1,283.00	9,879,100
ワールドホールディングス	2,500	3,620.00	9,050,000
ディー・エヌ・エー	41,000	2,178.00	89,298,000

博報堂D Yホールディングス	105,500	1,541.00	162,575,500
ぐるなび	12,000	1,167.00	14,004,000
エスアールジータカミヤ	9,000	664.00	5,976,000
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	836.00	7,774,800
ファンコミュニケーションズ	21,100	716.00	15,107,600
ライク	3,000	2,109.00	6,327,000
ビジネス・ブレイクスルー	3,700	484.00	1,790,800
WDBホールディングス	3,500	3,605.00	12,617,500
ティア	4,100	1,069.00	4,382,900
C D G	700	1,939.00	1,357,300
バリューコマース	6,800	1,641.00	11,158,800
インフォマート	38,500	1,053.00	40,540,500
J Pホールディングス	23,800	361.00	8,591,800
E P Sホールディングス	11,400	2,043.00	23,290,200
レッグス	2,000	1,013.00	2,026,000
プレステージ・インターナショナル	15,700	1,269.00	19,923,300
アミューズ	5,100	3,135.00	15,988,500
ドリームインキュベータ	2,600	2,559.00	6,653,400
クイック	4,700	1,714.00	8,055,800
T A C	4,800	310.00	1,488,000
ケネディクス	100,700	658.00	66,260,600
電通	92,500	5,170.00	478,225,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,186.00	4,269,600
ぴあ	2,500	6,130.00	15,325,000
イオンファンタジー	2,400	6,350.00	15,240,000
シーティーエス	7,600	845.00	6,422,000
ネクシィーズグループ	3,000	1,655.00	4,965,000
みらかホールディングス	22,600	4,180.00	94,468,000
アルプス技研	6,700	2,300.00	15,410,000
ダイオーズ	1,600	1,400.00	2,240,000
日本空調サービス	8,000	819.00	6,552,000
オリエンタルランド	89,700	11,225.00	1,006,882,500
ダスキン	20,500	2,840.00	58,220,000
明光ネットワークジャパン	9,600	1,238.00	11,884,800
ファルコホールディングス	3,900	1,851.00	7,218,900
ラウンドワン	23,500	1,955.00	45,942,500
リゾートトラスト	32,200	2,308.00	74,317,600
ビー・エム・エル	9,800	2,726.00	26,714,800
ワタベウェディング	1,400	577.00	807,800
りらいあコミュニケーションズ	12,000	1,398.00	16,776,000
リソー教育	12,900	838.00	10,810,200
早稲田アカデミー	1,100	1,992.00	2,191,200

ユー・エス・エス	92,700	2,329.00	215,898,300
東京個別指導学院	2,800	1,254.00	3,511,200
サイバーエージェント	46,800	5,870.00	274,716,000
楽天	389,200	813.90	316,769,880
クリーク・アンド・リバー社	4,000	1,170.00	4,680,000
テー・オー・ダブリュー	7,300	919.00	6,708,700
セントラルスポーツ	2,900	3,915.00	11,353,500
フルキャストホールディングス	6,700	2,431.00	16,287,700
リソルホールディングス	800	4,455.00	3,564,000
テクノプロ・ホールディングス	14,300	6,720.00	96,096,000
アトラ	1,400	1,050.00	1,470,000
インターワークス	1,800	1,067.00	1,920,600
Keeper 技研	2,500	1,435.00	3,587,500
ファーストロジック	1,600	873.00	1,396,800
三機サービス	1,200	1,790.00	2,148,000
Gunosy	4,600	1,689.00	7,769,400
デザインワン・ジャパン	1,600	1,418.00	2,268,800
イー・ガーディアン	3,900	3,185.00	12,421,500
リブセンス	5,000	490.00	2,450,000
ジャパンマテリアル	20,700	1,516.00	31,381,200
ベクトル	9,100	2,138.00	19,455,800
ウチヤマホールディングス	3,900	649.00	2,531,100
ライクキッズネクスト	1,400	1,030.00	1,442,000
キャリアリンク	2,600	581.00	1,510,600
I B J	6,200	994.00	6,162,800
アサンテ	2,800	2,026.00	5,672,800
N・フィールド	4,300	1,774.00	7,628,200
バリューHR	1,800	1,965.00	3,537,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	8,970.00	17,043,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,200	1,063.00	3,401,600
E R Iホールディングス	2,200	1,092.00	2,402,400
アビスト	1,200	5,180.00	6,216,000
シグマクシス	4,100	1,712.00	7,019,200
ウィルグループ	3,300	1,382.00	4,560,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,500	450.00	4,725,000
日本ビューホテル	2,500	1,506.00	3,765,000
リクルートホールディングス	585,500	2,771.00	1,622,420,500
エラン	1,900	1,934.00	3,674,600
土木管理総合試験所	2,500	592.00	1,480,000
日本郵政	430,700	1,316.00	566,801,200
ベルシステム24ホールディングス	12,700	1,697.00	21,551,900
鎌倉新書	1,400	3,825.00	5,355,000



一蔵	1,100	1,027.00	1,129,700
LITALICO	1,800	1,627.00	2,928,600
グローバルグループ	900	1,260.00	1,134,000
エポラブルアジア	2,200	2,023.00	4,450,600
ストライク	1,000	6,870.00	6,870,000
ソラスト	4,600	3,010.00	13,846,000
セラク	1,800	820.00	1,476,000
インソース	2,600	2,211.00	5,748,600
キャリアインデックス	1,100	2,340.00	2,574,000
MS - Japan	800	7,350.00	5,880,000
船場	1,500	1,302.00	1,953,000
フルテック	900	1,249.00	1,124,100
グリーンズ	1,700	1,673.00	2,844,100
日総工産	1,300	4,650.00	6,045,000
キュービーネットホールディングス	3,800	1,952.00	7,417,600
リログループ	41,500	2,552.00	105,908,000
東祥	4,800	4,100.00	19,680,000
エイチ・アイ・エス	11,900	3,720.00	44,268,000
ラックランド	1,500	2,585.00	3,877,500
共立メンテナンス	13,600	5,230.00	71,128,000
イチネンホールディングス	8,500	1,458.00	12,393,000
建設技術研究所	5,300	1,471.00	7,796,300
スペース	5,000	1,489.00	7,445,000
長大	3,200	778.00	2,489,600
燦ホールディングス	1,800	2,834.00	5,101,200
スバル興業	500	7,020.00	3,510,000
東京テアトル	3,200	1,464.00	4,684,800
タナベ経営	1,500	2,108.00	3,162,000
ナガワ	1,500	4,570.00	6,855,000
よみうりランド	1,700	5,000.00	8,500,000
東京都競馬	5,700	4,725.00	26,932,500
カナモト	11,600	3,695.00	42,862,000
東京ドーム	30,600	1,074.00	32,864,400
西尾レントオール	7,700	3,425.00	26,372,500
トランス・コスモス	8,500	2,490.00	21,165,000
乃村工藝社	17,700	2,203.00	38,993,100
藤田観光	3,000	3,220.00	9,660,000
KNT - CTホールディングス	4,700	1,747.00	8,210,900
日本管財	8,100	2,146.00	17,382,600
トーカイ	7,300	2,452.00	17,899,600
白洋舎	900	3,275.00	2,947,500
セコム	80,500	8,417.00	677,568,500

セントラル警備保障	3,700	3,915.00	14,485,500	
丹青社	15,500	1,302.00	20,181,000	
メイテック	8,900	5,540.00	49,306,000	
応用地質	8,500	1,567.00	13,319,500	
船井総研ホールディングス	15,800	2,640.00	41,712,000	
進学会ホールディングス	3,600	628.00	2,260,800	
オオバ	6,300	660.00	4,158,000	
いであ	1,600	1,161.00	1,857,600	
学究社	2,800	1,806.00	5,056,800	
ベネッセホールディングス	27,800	4,140.00	115,092,000	
イオンディライト	9,400	3,870.00	36,378,000	
ナック	5,200	929.00	4,830,800	
ニチイ学館	14,400	1,205.00	17,352,000	
ダイセキ	12,800	3,460.00	44,288,000	
ステップ	2,800	1,722.00	4,821,600	
合 計	95,882,300		201,885,296,590	

## (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

項目	2018年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,905,412,571
コール・ローン	136,285,585
株式	315,229,718,540
投資信託受益証券	260,831,264
投資証券	7,328,333,684
派生商品評価勘定	380,764,198
未収入金	51,411,312
未収配当金	448,512,676

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	2,008,283,147
流動資産合計	339,749,552,977
資産合計	339,749,552,977
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	216,623,278
前受金	164,430,640
未払株式払込金	5,138,890
未払解約金	180,806,505
未払利息	220
その他未払費用	9,563
流動負債合計	567,009,096
負債合計	567,009,096
純資産の部	
元本等	
元本	137,860,073,599
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	201,322,470,282
元本等合計	339,182,543,881
純資産合計	339,182,543,881
負債純資産合計	339,749,552,977

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 5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> <p>(1) 先物取引</p>

2018年 5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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,860,073,599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 2.4603円 (1万口当たり純資産額) (24,603円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 5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

	2018年 5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。

	2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	135,279,294,476円
期中追加設定元本額	11,370,020,531円
期中一部解約元本額	8,789,241,408円
期末元本額	137,860,073,599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）	2,405,683,007円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,239,426円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,980,802,187円
世界経済インデックスファンド	7,008,822,837円
外国株式インデックス・オープン	794,442,851円
D C マイセレクション 2 5	1,008,187,838円
D C マイセレクション 5 0	4,647,837,634円
D C マイセレクション 7 5	5,110,160,679円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,518,100,994円
D C マイセレクション S 2 5	388,883,342円

区分	2018年 5月10日現在
DCマイセレクションS50	1,821,839,446円
DCマイセレクションS75	1,427,289,688円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	120,981,155円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	180,691,064円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	112,909,090円
DC世界経済インデックスファンド	5,486,113,731円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,714,585,933円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	21,268,448円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,113,767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)	63,032,181円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	93,265,312円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	319,301,052円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	49,791,363円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	427,227,341円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	933,818,054円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	450,525,069円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,944,756,183円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,193,668,145円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	148,438,768円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	433,844,897円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	308,157,677円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	141,436,507円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,112,848,114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)	2,552,337,473円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,461,931,050円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,276,837,565円
コア投資戦略ファンド(成長型)	7,430,177,721円
分散投資コア戦略ファンドA	2,064,611,267円
分散投資コア戦略ファンドS	4,185,644,000円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	590,890,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	717,110,330円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,144,870,945円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	868,356,070円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,046,123円
SMT インデックスバランス・オープン	319,740,160円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	2,075,872,181円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	30,097,707,402円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,546,773円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	251,450,547円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	28,394,826円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	434,721円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	21,653,319円
グローバル経済コア	1,231,548,515円

区分	2018年 5月10日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,495,892円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	48,752円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,731,740,246円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,354,562,949円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	25,658,517,340
投資信託受益証券	4,115,465
投資証券	230,935,886
合計	25,423,465,989

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2018年 5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	15,834,131,132	-	15,998,561,772	164,430,640
	合計	15,834,131,132	-	15,998,561,772	164,430,640

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2018年 5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	375,505,380	-	375,795,100	289,720
	アメリカドル	162,696,400	-	162,696,400	-



	ユーロ	118,218,290	-	118,509,300	291,010
	イギリスポンド	41,685,840	-	41,686,400	560
	スイスフラン	16,400,850	-	16,401,000	150
	スウェーデンクローナ	20,195,200	-	20,192,000	3,200
	シンガポールドル	16,308,800	-	16,310,000	1,200
	合計	375,505,380	-	375,795,100	289,720

## (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	67.44	2,992,987.20	
	ANDEAVOR	11,677	140.28	1,638,049.56	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	18.97	353,524.92	
	APACHE CORP	29,810	41.25	1,229,662.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	31,676	36.37	1,152,056.12	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	23.10	828,804.90	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	62.40	979,118.40	
	CHEVRON CORP	151,790	128.72	19,538,408.80	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	97.73	742,650.27	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	159.47	1,880,629.71	
	CONOCOPHILLIPS	96,082	68.70	6,600,833.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	68.06	520,454.82	
	DEVON ENERGY CORPORATION	40,715	40.22	1,637,557.30	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,758	136.52	922,602.16	
	EOG RESOURCES INC	46,520	117.79	5,479,590.80	
	EQT CORPORATION	18,637	51.24	954,959.88	
	EXXON MOBIL	338,335	79.93	27,043,116.55	
	HALLIBURTON CO	69,072	52.70	3,640,094.40	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	68.12	566,417.80	
	HESS CORP	22,081	62.35	1,376,750.35	
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	67.97	846,090.56		

KINDER MORGAN INC	157,150	16.45	2,585,117.50
MARATHON OIL CORP	65,596	21.26	1,394,570.96
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	77.11	2,973,824.26
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	40.37	1,223,655.07
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	28.19	453,097.87
NOBLE ENERGY INC	38,291	34.90	1,336,355.90
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,953	82.40	4,940,127.20
ONEOK INC	30,874	64.71	1,997,856.54
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	32.49	524,193.66
PHILLIPS 66	34,624	117.50	4,068,320.00
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	201.52	2,710,444.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	24.86	245,865.40
RANGE RESOURCES CORP	20,891	14.79	308,977.89
SCHLUMBERGER	109,215	70.88	7,741,159.20
TARGA RESOURCES CORP	16,467	47.59	783,664.53
TECHNIPFMC PLC	36,005	33.51	1,206,527.55
VALERO ENERGY CORP	35,381	114.82	4,062,446.42
WILLIAMS COS	67,038	26.52	1,777,847.76
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,986	164.89	2,800,821.54
ALBEMARLE CORP	8,647	101.75	879,832.25
AVERY DENNISON CORP	7,457	106.21	792,007.97
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	32.08	564,800.48
BALL CORP	27,142	38.59	1,047,409.78
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	109.19	1,206,877.07
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	38.75	686,688.75
CHEMOURS CO/THE	13,243	50.67	671,022.81
CROWN HOLDINGS INC	10,321	44.97	464,135.37
DOWDUPONT INC	187,231	66.03	12,362,862.93
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	107.45	1,274,142.10
ECOLAB INC	20,812	146.98	3,058,947.76
FMC CORP	10,402	86.38	898,524.76
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	15.68	1,746,689.28
INT'L PAPER CO	30,605	52.19	1,597,274.95
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	130.39	791,467.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	109.90	2,936,528.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	212.61	1,060,711.29
MONSANTO CO	35,478	124.69	4,423,751.82
MOSAIC CO/THE	27,677	25.80	714,066.60
NEWMONT MINING CORP	42,952	39.96	1,716,361.92
NUCOR CORP	24,915	62.71	1,562,419.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	115.45	831,817.25
PPG INDUSTRIES INC	19,958	107.05	2,136,503.90

PRAXAIR INC	22,656	155.51	3,523,234.56
SEALED AIR CORP	14,689	44.06	647,197.34
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,536	380.81	2,488,974.16
STEEL DYNAMICS INC	18,273	46.92	857,369.16
VULCAN MATERIALS CO	10,740	127.06	1,364,624.40
WESTROCK CO	19,364	60.48	1,171,134.72
WR GRACE & CO	5,635	71.67	403,860.45
3 M COMPANY	47,685	203.42	9,700,082.70
ACUITY BRANDS INC	3,505	113.90	399,219.50
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	55.37	627,342.10
AGCO CORP	4,669	63.45	296,248.05
ALLEGION PLC	7,168	76.28	546,775.04
AMETEK INC	18,866	74.80	1,411,176.80
APERGY CORP	6,004	40.91	245,623.64
ARCONIC INC	36,550	18.02	658,631.00
BOEING CO	45,238	344.50	15,584,491.00
CATERPILLAR	47,736	152.61	7,284,990.96
CUMMINS INC	12,421	146.52	1,819,924.92
DEERE&CO	22,078	145.16	3,204,842.48
DOVER CORP	12,008	76.89	923,295.12
EATON CORP	35,279	75.66	2,669,209.14
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	71.93	3,663,179.11
FASTENAL CO	23,228	51.51	1,196,474.28
FLOWSERVE CORP	10,826	47.82	517,699.32
FLUOR CORP	11,267	45.42	511,747.14
FORTIVE CORP	24,294	75.22	1,827,394.68
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	55.25	707,752.50
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	201.05	4,033,465.10
GENERAL ELECTRIC CO	694,701	14.62	10,156,528.62
GRAINGER (WW) INC	4,253	295.83	1,258,164.99
HARRIS CORP	9,793	155.39	1,521,734.27
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	39.28	598,077.28
HONEYWELL INTL INC	58,004	145.69	8,450,602.76
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	221.54	780,263.88
IDEX CORP	5,756	136.60	786,269.60
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	146.47	3,592,616.16
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	88.56	1,793,251.44
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	62.86	609,301.98
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	60.96	1,011,936.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	37.17	613,305.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	36.27	2,701,679.76
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	193.75	1,185,168.75

LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	202.52	584,270.20
LOCKHEED MARTIN CORP	20,422	326.12	6,660,022.64
MASCO CORP	24,547	37.63	923,703.61
MIDDLEBY CORP	4,364	108.55	473,734.02
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,972	327.59	4,249,497.48
OWENS CORNING	7,979	66.37	529,566.23
PACCAR INC	27,548	64.05	1,764,449.40
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	174.54	1,807,187.16
PENTAIR PLC	13,583	44.55	605,122.65
RAYTHEON COMPANY	22,777	212.23	4,833,962.71
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	177.20	1,862,549.20
ROCKWELL COLLIN	13,112	133.93	1,756,090.16
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	275.07	2,228,067.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	51.51	712,280.28
SMITH (A.O.) CORP	12,146	63.35	769,449.10
SNAP-ON INC	4,900	148.04	725,396.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	84.92	720,206.52
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	141.92	1,705,168.80
TEXTRON	21,877	65.17	1,425,724.09
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	334.48	1,362,002.56
UNITED RENTALS INC	6,446	162.32	1,046,314.72
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	123.11	7,490,135.51
WABCO HOLDINGS INC	3,841	130.50	501,250.50
WABTEC CORP	7,158	93.49	669,201.42
XYLEM INC	13,941	71.92	1,002,636.72
CINTAS CORP	7,034	178.88	1,258,241.92
COSTAR GROUP INC	3,008	390.28	1,173,962.24
EQUIFAX INC	9,276	113.86	1,056,165.36
IHS MARKIT LTD	32,775	51.19	1,677,752.25
MANPOWER GROUP	5,123	95.67	490,117.41
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	30.21	830,895.84
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	67.63	1,248,517.43
ROBERT HALF INTL INC	9,566	63.11	603,710.26
ROLLINS INC	7,031	49.64	349,018.84
STERICYCLE INC	6,767	64.01	433,155.67
TRANSUNION	15,344	68.60	1,052,598.40
VERISK ANALYTICS INC	12,301	104.78	1,288,898.78
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	75.64	1,543,661.12
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	83.01	2,899,622.31
AMERCO	602	336.91	202,819.82
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	41.50	411,680.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	83.49	955,793.52

CSX CORP	68,519	62.25	4,265,307.75
DELTA AIR LINES INC	15,095	51.62	779,203.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	70.54	973,663.62
FEDEX CORP	20,171	244.17	4,925,153.07
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	120.71	861,145.14
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	109.51	957,445.93
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	40.01	428,107.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	38.80	225,389.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	150.93	3,441,053.07
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	144.77	759,318.65
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	51.56	591,135.40
UNION PACIFIC CORP	63,087	139.90	8,825,871.30
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	65.80	394,997.40
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	111.40	6,150,616.80
APTIV PLC	20,954	94.39	1,977,848.06
AUTOLIV INC	6,639	139.56	926,538.84
BORGWARNER INC	15,953	49.93	796,533.29
FORD MOTOR COMPANY	299,765	11.06	3,315,400.90
GENERAL MOTORS CO	101,158	36.27	3,669,000.66
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	25.19	544,784.13
HARLEY-DAVIDSON	14,677	40.10	588,547.70
LEAR CORP	5,287	191.20	1,010,874.40
TESLA INC	10,869	306.85	3,335,152.65
DR HORTON INC	28,586	43.63	1,247,207.18
GARMIN LTD	9,564	59.41	568,197.24
HANESBRANDS INC	31,136	16.56	515,612.16
HASBRO INC	9,007	86.68	780,726.76
LEGGETT & PLATT INC	10,594	41.60	440,710.40
LENNAR CORP-CL A	23,545	53.61	1,262,247.45
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	98.96	838,389.12
MATTEL INC	27,399	14.49	397,011.51
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	62.38	720,301.86
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	210.38	1,064,943.56
NEWELL BRANDS INC	37,563	26.96	1,012,698.48
NIKE B	105,293	67.95	7,154,659.35
NVR INC	264	3,022.99	798,069.36
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	107.14	502,593.74
PULTE GROUP INC	21,959	30.76	675,458.84
PVH CORP	5,820	153.06	890,809.20
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	109.85	502,893.30
TAPESTRY INC	22,032	45.40	1,000,252.80
TOLL BROTHERS INC	11,211	42.26	473,776.86

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	18.29	291,725.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	16.51	268,832.33
VF CORP	26,718	78.13	2,087,477.34
WHIRLPOOL CORP	5,324	154.60	823,090.40
ARAMARK	19,980	37.47	748,650.60
BLOCK H & R INC	16,984	27.39	465,191.76
CARNIVAL CORPORATION	27,162	63.95	1,737,009.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	424.69	838,762.75
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	91.84	921,247.04
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	249.91	1,021,632.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,983	82.85	1,241,341.55
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	77.89	2,402,517.05
MARRIOTT INTL A	25,016	137.90	3,449,706.40
MCDONALD'S CORP	63,834	164.24	10,484,096.16
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	31.68	559,532.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	32.90	1,189,137.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.16	912,592.08
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	105.17	1,460,285.45
STARBUCKS CORP	113,248	57.04	6,459,665.92
VAIL RESORTS INC	2,987	231.40	691,191.80
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	110.86	880,560.98
WYNN RESORTS LTD	6,619	199.21	1,318,570.99
YUM BRANDS INC	25,546	84.45	2,157,359.70
CBS CORP-CL B	25,905	51.44	1,332,553.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,932	270.13	4,033,581.16
COMCAST CORP-CL A	373,142	30.73	11,466,653.66
DISCOVERY INC - A	12,804	22.28	285,273.12
DISCOVERY INC-C	23,672	21.11	499,715.92
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	31.12	566,944.16
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	23.72	802,542.48
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	71.12	616,112.56
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	30.34	470,755.44
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	29.52	1,365,919.92
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	30.68	429,826.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	43.37	660,655.21
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.28	276,299.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	9,899	42.87	424,370.13
NEWS CORP-CLASS A	33,479	16.51	552,738.29
OMNICOM GROUP	19,030	74.29	1,413,738.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.77	876,748.85
THE WALT DISNEY CO	120,117	99.97	12,008,096.49
TIME WARNER INC	62,552	92.38	5,778,553.76

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	37.70	3,136,112.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	33,111	37.24	1,233,053.64
VIACOM INC-CLASS B	26,755	30.06	804,255.30
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	117.99	729,886.14
AMAZON.COM	32,676	1,608.00	52,543,008.00
AUTONATION INC	5,015	46.61	233,749.15
AUTOZONE INC	2,151	658.33	1,416,067.83
BEST BUY COMPANY INC	21,836	76.22	1,664,339.92
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	2,183.59	8,535,653.31
CARMAX INC	14,253	64.11	913,759.83
DOLLAR GENERAL CORP	21,092	93.52	1,972,523.84
DOLLAR TREE INC	18,300	93.55	1,711,965.00
EXPEDIA GROUP INC	9,800	112.22	1,099,756.00
GAP	16,326	29.21	476,882.46
GENUINE PARTS CO	11,245	90.19	1,014,186.55
HOME DEPOT	93,339	186.36	17,394,656.04
KOHL'S CORP	12,602	61.39	773,636.78
L BRANDS INC	19,499	34.12	665,305.88
LKQ CORP	24,693	30.20	745,728.60
LOWES COMPANIES	66,782	84.42	5,637,736.44
MACY'S INC	25,926	30.14	781,409.64
NETFLIX INC	34,642	330.30	11,442,252.60
NORDSTROM INC	10,094	49.27	497,331.38
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	265.41	1,752,502.23
QURATE RETAIL INC QVC GROUP	35,071	24.55	860,993.05
ROSS STORES INC	30,239	81.85	2,475,062.15
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	69.93	2,925,591.48
TIFFANY & CO	10,306	103.36	1,065,228.16
TJX COMPANIES INC	50,039	83.89	4,197,771.71
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	66.69	630,620.64
TRIPADVISOR INC	10,393	47.62	494,914.66
ULTA BEAUTY INC	4,911	248.90	1,222,347.90
COSTCO WHOLESALE CORP	35,083	196.04	6,877,671.32
CVS HEALTH CORP	81,494	61.21	4,988,247.74
KROGER CO	67,460	24.36	1,643,325.60
SYSCO CORP	40,229	63.50	2,554,541.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	62.94	4,267,143.18
WALMART INC	119,581	83.06	9,932,397.86
ALTRIA GROUP INC	152,862	55.92	8,548,043.04
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	43.70	1,947,577.90
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	19,547	56.97	1,113,592.59
BUNGE LIMITED	11,767	69.92	822,748.64

CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	41.36	582,017.92
COCA-COLA CO	323,690	41.78	13,523,768.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	38.17	651,790.92
CONAGRA BRANDS INC	33,243	37.67	1,252,263.81
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,382	221.97	2,970,402.54
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	119.92	1,781,411.60
GENERAL MILLS INC	44,875	42.51	1,907,636.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	92.61	1,037,232.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	36.09	846,851.85
INGREDION INC	5,835	111.12	648,385.20
JM SMUCKER CO	9,442	113.79	1,074,405.18
KELLOGG CO	21,051	60.33	1,270,006.83
KRAFT HEINZ CO/THE	47,604	58.48	2,783,881.92
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	105.36	977,319.36
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	61.07	922,157.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	38.77	4,661,782.34
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	49.11	1,526,977.23
PEPSICO INC	113,781	96.16	10,941,180.96
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,274	81.99	10,189,225.26
TYSON FOODS INC	24,363	67.27	1,638,899.01
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	47.75	911,213.25
CLOROX COMPANY	10,045	120.33	1,208,714.85
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,693	61.91	4,067,053.63
COTY INC-CL A	39,000	15.01	585,390.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	137.81	2,456,049.82
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	103.06	2,884,649.40
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	72.37	14,677,070.22
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	72.89	138,053.66
ABBOTT LABORATORIES	139,733	59.40	8,300,140.20
AETNA INC	26,005	170.57	4,435,672.85
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	268.00	1,678,752.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	84.72	1,088,397.84
ANTHEM INC	20,286	221.77	4,498,826.22
BAXTER INTERNATIONAL	38,194	69.32	2,647,608.08
BECTON DICKINSON & CO	20,791	223.39	4,644,501.49
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	29.83	3,217,881.42
CARDINAL HEALTH	25,252	52.76	1,332,295.52
CENTENE CORP	13,787	112.83	1,555,587.21
CERNER CORP	23,088	59.35	1,370,272.80
CIGNA CORP	19,408	169.58	3,291,208.64
DANAHER CORP	50,460	99.54	5,022,788.40
DAVITA INC	11,875	64.80	769,500.00



DENTSPLY SIRONA INC	17,834	44.58	795,039.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	135.23	2,268,618.48
ENVISION HEALTHCARE	9,978	40.71	406,204.38
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	44,207	68.63	3,033,926.41
HCA HEALTHCARE INC	21,820	100.12	2,184,618.40
HENRY SCHEIN INC	12,492	71.58	894,177.36
HOLOGIC INC	21,094	36.91	778,579.54
HUMANA INC	11,281	273.25	3,082,533.25
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	206.62	1,488,697.10
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	462.27	4,188,628.47
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	171.86	1,366,802.58
MCKESSON CORP	16,655	144.81	2,411,810.55
MEDTRONIC PLC	108,664	84.06	9,134,295.84
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	100.64	1,059,940.48
RESMED INC	10,895	98.16	1,069,453.20
STRYKER CORP	27,181	167.39	4,549,827.59
TELEFLEX INC	3,697	267.09	987,431.73
THE COOPER COS INC	3,563	226.49	806,983.87
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,581	229.21	17,782,341.01
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	117.27	849,972.96
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	117.36	824,571.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	76.16	743,397.76
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	116.21	1,866,681.23
ABBVIE INC	127,922	101.18	12,943,147.96
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	68.13	1,725,255.99
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	116.77	2,070,215.33
ALKERMES PLC	12,547	44.70	560,850.90
ALLERGAN PLC	26,330	146.28	3,851,552.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	97.09	718,368.91
AMGEN	54,066	169.64	9,171,756.24
BIOGEN INC	16,758	274.03	4,592,194.74
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	88.45	1,268,461.45
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	129,430	51.09	6,612,578.70
CELGENE CORP	63,396	82.80	5,249,188.80
GILEAD SCIENCES INC	104,917	65.69	6,891,997.73
ILLUMINA INC	11,395	262.52	2,991,415.40
INCYTE CORP	14,121	64.35	908,686.35
IQVIA HOLDINGS INC	10,874	99.39	1,080,766.86
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	156.31	777,017.01
JOHNSON & JOHNSON	214,843	123.51	26,535,258.93
LILLY (ELI) & CO	79,730	79.27	6,320,197.10
MERCK & CO	218,364	57.95	12,654,193.80

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	549.66	1,102,617.96
MYLAN NV	36,548	36.72	1,342,042.56
PERRIGO CO PLC	9,792	73.45	719,222.40
PFIZER	477,201	35.17	16,783,159.17
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,112	284.60	1,739,475.20
SEATTLE GENETICS INC	7,471	55.50	414,640.50
TESARO INC	2,771	45.82	126,967.22
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	19.33	1,389,363.08
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	208.69	6,727,748.22
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	103.51	336,096.97
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	149.07	2,964,107.88
WATERS CORP	6,513	193.38	1,259,483.94
ZOETIS INC	38,334	82.33	3,156,038.22
BANK OF AMERICA CORP	791,346	30.72	24,310,149.12
BB&T CORP	64,293	54.92	3,530,971.56
CIT GROUP INC	10,713	53.76	575,930.88
CITIGROUP	212,257	71.95	15,271,891.15
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	42.17	1,687,221.70
COMERICA INC	12,963	97.32	1,261,559.16
EAST WEST BANCORP INC	10,794	69.41	749,211.54
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	33.67	1,960,166.39
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	97.13	1,221,701.14
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	15.09	1,319,137.62
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	113.41	31,411,394.52
KEY CORP	87,033	20.06	1,745,881.98
M & T BANK CORP	10,792	184.11	1,986,915.12
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	11.69	457,020.55
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	18.64	510,437.76
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	150.29	5,695,840.71
REGIONS FINL CORP	96,209	19.22	1,849,136.98
SIGNATURE BANK	4,354	130.24	567,064.96
SUNTRUST BANKS	38,353	68.55	2,629,098.15
SVB FINANCIAL GROUP	3,954	317.12	1,253,892.48
US BANCORP	133,199	50.83	6,770,505.17
WELLS FARGO & CO	373,750	53.76	20,092,800.00
ZIONS BANCORPORATION	15,186	57.28	869,854.08
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	163.53	724,928.49
ALLY FINANCIAL INC	36,028	27.07	975,277.96
AMERICAN EXPRESS	58,101	100.50	5,839,150.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	134.24	1,590,744.00
BANK NEW YORK CO	81,361	56.86	4,626,186.46
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,464	199.87	20,279,609.68

BLACKROCK INC	9,490	531.35	5,042,511.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	92.11	3,525,510.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,588	103.91	788,469.08
CME GROUP INC	27,024	161.47	4,363,565.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	74.12	2,191,357.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	64.00	1,350,912.00
EATON VANCE CORP	10,061	56.32	566,635.52
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.66	851,446.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,481	241.73	6,884,712.13
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	71.87	3,371,134.22
INVESCO LTD	30,943	27.98	865,785.14
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	24.64	633,395.84
MOODY'S CORP	13,385	170.55	2,282,811.75
MORGAN STANLEY	108,682	54.14	5,884,043.48
MSCI INC	6,934	156.63	1,086,072.42
NASDAQ INC	9,070	90.09	817,116.30
NORTHERN TRUST CORP	17,320	106.23	1,839,903.60
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	116.66	2,215,606.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	92.43	918,014.76
S&P GLOBAL INC	20,491	197.41	4,045,128.31
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	58.73	5,593,973.77
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	63.35	684,306.70
STATE STREET CORP	29,345	101.11	2,967,072.95
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	33.73	2,035,504.31
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	61.41	1,437,239.64
VOYA FINANCIAL INC	14,081	52.77	743,054.37
AFLAC	61,894	44.75	2,769,756.50
ALLEGHANY CORP	1,276	577.23	736,545.48
ALLSTATE CORP	28,446	96.41	2,742,478.86
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	110.88	615,273.12
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	52.82	3,830,031.02
AON PLC	20,775	141.29	2,935,299.75
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	79.38	801,896.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	68.66	1,027,977.52
ASSURANT INC	4,769	86.39	411,993.91
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	46.63	622,370.61
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.59	420,522.18
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	49.01	333,071.96
CHUBB LTD	36,582	134.69	4,927,229.58
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	71.21	883,929.73
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	227.95	764,316.35
FNF GROUP	20,786	37.67	783,008.62

HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	52.67	1,509,627.54
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	67.59	1,202,426.10
LOEWS CORP	22,051	51.61	1,138,052.11
MARKEL CORP	1,132	1,145.49	1,296,694.68
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	81.25	3,318,087.50
METLIFE INC	71,520	46.59	3,332,116.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	57.72	1,336,506.60
PROGRESSIVE CORP	46,702	61.79	2,885,716.58
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	100.13	3,358,960.98
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	150.60	817,908.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	127.31	413,630.19
TORCHMARK CORP	8,473	85.02	720,374.46
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	129.75	2,829,977.25
UNUM GROUP	18,574	37.76	701,354.24
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,962	152.21	1,516,316.02
WR BERKLEY CORP	7,296	75.27	549,169.92
XL GROUP LTD	20,644	55.08	1,137,071.52
CBRE GROUP INC-A	24,306	46.71	1,135,333.26
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.39	729,393.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	173.03	635,539.19
WEYERHAEUSER CO	58,857	36.45	2,145,337.65
ACCENTURE PLC-CL A	48,671	154.62	7,525,510.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	71.31	4,130,703.06
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	239.74	9,452,948.20
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	77.30	1,095,959.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	203.88	818,782.08
ALPHABET INC-CL A	23,818	1,088.95	25,936,611.10
ALPHABET INC-CL C	25,114	1,082.76	27,192,434.64
ANSYS INC	6,865	171.50	1,177,347.50
AUTODESK INC	15,592	135.32	2,109,909.44
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	127.04	4,543,966.72
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	113.88	1,098,942.00
CA INC	26,520	34.40	912,288.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	41.76	901,389.60
CDK GLOBAL INC	10,687	64.70	691,448.90
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	99.80	1,077,939.80
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	107.78	1,348,435.58
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,074	75.03	3,456,932.22
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	72.72	1,150,939.44
DXC TECHNOLOGY CO	22,050	103.44	2,280,852.00
EBAY	81,500	38.23	3,115,745.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,208	131.01	3,171,490.08

FACEBOOK INC-A	190,361	182.66	34,771,340.26
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	25,779	103.91	2,678,695.89
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	19.50	765,531.00
FISERV INC	33,784	71.49	2,415,218.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	204.11	1,462,039.93
FORTINET INC	10,871	59.02	641,606.42
GARTNER INC	7,002	133.54	935,047.08
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	114.60	1,433,989.80
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	138.76	883,068.64
INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,407	142.61	10,040,742.27
INTUIT INC	19,275	192.67	3,713,714.25
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	122.73	733,802.67
LEIDOS HOLDINGS	10,999	62.53	687,767.47
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	190.63	14,321,460.01
MERCADOLIBRE INC	3,264	325.31	1,061,811.84
MICROSOFT CORP	584,648	96.94	56,675,777.12
ORACLE CORP	250,503	46.58	11,668,429.74
PAYCHEX INC	25,506	62.21	1,586,728.26
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	77.01	7,054,655.07
RED HAT INC	13,963	171.16	2,389,907.08
SABRE CORP	17,243	22.97	396,071.71
SALESFORCE.COM INC	55,092	129.73	7,147,085.16
SERVICENOW INC	13,794	180.04	2,483,471.76
SPLUNK INC	10,741	114.84	1,233,496.44
SQUARE INC - A	22,319	54.26	1,211,028.94
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	49.00	648,711.00
SYMANTEC CORP	48,508	28.75	1,394,605.00
SYNOPSYS INC	12,264	90.83	1,113,939.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	115.99	1,107,936.48
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	87.82	1,107,410.20
TWITTER INC	47,756	32.46	1,550,159.76
VERISIGN INC	7,289	123.33	898,952.37
VISA INC-CLASS A SHARES	144,929	130.84	18,962,510.36
VMWARE INC-CLASS A	5,821	138.57	806,615.97
WESTERN UNION CO	38,757	19.92	772,039.44
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	136.50	1,459,321.50
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	84.49	1,978,586.82
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	56.38	438,974.68
AMPHENOL CORPORATION	24,215	86.31	2,089,996.65
APPLE INC	409,491	187.36	76,722,233.76
ARISTA NETWORKS INC	3,532	259.42	916,271.44
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	75.62	504,082.92

AVNET INC	10,936	40.00	437,440.00
CDW CORP/DE	12,482	77.69	969,726.58
CISCO SYSTEMS	393,079	46.04	18,097,357.16
COGNEX CORP	12,660	48.23	610,591.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	29.58	441,718.14
CORNING	71,752	27.08	1,943,044.16
F5 NETWORKS INC	5,350	172.00	920,200.00
FLEX LTD	40,465	14.34	580,268.10
FLIR SYSTEMS INC	11,686	55.39	647,287.54
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	17.60	2,283,353.60
HP INC	128,828	22.58	2,908,936.24
IPG PHOTONICS CORP	2,683	244.50	655,993.50
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	26.17	819,225.68
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	105.78	1,334,943.60
NETAPP INC	20,821	71.17	1,481,830.57
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	206.61	1,489,864.71
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	57.23	1,306,904.28
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	93.46	2,617,721.14
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	33.94	699,910.68
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	78.45	1,849,615.65
XEROX CORP	16,718	28.83	481,979.94
AT&T INC	490,614	31.40	15,405,279.60
CENTURYLINK INC	73,994	18.04	1,334,851.76
SPRINT CORP	64,825	5.18	335,793.50
T-MOBILE US INC	22,516	56.32	1,268,101.12
VERIZON COMMUNICATIONS	329,757	46.38	15,294,129.66
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.12	521,660.68
AES CORP	52,646	12.07	635,437.22
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	41.26	794,502.56
AMEREN CORPORATION	18,723	56.22	1,052,607.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	66.27	2,576,047.44
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	83.23	1,188,774.09
ATMOS ENERGY CORP	8,018	87.68	703,018.24
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	26.27	825,955.07
CMS ENERGY CORP	21,593	44.73	965,854.89
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	75.43	1,805,945.06
DOMINION ENERGY INC	50,217	62.67	3,147,099.39
DTE ENERGY COMPANY	14,355	100.24	1,438,945.20
DUKE ENERGY CORP	54,806	77.64	4,255,137.84
EDISON INTL	26,184	60.42	1,582,037.28
ENERGY CORP	13,854	78.02	1,080,889.08
EVERSOURCE ENERGY	25,381	57.00	1,446,717.00

EXELON CORP	77,742	39.97	3,107,347.74	
FIRSTENERGY CORP	35,696	33.52	1,196,529.92	
NEXTERA ENERGY INC	37,780	158.29	5,980,196.20	
NISOURCE INC	26,021	24.65	641,417.65	
OGE ENERGY CORP	15,686	33.60	527,049.60	
PG&E CORP	41,241	42.59	1,756,454.19	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	77.41	728,892.56	
PPL CORPORATION	53,473	27.89	1,491,361.97	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	50.57	2,053,445.42	
SCANA CORP	11,459	35.13	402,554.67	
SEMPRA ENERGY	18,704	105.14	1,966,538.56	
SOUTHERN CO	81,059	43.79	3,549,573.61	
UGI CORP	13,950	48.36	674,622.00	
VISTRA ENERGY CORP	16,718	22.99	384,346.82	
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	61.44	1,553,633.28	
WESTAR ENERGY INC	11,492	52.96	608,616.32	
XCEL ENERGY INC	40,763	44.81	1,826,590.03	
ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	11.95	722,532.85	
ANALOG DEVICES	28,935	92.62	2,679,959.70	
APPLIED MATERIALS	84,218	54.13	4,558,720.34	
BROADCOM INC	32,706	238.05	7,785,663.30	
INTEL CORP	373,935	54.34	20,319,627.90	
KLA-TENCOR CORP	12,266	109.17	1,339,079.22	
LAM RESEARCH CORP	12,814	199.72	2,559,212.08	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,459	21.29	648,472.11	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	57.33	1,251,456.57	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	91.86	1,710,800.64	
MICRON TECHNOLOGY	92,766	51.01	4,731,993.66	
NVIDIA CORP	48,497	255.78	12,404,562.66	
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	98.64	2,691,195.12	
QORVO INC	10,609	80.21	850,947.89	
QUALCOMM	118,351	53.17	6,292,722.67	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	95.55	1,386,430.50	
TEXAS INSTRUMENTS	79,005	107.54	8,496,197.70	
XILINX INC	20,299	68.43	1,389,060.57	
アメリカドル 小計	24,433,321		1,881,470,016.28 (206,886,442,990)	
カナダドル				
ALTAGAS INCOME LTD	11,886	25.47	302,736.42	
ARC RESOURCES LTD	27,117	13.59	368,520.03	
CAMECO CORP	28,709	14.67	421,161.03	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,125	45.90	4,090,837.50	
CENOVUS ENERGY INC	77,803	14.11	1,097,800.33	

CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	10.35	447,575.40
ENBRIDGE	133,550	41.48	5,539,654.00
ENCANA CORP	76,271	17.19	1,311,098.49
HUSKY ENERGY INC	31,439	18.13	569,989.07
IMPERIAL OIL	24,763	41.00	1,015,283.00
INTER PIPELINE LTD	30,317	23.68	717,906.56
KEYERA CORP	14,929	35.38	528,188.02
PEMBINA PIPELINE CORP	37,784	44.00	1,662,496.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	27.20	499,120.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	16.24	324,962.40
SUNCOR ENERGY	130,278	50.18	6,537,350.04
TOURMALINE OIL CORP	19,965	24.02	479,559.30
TRANSCANADA CORP	70,703	55.89	3,951,590.67
VERMILION ENERGY INC	10,067	44.25	445,464.75
AGNICO EAGLE MINES	17,661	56.12	991,135.32
BARRICK GOLD CORP	94,395	17.14	1,617,930.30
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	61.25	643,125.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	19.92	1,133,448.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	96.38	1,374,089.66
GOLDCORP INC	68,688	17.33	1,190,363.04
KINROSS GOLD CORP	107,615	4.73	509,018.95
LUNDIN MINING CORP	40,933	8.32	340,562.56
METHANEX CORP	7,099	87.53	621,375.47
NUTRIEN LTD	51,428	62.37	3,207,564.36
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	34.16	1,560,326.32
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.78	268,380.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	90.22	390,381.94
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	27.72	1,021,149.36
BOMBARDIER B	157,835	4.21	664,485.35
CAE INC	18,372	24.32	446,807.04
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	33.21	390,682.44
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	56.06	824,810.78
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,879	102.20	6,017,433.80
CP RAILWAY LIMITED	11,263	238.76	2,689,153.88
LINAMAR CORP	3,889	73.19	284,635.91
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	78.16	2,186,760.48
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	36.99	653,206.41
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	71.67	1,316,721.24
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	26.07	937,138.29
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	175.37	948,576.33
DOLLARAMA INC	8,900	147.43	1,312,127.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	53.59	1,825,436.17



EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	25.05	288,049.95	
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	24.50	135,093.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	65.33	1,020,323.94	
METRO INC	19,179	40.54	777,516.66	
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	103.12	492,398.00	
SAPUTO INC	15,941	42.28	673,985.48	
BANK MONTREAL	50,677	100.14	5,074,794.78	
BANK NOVA SCOTIA	96,431	80.00	7,714,480.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	114.07	4,031,804.15	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	62.56	1,765,943.68	
ROYAL BANK OF CANADA	116,879	99.63	11,644,654.77	
TORONTO-DOMINION BANK	148,256	74.24	11,006,525.44	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	51.41	3,512,279.79	
CI FINANCIAL CORP	18,671	26.29	490,860.59	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	4.85	140,582.10	
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.60	296,641.00	
ONEX CORP	6,603	93.88	619,889.64	
THOMSON REUTERS CORP	22,284	49.96	1,113,308.64	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	711.00	1,638,855.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	33.58	798,801.04	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	52.91	435,449.30	
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	95.15	995,839.90	
MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	24.75	3,973,315.50	
POWER CORP OF CANADA	29,774	29.75	885,776.50	
POWER FINANCIAL CORP	20,740	32.46	673,220.40	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	52.42	2,596,677.12	
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.48	255,283.20	
BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.89	586,666.00	
CGI GROUP INC - CL A	21,192	77.78	1,648,313.76	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	973.25	1,483,233.00	
OPEN TEXT CORP	19,994	47.26	944,916.44	
SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	187.60	1,377,359.20	
BCE INC	12,539	53.28	668,077.92	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	61.08	1,764,051.48	
TELUS CORP	16,454	45.93	755,732.22	
ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.06	204,713.46	
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.13	331,710.12	
EMERA INC	4,086	40.71	166,341.06	
FORTIS INC	34,128	42.50	1,450,440.00	
HYDRO ONE LTD	21,742	20.23	439,840.66	
カナダドル 小計	3,190,250		140,551,863.30 (12,029,833,979)	

ユーロ	ENAGAS	18,299	24.39	446,312.61
	ENI	202,686	16.68	3,382,018.59
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	16.44	655,413.48
	NESTE OIL OYJ	9,229	66.66	615,205.14
	OMV AG	12,139	54.50	661,575.50
	REPSOL SA	98,275	16.54	1,625,468.50
	SNAM SPA	173,485	3.86	670,866.49
	TENARIS SA	40,648	16.39	666,423.96
	TOTAL SA	192,377	52.78	10,153,658.06
	VOPAK	6,360	41.31	262,731.60
	AIR LIQUIDE	34,556	108.20	3,738,959.20
	AKZO NOBEL	19,791	75.80	1,500,157.80
	ARCELORMITTAL	53,985	29.41	1,587,698.85
	ARKEMA	5,335	108.40	578,314.00
	BASF SE	73,727	86.14	6,350,843.78
	COVESTRO AG	13,429	77.70	1,043,433.30
	CRH PLC	71,124	31.00	2,204,844.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	31.16	419,226.64
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	45.14	260,096.68
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	83.96	957,731.72
	IMERYS SA	3,000	75.00	225,000.00
	K+S AG	14,355	24.54	352,271.70
	KONINKLIJKE DSM NV	13,812	85.60	1,182,307.20
	LANXESS	7,293	67.88	495,048.84
	LINDE AG - TENDER	14,602	189.70	2,769,999.40
	SOLVAY SA	5,511	115.10	634,316.10
	STORA ENSO OYJ R	47,237	16.75	791,219.75
	SYMRISE AG	9,083	71.32	647,799.56
	THYSSEN KRUPP	33,044	22.82	754,064.08
	UMICORE	17,605	47.70	839,758.50
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	30.62	1,346,973.80
	VOESTALPINE AG	8,140	45.98	374,277.20
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,077	36.22	727,188.94
	AIRBUS SE	46,842	99.16	4,644,852.72
	ALSTOM	13,816	38.59	533,159.44
ANDRITZ AG	5,242	43.76	229,389.92	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	24.40	203,422.80	
BOUYGUES ORD	16,815	43.08	724,390.20	
BRENTAG AG	11,626	50.80	590,600.80	
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	10.44	800,640.58	
DASSAULT AVIATION SA	213	1,705.00	363,165.00	
EIFFAGE	6,079	100.15	608,811.85	

FERROVIAL SA	36,974	18.07	668,305.05
GEA GROUP AG	13,382	33.24	444,817.68
HOCHTIEF AG	1,354	151.40	204,995.60
KION GROUP AG	5,887	73.02	429,868.74
KONE OYJ-B	26,924	42.10	1,133,500.40
LEGRAND SA	21,312	66.14	1,409,575.68
LEONARDO SPA	35,425	9.94	352,266.20
MAN SE	3,262	96.90	316,087.80
METSO OYJ	9,561	30.12	287,977.32
MTU AERO ENGINES AG	3,907	153.90	601,287.30
OSRAM LICHT AG	7,440	52.14	387,921.60
PRYSMIAN SPA	14,715	25.42	374,055.30
REXEL SA	24,339	13.10	318,840.90
SAFRAN SA	27,252	98.90	2,695,222.80
SAINT-GOBAIN	39,044	44.43	1,734,724.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	75.22	3,370,909.08
SIEMENS	61,389	114.60	7,035,179.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	14.10	246,623.10
THALES SA	8,109	111.00	900,099.00
VINCI S.A.	40,049	85.16	3,410,572.84
WARTSILA OYJ	34,386	18.01	619,291.86
BUREAU VERITAS SA	19,558	21.86	427,537.88
EDENRED	18,941	28.90	547,394.90
RANDSTAD NV	9,588	53.16	509,698.08
RELX NV	80,302	18.00	1,445,436.00
SOCIETE BIC SA	2,424	85.15	206,403.60
TELEPERFORMANCE	4,523	136.80	618,746.40
WOLTERS KLUWER	23,031	45.19	1,040,770.89
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	53,260	18.24	971,462.40
ADP	2,382	182.50	434,715.00
AENA SME SA	5,610	177.95	998,299.50
ATLANTIA SPA	37,004	28.40	1,050,913.60
BOLLORE	61,805	4.30	265,761.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	24.26	410,697.54
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	34.13	2,682,344.96
FRAPORT AG	3,561	83.70	298,055.70
GETLINK	36,478	11.82	431,352.35
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.93	367,584.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	91.96	2,472,988.32
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	80.05	399,529.55
CONTINENTAL AG	8,828	226.40	1,998,659.20
DAIMLER AG	77,385	67.10	5,192,533.50

FAURECIA	5,945	70.96	421,857.20
FERRARI NV	9,947	114.05	1,134,455.35
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	18.74	1,622,161.99
MICHELIN	13,802	117.65	1,623,805.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	31.57	324,918.44
PEUGEOT SA	46,029	20.01	921,040.29
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	70.46	819,731.64
RENAULT SA	15,041	88.54	1,331,730.14
SCHAEFFLER AG	15,247	13.43	204,843.44
VALEO SA	19,350	57.54	1,113,399.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	170.80	2,524,424.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	168.20	436,310.80
ADIDAS AG	14,964	190.35	2,848,397.40
HERMES INTERNATIONAL	2,561	572.00	1,464,892.00
HUGO BOSS AG	4,852	74.98	363,802.96
KERING	6,060	480.60	2,912,436.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	52.88	704,308.72
LVMH	22,399	292.05	6,541,627.95
SEB SA	2,075	159.80	331,585.00
ACCOR	14,931	47.84	714,299.04
PADDY POWER PLC	7,143	80.90	577,868.70
SODEXO	7,035	83.50	587,422.50
ALTICE NV -A	38,810	7.41	287,582.10
AXEL SPRINGER SE	3,827	66.70	255,260.90
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	17.97	215,268.60
JC DECAUX SA	4,674	29.58	138,256.92
LAGADERE S.C.A	9,057	22.95	207,858.15
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	28.22	541,090.28
PUBLICIS GROUPE	15,618	62.32	973,313.76
RTL GROUP	3,513	70.15	246,436.95
SES	31,369	13.27	416,266.63
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	49.26	246,201.48
VIVENDI	83,098	22.90	1,902,944.20
INDITEX	86,470	27.10	2,343,337.00
ZALANDO SE	9,155	43.81	401,080.55
CARREFOUR	43,442	16.54	718,530.68
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	41.87	154,374.69
COLRUYT SA	4,160	47.06	195,769.60
JERONIMO MARTINS	20,234	13.53	273,766.02
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	19.37	1,947,966.16
METRO AG	13,712	11.80	161,870.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	82.72	5,032,602.08

DANONE (GROUPE)	48,771	64.72	3,156,459.12
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	6.26	266,212.76
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	84.75	761,055.00
HEINEKEN NV	20,246	87.78	1,777,193.88
KERRY GROUP PLC-A	13,146	89.30	1,173,937.80
PERNOD-RICARD	16,613	137.80	2,289,271.40
REMY COINTREAU	1,575	116.80	183,960.00
BEIERSDORF AG	7,693	97.34	748,836.62
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	97.00	835,946.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	104.20	1,491,518.80
LOREAL	20,321	201.10	4,086,553.10
UNILEVER NV-CVA	130,808	47.48	6,210,763.84
BIOMERIEUX	3,246	69.60	225,921.60
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	115.35	1,869,016.05
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,573	84.90	1,407,047.70
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	67.30	2,278,105.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	35.27	2,626,204.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	33.00	412,500.00
BAYER	66,378	102.16	6,781,176.48
EUROFINS SCIENTIFIC	971	447.20	434,231.20
GRIFOLS SA	22,128	24.80	548,774.40
IPSEN	2,722	131.80	358,759.60
MERCK KGAA	10,480	82.08	860,198.40
ORION OYJ-CLASS B	7,975	25.18	200,810.50
QIAGEN N.V.	17,548	29.18	512,050.64
RECORDATI SPA	7,493	30.71	230,110.03
SANOFI	91,271	66.26	6,047,616.46
UCB (GROUPE)	10,465	63.24	661,806.60
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	25.94	860,922.66
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	6.80	3,686,258.91
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.71	757,684.79
BANCO SANTANDER SA	1,302,544	5.43	7,079,326.64
BANKIA SA	110,053	3.62	399,272.28
BANKINTER SA	58,881	9.04	532,755.28
BNP PARIBAS	90,844	62.65	5,691,376.60
CAIXABANK	277,342	4.22	1,170,383.24
COMMERZBANK AG	80,494	10.85	874,003.85
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	13.44	1,247,688.96
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	38.17	882,032.36
ING GROEP NV-CVA	314,846	13.50	4,252,310.07
INTESA SANPAOLO	1,095,718	3.16	3,462,468.88
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	3.29	213,980.00

KBC GROEP NV	20,232	71.20	1,440,518.40
MEDIOBANCA	53,990	10.00	539,900.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	28.53	356,339.70
SOCIETE GENERALE	60,408	42.33	2,557,070.64
UNICREDIT SPA	163,189	17.53	2,862,008.68
AMUNDI SA	4,764	71.72	341,674.08
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	11.54	1,859,740.24
DEUTSCHE BOERSE	15,552	115.60	1,797,811.20
EURAZEO SA	3,198	70.05	224,019.90
EXOR NV	7,813	65.14	508,938.82
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	91.66	572,600.02
NATIXIS	69,996	6.81	477,092.73
WENDEL	2,023	127.80	258,539.40
AEGON	133,499	6.03	804,998.97
AGEAS	16,065	44.45	714,089.25
ALLIANZ SE-REG	36,019	198.54	7,151,212.26
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	16.56	1,683,307.44
AXA	157,703	22.34	3,523,085.02
CNP ASSURANCES	11,830	20.74	245,354.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	113.70	535,072.20
MAPFRE SA	90,939	2.91	264,632.49
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	192.50	2,438,012.50
NN GROUP NV	23,899	39.10	934,450.90
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.10	373,159.71
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	44.00	1,593,372.00
SCOR SE	13,354	33.25	444,020.50
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.20	209,176.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	39.66	1,092,751.98
VONOVIA SE	37,270	40.72	1,517,634.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	34,225	63.08	2,158,913.00
ATOS SE	7,634	111.20	848,900.80
CAPGEMINI SA	13,238	115.40	1,527,665.20
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	110.00	1,151,590.00
SAP SE	78,835	96.74	7,626,497.90
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	85.50	583,965.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	57.16	543,763.08
WIRECARD AG	8,914	120.50	1,074,137.00
INGENICO GROUP	4,681	74.28	347,704.68
NOKIA OYJ	458,694	5.30	2,431,078.20
1&1 DRILLISCH AG	3,773	63.20	238,453.60
DEUTSCHE TELEKOM	268,918	14.30	3,845,527.40
ELISA A	11,722	36.71	430,314.62

	ILIAD SA	2,053	169.15	347,264.95
	KPN (KON.)	261,596	2.59	679,103.21
	ORANGE	156,887	15.22	2,388,604.57
	PROXIMUS	13,141	24.44	321,166.04
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.82	706,765.60
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.71	335,778.98
	TELEFONICA	377,880	8.33	3,150,007.68
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.13	276,908.54
	E.ON SE	169,727	9.52	1,617,158.85
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	11.86	589,868.96
	ENDESA	24,774	19.47	482,349.78
	ENEL	656,974	5.24	3,442,543.76
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.05	590,547.55
	ENGIE	142,903	14.60	2,086,383.80
	FORTUM OYJ	32,675	19.73	644,677.75
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	21.47	558,949.98
	IBERDROLA SA	454,702	6.53	2,972,841.67
	INNOGY SE	11,000	36.50	401,500.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	17.22	566,392.45
	RWE STAMM	42,828	19.97	855,489.30
	SUEZ	28,043	11.93	334,552.99
	TERNA SPA	105,905	4.96	525,394.70
	UNIPER SE	14,751	26.90	396,801.90
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	20.57	757,366.83
	ASML HOLDING NV	31,209	165.60	5,168,210.40
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	23.92	2,170,572.56
	STMICROELECTRONICS	48,144	19.88	957,343.44
	ユーロ 小計	15,524,244		326,517,883.28 (42,522,423,939)
イギリスポンド	BP PLC	1,581,506	5.72	9,046,214.32
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	363,174	26.33	9,564,187.29
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	299,477	27.22	8,151,763.94
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	5.97	322,380.00
	ANGLO AMERICAN PLC	102,395	17.50	1,791,912.50
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.13	363,400.56
	BHP BILLITTON PLC	168,203	16.31	2,744,736.55
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	45.97	470,870.71
	FRESNILLO PLC	17,743	12.99	230,570.28
	GLENCORE PLC	981,189	3.66	3,599,491.84
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	34.07	480,761.77
	MONDI PLC	27,192	20.01	544,111.92
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	61.00	444,934.00

RIO TINTO PLC REG	96,058	41.27	3,964,313.66
ASHTED GROUP PLC	37,298	22.00	820,556.00
BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.14	1,577,267.76
BUNZL PLC	27,712	22.02	610,218.24
COBHAM PLC	197,992	1.17	233,036.58
DCC PLC	7,320	73.95	541,314.00
FERGUSON PLC	20,276	56.14	1,138,294.64
IMI PLC	23,923	10.77	257,650.71
MEGGITT PLC	66,268	4.82	319,411.76
MELROSE INDUSTRIES PLC	221,626	2.33	516,388.58
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	8.30	1,110,647.90
SMITHS GROUP PLC	28,628	16.55	473,793.40
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	13.04	242,049.97
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	22.56	419,300.16
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.55	148,721.53
EXPERIAN PLC	75,041	17.38	1,304,212.58
G4S PLC	132,555	2.57	340,666.35
INTERTEK GROUP PLC	12,430	50.58	628,709.40
RELX PLC	82,063	15.83	1,299,467.60
EASYJET PLC	11,633	16.58	192,875.14
ROYAL MAIL PLC	75,133	6.03	453,653.05
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.68	405,990.26
BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.70	625,305.60
PERSIMMON PLC	22,676	27.73	628,805.48
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.93	524,550.34
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	41.42	439,010.58
CARNIVAL PLC	13,721	47.97	658,196.37
COMPASS GROUP PLC	126,022	15.08	1,900,411.76
GVC HOLDINGS PLC	42,500	8.72	370,812.50
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	47.94	669,434.16
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.72	242,359.85
TUI AG-DI	31,155	17.27	538,202.62
WHITBREAD PLC	14,664	42.42	622,046.88
ITV PLC	295,435	1.51	446,697.72
PEARSON	66,305	9.14	606,160.31
SKY PLC	83,042	13.54	1,124,388.68
WPP PLC	98,371	12.70	1,249,803.55
KINGFISHER PLC	170,994	2.88	492,975.70
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.93	396,591.11
NEXT PLC	11,202	52.46	587,656.92
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.45	412,578.75
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.99	444,263.32



TESCO	786,019	2.41	1,900,593.94
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	27.41	790,641.45
BRITISH AMERICAN TOBACCO	183,352	39.09	7,167,229.68
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	24.66	345,215.34
DIAGEO	196,556	26.59	5,227,406.82
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	27.80	2,139,154.40
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	57.26	3,071,369.14
UNILEVER PLC	99,877	40.93	4,088,464.99
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.33	262,951.84
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	7.06	212,110.72
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	12.99	922,640.73
ASTRAZENECA	101,347	52.57	5,327,811.79
GLAXOSMITHKLINE	393,661	14.78	5,820,671.54
SHIRE PLC	72,022	39.78	2,865,035.16
BARCLAYS	1,365,547	2.10	2,880,621.39
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,602,916	7.19	11,532,980.62
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,748,978	0.66	3,825,369.96
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.76	815,941.76
STANDARD CHARTERED PLC	258,738	7.49	1,938,465.09
3I GROUP PLC	79,251	9.56	758,115.06
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	18.66	382,053.88
INVESTEC PLC	54,280	5.74	311,567.20
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,018	44.02	1,057,272.36
SCHRODERS PLC	8,614	34.17	294,340.38
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	11.75	525,812.50
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.69	816,423.03
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.12	327,050.60
AVIVA PIC	318,261	5.40	1,720,518.96
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.71	422,110.08
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.79	1,355,289.84
OLD MUTUAL PLC	397,509	2.55	1,013,647.95
PRUDENTIAL	206,892	19.34	4,002,325.74
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.35	549,862.45
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.70	296,037.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	12.58	440,752.88
SAGE GROUP PLC	89,321	6.62	591,483.66
BT GROUP PLC	663,615	2.38	1,583,385.39
VODAFONE GROUP PLC	2,124,853	2.08	4,434,568.21
CENTRICA PLC	440,558	1.55	684,847.41
NATIONAL GRID PLC	272,668	8.44	2,302,135.92
SEVERN TRENT PLC	18,112	20.11	364,232.32
SSE PLC	80,824	14.04	1,134,768.96

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.75	456,397.50
	イギリスbond 小計	24,553,295		154,693,802.79 (23,033,907,235)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	24.04	418,247.92
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	629.00	422,688.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,266.00	1,676,840.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	55.02	2,013,952.08
	SIKA AG-BR	175	7,505.00	1,313,375.00
	ABB LTD	149,127	23.92	3,567,117.84
	GEBERIT AG-REG	3,021	445.60	1,346,157.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	208.00	307,632.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	214.80	642,037.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	64.12	847,922.88
	SGS SA	437	2,506.00	1,095,122.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	156.55	620,720.75
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	96.38	3,999,288.10
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	476.10	1,182,156.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	88.40	348,119.20
	DUFREY AG-REG	2,548	147.00	374,556.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,842.00	294,720.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	74,200.00	593,600.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,340.00	475,500.00
	NESTLE SA - REGISTERED	248,716	77.40	19,250,618.40
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	165.90	686,826.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	686.00	534,394.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	263.20	1,515,242.40
	NOVARTIS	177,940	77.70	13,825,938.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,225	226.00	12,706,850.00
	VIFOR PHARMA AG	3,601	157.00	565,357.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	197,863	16.80	3,324,098.40
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	61.58	1,062,501.32
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	93.55	317,789.35
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,299	744.00	966,456.00
	UBS GROUP AG	296,570	16.21	4,808,882.55
	BALOISE HOLDING AG	3,877	155.70	603,648.90
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	357.90	879,002.40
	SWISS RE LTD	24,531	94.64	2,321,613.84
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	318.30	3,916,681.50
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	94.10	590,665.70
	SWISSCOM	2,064	458.90	947,169.60
	スイスフラン 小計	1,345,589		90,363,488.23 (9,880,343,803)

スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	264.60	3,754,938.60	
	BOLIDEN AB	20,141	318.20	6,408,866.20	
	ALFA LAVAL AB	25,639	229.20	5,876,458.80	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	191.05	15,340,359.75	
	ATLAS COPCO A	53,833	352.70	18,986,899.10	
	ATLAS COPCO B	29,972	318.20	9,537,090.40	
	SANDVIK AB	87,313	159.70	13,943,886.10	
	SKANSKA B	28,530	166.45	4,748,818.50	
	SKF AB-B	28,335	186.65	5,288,727.75	
	VOLVO B	123,214	157.90	19,455,490.60	
	SECURITAS B	22,844	141.40	3,230,141.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	231.80	4,211,806.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	86.50	3,348,588.00	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	145.24	10,742,240.88	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	273.80	1,568,874.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	412.60	6,250,477.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	233.50	11,341,328.50	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	87.38	1,384,536.10	
	NORDEA BANK AB	244,135	90.64	22,128,396.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	86.14	10,550,771.76	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	100.50	12,077,788.50	
	SWEDBANK AB-A	71,353	195.70	13,963,782.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	197.20	2,522,582.40	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	386.00	14,186,272.00	
KINNEVIK AB - B	18,104	320.30	5,798,711.20		
LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	605.50	2,204,020.00		
ERICSSON (LM) B	248,169	70.40	17,471,097.60		
HEXAGON AB-B SHS	21,504	479.70	10,315,468.80		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	563.00	3,487,222.00		
TELE2 AB-B SHS	33,266	113.95	3,790,660.70		
TELIA CO AB	235,437	43.80	10,312,140.60		
スウェーデンクローナ 小計		1,904,453		274,228,442.34 (3,460,762,942)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	92,696	214.60	19,892,561.60	
	NORSK HYDRO	106,150	48.64	5,163,136.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	341.60	4,601,352.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	211.00	1,470,881.00	
	MARINE HARVEST	32,238	175.50	5,657,769.00	
	ORKLA	69,804	74.12	5,173,872.48	
	DNB ASA	80,217	155.75	12,493,797.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	128.00	2,377,472.00	
	TELENOR ASA	60,821	174.50	10,613,264.50	

	ノルウェークローネ 小計	480,941		67,444,106.33 (917,914,287)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	578.20	4,279,258.20
	NOVOZYMES A/S	17,687	316.90	5,605,010.30
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	440.10	7,798,572.00
	ISS A/S	14,253	220.90	3,148,487.70
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	9,930.00	2,969,070.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	10,535.00	5,351,780.00
	DSV A/S	14,599	514.40	7,509,725.60
	PANDORA A/S	8,431	692.80	5,840,996.80
	CARLSBERG AS-B	8,236	713.20	5,873,915.20
	COLOPLAST-B	9,476	594.60	5,634,429.60
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	237.60	1,762,992.00
	GENMAB A/S	4,512	1,244.00	5,612,928.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	411.30	2,003,442.30
	NOVO NORDISK A/S-B	149,665	300.20	44,929,433.00
	DANSKE BANK A/S	59,378	215.20	12,778,145.60
TRYG A/S	9,828	146.50	1,439,802.00	
ORSTED A/S	15,908	400.80	6,375,926.40	
	デンマーククローネ 小計	350,192		128,913,914.70 (2,253,415,228)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	30.43	627,740.47
	OIL SEARCH LTD	118,781	8.09	960,938.29
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	9.94	1,333,967.88
	SANTOS	156,437	6.25	977,731.25
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	32.35	2,488,232.60
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.79	475,577.82
	AMCOR	88,486	13.97	1,236,149.42
	BHP BILLITON LTD	258,265	32.19	8,313,550.35
	BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	17.35	680,189.40
	BORAL LIMITED	81,732	6.50	531,258.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.83	650,485.08
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.55	534,626.45
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	23.46	876,535.98
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	21.92	1,340,605.28
	ORICA LTD	29,211	18.62	543,908.82
	RIO TINTO LTD	32,522	81.67	2,656,071.74
	SOUTH32 LTD	408,172	3.85	1,571,462.20
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	43.97	405,403.40
	BRAMBLES LTD	129,297	9.97	1,289,091.09
SEEK LTD	26,358	20.67	544,819.86	
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.42	704,932.54	

	TRANSURBAN GROUP	182,844	12.04	2,201,441.76	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	27.29	1,193,255.25	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	13.31	403,665.68	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	42.33	233,788.59	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	60.03	195,877.89	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.28	714,100.88	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.45	155,812.35	
	WESFARMERS LTD	89,270	44.12	3,938,592.40	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	28.56	2,936,567.76	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.34	430,854.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	19.63	1,145,901.25	
	COCHLEAR LIMITED	4,811	194.22	934,392.42	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.48	347,891.92	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	65.33	800,161.84	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	23.65	751,526.05	
	CSL LIMITED	36,265	173.24	6,282,548.60	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	27.95	6,564,644.45	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	10.19	362,764.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.82	459,135.88	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	71.41	10,017,609.03	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	214,180	28.72	6,151,249.60	
	WESTPAC BANKING	270,630	29.75	8,051,242.50	
	AMP LTD	244,230	4.08	996,458.40	
	ASX LTD	15,814	61.95	979,677.30	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	12.52	551,731.36	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,804	112.87	2,799,627.48	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	8.14	1,486,005.84	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.00	643,536.00	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	10.20	1,153,548.60	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.05	1,446,040.05	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	17.82	580,290.48	
	REA GROUP LTD	3,593	83.62	300,446.66	
	TELSTRA CORP	342,339	3.25	1,112,601.75	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.74	180,666.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	22.13	1,136,242.72	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.75	210,402.50	
	オーストラリアドル 小計	5,784,383		96,593,577.86 (7,924,537,127)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.45	494,353.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.60	560,670.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	12.80	582,502.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	10.99	399,123.83	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.49	507,617.01
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.24	200,040.84
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.98	329,973.84
	ニュージーランドドル 小計	561,153		3,074,281.72 (234,475,466)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	91.80	19,553,032.80
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	14.74	1,459,260.00
	MTR CORP	114,000	45.10	5,141,400.00
	MINTH GROUP LTD	46,000	37.90	1,743,400.00
	LI & FUNG	554,800	4.19	2,324,612.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	46.35	5,515,650.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	22.70	1,554,950.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	67.90	12,222,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	23.30	1,565,760.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	45.90	9,308,520.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	14.54	1,424,920.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.90	1,174,800.00
	WYNN MACAU LTD	102,800	29.90	3,073,720.00
	WH GROUP LTD	699,000	7.93	5,543,070.00
	BANK EAST ASIA	109,160	33.90	3,700,524.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	282,000	40.75	11,491,500.00
	HANG SENG BANK	61,100	196.50	12,006,150.00
	FIRST PACIFIC CO	128,000	3.90	499,200.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	257.00	23,515,500.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	248,000	3.95	979,600.00
	AIA GROUP LTD	968,600	69.70	67,511,420.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	199,996	67.15	13,429,731.40
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	24.15	1,956,150.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.56	3,210,880.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	103,495	49.80	5,154,051.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	44.40	2,619,600.00
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	38.00	2,451,000.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.28	5,544,120.00
	SINO LAND CO	235,400	13.20	3,107,280.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	124.90	14,613,300.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	77.25	3,128,625.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	28.80	2,770,560.00
	WHARF HOLDINGS	91,000	25.35	2,306,850.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	59.70	5,432,700.00
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	56.00	3,640,000.00
	PCCW LTD	357,000	4.91	1,752,870.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	62.30	3,115,000.00

	CLP HOLDINGS	133,500	81.85	10,926,975.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	670,830	16.62	11,149,194.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	59.20	6,571,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	102.60	2,431,620.00	
	香港ドル 小計	7,839,077		296,620,695.80 (4,155,655,948)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	8.20	920,860.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	3.09	330,630.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.48	379,320.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.19	237,881.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.34	389,610.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	11.11	481,429.63	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.57	285,184.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.16	493,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.71	344,441.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	33.88	335,412.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.36	150,840.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.25	373,100.00	
	DBS GROUP	145,600	28.76	4,187,456.00	
	OCBC BANK	245,300	13.14	3,223,242.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	29.28	3,039,264.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.72	480,956.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.62	677,302.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	12.52	390,624.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	8.58	407,550.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.54	2,268,938.22	
STARHUB LTD	38,000	2.22	84,360.00		
	シンガポールドル 小計	3,386,776		19,481,399.85 (1,589,097,785)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	339.30	1,028,757.60	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	16.33	1,106,455.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	411.60	600,936.00	
	BANK HAPOLIM BM	84,067	25.74	2,163,884.58	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	21.94	2,540,520.36	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	67.71	555,222.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	164.90	712,862.70	
	NICE LTD	4,894	355.90	1,741,774.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.25	657,693.92	
	イスラエルシェケル 小計	444,132		11,108,107.24 (340,907,811)	
	合 計	89,797,806		315,229,718,540 (315,229,718,540)	

## (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	163,150.50	
		アメリカドル 小計		472,900	163,150.50 (17,940,028)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	756,874.95	
		LENLEASE GROUP	44,009	796,562.90	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	655,978.00	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,209,415.85 (181,260,476)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,611,855.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,787,200.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,399,055.00 (61,630,760)	
	投資信託受益証券合計			1,184,840	260,831,264 (260,831,264)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	509,630.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,450	967,308.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,504	4,759,826.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	984,537.36	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,790,770.32	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,528,523.50	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	361,208.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	618,067.80	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	279,400.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,404,415.79	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,781,998.08	
		DUKE REALTY CORP	29,929	858,962.30	
		EQUINIX INC	6,083	2,361,238.11	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,796,660.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,238,280.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	951,776.52	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	715,099.69	
		GGP INC	48,203	978,520.90	
		HCP INC	36,011	859,942.68	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,223,986.68	
INVITATION HOMES INC	24,000	569,520.00			
IRON MOUNTAIN INC	20,489	684,742.38			
KIMCO REALTY CORP	35,407	512,339.29			



	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	514,138.78
	MACERICH CO/THE	10,128	582,157.44
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	806,230.00
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	442,012.20
	PROLOGIS INC	41,651	2,716,478.22
	PUBLIC STORAGE	12,201	2,580,999.54
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,146,803.17
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	687,202.05
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,488,632.04
	SIMON PROPERTY GROUP	24,417	3,905,254.98
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	814,040.97
	UDR INC	20,960	762,944.00
	VENTAS INC	27,813	1,478,260.95
	VEREIT INC	77,798	543,808.02
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	929,719.35
	WELLTOWER INC	29,615	1,640,078.70
	アメリカドル 小計	963,971	50,775,516.35 (5,583,275,777)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	195,718.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	363,240.50
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	161,609.70
	カナダドル 小計	30,576	720,568.70 (61,673,475)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	219,681.00
	GECINA SA	3,549	513,185.40
	ICADE	2,845	225,181.75
	KLEPIERRE	17,225	592,023.25
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,814	1,536,623.10
	ユーロ 小計	33,743	3,086,694.50 (401,980,224)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	543,827.07
	HAMMERSON PLC	61,184	338,347.52
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	574,726.80
	SEGRO PLC	81,695	527,913.09
	イギリスポンド 小計	280,843	1,984,814.48 (295,538,876)
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	726,082.00
	GOODMAN GROUP	140,271	1,287,687.78
	GPT GROUP	136,015	673,274.25
	MIRVAC GROUP	306,089	707,065.59
	SCENTRE GROUP	426,663	1,770,651.45
	STOCKLAND	207,412	885,649.24

	VICINITY CENTERS	291,115	745,254.40	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,478,799.56	
	オーストラリアドル 小計	1,743,096	8,274,464.27	(678,837,048)
香港ドル	LINK REIT	179,500	12,026,500.00	
	香港ドル 小計	179,500	12,026,500.00	(168,491,265)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	523,375.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	427,680.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	418,627.00	
	SUNTEC REIT	173,000	328,700.00	
	シンガポールドル 小計	813,800	1,698,382.00	(138,537,019)
	投資証券合計	4,045,529	7,328,333,684	(7,328,333,684)
	合計		7,589,164,948	(7,589,164,948)

(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	97.4%			64.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 39銘柄			2.6%	1.7%
カナダドル	株式 87銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.1%			13.2%
	投資証券 5銘柄			0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式 98銘柄	98.7%			7.1%
	投資証券 4銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	90.2%			2.5%

	投資信託受 3銘柄 益証券		2.1%		0.1%
	投資証券 8銘柄			7.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 41銘柄	94.8%			1.3%
	投資信託受 2銘柄 益証券		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.8%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	92.0%			0.5%
	投資証券 4銘柄			8.0%	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

	2018年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	837,765,944
コール・ローン	56,982,901
株式	49,731,989,596
投資信託受益証券	89,117,752
投資証券	238,740,409
派生商品評価勘定	248,142
未収入金	1,329,835
未収配当金	64,629,979
前払金	22,180,032
差入委託証拠金	126,524,728
流動資産合計	51,169,509,318
資産合計	51,169,509,318
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,299,049
未払解約金	30,597,715
未払利息	92
その他未払費用	593
流動負債合計	52,897,449
負債合計	52,897,449

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	17,117,018,689
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,999,593,180
元本等合計	51,116,611,869
純資産合計	51,116,611,869
負債純資産合計	51,169,509,318

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 5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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2018年 5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)

2018年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,117,018,689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 2.9863円 (1万口当たり純資産額) (29,863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

2018年 5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>

	2018年 5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

	2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	15,742,008,514円
期中追加設定元本額	2,119,116,155円
期中一部解約元本額	744,105,980円
期末元本額	17,117,018,689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	6,585,851,057円
世界経済インデックスファンド	2,873,040,861円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,544,020,045円
DC 世界経済インデックスファンド	2,307,253,691円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	89,586,141円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,790,386円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	301,258,587円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	365,348,002円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,143,453円
SMT インデックスバランス・オープン	131,153,157円
SMT 世界経済インデックス・オープン	7,064,233円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	143,039,286円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	16,130,624円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	349,518円
グローバル経済コア	484,902,594円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	8,087,054円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		142,873,968
投資信託受益証券		10,115,037
投資証券		31,190,930
合計		121,798,075

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2018年 5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	1,044,983,418	-	1,022,803,386	22,180,032
合計		1,044,983,418	-	1,022,803,386	22,180,032

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2018年 5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	30,008,454	-	30,136,544	128,090
	アメリカドル	30,008,454	-	30,136,544	128,090
	売建	453,354	-	452,319	1,035
	ブラジルリアル	453,354	-	452,319	1,035
合計		30,461,808	-	30,588,863	129,125

(注)時価の算定方法

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

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



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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	469,919	4.56	2,144,240.39	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	37,814	66.84	2,527,487.76	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,018	125.30	1,129,955.40	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	6.25	676,082.41	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	119,005	4.67	556,467.38	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	63.30	1,400,892.30	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.61	264,277.30	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49,894	17.00	848,198.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	24.59	381,366.31	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	14.20	264,404.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,736	31.00	146,816.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	15.54	393,939.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	51.61	278,797.22	
	DP WORLD LTD	21,152	22.00	465,344.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	11,374	91.99	1,046,294.26	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	29,537	40.00	1,181,480.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	37.67	1,254,637.02	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	31,722	43.39	1,376,417.58	
	JD.COM INC-ADR	54,669	37.14	2,030,406.66	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	15.36	556,631.04	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	19.35	599,250.15	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	5.19	485,721.72	
	CREDICORP LTD	5,824	226.50	1,319,136.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	217,842	14.70	3,202,277.40	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	264,285	1.82	483,112.98	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.43	65,091.60	
	58.COM INC-ADR	7,312	88.69	648,501.28	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	97,658	195.43	19,085,302.94	
	AUTOHOME INC-ADR	3,833	99.67	382,035.11	
	BAIDU INC - SPON ADR	23,402	261.29	6,114,708.58	
MOMO INC-SPON ADR	10,135	37.56	380,670.60		
NETEASE INC-ADR	7,048	259.95	1,832,127.60		

	SINA CORP	4,000	89.84	359,360.00
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	109.82	421,489.16
	YY INC-ADR	4,344	100.29	435,659.76
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.25	408,503.50
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.12	123,408.47
	アメリカドル 小計	2,089,322		55,270,490.88 (6,077,543,177)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	11.67	14,366,481.87
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	54.86	16,501,449.12
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	355.79	3,531,215.75
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	56.33	5,455,673.16
	ALFA S.A.B. -A	242,900	21.70	5,270,930.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	59.72	2,239,500.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	327.75	5,075,208.75
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	178.66	5,552,752.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	184.80	3,137,904.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	190,790	72.21	13,776,945.90
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	116.78	1,272,902.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	49.52	23,204,081.60
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	120.63	4,062,215.25
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	116.07	5,025,831.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	169.06	26,954,926.40
	GRUMA S.A.B. -B	14,210	215.64	3,064,244.40
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	39.59	5,241,716.00
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	21.53	770,774.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	214,100	32.37	6,930,417.00
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	27.20	4,615,840.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	219,300	112.22	24,609,846.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	284,600	29.84	8,492,464.00
	GENTERA SAB DE CV	77,100	14.44	1,113,324.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,721,740	16.78	45,670,797.20
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	82.72	3,118,544.00
	メキシコペソ 小計	6,795,910		239,055,984.20 (1,343,494,631)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	37.90	697,360.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	27.22	6,894,826.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	337,840	24.78	8,371,675.20
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	52.11	1,495,557.00
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	44.23	393,647.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	8.70	285,360.00
	FIBRIA CELULOSE SA	24,900	70.00	1,743,000.00
	GERDAU SA-PREF	87,000	17.36	1,510,320.00

SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	42.85	1,726,855.00
VALE SA	278,478	50.25	13,993,519.50
EMBRAER SA	69,700	23.08	1,608,676.00
WEG SA	66,872	16.94	1,132,811.68
CCR SA	101,100	11.67	1,179,837.00
LOCALIZA RENT A CAR	34,302	26.85	921,008.70
RUMO SA	97,700	14.70	1,436,190.00
KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	12.85	1,775,664.40
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	18.70	1,191,489.20
LOJAS RENNER S.A.	60,370	32.93	1,987,984.10
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	15.75	653,625.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	77.44	836,352.00
RAIA DROGASIL SA	17,000	63.20	1,074,400.00
AMBEV SA	406,600	21.91	8,908,606.00
BRF SA	38,800	24.36	945,168.00
JBS SA	111,900	8.46	946,674.00
M DIAS BRANCO SA	6,300	42.19	265,797.00
NATURA COSMETICOS SA	10,700	31.26	334,482.00
ODONTOPREV S.A.	12,400	14.30	177,320.00
QUALICORP SA	20,800	23.30	484,640.00
HYPERA SA	35,300	29.94	1,056,882.00
BANCO BRADESCO S.A.	104,769	30.62	3,208,026.78
BANCO BRADESCO SA-PREF	273,361	32.79	8,963,507.19
BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	37.35	2,580,885.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	271,721	47.55	12,920,333.55
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	336,425	12.33	4,148,120.25
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	24.06	4,150,422.18
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	27.05	1,522,915.00
PORTO SEGURO SA	7,300	48.25	352,225.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	10.30	587,748.90
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	61.70	339,350.00
CIELO SA	99,269	17.85	1,771,951.65
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	46.90	1,491,420.00
TIM PARTICIPACOES SA	72,900	14.87	1,084,023.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	21.74	384,798.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	18.65	233,125.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	7.79	514,077.68
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	32.72	853,992.00
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	13.01	346,066.00
ENGIE BRASIL SA	13,400	35.98	482,132.00
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	24,000	67.90	1,629,600.00
	4,198,965		111,594,445.96

ブラジルリアル 小計				(3,414,790,046)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	9,861.00	441,082,530.00
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	2,414.70	203,510,916.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	33,854.00	245,780,040.00
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	8,862.30	195,918,866.10
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	5,997.90	318,446,504.70
	CENCOSUD SA	137,988	1,756.20	242,334,525.60
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,505.80	79,299,573.40
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,918.80	44,400,785.60
	BANCO DE CHILE	2,284,160	100.40	229,329,664.00
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,504	45,724.00	114,492,896.00
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	51.50	323,410,781.50
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	6.49	108,735,520.75
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,859.20	127,251,878.40
	AES GENER SA	141,749	174.01	24,665,743.49
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	404.93	66,104,012.64
	COLBUN SA	475,888	145.00	69,003,760.00
ENEL AMERICAS SA	2,162,581	133.24	288,142,292.44	
ENEL CHILE SA	2,561,278	74.87	191,762,883.86	
チリペソ 小計		31,212,930		3,313,673,174.48 (575,253,663)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	3,160.00	1,129,153,320.00
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	9,480.00	303,464,280.00
	GRUPO ARGOS SA	17,723	19,020.00	337,091,460.00
	BANCOLOMBIA SA	13,742	34,160.00	469,426,720.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	34,220.00	1,309,873,160.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,225.00	372,042,300.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	37,940.00	552,102,880.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	35,700.00	448,427,700.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,820.00	698,062,020.00
コロンビアペソ 小計		840,413		5,619,643,840.00 (215,794,323)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	21.65	94,350.70
	OPAP SA	17,668	9.41	166,344.22
	FF GROUP	3,404	9.25	31,487.00
	JUMBO SA	8,599	15.18	130,532.82
	ALPHA BANK AE	94,467	2.19	206,882.73
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.97	145,477.01
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.30	121,662.07
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	3.27	60,825.27
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	11.50	233,369.50
		717,893		1,190,931.32

ユーロ 小計				(155,094,985)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	96.05	1,114,468.15
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	10.53	1,229,430.15
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	5.36	257,349.68
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	23.38	556,701.18
	KOC HOLDING AS	62,460	13.35	833,841.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.39	189,507.52
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	21.16	208,129.76
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	16.50	1,026,151.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	56.25	183,262.50
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	23.40	157,950.00
	ARCELIK AS	15,358	17.04	261,700.32
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	69.30	1,079,486.10
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	24.52	275,359.60
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	35.02	154,683.34
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	20.40	196,370.40
	AKBANK T.A.S.	176,098	8.35	1,470,418.30
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	9.11	2,186,327.12
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	7.51	393,756.81
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	5.98	664,790.62
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	5.76	299,191.68
YAPI VE KREDI BANKASI	109,792	4.01	440,265.92	
HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	9.88	607,086.48	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	5.77	102,682.92	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	13.13	1,248,610.48	
トルコリラ 小計		1,359,816		15,137,521.53 (388,126,052)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	887.50	6,623,412.50
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	75.90	2,027,820.30
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	283.00	1,273,500.00
	CEZ AS	13,737	554.00	7,610,298.00
チェココルナ 小計		52,417		17,535,030.80 (89,253,306)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	2,700.00	88,754,400.00
	RICHTER GEDEON NYRT	20,294	5,350.00	108,572,900.00
	OTP BANK NYRT	19,549	10,560.00	206,437,440.00
ハンガリーフォリント 小計		72,715		403,764,740.00 (166,674,084)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	57.50	317,170.00
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,189	86.50	2,611,348.50
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	6.25	915,606.25
	GRUPA AZOTY SA	2,786	52.95	147,518.70

	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	82.12	342,522.52	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	93.50	1,227,842.00	
	CCC SA	3,138	266.60	836,590.80	
	LPP SA	124	9,350.00	1,159,400.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	25.36	596,010.72	
	ALIOR BANK SA	8,830	68.30	603,089.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	82.00	164,820.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	8.46	279,323.82	
	BANK PEKAO SA	15,510	116.50	1,806,915.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	364.20	873,351.60	
	M BANK SA	747	446.00	333,162.00	
	PKO BANK POLSKI SA	81,052	42.05	3,408,236.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	40.29	2,052,815.79	
	CD PROJEKT SA	6,704	144.90	971,409.60	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.23	291,091.34	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	18,973	28.98	549,837.54	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.08	640,039.68	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	2.35	134,027.55	
	ポーランドズロチ 小計	625,434		20,262,129.01	(619,008,041)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	7.88	819,520.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,175,400	7.88	17,142,152.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	250,500	19.76	4,949,880.00	
	CNOOC LTD-R	1,538,000	13.52	20,793,760.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	6.78	1,749,240.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	5.95	10,436,300.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	10.40	1,164,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.39	1,492,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	48.85	5,373,500.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	5.49	1,844,640.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	8.82	2,910,600.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	11.12	922,960.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	9.11	1,512,260.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	12.80	1,292,800.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	5.14	1,022,860.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.51	2,558,790.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.87	603,880.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	39.80	1,552,200.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	8.66	2,701,920.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	24.40	3,891,800.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	9.10	996,450.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.23	1,869,000.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.59	1,630,300.00
CITIC LTD	502,000	11.86	5,953,720.00
CRRC CORP LTD-H	313,050	7.04	2,203,872.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	16.82	4,844,160.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	20.55	719,250.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.82	473,760.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	20.85	792,300.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	108,800	9.12	992,256.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	39,500	40.90	1,615,550.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	281,000	11.26	3,164,060.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	10.06	1,187,080.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	11.10	1,198,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	17.36	1,693,415.92
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	8.30	1,460,800.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.90	703,800.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.52	783,360.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.62	670,560.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	14.24	3,560,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	52.10	2,578,950.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	8.48	2,255,680.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	28.60	777,920.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	22.85	8,911,500.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	7.94	1,617,775.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	180,246	13.66	2,462,160.36
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	11.34	1,043,280.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	47.75	5,300,250.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	26.50	3,074,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	88.05	6,163,500.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	0.92	717,600.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.84	498,924.72
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	9.07	1,768,650.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	277,000	27.45	7,603,650.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	35.15	4,991,300.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	15.72	1,917,840.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	47.30	946,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	7.08	2,329,320.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	69.00	4,588,500.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	224,000	4.30	963,200.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	5.41	584,280.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	22.00	2,824,800.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	33.55	3,341,580.00

3SBIO INC	84,500	18.80	1,588,600.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	18.26	1,826,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	21.40	8,132,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	10.66	1,678,950.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	45.75	2,539,125.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.97	632,370.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	352,000	18.66	6,568,320.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,245,000	4.37	9,810,650.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,588,200	4.16	27,406,912.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	6.28	5,950,143.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	5.70	5,421,840.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,069,620	8.09	57,193,225.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.92	874,160.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	357,423	33.80	12,080,897.40
CHINA MINSHENG BANKING-H	459,500	7.40	3,400,300.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	5.43	754,770.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,302,515	6.77	42,668,026.55
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	2.79	2,321,280.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	16.68	1,034,160.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	5.03	1,652,355.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	2.78	2,577,060.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	19.06	3,792,940.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	8.05	1,135,050.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	13.58	1,434,048.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	10.52	2,911,936.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	15.74	1,658,996.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	667,000	22.55	15,040,850.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	205,200	36.65	7,520,580.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	27.95	3,963,980.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	38.25	2,562,750.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.68	2,546,560.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	408,859	14.42	5,895,746.78
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	76.95	34,358,175.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	15.76	2,237,920.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	25.00	5,950,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.66	2,693,480.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	26.80	8,764,672.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	219,111	29.40	6,441,863.40
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	30.85	3,726,680.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	6.27	1,730,520.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	421,285	16.16	6,807,965.60
FULLSHARE HOLDINGS LTD	460,000	3.72	1,711,200.00



	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	18.70	1,286,560.00	
	LONGFOR PROPERTIES	123,500	24.15	2,982,525.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	148,500	21.30	3,163,050.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	5.49	1,029,874.59	
	SOHO CHINA LTD	113,000	3.95	446,350.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	227,000	35.30	8,013,100.00	
	KINGSOFT CORP LTD	66,000	24.95	1,646,700.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	482,500	394.60	190,394,500.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	24.25	1,285,250.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	117.50	7,050,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	11.96	1,016,600.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	45,000	29.90	1,345,500.00	
	LENOVO GROUP LTD	578,000	3.71	2,144,380.00	
	MEITU INC	143,000	8.33	1,191,190.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	57,000	142.00	8,094,000.00	
	ZTE CORP-H	48,508	25.60	1,241,804.80	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	5.09	661,700.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	528,000	73.55	38,834,400.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.78	4,158,000.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	442,000	10.74	4,747,080.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.48	1,827,840.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.13	2,858,460.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	29.05	3,950,800.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	7.04	1,781,120.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	28.25	2,429,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	14.94	2,620,476.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	75.75	4,242,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	12.52	2,779,440.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	5.17	1,333,860.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	3.28	1,003,680.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	0.94	972,900.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	10.18	2,697,700.00	
	香港ドル 小計	62,607,102		817,035,414.72 (11,446,666,160)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	3.06	682,282.08	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	26.40	662,640.00	
	SAPURA ENERGY BHD	282,600	0.67	189,342.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.42	1,769,042.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.81	694,083.00	
	GAMUDA BHD	139,200	5.10	709,920.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.70	370,540.00	

	IJM CORP BHD	198,100	2.65	524,965.00
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.69	449,891.74
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	3.70	239,760.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.85	474,306.90
	MISC BHD	125,040	7.06	882,782.40
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.26	228,200.00
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	6.20	210,800.00
	GENTING BHD	205,300	8.60	1,765,580.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.03	1,127,223.00
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	1.83	216,855.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	22.70	247,430.00
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.61	129,283.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.86	138,040.00
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.67	838,918.80
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	25.38	1,390,824.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	8,100	137.00	1,109,700.00
	PPB GROUP BERHAD	43,900	19.16	841,124.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.44	909,818.24
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	72,000	5.86	421,920.00
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.05	1,387,265.00
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	4.12	290,872.00
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.72	484,344.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	421,219	6.90	2,906,411.10
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	18.62	1,141,257.04
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	18.98	283,428.34
	MALAYAN BANKING BHD	348,360	10.70	3,727,452.00
	PUBLIC BANK BERHAD	228,020	23.88	5,445,117.60
	RHB BANK BHD	53,119	5.27	279,937.13
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.52	233,814.00
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.41	235,816.86
	SP SETIA BHD	236,947	3.11	736,905.17
	AXIATA GROUP BERHAD	324,274	5.29	1,715,409.46
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.60	1,433,820.00
	MAXIS BHD	135,500	5.51	746,605.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.00	352,760.00
	PETRONAS GAS BHD	85,700	17.76	1,522,032.00
	TENAGA NATIONAL BHD	312,575	16.06	5,019,954.50
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.33	335,645.45
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	124,771	0.91	114,165.46
	マレーシアリングット 小計	6,686,532		45,618,283.27 (1,270,013,006)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	19.60	2,322,600.00

ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	35.50	2,438,850.00	
IRPC PCL - NVDR	572,800	6.75	3,866,400.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	134.50	16,772,150.00	
PTT PCL-NVDR	789,000	56.25	44,381,250.00	
THAI OIL PCL-NVDR	120,100	94.00	11,289,400.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	60.25	6,139,475.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	94.50	21,256,263.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	468.00	6,318,000.00	
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	466.00	8,714,200.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	70.25	30,074,025.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	7.75	3,031,800.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.20	3,381,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	38.75	6,270,137.50	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	13.90	3,219,726.50	
ROBINSON PCL-NVDR	34,800	63.50	2,209,800.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	59.00	4,000,200.00	
CP ALL PCL-NVDR	372,000	87.00	32,364,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	23.80	8,108,660.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.70	4,488,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	22.40	10,207,680.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	186.00	4,761,600.00	
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	196.00	3,175,200.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	195.50	24,711,200.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	190.50	9,829,800.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	17.00	4,203,250.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	133.00	19,684,000.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.36	3,154,140.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	78.00	10,303,800.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	65.25	2,107,575.00	
KCE ELECTRONICS - NVDR	24,700	70.50	1,741,350.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	195.00	20,650,500.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	7.55	4,588,202.95	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	232.00	5,382,400.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	81.50	2,412,400.00	
タイパーツ 小計	8,151,138		347,559,034.95 (1,188,651,899)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	291,840	59.70	17,422,848.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	13.08	7,725,048.00	
DMCI HOLDINGS INC	345,450	10.14	3,502,863.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	59.05	13,602,758.00	
SM INVESTMENTS CORP	22,805	920.00	20,980,600.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	81.00	5,122,440.00	

	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	283.00	7,202,350.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	141.30	8,955,594.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	96.00	5,745,120.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	126.10	21,906,218.10	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	51,502	81.50	4,197,413.00	
	SECURITY BANK CORP	30,810	189.50	5,838,495.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	941.00	21,050,170.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	997.00	6,116,595.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.40	3,972,780.00	
	AYALA LAND INC	637,000	39.95	25,448,150.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.29	2,737,020.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	18.00	1,674,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	34.30	30,442,965.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,750.00	3,132,500.00	
	PLDT INC	6,225	1,342.00	8,353,950.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	38.25	3,423,375.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	328.00	9,548,080.00	
	フィリピンベソ 小計	5,095,383		238,101,332.10 (504,774,824)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,700.00	1,360,850,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	33,075.00	4,263,367,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	17,725.00	3,367,750,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	8,950.00	2,099,670,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	4,550.00	637,910,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	1,970.00	773,028,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	4,100.00	506,350,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	7,100.00	12,220,520,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	2,440.00	1,300,520,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	8,700.00	1,613,850,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,310.00	1,430,251,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	70,000.00	2,156,000,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,600.00	3,304,440,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,475.00	1,364,475,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,375.00	2,735,512,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	49,450.00	5,864,770,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,435.00	1,798,629,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	22,900.00	19,034,480,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	6,250.00	1,228,125,000.00	
	BANK MANDIRI	1,424,996	7,175.00	10,224,346,300.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,050.00	6,522,110,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	2,860.00	2,558,556,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	3,210.00	15,684,381,000.00	

	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,520.00	1,038,768,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	545.00	877,668,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,851,900	3,700.00	17,952,030,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	5,125.00	683,675,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	1,890.00	326,025,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	1,930.00	1,527,595,000.00	
	インドネシアルピア 小計	25,079,396		124,455,652,300.00 (970,754,087)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	61,600.00	260,383,200.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	106,000.00	360,506,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	202,000.00	1,060,904,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	27,500.00	294,415,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	132,500.00	186,692,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	62,700.00	454,073,400.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	429,000.00	335,907,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	108,500.00	114,033,500.00	
	LG CHEM LTD	3,844	339,500.00	1,305,038,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	195,500.00	93,644,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	389,000.00	431,790,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	149,000.00	167,923,000.00	
	POSCO	6,275	350,500.00	2,199,387,500.00	
	CJ CORP	1,230	162,500.00	199,875,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	82,300.00	326,237,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	6,330.00	52,349,100.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	32,050.00	138,071,400.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	18,500.00	61,827,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	41,100.00	139,657,800.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	2,160	29,050.00	62,748,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	39,350.00	111,163,750.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	46,400.00	175,252,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	62,400.00	398,112,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	124,500.00	413,091,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	408,500.00	330,885,000.00	
	KCC CORP	1,024	373,000.00	381,952,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	44,300.00	229,296,800.00	
	LG CORP	7,072	77,600.00	548,787,200.00	
	LOTTE CORP	2,370	60,300.00	142,911,000.00	
	POSCO DAEWOO CORP	1,560	22,050.00	34,398,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,354	129,000.00	819,666,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,710.00	286,434,210.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,769	295,500.00	818,239,500.00	
	SK NETWORKS CO LTD	26,186	5,060.00	132,501,160.00	

KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	40,300.00	37,922,300.00
S-1 CORPORATION	960	94,200.00	90,432,000.00
CJ LOGISTICS	324	154,000.00	49,896,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	158,500.00	230,617,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,378	33,450.00	79,544,100.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,130.00	152,545,680.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	47,700.00	337,048,200.00
HANON SYSTEMS	10,825	10,800.00	116,910,000.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	235,000.00	1,310,595,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,724	153,500.00	2,106,634,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	103,500.00	299,322,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	94,300.00	283,182,900.00
HYUNDAI WIA CORP	1,737	53,700.00	93,276,900.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	33,550.00	692,035,850.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	91,400.00	363,954,800.00
HANSSEM CO LTD	615	109,500.00	67,342,500.00
LG ELECTRONICS INC	8,015	95,300.00	763,829,500.00
KANGWON LAND INC	8,683	28,650.00	248,767,950.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	18,450.00	93,541,500.00
CJ E&M CORP	2,024	89,400.00	180,945,600.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	121,000.00	260,392,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	102,000.00	124,644,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	233,500.00	241,439,000.00
SHINSEGAE CO LTD	417	394,500.00	164,506,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	200,500.00	110,074,500.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	27,500.00	41,827,500.00
EMART	1,661	257,000.00	426,877,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	40,650.00	53,292,150.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	342,000.00	172,026,000.00
KT&G CORP	10,696	96,100.00	1,027,885,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	131,500.00	262,079,500.00
OTTOGI CORPORATION	68	746,000.00	50,728,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,180	350,500.00	1,114,590,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	176,000.00	124,960,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,331,000.00	998,250,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	742,000.00	100,170,000.00
PACIFIC CORP	2,115	139,000.00	293,985,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,499	88,100.00	220,161,900.00
CELLTRION INC	6,864	259,000.00	1,777,776,000.00
HANMI PHARM CO LTD	372	469,500.00	174,654,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	616	76,900.00	47,370,400.00
MEDY-TOX INC	317	658,000.00	208,586,000.00

	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	398,000.00	622,074,000.00	
	SILLAJEN INC	4,157	69,900.00	290,574,300.00	
	YUHAN CORPORATION	600	231,500.00	138,900,000.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	10,100.00	234,481,600.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	11,300.00	138,718,800.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	26,441	45,500.00	1,203,065,500.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	16,750.00	302,270,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	34,088	58,200.00	1,983,921,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	38,734	46,700.00	1,808,877,800.00	
	WOORI BANK	48,474	15,550.00	753,770,700.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	5,213	87,300.00	455,094,900.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	9,470.00	294,441,240.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	15,350.00	173,424,300.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	39,550.00	75,105,450.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	36,100.00	208,513,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	61,300.00	258,011,700.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	5,950.00	72,709,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	37,500.00	161,925,000.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,975	42,850.00	170,328,750.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	272,000.00	687,072,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	112,000.00	593,600,000.00	
	KAKAO CORP	3,347	113,000.00	378,211,000.00	
	NAVER CORP	2,391	727,000.00	1,738,257,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,650	358,500.00	591,525,000.00	
	NETMARBLE CORP	3,203	135,000.00	432,405,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	218,500.00	681,938,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	18,774	22,500.00	422,415,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	857	129,500.00	110,981,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	121,500.00	554,769,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	411,500	50,900.00	20,945,350,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	71,650	40,550.00	2,905,407,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	191,000.00	902,284,000.00	
	KT CORP	3,800	27,500.00	104,500,000.00	
	SK TELECOM	1,647	226,000.00	372,222,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,680	35,700.00	952,476,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	53,700.00	76,898,400.00	
	SK HYNIX INC	49,668	83,400.00	4,142,311,200.00	
	韓国ウォン 小計	1,255,100		74,601,604,690.00 (7,616,823,838)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	120.50	13,163,420.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	32.40	9,628,502.40	
	CHINA STEEL	1,120,261	23.45	26,270,120.45	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	247,061	110.00	27,176,710.00
FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	105.50	41,020,932.00
NAN YA PLASTICS CORP	370,752	83.00	30,772,416.00
TAIWAN CEMENT	297,929	40.60	12,095,917.40
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	503.00	6,036,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	432,028	28.30	12,226,392.40
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,019	447.50	5,826,002.50
TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	24.05	2,669,550.00
CHINA AIRLINES LTD	130,203	10.35	1,347,601.05
EVA AIRWAYS CORP	143,931	15.20	2,187,751.20
EVERGREEN MARINE	119,812	15.00	1,797,180.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	22.40	3,964,800.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	46.00	8,144,806.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	370.00	4,416,690.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	134.00	4,410,744.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	33.25	1,330,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	148.00	3,768,672.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	260.00	1,820,000.00
POU CHEN	153,780	37.50	5,766,750.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	58.20	2,144,495.40
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	290.50	7,553,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	289.50	13,184,988.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	65.00	2,324,140.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	68.90	25,795,815.50
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	316.00	4,108,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	17.00	6,738,290.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	11.15	14,013,097.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	21.45	29,541,733.65
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	673,363	20.70	13,938,614.10
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	716,984	20.30	14,554,775.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	816,242	17.75	14,488,295.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	26.15	23,596,164.85
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,134,205	10.50	11,909,152.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	14.50	13,122,340.50
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	9.05	1,737,247.05
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	17.25	12,513,874.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,429	109.50	15,048,475.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	50.70	27,939,857.40
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	14.30	11,041,787.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	53.60	39,232,573.60
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	153,922	31.30	4,817,758.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	12.25	7,543,194.75



HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	45.05	1,897,506.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	35.45	1,975,770.30
ACER INC	255,803	23.70	6,062,531.10
ADVANTECH CO LTD	56,402	205.00	11,562,410.00
ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	276.50	15,232,938.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	12.60	7,435,134.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,700	338.00	17,136,600.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,649	72.30	2,071,322.70
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	11.60	8,990,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.35	8,354,556.00
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	113.00	21,120,039.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	76.40	7,093,740.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	175.00	2,450,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,365,311	81.80	111,682,439.80
HTC CORPORATION	37,430	56.40	2,111,052.00
INVENTEC CO LTD	136,511	22.75	3,105,625.25
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	4,000.00	32,160,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	38.15	5,739,743.80
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	99,000	100.00	9,900,000.00
PEGATRON CORP	159,474	68.90	10,987,758.60
QUANTA COMPUTER INC	196,270	52.40	10,284,548.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	43.20	3,373,920.00
WISTRON CORP	235,771	23.70	5,587,772.70
WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	41.30	6,450,523.10
YAGEO CORPORATION	19,000	769.00	14,611,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	65.00	1,424,930.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	8.60	1,702,800.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	110.00	39,304,650.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	75.00	11,775,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	108.50	16,513,700.00
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	259,315	77.20	20,019,118.00
GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	500.00	9,000,000.00
MACRONIX INTERNATIONAL	127,000	42.00	5,334,000.00
MEDIATEK INC	133,804	328.00	43,887,712.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	121,000	94.40	11,422,400.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	133.50	5,346,007.50
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	262.50	3,044,737.50
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	88.00	4,203,760.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	111.50	3,115,756.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,077,389	229.50	476,760,775.50
UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	16.20	15,827,400.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	61.80	3,337,200.00

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	243.00	5,346,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	18.10	3,692,400.00
	新台湾ドル 小計	27,292,108		1,551,163,905.75 (5,692,771,534)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	385.45	25,485,954.00
	COAL INDIA LTD	41,924	267.35	11,208,381.40
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	305.25	18,139,481.25
	INDIAN OIL CORP LTD	117,608	167.20	19,664,057.60
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	182.85	18,799,539.90
	PETRONET LNG LTD	49,423	217.45	10,747,031.35
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	237,229	976.70	231,701,564.30
	ACC LTD	1,768	1,509.65	2,669,061.20
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	224.65	8,353,610.25
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,222.55	30,514,848.00
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,094.95	29,938,122.90
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	238.15	18,818,851.15
	JSW STEEL LTD	80,284	321.75	25,831,377.00
	SHREE CEMENT LTD	901	16,352.90	14,733,962.90
	TATA STEEL LTD	25,839	603.15	15,584,792.85
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	3,966.25	29,167,802.50
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	731.30	19,173,223.40
	VEDANTA LTD	110,508	283.15	31,290,340.20
	ASHOK LEYLAND LIMITED	186,170	162.10	30,178,157.00
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	83.60	4,263,182.00
	EICHER MOTORS LTD	939	30,315.65	28,466,395.35
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	553.90	13,003,356.40
	LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,375.65	48,772,295.10
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,043.80	5,592,680.40
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	413.35	25,845,122.10
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,337	1,380.30	4,606,061.10
	BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,872.00	27,183,480.00
	BHARAT FORGE LTD	13,392	728.95	9,762,098.40
	BOSCH LTD	431	18,923.80	8,156,157.80
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,654.40	11,873,145.60
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	860.10	54,141,574.80
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	8,718.35	82,815,606.65
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	336.20	17,221,845.00	
TATA MOTORS LTD	147,050	341.95	50,283,747.50	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	34,784	197.45	6,868,100.80	
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	985.70	27,421,188.30	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	591.45	29,162,625.15	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,739	5,401.50	14,794,708.50	

ITC LTD	272,605	282.30	76,956,391.50
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	9,120.75	21,844,196.25
UNITED SPIRITS LTD	3,561	3,297.75	11,743,287.75
DABUR INDIA LTD	58,111	368.55	21,416,809.05
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	1,090.25	20,304,816.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,496.00	89,296,240.00
MARICO LTD	42,465	315.30	13,389,214.50
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	609.30	12,390,724.80
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	400.35	4,206,077.10
CIPLA LTD	31,308	588.00	18,409,104.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,064.35	16,103,994.35
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	526.25	8,438,945.00
LUPIN LTD	16,340	762.15	12,453,531.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,510.35	16,821,855.35
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	506.15	41,985,142.50
AXIS BANK LTD	141,543	548.50	77,636,335.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	129,894	1,897.65	246,493,349.10
ICICI BANK LTD	190,983	306.80	58,593,584.40
IDFC BANK LTD	75,550	45.40	3,429,970.00
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,236.25	33,277,377.50
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	507.20	14,186,891.20
STATE BANK OF INDIA	132,502	248.00	32,860,496.00
YES BANK LTD	172,833	347.85	60,119,959.05
BAJAJ FINANCE LTD	19,125	1,849.10	35,364,037.50
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	500.80	8,121,974.40
POWER FINANCE CORPORATION	37,247	84.90	3,162,270.30
RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	122.60	5,905,396.80
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,534.45	18,623,619.65
BAJAJ FINSERV LTD	2,289	5,349.50	12,245,005.50
HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	927.50	42,515,672.50
INFOSYS LTD	148,301	1,170.70	173,615,980.70
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	40,974	3,489.30	142,970,578.20
TECH MAHINDRA LTD	52,680	654.10	34,457,988.00
VAKRANGEE LTD	36,538	73.60	2,689,196.80
WIPRO LTD	89,034	270.25	24,061,438.50
BHARTI AIRTEL LTD	124,727	402.45	50,196,381.15
BHARTI INFRATEL LTD	68,125	324.85	22,130,406.25
IDEA CELLULAR LTD	142,255	60.65	8,627,765.75
GAIL INDIA LTD	53,170	341.90	18,178,823.00
NTPC LTD	145,475	170.40	24,788,940.00
TATA POWER CO LTD	93,250	83.35	7,772,387.50
	4,599,261		2,610,019,684.50

インドルピー 小計				(4,306,532,479)
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	14.81	336,779.40
	INDUSTRIES QATAR	15,948	112.00	1,786,176.00
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	35.80	730,284.20
	DOHA BANK QSC	12,309	27.15	334,189.35
	MASRAF AL RAYAN	26,948	34.33	925,124.84
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	103.51	609,363.37
	QATAR NATIONAL BANK	17,714	145.51	2,577,564.14
	QATAR INSURANCE CO	10,545	33.71	355,471.95
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	33.20	127,023.20
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	9.08	440,824.92
	OORED00 QSC	7,280	71.26	518,772.80
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	194.50	309,449.50
カタールリアル 小計		193,736		9,051,023.67 (273,883,976)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	113.83	2,235,393.54
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	357.88	1,142,352.96
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	113.14	5,476,202.28
	GOLD FIELDS LTD	64,581	48.50	3,132,178.50
	KUMBA IRON ORE LTD	1,758	276.09	485,366.22
	MONDI LTD	9,893	340.00	3,363,620.00
	SAPPI LIMITED	49,985	83.40	4,168,749.00
	SASOL LTD	50,217	446.27	22,410,340.59
	SIBANYE-STILLWATER	167,414	9.31	1,558,624.34
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	236.99	6,565,096.98
	NASPERS LTD-N SHS	37,399	3,076.05	115,041,193.95
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	224.00	2,786,560.00
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	263.10	5,603,766.90
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	205.65	4,942,180.80
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	99.49	4,712,542.83
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	61.80	5,171,671.20
	BID CORP LTD	26,440	283.54	7,496,797.60
	PICK N PAY STORES LTD	52,108	78.58	4,094,646.64
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	243.17	8,380,367.71
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	200.78	2,933,998.14
	PIONEER FOODS LTD	8,805	112.06	986,688.30
	TIGER BRANDS LTD	13,023	369.28	4,809,133.44
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	79,877	28.59	2,283,683.43	
NETCARE LTD	60,221	30.07	1,810,845.47	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	263.06	7,924,682.50	
BARCLAYS AFRICA GROUP	61,049	177.42	10,831,313.58	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	860.21	2,771,596.62	

	NEDBANK GROUP LTD	14,966	300.19	4,492,643.54	
	STANDARD BANK GROUP LTD	112,744	212.20	23,924,276.80	
	BRAIT SE	20,371	38.00	774,098.00	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	69.84	705,663.36	
	FIRSTSTRAND LTD	284,395	64.96	18,474,299.20	
	INVESTEC LTD	28,883	96.45	2,785,765.35	
	PSG GROUP LTD	18,494	220.19	4,072,193.86	
	REMGRO LTD	46,153	219.67	10,138,429.51	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	76.00	5,654,248.00	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	168.47	5,895,776.12	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	129.65	807,200.90	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	21.22	1,444,615.16	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	39.66	1,602,581.28	
	SANLAM LTD	113,378	77.45	8,781,126.10	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	133.59	4,129,801.26	
	MTN GROUP LTD	132,522	124.22	16,461,882.84	
	TELKOM SA LTD	11,353	56.66	643,260.98	
	VODACOM GROUP	42,279	155.80	6,587,068.20	
	南アフリカランド 小計	2,143,611		360,494,523.98 (3,154,327,084)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	296,657	1.80	533,982.60	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	234,432	0.38	89,084.16	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	6.72	1,240,108.80	
	DUBAI ISLAMIC BANK	96,441	5.54	534,283.14	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	11.60	1,247,382.80	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.03	551,108.46	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	2.26	409,532.34	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.05	368,268.15	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	5.04	1,515,134.88	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	16.45	2,265,576.25	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,990,284		8,754,461.58 (261,758,401)	
	合 計	193,059,466		49,731,989,596 (49,731,989,596)	

## (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	999,320.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,160,957.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	340,017.86	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20,500	412,050.00	

		ブラジルリアル 小計	120,162	2,912,344.86 (89,117,752)	
		投資信託受益証券合計	120,162	89,117,752 (89,117,752)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,666,040.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	8,666,040.00 (48,703,144)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	336,362.40	
		トルコリラ 小計	135,630	336,362.40 (8,624,331)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	813,079.20	
		FORTRESS REIT LTD-B	95,040	1,501,632.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	8,243,613.18	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,452,761.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	6,367,585.70	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	1,354,235.74	
	南アフリカランド 小計	1,033,671	20,732,906.82 (181,412,934)		
	投資証券合計	1,477,701	238,740,409 (238,740,409)		
	合計		327,858,161 (327,858,161)		

(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 37銘柄	100.0%			12.1%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.5%			2.7%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	97.5%			6.8%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.5%		0.2%
チリペソ	株式 18銘柄	100.0%			1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.8%			0.8%

	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%			1.2%
香港ドル	株式	139銘柄	100.0%			22.9%
マレーシアリングギット	株式	46銘柄	100.0%			2.5%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%			2.4%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.0%
インドネシアルピア	株式	29銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式	113銘柄	100.0%			15.2%
新台湾ドル	株式	89銘柄	100.0%			11.4%
インドルピー	株式	79銘柄	100.0%			8.6%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.5%
南アフリカランド	株式	45銘柄	94.6%			6.3%
	投資証券	6銘柄			5.4%	0.4%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	10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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2018年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,102,678,535
国債証券	309,869,467,400
地方債証券	20,906,416,254
特殊債券	26,176,807,582
社債券	15,203,481,900
未収入金	38,704
未収利息	762,057,679
前払費用	21,696,906
差入委託証拠金	60,000
流動資産合計	374,042,704,960

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	374,042,704,960
負債の部	
流動負債	
未払金	399,624,948
未払解約金	228,937,385
未払利息	1,784
その他未払費用	31,537
流動負債合計	628,595,654
負債合計	628,595,654
純資産の部	
元本等	
元本	268,346,768,030
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	105,067,341,276
元本等合計	373,414,109,306
純資産合計	373,414,109,306
負債純資産合計	374,042,704,960

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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)

	2018年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	268,346,768,030口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 103,470,000円</p>



		2018年 5月10日現在
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3915円 (13,915円)

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

### (金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

		2018年 5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に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

#### 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2018年 5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。	

	2018年 5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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	241,201,108,612円
期中追加設定元本額	35,071,354,154円
期中一部解約元本額	7,925,694,736円
期末元本額	268,346,768,030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）	3,261,229,065円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,168,336円
S M T 国内債券インデックス・オープン	11,941,788,313円
世界経済インデックスファンド	1,501,062,314円
D C マイセレクション 2 5	19,029,534,879円
D C マイセレクション 5 0	21,636,149,918円
D C マイセレクション 7 5	5,996,990,050円
D C 日本債券インデックス・オープン	446,989,423円
D C 日本債券インデックス・オープン S	75,145,244,111円
D C 日本債券インデックス・オープン P	34,352,806,396円
D C マイセレクション S 2 5	7,351,628,999円

区分	2018年 5月10日現在
DCマイセレクションS50	8,418,377,254円
DCマイセレクションS75	1,689,654,020円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,256,685,757円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,111,415,798円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	352,848,445円
DC世界経済インデックスファンド	1,137,394,660円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	102,424,601円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	8,704,364円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	100,126,197円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	18,021,345円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	951,991円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	326,310,315円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	459,350,513円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	82,689,843円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	206,947,201円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	5,544,791,805円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,160,323,462円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,420,663,758円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	907,680,013円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	187,650,741円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,542,348,521円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	960,856,864円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,689,192,678円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,195,625,992円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	181,485,371円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,805,764,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,654,231,487円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	47,615,881円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	571,018,480円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	67,312,248円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,205,649円
SMT インデックスバランス・オープン	79,689,304円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,574,216円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	15,500,271円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	16,051,952円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	699,301円
グローバル経済コア	255,771,374円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,888,491円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	67,485円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	35,048,036,948円

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5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		258,781,800
地方債証券		79,092,620
特殊債券		105,131,229
社債券		33,242,360
合計		476,248,009

(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377回利付国債(2年)	2,650,000,000	2,656,969,500	
	第378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,684,754,400	
	第379回利付国債(2年)	2,200,000,000	2,206,666,000	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,785,767,200	
	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	2,588,849,400	
	第382回利付国債(2年)	310,000,000	311,128,400	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,304,992,000	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,726,948,800	
	第385回利付国債(2年)	420,000,000	421,785,000	
	第386回利付国債(2年)	1,590,000,000	1,597,043,700	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,717,934,400	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,523,232,700	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,002,660,000	
	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,571,673,600	
	第121回利付国債(5年)	700,000,000	702,240,000	

第 1 2 2 回利付国債（ 5 年）	3,520,000,000	3,533,059,200	
第 1 2 3 回利付国債（ 5 年）	3,140,000,000	3,153,125,200	
第 1 2 4 回利付国債（ 5 年）	1,950,000,000	1,959,262,500	
第 1 2 5 回利付国債（ 5 年）	3,610,000,000	3,629,205,200	
第 1 2 6 回利付国債（ 5 年）	2,960,000,000	2,977,434,400	
第 1 2 7 回利付国債（ 5 年）	4,390,000,000	4,418,315,500	
第 1 2 8 回利付国債（ 5 年）	1,610,000,000	1,621,044,600	
第 1 2 9 回利付国債（ 5 年）	3,200,000,000	3,223,744,000	
第 1 3 0 回利付国債（ 5 年）	1,360,000,000	1,370,594,400	
第 1 3 1 回利付国債（ 5 年）	5,540,000,000	5,585,040,200	
第 1 3 2 回利付国債（ 5 年）	3,610,000,000	3,640,540,600	
第 1 3 3 回利付国債（ 5 年）	4,740,000,000	4,782,565,200	
第 1 3 4 回利付国債（ 5 年）	3,170,000,000	3,200,083,300	
第 1 3 5 回利付国債（ 5 年）	3,370,000,000	3,403,700,000	
第 1 回利付国債（ 4 0 年）	400,000,000	577,196,000	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	420,000,000	586,567,800	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	520,000,000	729,830,400	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	700,000,000	987,077,000	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	750,000,000	1,016,857,500	
第 6 回利付国債（ 4 0 年）	390,000,000	518,228,100	
第 7 回利付国債（ 4 0 年）	690,000,000	875,230,500	
第 8 回利付国債（ 4 0 年）	750,000,000	881,850,000	
第 9 回利付国債（ 4 0 年）	970,000,000	827,206,300	
第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	1,820,000,000	1,835,852,200	
第 3 0 1 回利付国債（ 1 0 年）	340,000,000	346,194,800	
第 3 0 2 回利付国債（ 1 0 年）	200,000,000	203,422,000	
第 3 0 3 回利付国債（ 1 0 年）	1,390,000,000	1,419,190,000	
第 3 0 4 回利付国債（ 1 0 年）	480,000,000	489,427,200	
第 3 0 5 回利付国債（ 1 0 年）	1,910,000,000	1,954,235,600	
第 3 0 6 回利付国債（ 1 0 年）	1,170,000,000	1,203,321,600	
第 3 0 7 回利付国債（ 1 0 年）	700,000,000	718,634,000	
第 3 0 8 回利付国債（ 1 0 年）	1,490,000,000	1,535,072,500	
第 3 0 9 回利付国債（ 1 0 年）	2,450,000,000	2,513,724,500	
第 3 1 0 回利付国債（ 1 0 年）	1,410,000,000	1,447,562,400	
第 3 1 1 回利付国債（ 1 0 年）	1,080,000,000	1,103,652,000	
第 3 1 2 回利付国債（ 1 0 年）	3,810,000,000	3,942,207,000	代用有価証券 100,000,000円
第 3 1 3 回利付国債（ 1 0 年）	1,250,000,000	1,301,075,000	
第 3 1 4 回利付国債（ 1 0 年）	310,000,000	320,890,300	
第 3 1 5 回利付国債（ 1 0 年）	2,070,000,000	2,155,615,200	
第 3 1 6 回利付国債（ 1 0 年）	1,090,000,000	1,131,681,600	
第 3 1 7 回利付国債（ 1 0 年）	710,000,000	739,230,700	
第 3 1 8 回利付国債（ 1 0 年）	950,000,000	985,910,000	

第319回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,670,480,000	
第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,038,055,600	
第321回利付国債（10年）	1,340,000,000	1,397,620,000	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	779,340,000	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,010,235,600	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,327,808,000	
第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,380,271,800	
第326回利付国債（10年）	860,000,000	891,863,000	
第327回利付国債（10年）	740,000,000	770,850,600	
第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	2,399,251,200	
第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,353,387,500	
第330回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,509,048,000	
第331回利付国債（10年）	1,380,000,000	1,431,294,600	
第332回利付国債（10年）	3,430,000,000	3,562,432,300	
第333回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,423,223,300	
第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	2,904,696,900	
第335回利付国債（10年）	2,710,000,000	2,807,803,900	
第336回利付国債（10年）	610,000,000	632,667,600	
第337回利付国債（10年）	1,980,000,000	2,027,302,200	
第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,526,709,500	
第339回利付国債（10年）	3,680,000,000	3,798,128,000	
第340回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,015,951,200	
第341回利付国債（10年）	3,030,000,000	3,108,628,500	
第342回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,626,598,000	
第343回利付国債（10年）	2,530,000,000	2,554,642,200	
第344回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,685,364,000	
第345回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,926,445,100	
第346回利付国債（10年）	3,500,000,000	3,527,860,000	
第347回利付国債（10年）	2,430,000,000	2,447,666,100	
第348回利付国債（10年）	1,230,000,000	1,238,610,000	
第349回利付国債（10年）	3,210,000,000	3,229,966,200	
第350回利付国債（10年）	2,270,000,000	2,282,235,300	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	52,162,000	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	202,376,000	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	150,829,200	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	147,199,800	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	62,973,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	245,544,600	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	231,249,600	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	60,997,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	279,297,600	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	179,353,600	

第11回利付国債(30年)	90,000,000	108,841,500
第12回利付国債(30年)	190,000,000	241,284,800
第13回利付国債(30年)	290,000,000	364,332,800
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,964,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	454,943,800
第16回利付国債(30年)	370,000,000	496,177,400
第17回利付国債(30年)	330,000,000	438,259,800
第18回利付国債(30年)	345,000,000	453,171,300
第19回利付国債(30年)	280,000,000	368,734,800
第20回利付国債(30年)	420,000,000	567,793,800
第21回利付国債(30年)	270,000,000	356,451,300
第22回利付国債(30年)	400,000,000	542,716,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	584,456,000
第24回利付国債(30年)	260,000,000	354,000,400
第25回利付国債(30年)	290,000,000	384,772,000
第26回利付国債(30年)	410,000,000	552,331,500
第27回利付国債(30年)	600,000,000	821,250,000
第28回利付国債(30年)	930,000,000	1,276,359,900
第29回利付国債(30年)	990,000,000	1,345,063,500
第30回利付国債(30年)	750,000,000	1,007,835,000
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,195,290,000
第32回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,610,474,600
第33回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,696,685,800
第34回利付国債(30年)	955,000,000	1,281,457,200
第35回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,162,764,200
第36回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,488,612,000
第37回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,581,620,100
第38回利付国債(30年)	760,000,000	962,479,200
第39回利付国債(30年)	870,000,000	1,121,699,700
第40回利付国債(30年)	600,000,000	760,158,000
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,107,329,100
第42回利付国債(30年)	800,000,000	995,864,000
第43回利付国債(30年)	820,000,000	1,021,301,800
第44回利付国債(30年)	810,000,000	1,010,499,300
第45回利付国債(30年)	800,000,000	959,712,000
第46回利付国債(30年)	840,000,000	1,007,865,600
第47回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,530,750,000
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,293,149,000
第49回利付国債(30年)	790,000,000	928,700,300
第50回利付国債(30年)	520,000,000	532,740,000
第51回利付国債(30年)	790,000,000	707,468,700
第52回利付国債(30年)	770,000,000	727,526,800
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,037,076,100

第54回利付国債（30年）	1,310,000,000	1,336,632,300	
第55回利付国債（30年）	970,000,000	988,672,500	
第56回利付国債（30年）	1,440,000,000	1,466,136,000	
第57回利付国債（30年）	1,160,000,000	1,179,766,400	
第58回利付国債（30年）	530,000,000	538,432,300	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	145,796,000	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	178,324,900	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	303,659,000	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	178,399,700	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	94,961,700	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	138,947,900	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	148,950,200	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	232,799,600	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	106,639,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	118,248,900	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	86,424,800	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	216,788,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	151,450,600	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	163,032,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	259,860,000	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	326,355,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	216,676,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	374,318,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	252,823,200	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	334,704,000	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	219,458,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	354,211,200	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	244,549,800	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	364,966,800	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	145,104,700	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	215,429,600	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	439,775,700	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	460,480,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	227,786,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	716,669,100	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	408,949,200	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	228,520,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	149,180,200	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	306,123,300	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	330,794,300	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	193,582,400	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	309,379,500	



第80回利付国債(20年)	220,000,000	253,657,800
第81回利付国債(20年)	390,000,000	448,741,800
第82回利付国債(20年)	600,000,000	694,800,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	337,246,800
第84回利付国債(20年)	470,000,000	542,986,300
第85回利付国債(20年)	290,000,000	338,517,000
第86回利付国債(20年)	210,000,000	248,438,400
第87回利付国債(20年)	550,000,000	646,343,500
第88回利付国債(20年)	420,000,000	499,144,800
第89回利付国債(20年)	350,000,000	413,112,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	746,512,200
第91回利付国債(20年)	450,000,000	536,989,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,038,681,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	482,201,000
第94回利付国債(20年)	610,000,000	722,819,500
第95回利付国債(20年)	610,000,000	736,465,200
第96回利付国債(20年)	320,000,000	380,521,600
第97回利付国債(20年)	400,000,000	481,256,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	525,272,000
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,377,470,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	581,515,200
第101回利付国債(20年)	715,000,000	880,243,650
第102回利付国債(20年)	410,000,000	506,657,500
第103回利付国債(20年)	400,000,000	490,280,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	434,012,400
第105回利付国債(20年)	680,000,000	822,419,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	463,501,200
第107回利付国債(20年)	150,000,000	181,975,500
第108回利付国債(20年)	660,000,000	786,799,200
第109回利付国債(20年)	230,000,000	274,909,800
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,155,931,500
第111回利付国債(20年)	490,000,000	603,390,900
第112回利付国債(20年)	790,000,000	964,131,800
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,652,386,500
第114回利付国債(20年)	850,000,000	1,043,324,000
第115回利付国債(20年)	740,000,000	916,778,600
第116回利付国債(20年)	760,000,000	944,262,000
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,046,146,000
第118回利付国債(20年)	690,000,000	843,324,900
第119回利付国債(20年)	270,000,000	323,562,600
第120回利付国債(20年)	790,000,000	927,894,500
第121回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,928,860,800
第122回利付国債(20年)	200,000,000	240,196,000

第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,241,340,000	
第124回利付国債(20年)	460,000,000	564,976,600	
第125回利付国債(20年)	480,000,000	602,980,800	
第126回利付国債(20年)	610,000,000	750,928,300	
第127回利付国債(20年)	580,000,000	706,695,200	
第128回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,282,113,000	
第129回利付国債(20年)	220,000,000	265,815,000	
第130回利付国債(20年)	855,000,000	1,035,045,900	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	455,065,200	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,006,950,000	
第133回利付国債(20年)	820,000,000	994,496,000	
第134回利付国債(20年)	610,000,000	741,101,200	
第135回利付国債(20年)	490,000,000	588,705,600	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	677,142,900	
第137回利付国債(20年)	450,000,000	541,507,500	
第138回利付国債(20年)	340,000,000	399,829,800	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	606,726,600	
第140回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,940,372,000	
第141回利付国債(20年)	950,000,000	1,145,785,500	
第142回利付国債(20年)	460,000,000	561,692,200	
第143回利付国債(20年)	890,000,000	1,062,117,100	
第144回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,238,013,000	
第145回利付国債(20年)	1,630,000,000	1,971,240,500	
第146回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,754,543,500	
第147回利付国債(20年)	1,860,000,000	2,223,890,400	
第148回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,499,552,500	
第149回利付国債(20年)	1,840,000,000	2,174,272,800	
第150回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,913,880,000	
第151回利付国債(20年)	1,555,000,000	1,765,251,550	
第152回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,644,880,000	
第153回利付国債(20年)	1,700,000,000	1,955,969,000	
第154回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,688,989,500	
第155回利付国債(20年)	1,840,000,000	2,023,282,400	
第156回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,334,439,000	
第157回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,601,429,800	
第158回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,705,767,700	
第159回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,639,792,000	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	2,029,443,000	
第161回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,266,040,000	
第162回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,650,051,000	
第163回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,240,679,000	
第164回利付国債(20年)	680,000,000	677,552,000	

国債証券合計		285,295,000,000	309,869,467,400	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,907,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,133,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,831,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	129,313,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,456,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,522,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	237,212,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,832,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	103,355,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	103,602,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	103,317,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	207,292,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,409,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,911,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,261,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,387,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,269,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,516,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	207,138,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,595,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,694,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,605,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	135,722,000	
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,991,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,084,000	
	第172回神奈川県公募公債	100,000,000	102,444,000	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,880,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,641,000	
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	200,610,000	
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	237,634,000	
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,242,000	
	第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,008,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,632,000	
	第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,623,000	
	第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,097,000	
	第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,835,000	
	第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,498,670	
	第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,997,000	
	第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,791,000	
	第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,660,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,682,000		

平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	118,634,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,010,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,270,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	106,221,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,203,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	104,764,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,837,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,773,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,022,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,466,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	116,204,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	99,202,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,945,433	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,438,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,098,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,179,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,358,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,368,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	122,014,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,011,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,603,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,469,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,918,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,569,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,027,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,952,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,660,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	121,550,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,750,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,523,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,658,797	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	200,088,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,357,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	199,770,440	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,036,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,794,000	

平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,484,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,715,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,502,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,771,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,134,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,918,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	121,123,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	207,204,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	128,998,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,677,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,074,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,971,200	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,170,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,324,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,209,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,503,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	220,470,800	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,138,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,216,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,293,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,508,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	370,218,640	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,499,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,055,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,792,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,033,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,471,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,404,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,159,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,272,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,064,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,430,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,343,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,028,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,536,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,346,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,077,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,769,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,370,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,472,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,464,214	

第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,431,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,620,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,032,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,156,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,214,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,178,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	206,818,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,496,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,234,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,936,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,755,000	
第5回名古屋市長公募公債（30年）	100,000,000	134,038,000	
第9回名古屋市長公募公債（20年）	100,000,000	119,373,000	
第11回名古屋市長公募公債（30年）	100,000,000	120,943,000	
第481回名古屋市長公募公債（10年）	100,000,000	103,265,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,532,660	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,749,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,402,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,866,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,214,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,740,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,448,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,645,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,171,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,174,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,951,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,614,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,523,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,302,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,470,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,084,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,444,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,292,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,184,150	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,914,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,609,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,280,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,478,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,089,250	
平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	207,294,000	

	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	203,276,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,604,000	
	地方債証券合計	19,845,920,000	20,906,416,254	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,130,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,312,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,296,000	
	第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,256,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,128,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,545,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,422,000	
	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	211,140,000	
	第14回道路債券	100,000,000	108,461,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,760,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	471,868,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,110,000	
	第28回道路債券	200,000,000	269,640,000	
	第33回道路債券	200,000,000	273,298,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,042,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,646,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,582,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,685,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,848,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,572,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,832,000	
	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	140,952,000	
	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	242,034,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,399,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,149,000	
	第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,688,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,532,000	

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	102,382,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,459,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,466,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,782,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,514,000	
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	122,355,000	
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	103,366,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,965,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,644,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,335,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,731,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,881,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	311,447,710	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,520,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,812,000	
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	103,541,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,494,000	
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	118,156,000	
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	104,017,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,973,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,632,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,474,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,333,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,172,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	154,427,640	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,735,000	
	200,000,000	231,258,000	



第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	105,980,040	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,823,000	
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	103,582,000	
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	103,293,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,886,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,739,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,226,390	
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	315,728,240	
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	100,352,000	
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	300,933,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	320,000,000	321,856,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,346,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	320,307,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,148,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,378,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,279,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	134,101,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,028,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,810,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,870,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,379,560	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,209,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,665,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,829,920	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,955,160	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,077,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,472,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,456,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	516,405,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,318,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,965,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,727,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,086,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,420,000	

第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,500,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,736,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,100,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,488,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,687,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,173,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,172,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,775,590	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,408,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,366,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,635,800	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,414,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,868,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,449,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,612,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,388,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,409,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,414,100	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,958,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,882,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	107,410,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,026,400	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,988,000	17,858,635	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,039,000	18,022,320	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,388,000	18,508,656	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,922,000	18,990,509	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,612,000	19,731,511	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,955,000	15,524,785	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,206,000	32,986,302	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,031,000	19,036,949	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,487,000	17,437,640	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,165,000	20,313,750	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,484,000	17,451,445	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,902,000	19,930,268	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,188,000	20,761,742	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,609,000	21,172,450	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,783,000	27,883,025	

第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,444,000	28,685,129
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,665,000	31,161,721
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,199,000	34,584,945
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,407,000	36,899,787
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,222,000	37,655,135
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,624,000
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,338,000	79,440,560
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,039,000	17,792,634
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,138,000	40,456,790
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,064,000	17,802,359
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,396,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,806,000	17,790,663
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,406,000	44,076,687
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,694,000	16,565,017
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,408,000	44,179,023
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,906,000	41,555,109
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,527,000	18,622,612
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,484,000	82,034,635
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,958,000	44,453,242
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,991,000	19,032,498
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,581,000	56,461,514
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,286,000	54,041,083
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,011,000	53,793,139
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,369,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,302,000	114,803,169
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,401,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,487,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,744,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,784,000	121,695,935
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,957,000	61,350,654
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,717,000	61,628,188
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,053,000	63,113,300
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,915,000	56,477,040
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,792,000	56,952,448
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,294,000	63,491,993
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	181,996,500
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,942,000	57,161,656
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,071,000	64,453,905
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,387,000	65,866,699
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,232,000	65,508,984
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,078,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,012,000	139,833,278
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,854,000	69,975,794

第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,002,000	143,342,447	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,867,000	80,002,891	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,807,000	83,768,731	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,730,000	83,114,764	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,564,000	170,982,909	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,846,000	84,369,312	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,467,000	89,193,304	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,554,000	93,637,263	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,860,000	93,707,946	
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,640,000	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,071,000	94,421,884	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,716,000	95,530,557	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,045,000	95,696,058	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,826,000	97,382,749	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,159,000	97,842,027	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,406,000	97,776,142	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,712,000	98,075,488	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,098,000	98,552,193	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,974,000	197,393,554	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,657,000	99,024,990	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,040,000	199,337,162	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,479,000	99,813,249	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,702,000	199,969,600	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	128,258,000	
第 1 6 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,549,000	
第 1 9 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,085,000	
第 1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,960,000	
第 6 回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	113,500,000	
い第 7 7 9 号商工債	100,000,000	100,244,000	
い第 7 8 6 号商工債	300,000,000	300,789,000	
い第 7 9 5 号商工債	200,000,000	199,144,000	
い第 7 8 0 号農林債	100,000,000	100,500,000	

	い第795号農林債	100,000,000	99,834,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,658,000	
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,240,000	
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,882,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,386,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,427,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,988,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	99,999,000	
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,649,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,881,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,820,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,897,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,925,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,875,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,762,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,176,000	
	特殊債券合計	24,731,227,000	26,176,807,582	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,961,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,507,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,433,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,782,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,351,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,601,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,036,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,293,000	
	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	100,255,000	
	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	100,210,000	
	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	100,875,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,319,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,161,000	
	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	100,248,000	
	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	100,342,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,918,000	

第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,111,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
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	99,900,000	
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	100,114,000	
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	102,260,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,390,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,906,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,068,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,948,000	
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	99,875,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,301,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,550,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,700,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,133,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,800,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,874,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,721,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,001,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,904,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,477,000	
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	101,162,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,382,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,524,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,118,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,680,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,904,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,168,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,472,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,685,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
	100,000,000	100,108,000	

第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債			
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	100,331,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,262,000	
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	100,458,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,382,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,704,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,603,000	
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	100,395,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,529,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,890,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,471,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,806,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	125,256,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,868,000	
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	104,289,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	118,028,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,324,000	
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	102,202,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,495,000	
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	103,208,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,241,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,785,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,516,000	
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	103,008,000	
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	104,193,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,359,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,646,000	
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	100,556,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,230,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,503,000	

第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,466,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,269,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,868,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,223,000	
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	100,390,000	
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	102,038,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,006,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,109,000	
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	103,152,000	
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	103,854,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,794,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,990,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,083,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,314,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,652,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	243,622,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,868,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,894,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,618,230	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,223,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,831,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,567,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,690,600	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,537,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,803,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,591,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,914,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,658,000	
第20回株式会社N T T ドコモ無担保社債	100,000,000	102,807,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	121,077,600	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,188,900	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,926,000	



第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,241,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,562,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,091,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,050,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,258,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,877,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,345,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,092,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,876,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,172,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,779,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,044,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,345,360	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,476,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,575,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,054,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,438,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,215,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,435,210	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,223,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,474,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,149,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,024,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,542,000	
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	101,161,000	
社債券合計	14,796,000,000	15,203,481,900	
合計		372,156,173,136	

(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

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	105,854,700
コール・ローン	3,211,416,730
国債証券	239,546,660,885
派生商品評価勘定	27,233,433
未収入金	1,321,612
未収利息	1,879,531,646
前払金	7,209,063
前払費用	126,456,079
差入委託証拠金	102,037,842
流動資産合計	245,007,721,990
資産合計	245,007,721,990
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,587,230
未払金	494,574
未払解約金	183,249,793
未払利息	5,196
その他未払費用	38,656
流動負債合計	215,375,449
負債合計	215,375,449
純資産の部	
元本等	
元本	90,563,196,023
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,229,150,518
元本等合計	244,792,346,541
純資産合計	244,792,346,541
負債純資産合計	245,007,721,990

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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>

2018年 5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)

2018年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	90,563,196,023口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7030円 (27,030円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 5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。

	2018年 5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

	2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	91,604,625,027円
期中追加設定元本額	10,812,592,607円
期中一部解約元本額	11,854,021,611円
期末元本額	90,563,196,023円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,104,713,863円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	903,134,829円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	572,553,708円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,975,300,917円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,348,221円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,919,666,270円
世界経済インデックスファンド	6,007,482,083円
D Cマイセレクション25	1,557,544,684円
D Cマイセレクション50	1,355,808,597円
D Cマイセレクション75	894,398,186円
D C外国債券インデックス・オープン	1,718,268,706円
D CマイセレクションS25	595,473,766円
D CマイセレクションS50	529,028,575円
D CマイセレクションS75	249,102,911円
D Cターゲット・イヤーフアンド2025	54,448,129円
D Cターゲット・イヤーフアンド2035	59,271,823円
D Cターゲット・イヤーフアンド2045	27,172,536円
D C世界経済インデックスファンド	4,679,485,515円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	580,376,849円

区分	2018年 5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）	50,424,739円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	6,176,650円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,626,376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）	62,654,539円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	192,963,250円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	275,419,593円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	210,793,446円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	602,941,295円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,729,095,603円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	724,160,933円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,654,456,078円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	964,108,349円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	152,198,044円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	747,501,471円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,239,785,163円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	291,033,791円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	356,960,499円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,197,603,465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）	979,029,635円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	912,279,258円
外国債券ファンド・シリーズ1	649,049,690円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,581,441,692円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,922,358,771円
分散投資コア戦略ファンドA	979,489,730円
分散投資コア戦略ファンドS	2,728,113,990円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	171,549,752円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,789,584,536円
コア投資戦略ファンド（切替型）	548,508,884円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	228,504,487円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	114,490,183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）	901,370,397円
SMT インデックスバランス・オープン	249,838,714円
外国債券SMTBセクション（SMA専用）	23,757,771,633円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,098,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	71,143,100円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	73,726,933円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	381,678円
グローバル経済コア	1,115,785,379円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,245,278円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	9,345円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,015,356,459円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	5,147,097,639円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	359,487,357円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5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		5,546,843,664
合計		5,546,843,664

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2018年 5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	2,279,109,516	-	2,271,900,453	7,209,063
	合計	2,279,109,516	-	2,271,900,453	7,209,063

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2018年 5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	3,075,357,234	-	3,078,212,500	2,855,266
	アメリカドル	1,391,225,825	-	1,415,769,600	24,543,775
	カナダドル	128,216,864	-	129,195,600	978,736
	ユーロ	1,330,610,299	-	1,311,416,100	19,194,199
	イギリスポンド	225,304,246	-	221,831,200	3,473,046
	合計	3,075,357,234	-	3,078,212,500	2,855,266

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,400,317.17	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,891,211.56	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,335,607.69	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,755,151.40	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,897,432.14	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,418,348.24	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,324,076.84	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,361,713.46	
		T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,359,290.71	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,195,625.43	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,404,695.39	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,508,297.80	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,908,364.10	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,905,940.30	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,638,630.96	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,899,116.80	
		T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,104,576.51	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	977,507.00	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,145,916.00	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,513,074.02	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,401,820.04	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,647,380.25	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,316,864.02	
		T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,885,593.92	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,403,204.40	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,820,597.84	
		T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,517,666.16	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,298,944.59	



T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,334,078.15	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,756,649.60	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,637,362.10	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,221,986.52	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,034,997.60	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,761,035.30	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,762,836.27	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,902,521.64	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,925,366.75	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,339,932.77	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,426,778.88	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	4,968,222.35	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,468,782.38	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,712,542.75	
T 1.625% 06/30/19	10,000,000.00	9,919,415.30	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,941,049.94	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,895,988.70	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,381,914.10	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,423,699.65	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,434,176.21	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,790,474.11	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,973,831.09	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,191,709.69	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,408,396.70	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,189,158.40	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,765,030.08	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,651,324.01	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,608,239.72	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,170,696.63	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,716,264.10	
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,953,003.15	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,706,178.66	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,916,028.28	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,013,076.08	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,419,321.97	
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,695,242.83	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,669,224.35	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,849,456.24	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,076,235.97	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,243,323.69	
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,261,845.25	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,863,825.50	

T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,364,102.32
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,921,576.24
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,158,616.03
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,958,256.53
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,088,792.70
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,241,441.53
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,369,631.10
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,045,296.65
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,582,286.88
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,985,413.69
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,430,296.14
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,960,366.90
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,922,671.18
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,402,149.70
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,434,428.62
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,014,113.82
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,456,466.26
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,956,575.39
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,411,380.47
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	9,880,891.53
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,045,006.49
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,735,252.01
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,758,326.18
T 2.25% 11/15/27	6,700,000.00	6,282,671.60
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,933,893.24
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,048,005.56
T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,362,466.65
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,107,868.12
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,283,978.47
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,863,751.00
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,554,405.83
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,492,088.43
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,834,554.36
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,237,586.03
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,469,761.29
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,387,144.30
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,505,388.29
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,998,727.19
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,977,332.81
T 2.75% 02/15/28	3,600,000.00	3,522,651.80
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,803,039.08
T 2.75% 08/15/47	8,250,000.00	7,601,698.98
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,855,993.93

T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,920,038.29	
T 2.875% 05/15/43	17,150,000.00	16,347,285.84	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,339,802.45	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,432,143.32	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,503,776.62	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,910,567.28	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,928,218.04	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,722,254.20	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	9,958,436.35	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,133,606.71	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,904,949.74	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,523,298.29	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,643,385.12	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,928,639.80	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,511,238.93	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,340,746.01	
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,099,535.50	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,413,157.64	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,930,478.22	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,142,348.49	
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,348,457.27	
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	4,984,655.05	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,040,046.70	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,365,834.37	
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	5,971,860.66	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,399,199.00	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,833,052.36	
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,866,358.20	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,192,342.00	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,133,970.62	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,386,160.22	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,417,926.65	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,740,893.66	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,165,788.78	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,541,528.06	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,535,766.82	
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,906,685.85	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,402,687.99	
T 3% 05/15/47	6,700,000.00	6,496,384.17	
T 3% 11/15/44	2,300,000.00	2,237,275.06	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,061,415.36	
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,360,899.15	

	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,192,611.24	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,284,024.04	
	T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	5,003,749.53	
	T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,242,257.74	
	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,206,307.47	
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,213,149.33	
	T 4.5% 08/15/39	250,000.00	304,788.69	
	T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	4,839,978.54	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,407,287.42	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,506,732.10	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,561,565.68	
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	1,997,382.97	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,463,057.49	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,058,308.40	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,824,085.06	
	T 6.25% 05/15/30	400,000.00	529,668.65	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,924,118.59	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,998,829.31	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,249,359.45	
	アメリカドル 小計	964,370,000.00	938,694,890.06 (103,218,890,110)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,913,829.50	
	CAN 0.75% 03/01/21	2,850,000.00	2,749,038.75	
	CAN 0.75% 08/01/19	2,770,000.00	2,735,513.50	
	CAN 0.75% 09/01/20	2,470,000.00	2,401,296.95	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,559,852.95	
	CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,472,037.50	
	CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,052,481.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,317,116.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,156,572.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	1,050,000.00	1,028,532.75	
	CAN 1.75% 09/01/19	2,600,000.00	2,597,647.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,890,000.00	1,678,801.95	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,427,805.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,542,164.75	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,450,000.00	1,467,994.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,608,509.75	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,550,000.00	1,652,222.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	678,766.70	
	CAN 2% 06/01/28	850,000.00	820,598.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,644,783.45	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,855,314.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,500,000.00	3,021,262.50	

	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,267,552.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,538,480.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,600,000.00	2,117,440.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,266,824.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,218,672.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	523,918.80	
	カナダドル 小計	57,980,000.00	60,315,028.30 (5,162,363,272)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	21,015,447.75	
	MBONO 10% 12/05/24	40,000,000.00	44,938,000.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	21,750,000.00	19,310,520.00	
	MBONO 5% 12/11/19	44,050,000.00	42,431,823.25	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,853,248.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	25,300,000.00	24,532,398.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	20,000,000.00	19,738,600.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	17,066,398.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	24,176,160.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,910,849.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,482,648.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	12,650,000.00	13,481,484.50	
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	31,064,418.75	
	MBONO 8% 11/07/47	7,650,000.00	7,762,378.50	
	MBONO 8% 12/07/23	4,400,000.00	4,474,580.00	
	メキシコペソ 小計	333,700,000.00	337,238,954.75 (1,895,282,925)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,705,882.00	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,154,085.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,128,705.15	
	BGB 0.8% 06/22/28	850,000.00	847,964.25	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	854,594.25	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	808,088.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,100,000.00	1,088,785.50	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,192,158.00	
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,171,410.50	
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,289,411.50	
	BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	485,579.25	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,669,432.50	
	BGB 2.25% 06/22/57	400,000.00	448,180.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,742,156.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,260,000.00	1,862,796.60	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	3,027,007.50	
	BGB 3% 06/22/34	1,600,000.00	2,009,696.00	

BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,097,860.00
BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,290,008.65
BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,424,450.00
BGB 4.25% 09/28/22	1,150,000.00	1,370,340.00
BGB 4.5% 03/28/26	980,000.00	1,285,637.50
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,619,663.75
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,421,240.35
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,295,475.50
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,539,791.10
BKO 0% 12/13/19	800,000.00	807,884.00
BTPS 0.35% 06/15/20	4,350,000.00	4,396,371.00
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,817,233.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,415,358.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,286,824.50
BTPS 0.65% 11/01/20	900,000.00	916,213.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,035,110.00
BTPS 0.9% 08/01/22	2,100,000.00	2,134,828.50
BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,315,905.50
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,518,990.00
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,440,610.50
BTPS 1.25% 12/01/26	2,100,000.00	2,039,331.00
BTPS 1.35% 04/15/22	1,550,000.00	1,606,350.25
BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	705,239.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,090,939.50
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	3,235,728.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,454,228.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,606,248.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,886,968.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,093,510.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	3,271,504.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,668,050.00
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,868,283.00
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	2,021,838.00
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,312,148.50
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,569,450.00
BTPS 2.5% 12/01/24	4,200,000.00	4,546,899.00
BTPS 2.7% 03/01/47	2,600,000.00	2,512,276.00
BTPS 2.8% 03/01/67	800,000.00	737,560.00
BTPS 2.95% 09/01/38	1,450,000.00	1,514,873.00
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,669,074.00
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,351,226.50
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,666,172.50
BTPS 3.45% 03/01/48	1,450,000.00	1,588,185.00

BTPS 3.5% 03/01/30	3,210,000.00	3,662,931.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,700,000.00	4,087,630.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	2,500,000.00	2,771,737.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,463,140.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,494,774.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,866,772.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,809,450.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,785,729.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	4,372,043.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	5,198,132.50	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,618,594.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	5,056,401.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,545,186.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,400,000.00	3,027,912.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	3,225,996.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,500,000.00	4,261,740.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,518,385.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,901,863.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,843,513.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,123,452.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	4,199,133.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,839,386.50	
BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,528,090.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,299,554.75	
BTPS 5% 08/01/34	3,200,000.00	4,302,624.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,965,083.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,445,532.00	
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,563,818.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,027,144.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,147,864.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,382,627.00	
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,267,488.00	
DBR 0.5% 02/15/26	2,900,000.00	2,943,123.00	
DBR 0.5% 02/15/28	2,050,000.00	2,038,827.50	
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,052,836.50	
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,036,632.50	
DBR 1.25% 08/15/48	800,000.00	801,568.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,748,543.00	
DBR 1.5% 05/15/23	2,050,000.00	2,212,175.50	
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,833,202.15	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,557,104.25	
DBR 1.75% 02/15/24	1,350,000.00	1,482,131.25	

DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,331,320.00
DBR 1% 08/15/24	3,000,000.00	3,163,965.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,216,758.75
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,662,250.00
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,175,110.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,589,787.50
DBR 2.5% 07/04/44	3,200,000.00	4,154,496.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,110,000.00	4,076,759.05
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,580,285.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,324,196.00
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,608,441.50
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,794,587.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,758,353.50
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,078,110.00
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,768,870.00
DBR 4.0% 01/04/37	2,800,000.00	4,239,858.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	2,976,289.25
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,330,964.80
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,109,339.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,630,165.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,300,000.00	3,633,965.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,968,190.00
DBR 6.25% 01/04/24	2,600,000.00	3,513,081.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,450,000.00	2,366,516.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,624,851.00
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,559,377.50
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,715,679.25
FRTR 0.5% 05/25/25	5,550,000.00	5,601,087.75
FRTR 0.5% 05/25/26	5,580,000.00	5,573,610.90
FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,794,605.00
FRTR 0.75% 05/25/28	2,950,000.00	2,937,624.75
FRTR 0% 03/25/23	750,000.00	748,500.00
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,028,680.00
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,578,388.25
FRTR 1.25% 05/25/34	950,000.00	956,132.25
FRTR 1.25% 05/25/36	3,350,000.00	3,320,118.00
FRTR 1.5% 05/25/31	4,800,000.00	5,070,840.00
FRTR 1.75% 05/25/23	4,800,000.00	5,213,592.00
FRTR 1.75% 05/25/66	1,050,000.00	1,027,530.00
FRTR 1.75% 06/25/39	1,650,000.00	1,754,230.50
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,292,397.50
FRTR 1% 05/25/19	2,300,000.00	2,337,156.50
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,758,204.25



FRTR 1% 11/25/25	5,000,000.00	5,207,125.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,478,742.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000.00	7,835,347.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,177,480.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,845,969.75	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,700,000.00	6,782,401.50	
FRTR 2% 05/25/48	2,400,000.00	2,592,060.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,588,796.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,684,124.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,863,885.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	1,880,000.00	2,328,615.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,550,000.00	6,226,711.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,336,795.20	
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,152,632.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,664,781.25	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,660,000.00	5,869,066.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,649,100.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,321,656.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,743,405.50	
FRTR 4% 10/25/38	3,800,000.00	5,617,521.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,035,816.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,686,895.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,690,039.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,421,160.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,269,016.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,003,363.15	
IRISH 0.9% 05/15/28	270,000.00	268,141.05	
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	514,859.80	
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	770,145.00	
IRISH 1% 05/15/26	1,650,000.00	1,691,703.75	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,450,000.00	1,655,581.00	
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	1,039,187.10	
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,357,690.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,066,090.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	400,000.00	421,748.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,282,009.60	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,063,003.50	
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	873,908.00	
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	894,793.50	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,950,000.00	1,978,158.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,678,989.65	
NETHER 0.5% 07/15/26	3,400,000.00	3,409,588.00	

NETHER 0.75% 07/15/27	1,650,000.00	1,673,784.75
NETHER 0.75% 07/15/28	850,000.00	853,893.00
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,815,822.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	893,146.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,650,000.00	1,798,021.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,600,000.00	1,762,832.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,245,243.25
NETHER 2.75% 01/15/47	1,630,000.00	2,226,791.90
NETHER 2% 07/15/24	2,450,000.00	2,722,966.75
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,287,769.25
NETHER 3.5% 07/15/20	2,700,000.00	2,939,827.50
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,596,099.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,900,000.00	2,933,115.50
NETHER 4% 01/15/37	1,940,000.00	2,921,940.70
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,160,593.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,667,130.30
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	271,268.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,379,410.25
OBL 0.25% 10/16/20	4,600,000.00	4,685,813.00
OBL 0% 04/17/20	1,600,000.00	1,617,696.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,626,820.00
OBL 0% 10/08/21	3,050,000.00	3,087,393.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,061,508.00
RAGB 0.5% 04/20/27	700,000.00	690,669.00
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,465,622.80
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	497,625.00
RAGB 0% 09/20/22	640,000.00	641,971.20
RAGB 1.2% 10/20/25	1,850,000.00	1,953,054.25
RAGB 1.5% 02/20/47	470,000.00	471,090.40
RAGB 1.5% 11/02/86	280,000.00	248,382.40
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,902,538.75
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,524,740.00
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	976,110.75
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	543,390.00
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,112,527.60
RAGB 3.15% 06/20/44	1,030,000.00	1,427,034.10
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,504,756.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,446,327.80
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,265,297.00
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	791,136.90
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,917,142.50
RAGB 4.15% 03/15/37	1,710,000.00	2,561,580.00
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	670,375.00

RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,277,375.75	
RFGB 0.375% 09/15/20	650,000.00	662,350.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	550,000.00	550,767.25	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	344,783.25	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	526,637.70	
RFGB 0.875% 09/15/25	650,000.00	672,077.25	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	542,937.60	
RFGB 0% 09/15/23	600,000.00	596,502.00	
RFGB 1.125% 04/15/34	420,000.00	421,218.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	696,858.50	
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	827,738.45	
RFGB 2.625% 07/04/42	550,000.00	713,185.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	863,568.00	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	663,666.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	752,640.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	823,771.70	
RFGB 4.375% 07/04/19	750,000.00	792,982.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,319,225.25	
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,105,940.00	
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,077,664.75	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,376,860.50	
SPGB 0.75% 07/30/21	300,000.00	308,256.00	
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,095,505.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	3,100,000.00	3,158,900.00	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,431,472.60	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,700,000.00	2,726,244.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,300,000.00	2,346,345.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,138,800.75	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,950,000.00	2,061,930.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,250,000.00	2,415,678.75	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,250,000.00	2,348,887.50	
SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,875,109.00	
SPGB 2.35% 07/30/33	1,500,000.00	1,604,835.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	950,000.00	1,006,197.25	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,319,851.25	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,627,552.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,980,000.00	2,208,016.80	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,000,000.00	1,206,440.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,691,077.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,500,000.00	3,378,000.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,171,615.50	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,126,258.75	

	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,217,375.20
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,301,753.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,550,000.00	3,731,389.50
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,793,940.75
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,364,358.50
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,200,000.00	3,276,603.00
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,255,120.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,898,976.50
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,750,000.00	2,751,621.25
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,224,942.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,300,000.00	3,853,228.50
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,950,000.00	4,479,619.25
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,250,000.00	5,177,435.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,297,501.90
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,537,352.25
	ユーロ 小計	657,920,000.00	758,081,242.55 (98,724,920,217)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,421,372.50
	UKT 0.75% 07/22/23	1,900,000.00	1,859,805.50
	UKT 1.25% 07/22/27	3,950,000.00	3,864,383.75
	UKT 1.5% 01/22/21	5,230,000.00	5,318,674.65
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,623,101.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,520,000.00	2,309,315.40
	UKT 1.625% 10/22/28	450,000.00	450,958.50
	UKT 1.75% 07/22/19	5,470,000.00	5,537,144.25
	UKT 1.75% 07/22/57	1,340,000.00	1,356,187.20
	UKT 1.75% 09/07/22	3,150,000.00	3,244,011.75
	UKT 1.75% 09/07/37	1,400,000.00	1,371,524.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,904,220.00
	UKT 2.5% 07/22/65	2,250,000.00	2,865,971.25
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,402,697.00
	UKT 2% 07/22/20	2,600,000.00	2,666,976.00
	UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,361,903.75
	UKT 3.25% 01/22/44	3,350,000.00	4,270,446.00
	UKT 3.5% 01/22/45	3,300,000.00	4,401,325.50
	UKT 3.5% 07/22/68	2,350,000.00	3,814,672.75
	UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,076,486.25
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	572,035.75
	UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	801,153.75
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,186,040.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,627,717.50
UKT 4.25% 06/07/32	2,050,000.00	2,692,593.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,768,083.50	

	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	836,116.45
	UKT 4.25% 12/07/40	2,080,000.00	2,991,362.40
	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,192,388.50
	UKT 4.25% 12/07/49	1,670,000.00	2,630,642.45
	UKT 4.25% 12/07/55	2,370,000.00	4,008,452.10
	UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,357,008.55
	UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,860,253.75
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,842,151.50
	UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,428,380.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,842,827.50
	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,300,716.25
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,615,372.50
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,362,811.50
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,793,687.50
	UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,885,699.00
イギリスポンド 小計		92,880,000.00	112,716,670.45 (16,783,512,230)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	426,152.00
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,078,505.00
	SWISS 3% 05/12/19	540,000.00	560,484.90
	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	668,032.75
	SWISS 4% 04/08/28	640,000.00	891,369.60
スイスフラン 小計		3,130,000.00	3,624,544.25 (396,307,668)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,900,000.00	6,919,044.00
	SGB 1.5% 11/13/23	11,500,000.00	12,373,942.50
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,670,598.25
	SGB 2.5% 05/12/25	7,350,000.00	8,453,639.25
	SGB 3.5% 03/30/39	5,700,000.00	7,910,431.50
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	16,161,294.45
	SGB 5% 12/01/20	11,450,000.00	13,061,644.75
スウェーデンクローナ 小計		65,320,000.00	73,550,594.70 (928,208,505)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,610,000.00	4,525,429.55
	NGB 1.75% 02/17/27	4,000,000.00	3,970,800.00
	NGB 1.75% 03/13/25	6,900,000.00	6,933,568.50
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,873,386.25
	NGB 3.75% 05/25/21	11,750,000.00	12,656,160.00
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	5,989,227.00
	NGB 4.5% 05/22/19	9,900,000.00	10,273,873.50
ノルウェークローネ 小計		51,360,000.00	53,222,444.80 (724,357,473)

デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	800,000.00	814,724.00
	DGB 0.5% 11/15/27	6,800,000.00	6,756,072.00
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,128,891.00
	DGB 1.75% 11/15/25	13,090,000.00	14,496,455.05
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,946,229.00
	DGB 4.5% 11/15/39	16,480,000.00	27,447,192.80
	DGB 4% 11/15/19	12,590,000.00	13,469,222.65
	デンマーククローネ 小計		67,060,000.00
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,197,734.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,065,269.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,000,270.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	3,200,000.00	3,198,784.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,436,425.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,869,067.50
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,000,000.00	1,914,470.00
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,510,570.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	4,570,000.00	4,673,807.55
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,735,328.80
	POLGB 4% 10/25/23	3,400,000.00	3,631,183.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,421,813.50
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,753,634.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	739,485.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,105,062.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,292,214.75
	ポーランドズロチ 小計		49,500,000.00
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,823,979.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,219,635.90
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	397,638.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,860,000.00	2,893,347.60
	ACGB 2.75% 06/21/35	730,000.00	700,077.30
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,478,052.50
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,539,722.75
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,033,819.75
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,550,000.00	1,535,476.50
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,369,434.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,479,829.25
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,236,946.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	750,000.00	759,697.50
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,638,015.00
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,512,800.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	4,949,797.20

	ACGB 4.5% 04/15/20	4,090,000.00	4,280,573.55	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,485,045.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,454,373.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,450,000.00	3,943,815.75	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,359,121.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,488,778.70	
	オーストラリアドル 小計	58,540,000.00	61,579,976.50	(5,052,021,272)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	242,760.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	410,000.00	408,690.05	
	SIGB 1.75% 04/01/22	360,000.00	354,148.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	242,612.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	873,558.30	
	SIGB 2.375% 06/01/25	700,000.00	694,326.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,300,000.00	1,309,821.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	650,000.00	622,219.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	596,870.90	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	825,681.60	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	284,779.60	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	474,737.60	
	SIGB 2% 07/01/20	760,000.00	760,296.40	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,144,027.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	606,402.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	827,201.70	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,017,326.50	
	SIGB 3% 09/01/24	610,000.00	629,577.95	
	シンガポールドル 小計	11,760,000.00	11,915,037.80	(971,909,633)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,453,012.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,641,707.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	1,993,140.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,252,100.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,602,384.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,148,890.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,258,400.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,095,765.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,057,942.50	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	751,530.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,506,150.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,095,258.15	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,250,000.00	2,217,285.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,065,897.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,897,530.00	

	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,377,021.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,669,123.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,950,000.00	2,967,729.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	629,554.25	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,309,105.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,225,344.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,821,573.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,250,000.00	1,249,531.25	
	MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	389,248.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,654,999.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,865,780.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	643,227.00	
	マレーシアリングット 小計	43,330,000.00	42,839,229.15 (1,192,644,139)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000.00	29,663,568.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	8,192,102.70	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	6,016,996.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,161,044.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	4,200,000.00	4,197,942.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,675,410.50	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,999,572.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	10,960,000.00	10,281,411.60	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	15,422,448.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	25,650,000.00	24,047,003.25	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,988,530.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,668,867.00	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,712,941.00	
	SAGB 9% 01/31/40	11,800,000.00	11,423,875.00	
	南アフリカランド 小計	183,130,000.00	173,451,712.05 (1,517,702,480)	
	合計		239,546,660,885 (239,546,660,885)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 174銘柄	100.0%	43.1%



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	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	287銘柄	100.0%	41.2%
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	7銘柄	100.0%	0.4%
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%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2018年 5月10日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	643,425,331
コール・ローン	663,241,088
国債証券	41,165,142,327
派生商品評価勘定	1,802,487
未収入金	426,161,355
未収利息	636,208,775
前払費用	188,660,278
流動資産合計	43,724,641,641
<b>資産合計</b>	
43,724,641,641	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	893,276
前受収益	8,161
未払金	912,012,080
未払解約金	112,716,193
未払利息	1,073
その他未払費用	8,699

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,025,639,482
負債合計	1,025,639,482
純資産の部	
元本等	
元本	25,386,326,416
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,312,675,743
元本等合計	42,699,002,159
純資産合計	42,699,002,159
負債純資産合計	43,724,641,641

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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)

	2018年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,386,326,416口

		2018年 5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)	1.6820円 (16,820円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		2018年 5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に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2018年 5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。		

	2018年 5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 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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	18,389,934,192円
期中追加設定元本額	7,633,844,043円
期中一部解約元本額	637,451,819円
期末元本額	25,386,326,416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	3,725,690,695円
世界経済インデックスファンド	4,751,772,381円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,546,164,383円
DC世界経済インデックスファンド	3,732,031,427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）	1,861,061,614円
コア投資戦略ファンド（安定型）	200,114,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	657,518,583円

区分	2018年 5月10日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	113,867,316円
分散投資コア戦略ファンドA	121,179,658円
分散投資コア戦略ファンドS	365,622,186円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	129,740,399円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,450,416,031円
コア投資戦略ファンド（切替型）	68,610,635円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,154,091円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,381,501円
SMT インデックスバランス・オープン	211,408,012円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,007,723,008円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,301,960円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	80,359,317円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	83,524,066円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	600,130円
グローバル経済コア	855,604,756円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	132,479,915円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5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		377,361,998
合計		377,361,998

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2018年 5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	395,492,634	-	397,219,707	1,727,073
	メキシコペソ	45,764,200	-	46,002,000	237,800
	ブラジルリアル	112,175,045	-	112,868,332	693,287
	トルコリラ	27,670,500	-	28,182,000	511,500
	チェココルナ	95,170,389	-	95,094,975	75,414
	ハンガリーフォリント	79,104,000	-	79,238,400	134,400

	南アフリカランド	35,608,500	-	35,834,000	225,500
	売建	130,470,483	-	131,288,345	817,862
	アメリカドル	112,175,045	-	112,831,818	656,773
	ハンガリーフォロント	132,238	-	132,527	289
	ポーランドズロチ	18,163,200	-	18,324,000	160,800
	合計	525,963,117	-	528,508,052	909,211

## (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	14,292,927.00	
		MBONO 10% 12/05/24	77,350,000.00	86,898,857.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	41,800,000.00	37,111,712.00	
		MBONO 5% 12/11/19	78,200,000.00	75,327,323.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	76,000,000.00	72,994,580.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	88,650,000.00	85,960,359.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	54,700,000.00	53,985,071.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	33,800,000.00	33,733,583.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	52,600,000.00	52,010,880.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	37,050,000.00	36,806,211.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	31,400,000.00	33,176,612.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	33,517,208.50	
		MBONO 8% 06/11/20	77,200,000.00	77,989,370.00	
		MBONO 8% 11/07/47	19,300,000.00	19,583,517.00	
		MBONO 8% 12/07/23	26,500,000.00	26,949,175.00	
			メキシコペソ 小計		737,800,000.00
		BLTN 0% 01/01/20	17,850,000.00	15,890,284.20	

ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	4,550,000.00	3,307,813.60	
	BLTN 0% 04/01/20	7,400,000.00	6,446,140.96	
	BLTN 0% 07/01/19	4,500,000.00	4,181,904.00	
	BLTN 0% 07/01/20	29,850,000.00	25,371,843.30	
	BLTN 0% 07/01/21	16,800,000.00	12,899,745.60	
	BLTN 0% 10/01/19	9,750,000.00	8,869,926.00	
	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000.00	15,357,315.65	
	BNTNF 10% 01/01/23	20,050,000.00	20,501,394.91	
	BNTNF 10% 01/01/25	10,350,000.00	10,443,682.63	
	BNTNF 10% 01/01/27	10,550,000.00	10,510,727.21	
	BNTNF 10% 01/01/29	1,650,000.00	1,628,433.60	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,588,125.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	532,968.75	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,958,187.50	
	ブラジルレアル 小計		151,850,000.00	139,488,492.91
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	6,020,000,000.00	6,273,712,900.00	
チリペソ 小計		6,020,000,000.00	6,273,712,900.00	(1,089,116,559)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	22,150,000,000.00	21,138,188,000.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000.00	20,801,480,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	33,700,000,000.00	42,691,665,500.00	
コロンビアペソ 小計		75,450,000,000.00	84,631,333,500.00	(3,249,843,206)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	4,750,000.00	5,023,980.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	4,650,000.00	4,849,903.50	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	5,600,000.00	6,013,560.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	3,950,000.00	4,337,633.25	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,050,000.00	6,788,644.50	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,950,000.00	2,160,902.25	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,150,000.00	6,217,878.25	
ペルーヌエボソル 小計		32,100,000.00	35,392,501.75	(1,180,693,858)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	13,900,000.00	13,065,096.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	15,450,000.00	15,978,699.00	
ウルグアイペソ 小計		29,350,000.00	29,043,795.50	(104,557,663)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,400,160.00	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	8,700,000.00	8,151,247.50	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	8,583,152.25	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	10,750,000.00	9,254,513.75	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,500,000.00	5,881,427.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	7,700,000.00	6,726,797.00	

	TURKGB 11% 02/24/27	4,200,000.00	3,668,490.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	8,586,096.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	5,100,000.00	4,689,577.50	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	5,950,000.00	4,535,000.75	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,406,730.25	
	TURKGB 8.5% 07/10/19	5,450,000.00	5,081,580.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	3,968,510.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,050,000.00	4,097,923.50	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,622,214.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	6,650,000.00	5,672,682.75	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	6,700,000.00	6,009,900.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,565,105.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	8,350,000.00	6,804,582.00	
	トルコリラ 小計	120,200,000.00	103,705,689.75 (2,659,013,885)	
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	21,000,000.00	18,552,870.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	20,300,000.00	19,450,749.50	
	CZGB 0.95% 05/15/30	25,500,000.00	22,482,075.00	
	CZGB 0% 02/10/20	9,050,000.00	8,961,083.75	
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	43,715,037.00	
	CZGB 1% 06/26/26	21,100,000.00	19,997,419.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	29,600,000.00	31,323,608.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	37,800,000.00	40,294,800.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	33,200,000.00	35,536,118.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	41,600,000.00	45,815,536.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	26,700,000.00	30,871,207.50	
	CZGB 5.7% 05/25/24	32,600,000.00	41,114,631.00	
	チェココルナ 小計	341,550,000.00	358,115,135.25 (1,822,806,038)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.75% 10/26/22	496,000,000.00	503,214,320.00	
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	232,325,300.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	291,000,000.00	305,903,565.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	235,000,000.00	238,366,375.00	
	HGB 2% 10/30/19	173,000,000.00	177,562,010.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	572,000,000.00	609,471,720.00	
	HGB 3% 06/26/24	358,000,000.00	381,461,530.00	
	HGB 3% 10/27/27	318,000,000.00	326,034,270.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	497,000,000.00	606,253,025.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	423,000,000.00	520,761,645.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	210,000,000.00	225,042,300.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	277,434,570.00	
	HGB 7% 06/24/22	433,000,000.00	533,419,195.00	



ハンガリーフォリント 小計		4,473,000,000.00	4,937,249,825.00 (2,038,096,727)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	12,050,000.00	12,037,588.50
	POLGB 1.75% 07/25/21	9,250,000.00	9,187,007.50
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,301,390.50
	POLGB 2.5% 01/25/23	6,950,000.00	6,947,359.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	12,450,000.00	11,878,171.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	9,800,000.00	9,248,015.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,900,000.00	2,775,981.50
	POLGB 2% 04/25/21	9,200,000.00	9,227,784.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000.00	8,539,670.25
	POLGB 3.25% 07/25/25	9,350,000.00	9,490,577.25
	POLGB 4% 10/25/23	8,800,000.00	9,398,356.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	6,250,000.00	6,789,312.50
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,871,814.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,328,637.25
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,400,000.00	7,191,456.00
ポーランドズロチ 小計		122,200,000.00	124,213,120.75 (3,794,710,838)
ロシアルー ブル	RFLB 6.4% 05/27/20	98,800,000.00	98,635,004.00
	RFLB 6.8% 12/11/19	81,200,000.00	81,599,504.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	151,000,000.00	149,040,775.00
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	164,626,761.00
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	176,687,374.50
	RFLB 7.5% 08/18/21	128,200,000.00	131,652,426.00
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	66,167,244.00
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	64,492,812.50
	RFLB 7.7% 03/23/33	165,200,000.00	168,728,672.00
	RFLB 7.75% 09/16/26	175,000,000.00	180,256,125.00
	RFLB 7% 01/25/23	65,200,000.00	65,909,702.00
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	108,236,088.00
	RFLB 7% 12/15/21	76,600,000.00	77,218,928.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	150,000,000.00	158,617,500.00
	RFLB 8.5% 09/17/31	107,400,000.00	117,688,920.00
ロシアルーブル 小計		1,769,650,000.00	1,809,557,836.00 (3,166,726,213)
マレーシア リンギット	MGS 3.492% 03/31/20	11,550,000.00	11,510,383.50
	MGS 3.62% 11/30/21	14,100,000.00	14,087,169.00
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,556,779.50
	MGS 3.659% 10/15/20	5,100,000.00	5,095,078.50
	MGS 3.8% 08/17/23	4,750,000.00	4,713,140.00
	MGS 3.899% 11/16/27	8,000,000.00	7,852,480.00
	MGS 3.9% 11/30/26	8,350,000.00	8,188,845.00

	MGS 3.955% 09/15/25	5,950,000.00	5,863,487.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	5,550,000.00	5,542,785.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,250,000.00	2,276,077.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,722,237.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	5,600,000.00	5,423,852.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,108,176.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	5,800,000.00	5,817,574.00	
マレーシアリングット 小計		90,300,000.00	89,758,064.00 (2,498,864,501)	
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	85,500,000.00	85,555,575.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	81,000,000.00	78,204,285.00	
	THAIGB 2.55% 06/26/20	101,750,000.00	103,683,758.75	
	THAIGB 2% 12/17/22	67,000,000.00	67,140,365.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	61,000,000.00	62,683,600.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,387,780.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	76,000,000.00	81,077,180.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	137,000,000.00	145,923,495.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	97,570,700.00	
	THAIGB 3.875% 06/13/19	79,700,000.00	81,746,297.50	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	113,186,800.00	
タイバーツ 小計		956,950,000.00	1,007,159,836.25 (3,444,486,639)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	23,883,125.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	15,000,000.00	14,999,025.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	21,526,100.00	
フィリピンペソ 小計		60,000,000.00	60,408,250.00 (128,065,490)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,799,904,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	13,137,460,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	20,627,962,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,887,558,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	25,500,000,000.00	24,110,505,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	25,700,000,000.00	23,585,789,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	24,114,470,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	18,300,000,000.00	18,050,937,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	20,000,000,000.00	19,474,800,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	30,800,000,000.00	30,903,642,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	35,801,616,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	30,500,000,000.00	31,666,625,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	17,460,046,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	32,500,000,000.00	33,792,850,000.00	
INDOGB 8.375% 03/15/24	46,500,000,000.00	48,946,830,000.00		

	INDOGB 8.375% 03/15/34	22,000,000,000.00	23,044,010,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,000,000,000.00	42,386,400,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	21,900,000,000.00	23,884,578,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,007,229,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	36,749,050,000.00	
	インドネシアルピア 小計	479,800,000,000.00	496,432,262,000.00 (3,872,171,643)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	64,250,000.00	72,192,585.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	30,300,000.00	22,524,565.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	21,499,754.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	21,000,000.00	20,600,265.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	9,000,000.00	8,995,590.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	24,100,000.00	24,038,906.50	
	SAGB 7% 02/28/31	36,300,000.00	30,952,284.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	29,000,000.00	27,204,465.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000.00	29,167,531.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	35,500,000.00	33,281,427.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000.00	55,001,970.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	22,800,000.00	22,207,884.00	
	SAGB 8% 01/31/30	32,300,000.00	30,269,299.00	
	SAGB 9% 01/31/40	24,200,000.00	23,428,625.00	
	南アフリカランド 小計	448,000,000.00	421,365,151.50 (3,686,945,075)	
	合計		41,165,142,327 (41,165,142,327)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券 15銘柄	100.0%	10.4%
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%	7.9%
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%	6.5%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.4%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	5.0%

ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	9.2%
ロシアルーブル	国債証券	15銘柄	100.0%	7.7%
マレーシアリングgit	国債証券	14銘柄	100.0%	6.1%
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%	9.4%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	9.0%

(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

	2018年 5月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,964,999,074
投資証券	95,576,653,110
派生商品評価勘定	116,327,800
未収入金	78,156,826
未収配当金	886,978,764
差入委託証拠金	67,158,000
流動資産合計	98,690,273,574
資産合計	98,690,273,574
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	116,327,800
未払金	71,170,218
未払解約金	80,123,169
未払利息	3,179
その他未払費用	42,288
流動負債合計	267,666,654
負債合計	267,666,654
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	61,085,196,735
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	37,337,410,185
元本等合計	98,422,606,920
純資産合計	98,422,606,920
負債純資産合計	98,690,273,574

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,085,196,735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 1.6112円 (1万口当たり純資産額) (16,112円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 5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

2018年 5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。

	2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	56,695,653,318円
期中追加設定元本額	8,015,368,098円
期中一部解約元本額	3,625,824,681円
期末元本額	61,085,196,735円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,765,884,268円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,960,229円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,062,464,701円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	29,903,626,934円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,392,325,479円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,714,327,571円
分散投資コア戦略ファンド A	2,117,277,275円
分散投資コア戦略ファンド S	3,222,389,528円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,182,377,175円
S M T インデックスバランス・オープン	43,165,942円

区分	2018年 5月10日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	714,019,157円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	685,376円
グローバル経済コア	449,841,059円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,000,071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）	1,506,851,970円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5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	6,606,613,611
合計	6,606,613,611

(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

（2018年 5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	2,719,050,200	-	2,835,378,000	116,327,800
	合計	2,719,050,200	-	2,835,378,000	116,327,800

## (注)1.時価の算定方法

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

## 2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

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



投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,904	1,877,824,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	13,107	1,087,881,000	
	森ヒルズリート投資法人	12,620	1,768,062,000	
	産業ファンド投資法人	13,644	1,653,652,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,877	3,078,191,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,976	958,550,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,315	2,580,432,500	
	G L P 投資法人	24,387	2,884,982,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,453	1,121,265,400	
	日本プロロジスリート投資法人	15,658	3,618,563,800	
	星野リゾート・リート投資法人	1,856	998,528,000	
	O n e リート投資法人	1,284	317,019,600	
	イオンリート投資法人	11,156	1,301,905,200	
	ヒューリックリート投資法人	7,978	1,330,730,400	
	日本リート投資法人	3,156	1,047,792,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	69,219	961,451,910	
	日本ヘルスケア投資法人	570	100,320,000	
	積水ハウス・リート投資法人	29,433	2,045,593,500	
	トーセイ・リート投資法人	1,889	214,023,700	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,272	984,696,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,448	154,646,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,040	198,900,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	34,765	5,371,192,500	
	いちごホテルリート投資法人	1,838	245,924,400	
	ラサールロジポート投資法人	8,862	983,682,000	
	スターアジア不動産投資法人	2,755	292,856,500	
	マリモ地方創生リート投資法人	941	110,943,900	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,222	776,589,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,972	179,452,000	
	さくら総合リート投資法人	2,824	264,608,800	
	投資法人みらい	1,495	273,884,000	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,544	368,880,000	
	三菱地所物流リート投資法人	1,089	295,663,500	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,176	135,475,200	
	ザイマックス・リート投資法人	1,083	126,061,200	
	日本ビルファンド投資法人	11,376	7,075,872,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,689	6,639,352,000	
	日本リテールファンド投資法人	22,183	4,565,261,400	
	オリックス不動産投資法人	23,309	3,999,824,400	
	日本プライムリアルティ投資法人	7,417	2,996,468,000	
	プレミア投資法人	10,611	1,145,988,000	

東急リアル・エステート投資法人	7,876	1,153,046,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,461	805,788,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,910	4,472,066,000	
森トラスト総合リート投資法人	8,396	1,359,312,400	
インヴィンシブル投資法人	32,219	1,610,950,000	
フロンティア不動産投資法人	3,996	1,808,190,000	
平和不動産リート投資法人	7,316	791,591,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,826	1,760,850,000	
福岡リート投資法人	6,076	1,045,072,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,434	2,297,346,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,096	758,606,400	
大和証券オフィス投資法人	2,533	1,598,323,000	
阪急リート投資法人	5,128	718,945,600	
スターツプロシード投資法人	1,851	302,823,600	
大和ハウスリート投資法人	13,669	3,575,810,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,906	2,756,557,800	
日本賃貸住宅投資法人	13,214	1,132,439,800	
ジャパンエクセレント投資法人	10,520	1,495,944,000	
合計	594,820	95,576,653,110	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2018年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	500,525,255
コール・ローン	6,633,290
投資証券	64,955,314,128
派生商品評価勘定	189,700
未収入金	53,402,028
未収配当金	135,416,618
流動資産合計	65,651,481,019
資産合計	65,651,481,019
負債の部	

	2018年 5月10日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	559,800
未払金	309,628,590
未払解約金	14,138,886
未払利息	10
その他未払費用	771
流動負債合計	324,328,057
<b>負債合計</b>	324,328,057
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	38,608,528,990
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,718,623,972
元本等合計	65,327,152,962
純資産合計	65,327,152,962
負債純資産合計	65,651,481,019

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 5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。  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。 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>

	2018年 5月10日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2018年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	38,608,528,990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 1.6920円 (1万口当たり純資産額) (16,920円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 5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

2018年 5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	2018年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月11日
期首元本額	35,325,721,632円
期中追加設定元本額	4,634,930,467円
期中一部解約元本額	1,352,123,109円

区分	2018年 5月10日現在
期末元本額	38,608,528,990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）	181,759,913円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,676,065,225円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,225,601円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,143,221,085円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,798,002,719円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,106,915,273円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,611,083,123円
分散投資コア戦略ファンドA	684,016,795円
分散投資コア戦略ファンドS	1,476,649,584円
コア投資戦略ファンド（切替型）	395,882,387円
SMT インデックスバランス・オープン	198,596,153円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	585,684,777円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	622,000円
グローバル経済コア	439,522,543円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	1,829,918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）	705,781,768円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	595,670,126円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 5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		2,476,141,077
合計		2,476,141,077

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2018年 5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	27,003,800	-	27,193,500	189,700
	イギリスポンド	14,809,100	-	14,889,000	79,900

オーストラリアドル	12,194,700	-	12,304,500	109,800
売建	37,951,200	-	38,511,000	559,800
カナダドル	37,951,200	-	38,511,000	559,800
合計	64,955,000	-	65,704,500	370,100

## (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	46,190	1,115,950.40	
		AGREE REALTY CORP	17,490	889,716.30	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	38,120	866,086.40	
		ALEXANDER'S INC	2,050	802,759.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	53,490	6,945,141.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,370	784,963.30	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	72,940	2,901,553.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	137,470	2,849,753.10	
		AMERICOLD REALTY TRUST	24,000	515,760.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	83,783	3,453,535.26	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	110,603	2,049,473.59	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	20,500	286,795.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	328,654.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	72,670	12,042,872.40	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	83,880.00	
		BOSTON PROPERTIES	81,320	10,104,010.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	153,845.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	89,338	1,482,117.42	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	158,240	2,326,128.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	49,190	4,286,908.50	

CARETRUST REIT INC	38,680	586,388.80
CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	385,569.60
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	131,953.50
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	472,189.40
CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,960	927,561.60
CITY OFFICE REIT INC	13,300	157,073.00
CLIPPER REALTY INC	7,300	61,904.00
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	280,610	1,781,873.50
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	65,530	1,482,288.60
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	7,200	194,184.00
CORECIVIC INC	62,220	1,279,865.40
CORESITE REALTY CORP	18,950	1,980,085.50
CORPORATE OFFICE PPTYS	55,120	1,543,360.00
COUSINS PROPERTIES INC	231,693	2,129,258.67
CUBESMART	97,480	2,972,165.20
CYRUSONE INC	49,810	2,691,234.30
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	50,080	3,292,760.00
DDR CORPORATION	168,119	1,260,892.50
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	105,350	1,245,237.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	108,170	11,457,366.40
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	85,050	3,273,574.50
DUKE REALTY CORP	189,170	5,429,179.00
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	25,160	526,598.80
EASTGROUP PROPERTIES, INC	18,530	1,714,395.60
EDUCATION REALTY TRUST INC	39,086	1,342,604.10
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	63,310	1,102,227.10
EPR PROPERTIES	33,260	1,984,291.60
EQUITY COMMONWEALTH	67,010	2,126,227.30
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	47,040	4,211,491.20
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	193,780	12,122,876.80
ESSEX PROPERTY TRUST	34,820	8,492,598.00
EXTRA SPACE STORAGE INC	66,660	6,286,704.60
FARMLAND PARTNERS INC	13,000	99,320.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	38,820	4,604,440.20
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	65,170	2,093,260.40
FOREST CITY REALTY TRUST-A	142,490	2,814,177.50
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	31,500	726,705.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	419,640.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	106,250	3,647,562.50
GEO GROUP INC/THE	67,530	1,607,214.00
GETTY REALTY CORP	17,300	439,766.00
GGP INC	333,730	6,774,719.00



GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	276,150.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	63,250.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	82,175.00	
GLOBAL NET LEASE INC	32,910	647,997.90	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	56,710	787,701.90	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	87,080	2,396,441.60	
HCP INC	248,410	5,932,030.80	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	63,510	1,764,307.80	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	111,780	2,908,515.60	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	348,610.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	55,400	2,566,682.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	88,293	2,414,813.55	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	387,460	7,985,550.60	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	83,130	2,891,261.40	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	40,000	379,600.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,000	215,500.00	
INFREIT INC	19,000	400,520.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	346,283.80	
INVITATION HOMES INC	151,860	3,603,637.80	
IRON MOUNTAIN INC	149,100	4,982,922.00	
ISTAR INC	35,000	374,150.00	
JBG SMITH PROPERTIES	49,300	1,834,946.00	
KILROY REALTY CORPORATION	52,510	3,885,214.90	
KIMCO REALTY CORP	226,890	3,283,098.30	
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	623,747.30	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	59,970	1,844,077.50	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	107,306	890,639.80	
LIBERTY PROPERTY TRUST	78,650	3,420,488.50	
LIFE STORAGE INC	25,140	2,313,634.20	
LTC PROPERTIES INC	19,700	751,161.00	
MACERICH CO/THE	57,780	3,321,194.40	
MACK-CALI REALTY CORP	47,270	862,677.50	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	579,000	544,260.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	11,500	120,750.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	199,540	2,637,918.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,130	5,562,025.00	
MONMOUTH REIT -CL A	42,460	675,538.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	82,060	3,291,426.60	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,440	698,582.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,710	1,607,868.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	346,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	284,700.00	

NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	435,414.84	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	106,176	3,011,151.36	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	196,000.00	
PARAMOUNT GROUP INC	110,840	1,677,009.20	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	107,340	3,247,035.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35,900	1,342,301.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	322,897.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	95,870	1,462,976.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,300,312.50	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	17,500	256,025.00	
PROLOGIS INC	283,280	18,475,521.60	
PS BUSINESS PARKS INC	10,900	1,292,304.00	
PUBLIC STORAGE	79,660	16,851,276.40	
QTS REALTY TRUST INC	24,800	857,336.00	
QUALITY CARE PROPERTIES	51,424	1,094,302.72	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	39,850	468,636.00	
REALTY INCOME CORP	149,990	7,929,971.30	
REGENCY CENTERS CORP	79,230	4,646,839.50	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,150	1,070,223.00	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	118,480	1,387,400.80	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	44,220	1,434,496.80	
RLJ LODGING TRUST	91,870	1,977,042.40	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,930	2,212,838.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	97,080	1,912,476.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	332,789.00	
SELECT INCOME REIT	30,920	638,188.80	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	124,370	2,016,037.70	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	12,000	448,320.00	
SIMON PROPERTY GROUP	165,130	26,410,892.20	
SL GREEN REALTY CORP	47,900	4,833,589.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	239,010	2,026,804.80	
STAG INDUSTRIAL INC	47,660	1,247,738.80	
STORE CAPITAL CORP	89,330	2,333,299.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	54,080	799,302.40	
SUN COMMUNITIES INC	42,170	3,966,931.90	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	117,150	1,945,861.50	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,110	1,040,149.80	
TAUBMAN CENTERS INC	33,120	1,860,019.20	
TERRENO REALTY CORP	30,340	1,170,820.60	
TIER REIT INC	26,300	556,771.00	
UDR INC	142,040	5,170,256.00	

	UMH PROPERTIES INC	14,000	200,200.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	359,790.60	
	URBAN EDGE PROPERTIES	54,720	1,140,912.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	345,510.00	
	VENTAS INC	187,750	9,978,912.50	
	VEREIT INC	518,540	3,624,594.60	
	VORNADO REALTY TRUST	91,400	6,391,602.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	91,000	635,180.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	42,580	1,248,445.60	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	61,770	1,698,675.00	
	WELLTOWER INC	195,090	10,804,084.20	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	16,960.00	
	WHITESTONE REIT	16,110	191,225.70	
	WP CAREY INC	55,400	3,655,846.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,410	1,276,646.40	
	アメリカドル 小計	12,423,757	415,539,682.01 (45,692,743,433)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	77,440.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	25,510	1,096,419.80	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	600,909.30	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,100	516,927.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	35,850	1,417,867.50	
	CHOICE PROPERTIES REIT	66,000	762,300.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	52,000	648,440.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	271,588.14	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	190,676.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	50,000	697,000.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	21,000	227,430.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,790	447,202.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,940	617,656.20	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	77,740	1,609,218.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	26,000	273,260.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	259,560.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	115,430.70	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	178,577.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	409,741.29	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	23,000	260,590.00	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	82,320	1,930,404.00
	SLATE OFFICE REI	17,000	128,860.00
	SLATE RETAIL REIT	10,300	131,119.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	33,810	970,347.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,000	174,800.00
	カナダドル 小計	724,390	14,013,762.93 (1,199,437,969)
ユーロ	AEDIFICA	9,300	728,190.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	73,000	915,420.00
	ALTAREA	2,000	434,000.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	5,100	93,432.00
	BEFIMMO S.C.A.	12,800	677,120.00
	BENI STABILI SPA	547,000	426,933.50
	COFINIMMO	10,700	1,196,260.00
	EUROCOMMERCIAL	26,600	945,896.00
	FONCIERE DES REGIONS	28,400	2,700,840.00
	GECINA SA	25,330	3,662,718.00
	GREEN REIT PLC	337,170	536,100.30
	HAMBORNER REIT AG	44,000	407,440.00
	HIBERNIA REIT PLC	378,290	584,836.34
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	59,300	1,058,505.00
	ICADE	23,800	1,883,770.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	28,000	219,520.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	165,000	1,671,450.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	8,000	183,200.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	190,000	264,100.00
	KLEPIERRE	111,150	3,820,225.50
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	443,043.60
	MERCIALYS	28,020	446,919.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	178,210	2,298,909.00
	NSI NV	9,200	329,820.00
	RETAIL ESTATES	3,600	266,400.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	52,480	10,320,192.00
	VASTNED RETAIL	8,500	358,275.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,600	896,120.00
	WERELDHAVE NV	21,780	742,480.20
	ユーロ 小計	2,441,722	38,512,115.44 (5,015,432,793)
イギリスポンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	39,000	36,738.00
	ASSURA PLC	1,211,290	726,774.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	77,290	755,123.30

	BRITISH LAND CO PLC	524,730	3,593,351.04
	CAPITAL & REGIONAL PLC	220,000	119,900.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	102,410.00
	DERWENT LONDON PLC	58,910	1,842,115.70
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	255,200.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	151,531	1,066,929.77
	HAMMERSON PLC	421,080	2,328,572.40
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	193,580	201,129.62
	INTU PROPERTIES PLC	471,100	923,120.45
	LAND SECURITIES GROUP PLC	396,360	3,890,669.76
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	378,110	735,802.06
	LXI REIT PLC	100,000	104,500.00
	NEWRIVER REIT PL	173,000	491,320.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	388,000	446,200.00
	RDI REIT PLC	612,000	225,828.00
	REGIONAL REIT LTD	170,000	169,660.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	108,990	598,355.10
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	153,500.00
	SEGRO PLC	525,190	3,393,777.78
	SHAFTESBURY PLC	131,570	1,330,172.70
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	805,000	1,211,525.00
	UNITE GROUP PLC	138,000	1,168,170.00
	WORKSPACE GROUP PLC	61,920	688,550.40
	イギリスbond 小計	7,994,651	26,559,395.08 (3,954,693,927)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	159,010	604,238.00
	ARENA REIT	114,000	250,800.00
	BWP TRUST	247,960	793,472.00
	CHARTER HALL GROUP	237,600	1,485,000.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	101,000	420,160.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	159,170	655,780.40
	CROMWELL PROPERTY GROUP	855,940	950,093.40
	DEXUS	536,230	5,255,054.00
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	290,640.00
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	271,692.44
	GOODMAN GROUP	847,940	7,784,089.20
	GPT GROUP	955,000	4,727,250.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	135,200	466,440.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	244,140.00
	INDUSTRIA REIT	75,000	189,750.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	243,000.00
	INVESTA OFFICE FUND	279,180	1,236,767.40
	MIRVAC GROUP	1,973,120	4,557,907.20

	NATIONAL STORAGE REIT	294,000	471,870.00		
	PROPERTYLINK GROUP	150,000	156,000.00		
	RURAL FUNDS GROUP	122,000	254,980.00		
	SCENTRE GROUP	2,808,080	11,653,532.00		
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	392,000	948,640.00		
	STOCKLAND	1,292,980	5,521,024.60		
	VICINITY CENTERS	1,744,300	4,465,408.00		
	VIVA ENERGY REIT	230,000	471,500.00		
	WESTFIELD CORP	1,009,690	9,248,760.40		
	オーストラリアドル 小計	15,207,688	63,617,989.04 (5,219,219,820)		
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	417,075.00		
	GOODMAN PROPERTY TRUST	520,000	712,400.00		
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	145,860.00		
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,060,800.00		
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	530,000	667,800.00		
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	302,760.00		
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	386,167.60		
	ニュージーランドドル 小計	2,708,460	3,692,862.60 (281,654,630)		
香港ドル	CHAMPION REIT	1,073,000	5,772,740.00		
	FORTUNE REIT	739,000	6,798,800.00		
	LINK REIT	1,143,000	76,581,000.00		
	PROSPERITY REIT	592,000	1,888,480.00		
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	483,000	1,593,900.00		
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,792,560.00		
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	600,000	3,138,000.00		
	香港ドル 小計	5,151,000	98,565,480.00 (1,380,902,374)		
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	389,200.00		
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	348,000	278,400.00		
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,283,866	3,402,244.90		
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	773,920.00		
	CACHE LOGISTICS TRUST	518,200	417,151.00		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,399,528	2,463,169.28		
	CAPITALAND MALL TRUST	1,445,600	3,021,304.00		
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	316,560	496,999.20		
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	385,900	667,607.00		
	ESR REIT	804,679	426,479.87		
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	268,410.00		
			338,000	459,680.00	

	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	646,360.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	493,200.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	558,200	586,110.00	
	KEPPEL DC REIT	369,460	517,244.00	
	KEPPEL REIT	955,300	1,136,807.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	300,510.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,040,130	1,653,806.70	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	993,000	1,141,950.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	645,760	1,265,689.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,085,452	1,324,251.44	
	QUE HOSPITALITY TRUST	590,000	469,050.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	542,520.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	205,772.20	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	211,992.00	
	SPH REIT	322,300	319,077.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	483,815.50	
	SUNTEC REIT	1,208,500	2,296,150.00	
	シンガポールドル 小計	19,280,275	26,658,870.69 (2,174,564,082)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	83,370	1,194,692.10	
	イスラエルシェケル 小計	83,370	1,194,692.10 (36,665,100)	
	合計	66,015,313	64,955,314,128 (64,955,314,128)	

(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 160銘柄	100.0%	70.3%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 29銘柄	100.0%	7.7%
イギリスポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	6.1%
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%	2.1%
シンガポールドル	投資証券	29銘柄	100.0%	3.3%
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】

(2018年 5月31日現在)

資産総額	8,680,307円
負債総額	33,289円
純資産総額( - )	8,647,018円
発行済口数	8,416,945口
1口当たり純資産額( / )	1.0273円
(1万口当たり純資産額)	(10,273円)

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	206,963,392,936円
負債総額	1,427,833,389円
純資産総額( - )	205,535,559,547円
発行済口数	130,889,114,032口
1口当たり純資産額( / )	1.5703円
(1万口当たり純資産額)	(15,703円)

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	335,912,482,115円
負債総額	2,552,271,928円
純資産総額( - )	333,360,210,187円
発行済口数	137,013,721,170口
1口当たり純資産額( / )	2.4330円
(1万口当たり純資産額)	(24,330円)

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	49,765,828,013円
負債総額	50,318,937円
純資産総額（ - ）	49,715,509,076円
発行済口数	17,273,216,157口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8782円
（1万口当たり純資産額）	（28,782円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	389,345,053,965円
負債総額	8,820,372,142円
純資産総額（ - ）	380,524,681,823円
発行済口数	273,062,878,573口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3935円
（1万口当たり純資産額）	（13,935円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	243,900,202,772円
負債総額	268,415,723円
純資産総額（ - ）	243,631,787,049円
発行済口数	91,812,793,285口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6536円
（1万口当たり純資産額）	（26,536円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	43,004,608,245円
負債総額	3,201,641円
純資産総額（ - ）	43,001,406,604円
発行済口数	26,215,586,207口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6403円
（1万口当たり純資産額）	（16,403円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	103,886,114,606円
負債総額	687,700,782円
純資産総額（ - ）	103,198,413,824円
発行済口数	63,979,448,211口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6130円
（1万口当たり純資産額）	（16,130円）

## グローバル R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 5月31日現在)

資産総額	66,051,984,865円
負債総額	410,688,684円
純資産総額（ - ）	65,641,296,181円
発行済口数	38,883,126,432口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6882円
（1万口当たり純資産額）	（16,882円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成30年 5月31日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

###### [ DO（実行） ]

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

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

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成30年 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成30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	497	9,459,331
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	242,723
単位型公社債投資信託	0	0
合計	565	9,702,054

## 3【委託会社等の経理状況】

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

なお、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、当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178



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

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136
収益分配金	129	116
投資有価証券売却益	307	499
貸倒引当金戻入	3,000	2,750
その他	1,591	4,351
営業外収益合計	9,697	9,854
営業外費用		
長期前払費用償却	1 4,644	1 -
投資有価証券売却損	604	2,224
固定資産除却損	-	7,891

その他	0	1,182
営業外費用合計	5,249	11,298
経常利益	6,265,794	5,514,818
特別損失		
統合関連費用	-	51,569
特別損失合計	-	51,569
税引前当期純利益	6,265,794	5,463,248
法人税、住民税及び事業税	1,889,846	1,739,837
法人税等調整額	45,558	50,178
法人税等合計	1,935,405	1,689,659
当期純利益	4,330,389	3,773,589

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			

剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

## 重要な会計方針

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

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

・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

## (1) 概要

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

## (2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1有形固定資産の減価償却累計額

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

計	362,567	〃	392,342	〃
---	---------	---	---------	---

## (損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 其他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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



## 2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## (セグメント情報)

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

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-

普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成30年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成30年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三重銀行	15,295	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成30年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年7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2017年11月1日から2018年5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2018年5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

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。