

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年2月12日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT 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】

2019年 2月13日から2019年 8月 9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】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 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						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

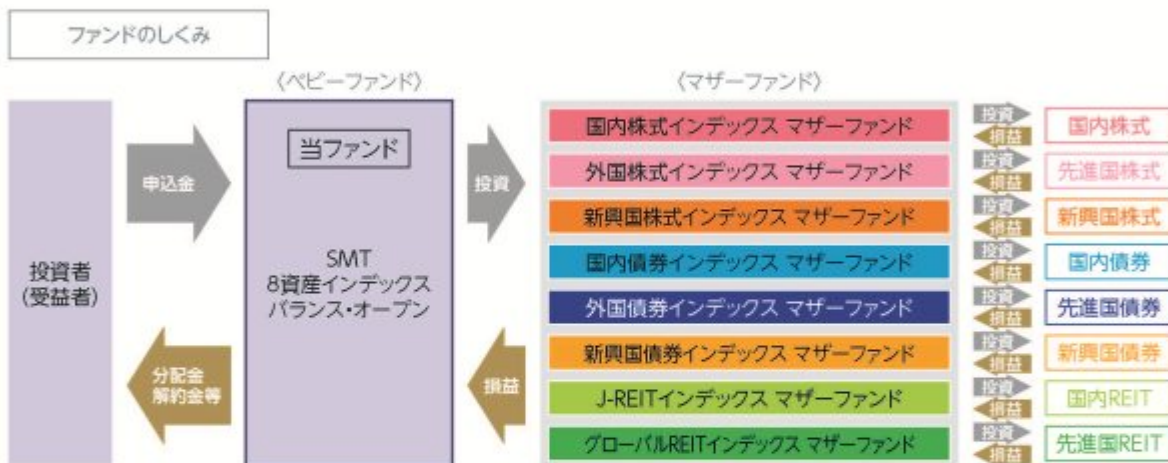
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

< ファンドの特色 >

特色1

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

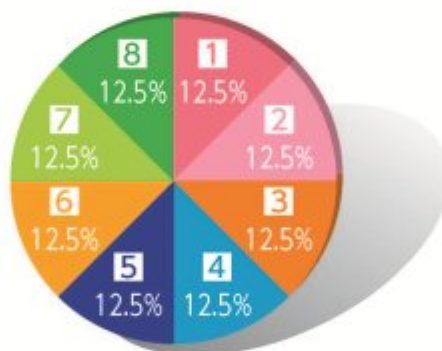
ファンドマネジャー

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

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

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

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

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。

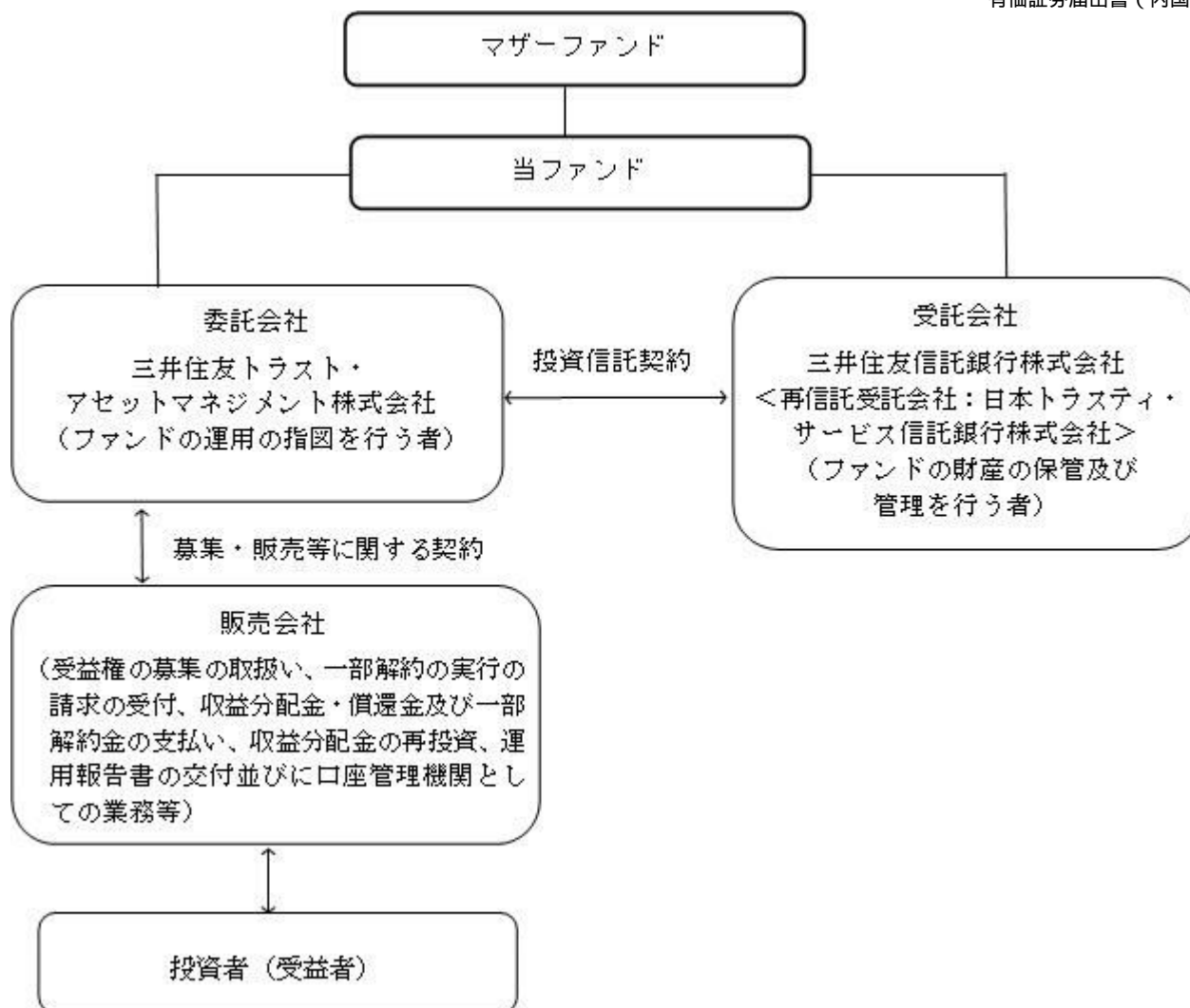
(2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2018年11月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、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がた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。

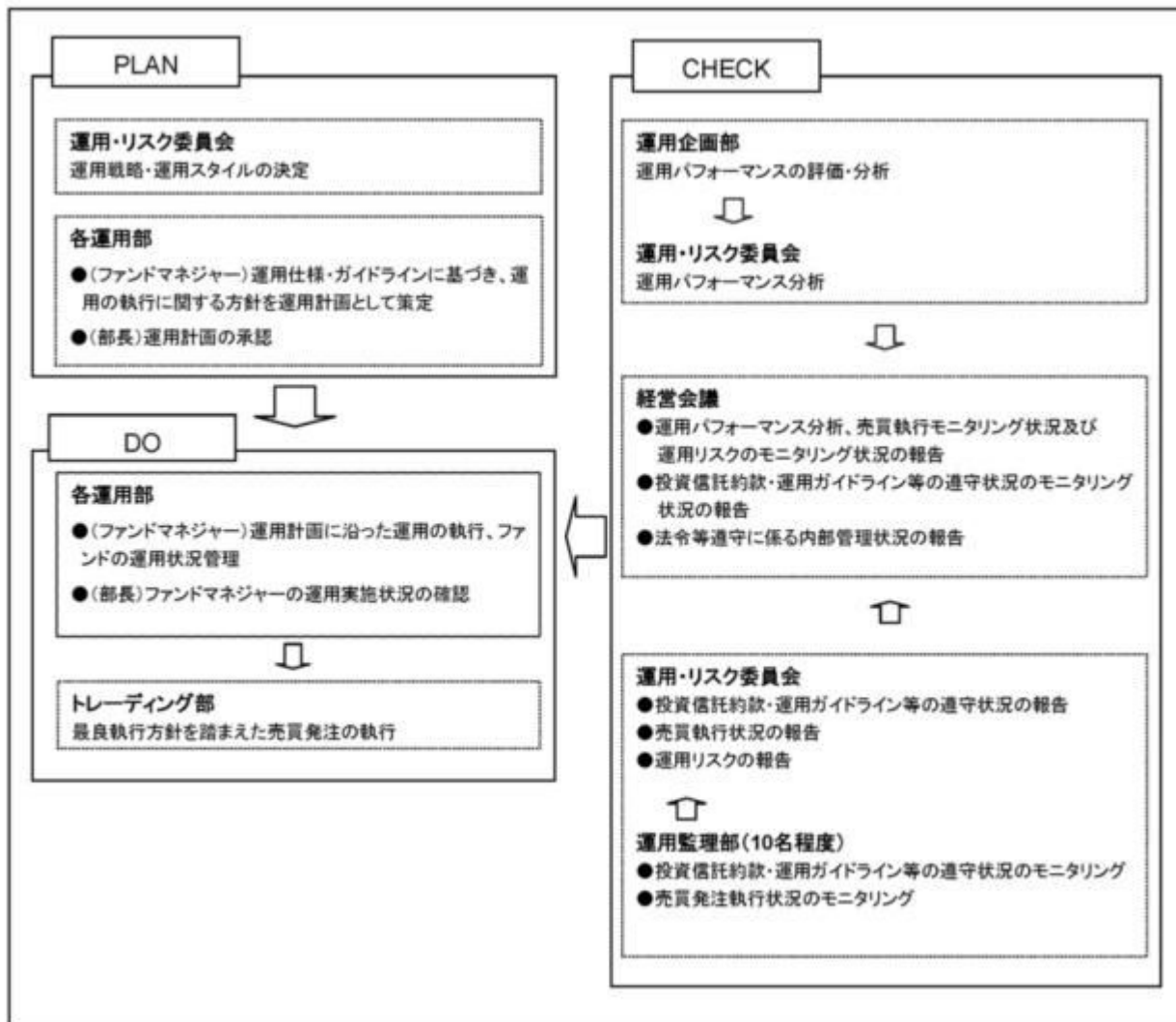
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。



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

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、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、
- (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、

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、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、
- (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、

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、
 - 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、
- (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、
- (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、

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ. 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

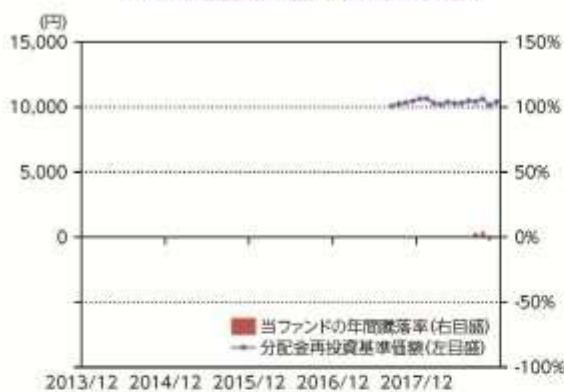
ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

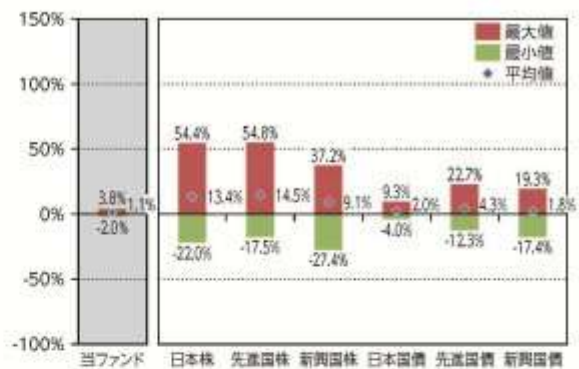
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2018年8月～2018年11月の4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2013年12月～2018年11月の5年間の各月末における最近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{#1}

先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{#2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{#4}

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{#5}

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

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

- #1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- #2 MSCIロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が発売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.が発売した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- #4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公債固定金利国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- #5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- #6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright © 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 2 ）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.54%（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）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。 ）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

です。

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率 （所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、2018年11月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2018年11月30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	14,666,355	98.99
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		149,950	1.01
合計（純資産総額）		14,816,305	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	1,120,505	1.6907	1,894,444	1.7237	1,931,414	13.04
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	703,688	2.7173	1,912,132	2.7292	1,920,505	12.96
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	754,222	2.5306	1,908,677	2.4924	1,879,822	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	1,032,483	1.8119	1,870,848	1.8121	1,870,962	12.63
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	1,125,289	1.6291	1,833,298	1.6492	1,855,826	12.53
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	1,194,928	1.5162	1,811,862	1.5136	1,808,643	12.21
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	640,029	2.6823	1,716,766	2.7333	1,749,391	11.81
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,187,670	1.3834	1,643,111	1.3891	1,649,792	11.13

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

(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
第3期計算期間末	(2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
	2017年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	
	6月末日	9,513,168		10,296	
	7月末日	10,529,223		10,477	
	8月末日	11,019,954		10,407	
	9月末日	12,275,993		10,616	
	10月末日	13,154,092		10,132	
	11月末日	14,816,305		10,394	

【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
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12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
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7

(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
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817

(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	242,447,522,790	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,230,778,307	1.72
合計(純資産総額)		246,678,301,097	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	4,203,360,000	1.70

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,145,100	6,930.32	7,935,911,260	6,803.00	7,790,115,300	3.16
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,058,100	679.40	4,795,284,032	624.50	4,407,783,450	1.79
日本	株式	ソニー	電気機器	688,900	5,356.36	3,689,999,778	5,937.00	4,089,999,300	1.66
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	421,400	8,022.76	3,380,794,535	9,526.00	4,014,256,400	1.63
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	689,700	5,088.13	3,509,287,252	4,680.00	3,227,796,000	1.31
日本	株式	キーエンス	電気機器	50,400	64,599.54	3,255,817,142	61,600.00	3,104,640,000	1.26
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	714,300	4,508.43	3,220,377,369	4,183.00	2,987,916,900	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	866,800	3,453.54	2,993,531,422	3,202.00	2,775,493,600	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,771,400	192.87	2,656,220,998	188.30	2,593,154,620	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	888,600	2,934.88	2,607,942,184	2,664.00	2,367,230,400	0.96
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	703,400	3,017.87	2,122,769,994	3,123.00	2,196,718,200	0.89
日本	株式	任天堂	その他製品	63,300	41,132.97	2,603,717,156	34,610.00	2,190,813,000	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	710,200	3,072.97	2,182,424,043	3,062.00	2,174,632,400	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	92,000	22,474.45	2,067,650,052	23,325.00	2,145,900,000	0.87
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	424,200	4,866.72	2,064,465,170	4,943.00	2,096,820,600	0.85
日本	株式	花王	化学	249,500	8,359.79	2,085,767,805	8,358.00	2,085,321,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	367,400	5,287.64	1,942,681,725	5,605.00	2,059,277,000	0.83
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	724,100	2,819.26	2,041,428,867	2,628.50	1,903,296,850	0.77
日本	株式	ファナック	電気機器	97,700	22,903.85	2,237,706,414	19,390.00	1,894,403,000	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	182,700	10,579.89	1,932,946,506	10,320.00	1,885,464,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	123,700	16,657.82	2,060,573,384	15,120.00	1,870,344,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	107,800	16,348.05	1,762,320,024	17,315.00	1,866,557,000	0.76
日本	株式	信越化学工業	化学	177,300	10,718.58	1,900,404,704	10,135.00	1,796,935,500	0.73
日本	株式	キヤノン	電気機器	553,300	3,688.51	2,040,857,317	3,220.00	1,781,626,000	0.72
日本	株式	ダイキン工業	機械	140,300	12,802.39	1,796,175,898	12,610.00	1,769,183,000	0.72
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	405,600	4,481.53	1,817,712,348	4,255.00	1,725,828,000	0.70
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	595,500	2,937.33	1,749,183,977	2,823.50	1,681,394,250	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	947,400	1,701.06	1,611,591,872	1,744.50	1,652,739,300	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,027,800	1,546.95	1,589,956,621	1,498.00	1,539,644,400	0.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	462,700	3,951.61	1,828,413,341	3,288.00	1,521,357,600	0.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.31

建設業	2.92	
食料品	4.31	
繊維製品	0.66	
パルプ・紙	0.28	
化学	7.21	
医薬品	5.14	
石油・石炭製品	0.74	
ゴム製品	0.81	
ガラス・土石製品	0.90	
鉄鋼	0.99	
非鉄金属	0.79	
金属製品	0.58	
機械	4.98	
電気機器	12.79	
輸送用機器	7.91	
精密機器	1.81	
その他製品	2.05	
電気・ガス業	1.87	
陸運業	4.52	
海運業	0.17	
空運業	0.59	
倉庫・運輸関連業	0.19	
情報・通信業	7.43	
卸売業	4.88	
小売業	5.20	
銀行業	6.59	
証券、商品先物取引業	0.91	
保険業	2.36	
その他金融業	1.19	
不動産業	2.34	
サービス業	4.76	
	小計	98.28
合計		98.28

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	252円		4,178,325,800	4,203,360,000	1.70

(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	210,130,295,075	60.81
	イギリス	20,739,023,194	6.00
	フランス	12,214,871,748	3.53
	カナダ	12,193,309,265	3.53
	スイス	11,729,814,055	3.39
	ドイツ	11,066,944,577	3.20
	オーストラリア	7,694,422,491	2.23
	オランダ	5,873,185,129	1.70
	アイルランド	5,677,755,555	1.64
	スペイン	3,746,087,709	1.08
	香港	3,005,673,850	0.87
	スウェーデン	3,004,625,535	0.87
	イタリア	2,354,189,120	0.68
	デンマーク	2,093,978,918	0.61
	フィンランド	1,487,554,117	0.43
	シンガポール	1,486,783,584	0.43
	バミューダ	1,420,484,755	0.41
	ジャージー	1,390,858,661	0.40
	ベルギー	1,234,337,521	0.36
	ノルウェー	924,918,163	0.27
	ケイマン	806,075,145	0.23
	イスラエル	679,312,490	0.20
	キュラソー	601,269,076	0.17
	ルクセンブルク	386,136,188	0.11
	ニュージーランド	286,721,496	0.08
	オーストリア	276,763,563	0.08
パナマ	242,054,429	0.07	
ポルトガル	178,696,962	0.05	
リベリア	175,876,520	0.05	

	パプアニューギニア	72,236,143	0.02
	英ヴァージン諸島	57,388,428	0.02
	マン島	46,314,381	0.01
	モーリシャス	7,988,109	0.00
	小計	323,285,945,952	93.56
投資信託受益証券	オーストラリア	167,421,597	0.05
	香港	67,914,853	0.02
	小計	235,336,450	0.07
投資証券	アメリカ	6,507,185,308	1.88
	オーストラリア	582,352,792	0.17
	フランス	429,648,481	0.12
	イギリス	243,692,377	0.07
	香港	196,512,920	0.06
	シンガポール	141,185,127	0.04
	カナダ	64,796,109	0.02
	小計	8,165,373,114	2.36
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		13,861,155,435	4.01
合計（純資産総額）		345,547,810,951	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,890,023,877	2.57
	買建	カナダ	545,859,426	0.16
	買建	ドイツ	2,288,175,081	0.66
	買建	イギリス	1,054,184,997	0.31
	買建	オーストラリア	560,918,774	0.16

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		457,347,850	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。

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	405,472	21,402.79	8,678,234,272	20,373.53	8,260,899,403	2.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	602,238	11,179.56	6,732,759,445	12,503.25	7,529,937,874	2.18
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	34,035	182,766.74	6,220,466,006	189,899.98	6,463,246,088	1.87
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	222,020	13,832.89	3,071,178,917	16,549.59	3,674,342,081	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	281,228	12,555.58	3,530,982,478	12,488.50	3,512,118,184	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,948	122,047.94	3,166,900,097	123,489.40	3,204,302,977	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,776	8,933.85	3,124,847,040	8,970.93	3,137,818,880	0.91
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	198,158	20,894.63	4,140,438,793	15,736.01	3,118,218,172	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,678	123,004.45	3,035,504,015	124,201.99	3,065,056,773	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,699	22,082.04	2,334,049,873	24,702.41	2,611,020,986	0.76
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	79,623	27,821.41	2,215,224,519	32,060.94	2,552,788,902	0.74
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	796,248	3,419.51	2,722,779,551	3,181.69	2,533,421,306	0.73
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	257,894	8,761.67	2,259,584,559	9,704.27	2,502,675,586	0.72
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	483,121	4,048.96	1,956,138,667	5,164.01	2,494,846,361	0.72
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	382,781	6,225.68	2,383,072,383	6,131.91	2,347,182,010	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	147,681	14,909.84	2,201,901,158	15,783.67	2,330,949,203	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	341,656	5,529.84	1,889,303,411	6,745.79	2,304,740,141	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	207,952	8,486.77	1,764,842,844	10,532.28	2,190,209,814	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	158,053	13,856.63	2,190,082,480	13,485.90	2,131,488,454	0.62
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	390,187	4,908.71	1,915,315,687	5,371.66	2,095,955,724	0.61
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	385,464	6,276.23	2,419,262,878	5,412.51	2,086,331,224	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	600,608	3,608.19	2,167,107,905	3,468.77	2,083,375,757	0.60

アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	223,104	6,742.92	1,504,372,563	8,840.44	1,972,339,244	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,435	21,191.71	2,022,431,573	19,932.14	1,902,223,800	0.55
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	180,510	8,626.78	1,557,220,201	10,292.00	1,857,809,642	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	333,176	4,824.09	1,607,272,831	5,557.76	1,851,712,446	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,796	40,833.83	1,870,026,110	38,870.28	1,780,103,489	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,741	21,714.85	1,666,419,368	22,315.01	1,712,476,198	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	380,181	3,616.83	1,375,052,513	4,472.98	1,700,544,823	0.49
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,377	24,841.40	1,450,166,465	28,953.37	1,690,211,464	0.49

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	6.27
		素材	4.21
		資本財	6.62
		商業・専門サービス	1.06
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	1.19
		耐久消費財・アパレル	1.63
		消費者サービス	1.84
		メディア・娯楽	2.03
		小売	4.67
		食品・生活必需品小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	4.75
		家庭用品・パーソナル用品	1.96
		ヘルスケア機器・サービス	4.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.53
		銀行	8.38
		各種金融	4.19
		保険	3.69
		不動産	0.57
		ソフトウェア・サービス	11.21
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.10		

		電気通信サービス	2.44
		公益事業	3.12
		半導体・半導体製造装置	2.70
		小計	93.56
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.36
合計			95.99

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	571	アメリカドル	80,092,357	9,088,079,748	78,346,910	8,890,023,877	2.57
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	35	カナダドル	6,467,427.5	552,447,657	6,390,300	545,859,426	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	59	スイスフラン	5,257,843	598,868,318	5,302,330	603,935,387	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	411	ユーロ	13,399,199.5	1,731,042,583	13,036,920	1,684,239,694	0.49
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	47	オーストラリアドル	7,029,704	584,027,808	6,751,550	560,918,774	0.16
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	103	イギリス債券	7,366,896.25	1,068,273,625	7,269,740	1,054,184,997	0.31

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,394,000.00	158,358,400	158,121,420	0.05
	ユーロ	買建	1,319,000.00	170,292,133	170,388,420	0.05
	イギリス債券	買建	649,000.00	94,561,896	94,098,510	0.03
	スイスフラン	買建	305,000.00	34,878,275	34,739,500	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	7,451,806,105	14.51
	韓国	7,029,716,566	13.69
	台湾	5,608,255,967	10.92
	中国	5,539,542,890	10.79
	インド	4,619,494,411	9.00
	ブラジル	3,705,049,344	7.21
	南アフリカ	3,027,977,609	5.90
	香港	1,933,866,548	3.77
	ロシア	1,880,511,289	3.66
	メキシコ	1,269,491,164	2.47
	タイ	1,205,654,430	2.35
	マレーシア	1,178,630,392	2.30
	インドネシア	1,140,846,630	2.22
	ポーランド	631,118,295	1.23
	チリ	561,765,049	1.09
	カタール	530,384,579	1.03
	フィリピン	519,569,816	1.01
	バミューダ	484,048,766	0.94
	トルコ	350,167,413	0.68
	アラブ首長国連邦	331,964,495	0.65
	コロンビア	210,329,595	0.41
	ハンガリー	163,750,920	0.32
	アメリカ	155,779,758	0.30
	ギリシャ	131,615,369	0.26
	チェコ	87,003,518	0.17
	エジプト	61,508,547	0.12
	パキスタン	30,276,736	0.06
	ルクセンブルク	29,450,260	0.06
	マン島	28,419,488	0.06
	シンガポール	28,200,185	0.05
ペルー	27,086,764	0.05	
	小計	49,953,282,898	97.27
投資信託受益証券	ブラジル	76,680,277	0.15
投資証券	南アフリカ	148,753,270	0.29
	メキシコ	36,228,796	0.07

	トルコ	4,916,655	0.01
	小計	189,898,721	0.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,133,241,138	2.21
合計(純資産総額)		51,353,103,034	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	1,120,138,394	2.18

(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		41,967,900	0.08

(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	511,400	4,049.19	2,070,758,232	4,527.12	2,315,169,168	4.51
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	431,602	4,500.00	1,942,211,857	4,384.03	1,892,160,432	3.68
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,207,389	850.02	1,876,346,407	842.71	1,860,210,858	3.62
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	103,684	16,450.08	1,705,610,449	17,733.09	1,838,637,869	3.58
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア・娯楽	39,228	22,768.46	893,161,537	23,406.00	918,170,568	1.79
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,631,620	93.28	805,229,539	96.34	831,625,513	1.62

香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	545,000	1,057.77	576,489,555	1,110.01	604,958,175	1.18
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	25,114	20,859.70	523,870,604	20,789.97	522,119,392	1.02
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	464,000	1,118.99	519,214,047	1,099.85	510,334,112	0.99
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,239,515	77.48	483,458,837	80.09	499,755,202	0.97
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	250,229	1,793.25	448,725,156	1,916.34	479,523,842	0.93
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	426,781	996.64	425,348,424	1,070.14	456,717,126	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	140,211	2,978.40	417,605,003	3,208.33	449,843,438	0.88
ブラジル	株式	VALE SA	素材	278,178	1,608.89	447,559,472	1,530.88	425,857,137	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	51,320	7,406.64	380,108,765	7,264.40	372,809,008	0.73
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	45,453	8,536.23	387,997,287	8,128.99	369,487,019	0.72
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	48.60	360,101,489	49.76	368,700,928	0.72
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	314,410	1,081.58	340,059,568	1,084.12	340,858,798	0.66
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	292,161	1,050.41	306,891,524	1,145.80	334,759,476	0.65
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	239,500	1,361.64	326,112,780	1,348.59	322,987,533	0.63
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,185,248	279.44	331,215,853	266.43	315,787,995	0.61
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,538,000	196.46	302,163,786	186.01	286,095,992	0.56
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	487,161	511.74	249,304,496	566.32	275,893,290	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	76,736	3,774.44	289,635,428	3,515.36	269,754,665	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	81,948	3,131.08	256,586,399	3,215.30	263,487,568	0.51
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	41,282	5,993.61	247,428,439	6,228.39	257,120,396	0.50
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	346,340	749.54	259,596,514	741.00	256,639,602	0.50
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SERL	電気通信サービス	3,037,840	81.73	248,306,054	78.37	238,080,685	0.46
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	278,100	824.91	229,408,865	819.90	228,015,302	0.44
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,377,400	97.07	230,783,215	95.62	227,329,128	0.44

(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	8.06
		素材	7.22
		資本財	3.61
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	1.65

自動車・自動車部品	2.55
耐久消費財・アパレル	1.08
消費者サービス	1.08
メディア・娯楽	2.15
小売	1.67
食品・生活必需品小売り	1.72
食品・飲料・タバコ	3.49
家庭用品・パーソナル用品	1.20
ヘルスケア機器・サービス	0.70
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.16
銀行	17.73
各種金融	2.67
保険	3.68
不動産	2.57
ソフトウェア・サービス	12.56
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.22
電気通信サービス	4.58
公益事業	2.52
半導体・半導体製造装置	5.24
小計	97.27
投資信託受益証券	0.15
投資証券	0.37
合計	97.79

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	197	アメリカドル	9,623,942	1,092,028,698	9,871,670	1,120,138,394	2.18

(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	370,000.00	42,011,600	41,967,900	0.08
--------	--------	----	------------	------------	------------	------

(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	354,632,496,100	82.80
地方債証券	日本	24,218,069,975	5.65
特殊債券	日本	30,127,902,073	7.03
社債券	日本	15,661,317,890	3.66
	フランス	1,100,048,000	0.26
	オーストラリア	601,709,000	0.14
	オランダ	200,774,000	0.05
	アメリカ	106,638,000	0.02
	イギリス	100,376,000	0.02
	スウェーデン	100,227,000	0.02
	小計		17,871,089,890
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,443,226,809	0.34
合計(純資産総額)		428,292,784,847	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)	7,450,000,000	101.04	7,527,480,000	100.94	7,520,700,500	0.100	2023/3/20	1.76
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	100.86	5,951,004,000	100.98	5,957,938,000	0.100	2023/6/20	1.39
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	100.76	5,582,104,000	0.100	2022/3/20	1.30
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	5,090,000,000	100.39	5,110,191,900	100.39	5,110,054,600	0.100	2020/7/1	1.19
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.65	4,811,342,700	100.55	4,806,385,600	0.100	2021/3/20	1.12
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.85	4,780,669,200	0.100	2022/9/20	1.12

日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	4,620,000,000	100.66	4,650,492,000	100.46	4,641,344,400	0.100	2028/3/20	1.08
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	4,220,000,000	103.49	4,367,486,200	103.43	4,365,083,600	0.500	2024/9/20	1.02
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,030,000,000	103.87	4,186,217,800	103.44	4,168,632,000	1.000	2021/12/20	0.97
日本	国債証券	第132回利付国債（5年）	4,000,000,000	100.87	4,035,056,800	100.80	4,032,040,000	0.100	2022/6/20	0.94
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,930,000,000	102.62	4,033,313,500	102.51	4,028,682,300	0.300	2025/12/20	0.94
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	3,890,000,000	103.24	4,016,200,500	103.09	4,010,201,000	0.400	2025/6/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	3,870,000,000	103.30	3,997,835,300	103.13	3,991,479,300	0.400	2025/9/20	0.93
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,880,000,000	102.23	3,966,631,800	102.30	3,969,550,400	0.300	2024/12/20	0.93
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	102.73	3,914,355,900	1.200	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.44	3,625,920,100	0.100	2020/9/20	0.85
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.57	3,552,656,800	0.600	2023/12/20	0.83
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	104.07	3,267,871,600	103.39	3,246,634,400	1.200	2021/6/20	0.76
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	100.58	3,228,810,600	0.100	2027/12/20	0.75
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	100.64	3,220,640,000	0.100	2021/9/20	0.75
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	100.91	3,199,005,500	0.100	2022/12/20	0.75
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	101.05	3,183,358,500	0.100	2026/6/20	0.74
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.31	3,149,953,800	0.100	2020/3/20	0.74
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	3,050,000,000	100.78	3,073,842,400	100.97	3,079,768,000	0.100	2026/9/20	0.72
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,020,000,000	100.88	3,046,576,000	100.87	3,046,304,200	0.100	2027/3/20	0.71
日本	国債証券	第386回利付国債（2年）	2,990,000,000	100.44	3,003,283,500	100.32	2,999,568,000	0.100	2020/3/15	0.70
日本	国債証券	第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.50	2,974,859,200	0.100	2020/12/20	0.69
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	117.98	2,996,934,100	116.86	2,968,447,200	1.500	2034/6/20	0.69
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,910,000,000	101.05	2,940,793,600	101.09	2,941,922,700	0.100	2026/3/20	0.69
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	103.87	2,898,084,600	0.600	2024/6/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.80
地方債証券	5.65
特殊債券	7.03
社債券	4.17

合計	99.66
----	-------

(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	114,494,094,324	44.92
	フランス	25,378,771,642	9.96
	イタリア	22,057,583,800	8.65
	ドイツ	17,216,861,467	6.75
	イギリス	16,327,270,941	6.41
	スペイン	14,684,823,180	5.76
	ベルギー	6,081,367,699	2.39
	オーストラリア	5,288,260,782	2.07
	オランダ	5,222,654,589	2.05
	カナダ	5,068,086,932	1.99
	オーストリア	3,660,637,761	1.44
	メキシコ	1,932,668,586	0.76
	アイルランド	1,917,507,556	0.75
	フィンランド	1,544,694,651	0.61
	デンマーク	1,537,850,437	0.60
	南アフリカ	1,497,492,419	0.59
	ポーランド	1,481,819,983	0.58
	マレーシア	1,222,127,732	0.48
	シンガポール	973,808,650	0.38
	スウェーデン	919,489,212	0.36
ノルウェー	589,336,020	0.23	
	小計	249,097,208,363	97.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,791,472,849	2.27
合計(純資産総額)		254,888,681,212	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	1,090,751,661	0.43
	買建	ドイツ	1,394,219,771	0.55

(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		3,422,685,900	1.34

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,813.82	1,892,419,039	10,820.86	1,893,651,459	1.750	2023/5/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,941.83	1,602,979,549	10,936.81	1,602,242,852	1.875	2022/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,102.37	1,666,892,179	9,659.08	1,593,749,111	2.500	2046/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,316.36	1,578,632,652	11,296.96	1,575,926,657	2.500	2020/5/31	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,685.63	1,565,445,076	10,665.19	1,562,450,480	2.250	2027/11/15	0.61
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	13,923.25	1,531,558,431	13,660.09	1,502,610,828	3.500	2020/4/25	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,039.72	1,379,965,632	11,032.07	1,379,009,377	2.375	2024/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,168.10	1,342,189,833	10,202.63	1,346,747,291	1.500	2026/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,688.47	1,314,682,011	10,700.66	1,316,181,739	2.000	2025/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,713.95	1,301,745,263	10,688.08	1,298,602,512	2.250	2027/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,819.10	1,298,292,616	10,810.38	1,297,246,056	2.125	2025/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,654.76	1,293,678,905	11,543.77	1,281,359,166	3.625	2021/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	11,292.98	1,242,228,711	11,323.58	1,245,594,626	2.750	2021/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,365.17	1,250,169,107	11,305.26	1,243,579,381	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,942.38	1,225,546,616	10,945.53	1,225,899,510	1.750	2022/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 06/30/25	10,500,000	11,132.76	1,168,940,707	11,224.55	1,178,577,963	2.750	2025/6/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	11,233.28	1,168,261,409	11,098.16	1,154,208,859	2.750	2028/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,901.71	1,188,287,022	10,437.83	1,137,724,189	2.875	2045/8/15	0.45

アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,811.83	1,135,242,493	10,826.96	1,136,831,712	2.000	2024/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	11,100.33	1,110,033,256	11,102.43	1,110,243,278	1.500	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,935.58	1,109,961,763	10,936.32	1,110,036,741	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,892.63	1,105,602,352	10,894.16	1,105,757,903	1.750	2022/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/47	10,850,000	10,703.46	1,161,326,449	10,123.03	1,098,349,823	2.750	2047/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,822.81	1,082,281,092	10,847.47	1,084,747,499	1.250	2021/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	11,128.15	1,070,528,593	11,151.49	1,072,774,195	1.250	2020/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,841.69	1,062,486,103	10,875.34	1,065,783,335	1.125	2021/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,952.93	1,046,005,372	10,956.55	1,046,351,008	1.750	2022/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,933.88	1,044,186,332	10,936.41	1,044,427,377	1.750	2022/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/21	9,500,000	10,953.64	1,040,596,740	10,967.08	1,041,873,039	1.375	2021/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/47	9,950,000	10,602.03	1,054,902,771	10,130.07	1,007,942,946	2.750	2047/8/15	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	40	アメリカ ドル	4,512,738.3	512,060,414	4,517,187.6	512,565,276	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	24	アメリカ ドル	2,858,955.38	324,405,667	2,863,500	324,921,345	0.13
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカ ドル	2,228,407.82	252,857,435	2,232,000	253,265,040	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	20	ユーロ	2,239,485	289,319,067	2,240,200	289,411,438	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	22	ユーロ	2,894,598	373,953,115	2,902,460	374,968,807	0.15
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	35	ユーロ	5,615,340	725,445,774	5,649,350	729,839,526	0.29

(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	15,130,000.00	1,713,326,350	1,714,531,600	0.67
	カナダドル	買建	1,690,000.00	144,578,800	144,224,600	0.06
	ユーロ	買建	10,290,000.00	1,321,942,735	1,329,159,300	0.52
	イギリスポンド	買建	1,620,000.00	236,094,719	234,770,400	0.09

(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	インドネシア	4,472,784,937	9.61
	ブラジル	4,327,738,796	9.30
	メキシコ	4,249,179,809	9.13
	ポーランド	4,219,170,618	9.07
	南アフリカ	4,114,707,628	8.84
	タイ	3,927,896,645	8.44
	ロシア	3,432,831,245	7.38
	コロンビア	3,318,360,386	7.13
	マレーシア	2,494,989,682	5.36
	トルコ	2,449,879,022	5.27
	ハンガリー	2,242,551,870	4.82
	チェコ	1,925,887,681	4.14
	ペルー	1,393,929,066	3.00
	チリ	1,275,141,458	2.74
	フィリピン	135,220,860	0.29
	ウルグアイ	115,154,458	0.25
	ドミニカ共和国	44,776,665	0.10
	小計	44,140,200,826	94.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,390,781,954	5.14
合計(純資産総額)		46,530,982,780	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		8,752,381	0.02
	売建		8,739,628	0.02

(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 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	47,000,000,000	4.31	2,027,783,275	4.30	2,023,465,150	9.850	2027/6/28	4.35
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	7,310,000,000	17.45	1,275,859,680	17.44	1,275,141,458	5.500	2020/8/5	2.74
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,612.77	981,096,008	2,629.52	987,385,591	0.000	2020/7/1	2.12
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000	3,007.18	777,356,178	3,033.01	784,033,530	10.000	2023/1/1	1.68
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.30	781,971,286	3.31	783,626,786	4.375	2023/3/21	1.68
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	76,750,000	891.25	684,037,445	905.52	694,987,904	10.500	2026/12/21	1.49
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	167,500,000	351.07	588,055,314	357.52	598,859,064	3.400	2036/6/17	1.29
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/20	21,600,000	2,667.80	576,246,158	2,683.04	579,537,533	0.000	2020/4/1	1.25
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	14,000,000,000	3.65	511,763,350	3.65	511,268,450	7.750	2021/4/14	1.10
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	361.97	495,537,697	367.83	503,564,801	3.650	2031/6/20	1.08
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	533.82	489,515,099	534.59	490,222,450	6.500	2021/6/10	1.05
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	91,600,000	524.28	480,245,386	523.14	479,204,787	6.500	2022/6/9	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000	556.94	473,402,375	557.66	474,017,511	8.000	2020/6/11	1.02
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	594.70	460,002,055	588.97	455,573,764	10.000	2024/12/5	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000	729.84	428,055,881	746.30	437,709,026	8.750	2048/2/28	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000	2,907.53	423,045,680	2,930.12	426,332,515	2.500	2026/7/25	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	56,800,000	731.75	415,635,647	747.25	424,439,789	8.750	2044/1/31	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000	3,030.15	424,221,705	3,031.69	424,436,905	2.250	2022/4/25	0.91
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	13,800,000	3,047.59	420,568,222	3,054.23	421,485,042	10.000	2021/1/1	0.91
ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000	3,015.11	402,517,876	3,015.44	402,562,137	1.500	2020/4/25	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000	3,011.22	401,998,820	3,011.55	402,043,081	1.750	2021/7/25	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,500,000	2,375.23	391,913,838	2,394.15	395,034,944	0.000	2021/7/1	0.85

タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	403.95	383,754,704	407.00	386,656,688	4.875	2029/6/22	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000	2,869.55	377,346,357	2,894.29	380,600,317	2.500	2027/7/25	0.82
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	73,700,000	515.62	380,018,666	509.63	375,602,945	7.500	2027/6/3	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 2% 12/17/22	108,500,000	340.18	369,098,903	341.55	370,586,264	2.000	2022/12/17	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	110,000,000	329.47	362,425,844	332.20	365,422,772	2.125	2026/12/17	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000	360.01	363,618,542	360.57	364,184,870	3.650	2021/12/17	0.78
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	45,200,000,000	0.79	361,214,986	0.80	364,039,489	8.375	2024/3/15	0.78
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.80	360,116,168	0.80	362,565,563	8.375	2026/9/15	0.78

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	94.86
合計	94.86

(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	77,161.09	8,739,628	8,752,381	0.02
	ロシアルーブル	売建	5,140,958.00	8,739,628	8,739,628	0.02

(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。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	105,527,531,940	97.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,668,166,365	2.47

合計(純資産総額)	108,195,698,305	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	2,658,271,000	2.46

(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	11,543	679,302.56	7,841,189,532	707,000	8,160,901,000	7.54
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,920	609,258.04	7,262,355,845	627,000	7,473,840,000	6.91
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,329	146,733.07	5,183,932,761	151,600	5,355,876,400	4.95
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	22,528	214,813.56	4,839,320,052	217,700	4,904,345,600	4.53
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,289	177,428.55	4,664,419,290	180,700	4,750,422,300	4.39
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,749	177,454.13	4,214,358,300	184,700	4,386,440,300	4.05
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,923	247,780.49	3,697,628,267	257,300	3,839,687,900	3.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,988	239,216.39	3,824,591,739	235,100	3,758,778,800	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,617	297,459.23	3,455,583,979	313,500	3,641,929,500	3.37
日本	投資証券	G L P 投資法人	29,536	112,689.96	3,328,410,829	114,200	3,373,011,200	3.12
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,545	415,838.88	3,137,504,421	443,500	3,346,207,500	3.09
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,687	725,107.38	2,673,470,921	745,000	2,746,815,000	2.54
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,513	80,379.32	2,774,131,695	79,000	2,726,527,000	2.52
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,712	484,708.77	2,768,656,526	477,000	2,724,624,000	2.52
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,961	524,115	2,076,019,529	551,000	2,182,511,000	2.02
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,754	70,764.31	2,176,285,845	69,900	2,149,704,600	1.99
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	41,711	46,401.02	1,935,433,291	47,100	1,964,588,100	1.82
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,751	721,062.07	1,983,641,762	702,000	1,931,202,000	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,670	139,278.65	1,903,939,172	140,600	1,922,002,000	1.78
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,055	441,911.63	1,791,951,687	441,500	1,790,282,500	1.65
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,865	228,361.52	1,796,063,405	226,600	1,782,209,000	1.65
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,674	148,761.66	1,587,881,970	155,600	1,660,874,400	1.54

日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,635	164,399.21	1,583,986,416	166,000	1,599,410,000	1.48
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,235	126,392.39	1,546,410,929	126,900	1,552,621,500	1.44
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,887	113,033.17	1,569,691,761	111,000	1,541,457,000	1.42
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,848	368,960.82	1,419,761,253	371,500	1,429,532,000	1.32
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,519	162,508.93	1,384,413,585	164,600	1,402,227,400	1.30
日本	投資証券	プレミアム投資法人	11,333	122,786.32	1,391,537,471	122,900	1,392,825,700	1.29
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,991	161,437.59	1,290,047,846	167,300	1,336,894,300	1.24
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,546	274,325.37	1,247,083,151	284,700	1,294,246,200	1.20

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.53
合計	97.53

(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	1,463	円	2,604,871,500	2,658,271,000	2.46

(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	54,783,930,337	72.59
	オーストラリア	5,251,119,201	6.96
	イギリス	3,689,564,480	4.89
	フランス	3,287,946,354	4.36
	シンガポール	2,665,880,286	3.53
	香港	1,592,736,509	2.11

カナダ	1,363,894,533	1.81
ベルギー	578,454,685	0.77
スペイン	562,973,995	0.75
ニュージーランド	327,815,973	0.43
オランダ	273,264,006	0.36
ドイツ	201,892,551	0.27
アイルランド	179,163,241	0.24
ガーンジー	86,499,045	0.11
イタリア	78,710,452	0.10
イスラエル	36,021,842	0.05
マン島	35,823,270	0.05
小計	74,995,690,760	99.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	470,771,369	0.62
合計(純資産総額)	75,466,462,129	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		38,564,900	0.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	181,170	21,410.65	3,878,968,240	20,946.56	3,794,888,638	5.03
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	369,171	7,667.16	2,830,496,041	7,622.91	2,814,159,006	3.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	87,980	23,414.53	2,060,010,746	24,039.75	2,115,017,575	2.80
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	218,700	7,883.89	1,724,207,967	8,105.16	1,772,598,951	2.35
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	81,240	20,711.67	1,682,616,810	21,340.30	1,733,686,208	2.30
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	216,500	7,656.95	1,657,730,888	7,973.53	1,726,270,739	2.29
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	80,830	20,902.94	1,689,584,802	19,980.52	1,615,025,868	2.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	121,160	12,552.05	1,520,806,548	12,900.40	1,563,012,985	2.07
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	210,040	6,816.19	1,431,672,753	7,086.20	1,488,385,763	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	1,252,500	1,044.72	1,308,511,800	1,094.77	1,371,211,324	1.82

アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	91,040	14,098.31	1,283,510,795	14,730.67	1,341,080,688	1.78
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	168,490	7,121.37	1,199,880,845	7,246.19	1,220,911,261	1.62
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,370	28,813.43	1,105,571,582	29,427.30	1,129,125,877	1.50
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,139,590	334.81	1,051,173,663	333.15	1,045,956,920	1.39
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	431,300	2,144.58	924,958,648	2,189.97	944,534,492	1.25
アメリカ	投資証券	HCP INC	273,690	3,270.20	895,022,516	3,267.93	894,401,404	1.19
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	61,550	14,122.47	869,238,410	13,886.45	854,711,527	1.13
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	933,420	868.18	810,382,176	887.29	828,218,339	1.10
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	100,850	7,949.70	801,728,072	8,008.71	807,678,666	1.07
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,750	10,297.40	759,433,435	10,710.43	789,894,456	1.05
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,340	11,406.00	756,674,332	11,598.90	769,471,252	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	156,890	4,634.11	727,046,271	4,753.25	745,738,695	0.99
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	94,390	7,394.75	697,991,248	7,692.13	726,060,273	0.96
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	98,810	7,403.91	731,581,088	7,128.18	704,335,999	0.93
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	209,580	3,242.97	679,662,198	3,185.10	667,533,866	0.88
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,620	14,599.05	636,810,570	14,852.08	647,848,092	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	167,160	3,718.41	621,569,733	3,829.61	640,158,025	0.85
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	50,750	11,651.09	591,293,305	11,664.71	591,984,337	0.78
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,950	11,068.99	586,103,470	11,053.11	585,262,317	0.78
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	53,410	10,500.51	560,832,442	10,634.40	567,983,753	0.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.38
合計	99.38

(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	340,000.00	38,601,900	38,564,900	0.05

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2017年8月25日
作成基準日：2018年11月30日

基準価額・純資産の推移



※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	2018年11月	-	-
分配金	0円	0円	0円	-	-

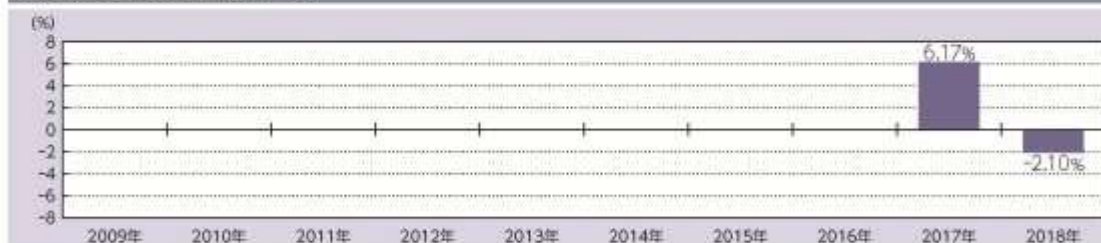
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実効投資比率
J-REIT インテックス マザーファンド	13.0%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.0%
		ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
外国債券 インテックス マザーファンド	13.0%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
		T 2.5% 02/15/46	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.1%
外国株式 インテックス マザーファンド	12.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア及び機器	-	-	0.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
グローバルREIT インテックス マザーファンド	12.6%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
新興国債券 インテックス マザーファンド	12.5%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.6%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.3%
国内株式 インテックス マザーファンド	12.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.2%
新興国株式 インテックス マザーファンド	11.8%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	テクノロジー/ハードウェア及び機器	-	-	0.4%
国内債券 インテックス マザーファンド	11.1%	第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.2%
		第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/06/20	0.2%

※投資比率及び実効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(百年ベース)



※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、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

<その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<解約価額>

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

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

<一部解約代金の支払い>

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

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないもの
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。（2017年 8月25日設定）

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

(4)【計算期間】

原則として、毎年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2017年8月25日から2017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ち、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30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当するものを除きます。）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。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失

い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年5月11日から2018年11月12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2期 (2018年 5月10日現在)	第3期 (2018年11月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	22,555
コール・ローン	95,564	154,168
親投資信託受益証券	8,361,845	14,059,261
流動資産合計	8,457,409	14,235,984
資産合計	8,457,409	14,235,984
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	301
未払受託者報酬	1,545	2,964
未払委託者報酬	13,774	26,589
その他未払費用	96	222
流動負債合計	15,415	30,076
負債合計	15,415	30,076
純資産の部		
元本等		
元本	8,106,595	13,730,817
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	335,399	475,091
(分配準備積立金)	108,982	234,270
元本等合計	8,441,994	14,205,908
純資産合計	8,441,994	14,205,908
負債純資産合計	8,457,409	14,235,984

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年11月11日 至 2018年 5月10日	自	2018年 5月11日 至 2018年11月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		43,052		44,587
営業収益合計		43,052		44,587
営業費用				
受託者報酬		1,545		2,964
委託者報酬		13,774		26,589
その他費用		96		222
営業費用合計		15,415		29,775
営業利益又は営業損失 ()		58,467		74,362
経常利益又は経常損失 ()		58,467		74,362
当期純利益又は当期純損失 ()		58,467		74,362
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 ()		8,257		7,586
期首剰余金又は期首欠損金 ()		135,038		335,399
剰余金増加額又は欠損金減少額		324,567		254,246
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		324,567		254,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		73,996		47,778
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		73,996		47,778
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		335,399		475,091

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第3期計算期間は2018年 5月11日から2018年11月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2018年 5月10日現在)	第3期 (2018年11月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,106,595口	13,730,817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) 1.0414円 (10,414円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0346円 (10,346円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年11月11日 至 2018年 5月10日			第3期 自 2018年 5月11日 至 2018年11月12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	72,631円	費用控除後の配当等収益額	A	137,116円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	226,417円	収益調整金額	C	348,929円
分配準備積立金額	D	36,351円	分配準備積立金額	D	97,154円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	335,399円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	583,199円
当ファンドの期末残存口数	F	8,106,595口	当ファンドの期末残存口数	F	13,730,817口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	413円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	424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3期 自 2018年 5月11日 至 2018年11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (2018年11月12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2期	第3期
	自 2017年11月11日 至 2018年 5月10日	自 2018年 5月11日 至 2018年11月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,170,810円	8,106,595円
期中追加設定元本額	6,642,105円	6,807,776円
期中一部解約元本額	1,706,320円	1,183,554円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	(2018年 5月10日現在)	(2018年11月12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	35,373	38,724
合計	35,373	38,724

（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	1,081,300	1,827,288	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	995,086	1,803,692	
	新興国株式インデックス マザーファンド	614,884	1,649,610	
	国内株式インデックス マザーファンド	1,149,876	1,744,706	
	外国株式インデックス マザーファンド	726,840	1,841,521	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,143,155	1,581,326	
	外国債券インデックス マザーファンド	678,974	1,844,976	
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,084,055	1,766,142	
合計		7,474,170	14,059,261	

(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11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	368,973,444
コール・ローン	2,521,954,298
株式	237,533,160,100
新株予約権証券	1,303,100
派生商品評価勘定	74,978,300
未収入金	29,376,456
未収配当金	1,898,580,497
前払金	38,957,000
差入委託証拠金	157,825,800
流動資産合計	242,625,108,995

	2018年11月12日現在
項目	金額（円）
資産合計	242,625,108,995
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	113,974,720
未払金	601,802,082
未払解約金	112,961,144
未払利息	7,143
その他未払費用	30,426
流動負債合計	828,775,515
負債合計	828,775,515
純資産の部	
元本等	
元本	159,356,089,061
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,440,244,419
元本等合計	241,796,333,480
純資産合計	241,796,333,480
負債純資産合計	242,625,108,995

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年11月12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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)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 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

	2018年11月12日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年11月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	159,356,089,061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 1.5173円 (1万口当たり純資産額) (15,173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11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	129,140,824,094円
期中追加設定元本額	37,918,243,925円
期中一部解約元本額	7,702,978,958円

区分	2018年11月12日現在
期末元本額	159,356,089,061円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	619,322,908円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,610,804,488円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,343,313円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,801,338,936円
世界経済インデックスファンド	1,738,805,569円
日本株式インデックス・オープン	5,772,993,739円
DCマイセレクション25	5,768,354,394円
DCマイセレクション50	18,032,583,538円
DCマイセレクション75	16,272,868,764円
DC日本株式インデックス・オープン	5,363,506,144円
DCマイセレクションS25	2,317,828,531円
DCマイセレクションS50	7,188,378,947円
DCマイセレクションS75	4,688,818,706円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,815,147,886円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	351,674,929円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	560,118,828円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	368,423,748円
DC世界経済インデックスファンド	1,348,794,984円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	522,290,438円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	23,263,031円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	47,928,202円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,334,232円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	333,383,584円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,630,550円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	120,387,330円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	427,747,220円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	71,985,277円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	657,174,313円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,801,511,938円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	720,443,876円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,233,051,974円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	667,250,664円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	51,213,752円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	811,141,489円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	254,083,058円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	456,258,086円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	585,024,439円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	54,754,744円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	922,936,409円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,200,692,196円

区分	2018年11月12日現在
日本株式ファンド・シリーズ2	1,535,644,781円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	914,462,546円
分散投資コア戦略ファンドS	1,900,636,139円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,772,020円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	189,485,876円
コア投資戦略ファンド（切替型）	549,059,750円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	215,390,670円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	8,501,421円
SMT インデックスバランス・オープン	66,401,033円
SMT 世界経済インデックス・オープン	6,153,732円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	46,970,592円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,934,297円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,149,876円
グローバル経済コア	309,725,067円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,264,002円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	33,874,512円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	518,797円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	16,741円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,167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）	41,207,955,648円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	679,045,034円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,241,924,731
新株予約権証券	1,303,100
合計	10,240,621,631

(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11月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引	株価指数先物取引 買建	4,199,747,000	-	4,160,790,000	38,957,000
合計		4,199,747,000	-	4,160,790,000	38,957,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	4,400	3,160.00	13,904,000	
日本水産	136,300	712.00	97,045,600	
マルハニチロ	19,700	4,395.00	86,581,500	
カネコ種苗	3,900	1,455.00	5,674,500	
サカタのタネ	16,600	3,750.00	62,250,000	
ホクト	11,400	2,058.00	23,461,200	
ホクリヨウ	1,800	739.00	1,330,200	
住石ホールディングス	28,900	120.00	3,468,000	
日鉄鉱業	3,100	5,210.00	16,151,000	
三井松島ホールディングス	5,700	1,567.00	8,931,900	
国際石油開発帝石	546,600	1,300.00	710,580,000	
石油資源開発	19,600	2,440.00	47,824,000	
K & O エナジーグループ	6,600	1,591.00	10,500,600	
ヒノキヤグループ	2,900	2,395.00	6,945,500	
ショーボンドホールディングス	10,600	8,220.00	87,132,000	
ミライト・ホールディングス	34,800	1,693.00	58,916,400	
タマホーム	8,400	1,161.00	9,752,400	
サンヨーホームズ	2,000	887.00	1,774,000	
日本アクア	3,200	352.00	1,126,400	
ファーストコーポレーション	3,700	1,113.00	4,118,100	
ベステラ	2,600	1,433.00	3,725,800	
T A T E R U	14,200	616.00	8,747,200	
スペースバリューホールディングス	16,600	1,053.00	17,479,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,600	860.00	2,236,000	
第一カッター興業	1,500	2,314.00	3,471,000	
安藤・間	87,100	693.00	60,360,300	

東急建設	39,900	1,120.00	44,688,000
コムシスホールディングス	48,300	2,982.00	144,030,600
ミサワホーム	10,700	812.00	8,688,400
ピーアールホールディングス	11,000	411.00	4,521,000
高松コンストラクショングループ	8,500	2,983.00	25,355,500
東建コーポレーション	4,200	7,920.00	33,264,000
ソネック	1,400	791.00	1,107,400
ヤマウラ	5,300	889.00	4,711,700
大成建設	111,900	5,040.00	563,976,000
大林組	337,100	1,078.00	363,393,800
清水建設	343,900	937.00	322,234,300
飛島建設	9,600	1,758.00	16,876,800
長谷工コーポレーション	140,500	1,405.00	197,402,500
松井建設	12,400	859.00	10,651,600
銭高組	1,400	5,440.00	7,616,000
鹿島建設	263,500	1,545.00	407,107,500
不動テトラ	8,500	1,873.00	15,920,500
大末建設	4,000	1,150.00	4,600,000
鉄建建設	6,800	2,919.00	19,849,200
西松建設	24,200	2,705.00	65,461,000
三井住友建設	75,400	720.00	54,288,000
大豊建設	7,600	3,515.00	26,714,000
前田建設工業	80,200	1,160.00	93,032,000
佐田建設	7,300	418.00	3,051,400
ナカノフドー建設	8,500	672.00	5,712,000
奥村組	18,500	3,630.00	67,155,000
東鉄工業	13,500	3,115.00	42,052,500
イチケン	2,000	2,206.00	4,412,000
富士ピー・エス	3,400	528.00	1,795,200
浅沼組	4,000	3,430.00	13,720,000
戸田建設	130,700	754.00	98,547,800
熊谷組	16,000	3,440.00	55,040,000
青木あすなろ建設	5,500	1,013.00	5,571,500
北野建設	2,300	3,960.00	9,108,000
植木組	1,400	2,439.00	3,414,600
矢作建設工業	15,300	786.00	12,025,800
ピーエス三菱	11,700	731.00	8,552,700
日本ハウスホールディングス	21,500	509.00	10,943,500
大東建託	40,000	15,695.00	627,800,000
新日本建設	13,400	1,093.00	14,646,200
N I P P O	29,800	1,861.00	55,457,800
東亜道路工業	2,100	3,570.00	7,497,000

前田道路	35,200	2,247.00	79,094,400
日本道路	3,000	6,060.00	18,180,000
東亜建設工業	9,700	1,711.00	16,596,700
若築建設	5,700	1,579.00	9,000,300
東洋建設	41,100	436.00	17,919,600
五洋建設	133,600	705.00	94,188,000
世紀東急工業	16,300	667.00	10,872,100
福田組	3,600	5,170.00	18,612,000
住友林業	79,700	1,647.00	131,265,900
日本基礎技術	11,400	373.00	4,252,200
巴コーポレーション	14,000	460.00	6,440,000
大和ハウス工業	311,300	3,584.00	1,115,699,200
ライト工業	21,600	1,450.00	31,320,000
積水ハウス	344,200	1,725.50	593,917,100
日特建設	9,600	729.00	6,998,400
北陸電気工事	5,400	1,055.00	5,697,000
ユアテック	18,000	911.00	16,398,000
四電工	1,700	2,644.00	4,494,800
中電工	14,500	2,477.00	35,916,500
関電工	51,200	1,162.00	59,494,400
きんでん	74,700	1,907.00	142,452,900
東京エネシス	11,600	962.00	11,159,200
トーエネック	3,200	3,240.00	10,368,000
住友電設	7,800	1,911.00	14,905,800
日本電設工業	19,200	2,347.00	45,062,400
協和エクシオ	44,000	2,960.00	130,240,000
新日本空調	9,500	1,877.00	17,831,500
九電工	22,200	4,405.00	97,791,000
三機工業	25,800	1,270.00	32,766,000
日揮	96,800	1,884.00	182,371,200
中外炉工業	3,200	2,472.00	7,910,400
ヤマト	10,100	637.00	6,433,700
太平電業	7,600	2,794.00	21,234,400
高砂熱学工業	28,400	2,047.00	58,134,800
三晃金属工業	1,400	2,977.00	4,167,800
朝日工業社	2,300	3,195.00	7,348,500
明星工業	20,300	866.00	17,579,800
大気社	15,300	3,230.00	49,419,000
ダイダン	7,500	2,578.00	19,335,000
日比谷総合設備	10,700	1,921.00	20,554,700
東芝プラントシステム	24,300	2,326.00	56,521,800
OSJBホールディングス	49,500	279.00	13,810,500

東洋エンジニアリング	10,100	875.00	8,837,500
新興プランテック	20,200	1,066.00	21,533,200
日本製粉	33,400	1,887.00	63,025,800
日清製粉グループ本社	113,800	2,318.00	263,788,400
日東富士製粉	700	5,350.00	3,745,000
昭和産業	9,200	2,858.00	26,293,600
鳥越製粉	8,900	952.00	8,472,800
中部飼料	12,300	1,446.00	17,785,800
フィード・ワン	67,500	223.00	15,052,500
東洋精糖	1,500	1,212.00	1,818,000
日本甜菜製糖	5,700	1,993.00	11,360,100
三井製糖	7,900	3,045.00	24,055,500
塩水港精糖	10,700	247.00	2,642,900
日新製糖	4,800	2,274.00	10,915,200
森永製菓	25,300	4,965.00	125,614,500
中村屋	2,600	4,590.00	11,934,000
江崎グリコ	30,300	5,550.00	168,165,000
名糖産業	4,800	1,492.00	7,161,600
井村屋グループ	4,300	3,150.00	13,545,000
不二家	5,600	2,504.00	14,022,400
山崎製パン	82,300	2,280.00	187,644,000
第一屋製パン	1,700	1,103.00	1,875,100
モロゾフ	1,700	5,500.00	9,350,000
亀田製菓	6,300	5,380.00	33,894,000
寿スピリッツ	10,700	4,475.00	47,882,500
カルビー	45,900	3,765.00	172,813,500
森永乳業	20,200	3,340.00	67,468,000
六甲バター	7,400	2,478.00	18,337,200
ヤクルト本社	74,600	8,070.00	602,022,000
明治ホールディングス	71,300	8,710.00	621,023,000
雪印メグミルク	24,200	2,995.00	72,479,000
プリマハム	14,200	2,494.00	35,414,800
日本ハム	43,500	4,245.00	184,657,500
林兼産業	3,300	657.00	2,168,100
丸大食品	10,700	1,859.00	19,891,300
S Foods	9,000	4,800.00	43,200,000
伊藤ハム米久ホールディングス	64,700	749.00	48,460,300
サッポロホールディングス	36,800	2,486.00	91,484,800
アサヒグループホールディングス	210,900	5,048.00	1,064,623,200
キリンホールディングス	455,500	2,609.50	1,188,627,250
宝ホールディングス	75,400	1,434.00	108,123,600
オエノンホールディングス	28,500	384.00	10,944,000

養命酒製造	3,100	2,327.00	7,213,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,100	3,340.00	257,514,000	
サントリー食品インターナショナル	67,400	4,590.00	309,366,000	
ダイドーグループホールディングス	5,700	5,990.00	34,143,000	
伊藤園	33,300	5,230.00	174,159,000	
キーコーヒー	9,900	2,097.00	20,760,300	
ユニカフェ	3,000	1,292.00	3,876,000	
ジャパンフーズ	1,400	1,236.00	1,730,400	
日清オイリオグループ	13,000	3,500.00	45,500,000	
不二製油グループ本社	24,600	3,290.00	80,934,000	
かどや製油	1,100	6,080.00	6,688,000	
J - オイルミルズ	5,200	3,900.00	20,280,000	
キッコーマン	66,400	6,210.00	412,344,000	
味の素	231,600	1,924.00	445,598,400	
キューピー	56,100	2,770.00	155,397,000	
ハウス食品グループ本社	38,400	3,900.00	149,760,000	
カゴメ	40,300	3,300.00	132,990,000	
焼津水産化学工業	4,900	1,050.00	5,145,000	
アリアケジャパン	9,200	10,000.00	92,000,000	
ピエトロ	1,300	1,649.00	2,143,700	
エバラ食品工業	2,400	2,183.00	5,239,200	
ニチレイ	52,300	3,055.00	159,776,500	
東洋水産	51,800	3,945.00	204,351,000	
イトアンド	3,500	1,690.00	5,915,000	
大冷	1,100	1,865.00	2,051,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,700	677.00	1,827,900	
日清食品ホールディングス	42,800	7,350.00	314,580,000	
永谷園ホールディングス	5,400	2,716.00	14,666,400	
一正蒲鉾	3,900	1,008.00	3,931,200	
フジッコ	10,900	2,497.00	27,217,300	
ロック・フィールド	10,800	1,702.00	18,381,600	
日本たばこ産業	581,500	2,870.50	1,669,195,750	
ケンコーマヨネーズ	5,600	2,219.00	12,426,400	
わらべや日洋ホールディングス	6,600	1,908.00	12,592,800	
なとり	5,600	1,864.00	10,438,400	
イフジ産業	1,700	745.00	1,266,500	
ピククルスコーポレーション	2,400	2,338.00	5,611,200	
北の達人コーポレーション	39,500	531.00	20,974,500	
ユーグレナ	40,000	674.00	26,960,000	
ミヨシ油脂	3,900	1,271.00	4,956,900	
理研ビタミン	4,800	3,660.00	17,568,000	
片倉工業	12,100	1,220.00	14,762,000	

グンゼ	7,200	4,615.00	33,228,000
東洋紡	41,700	1,611.00	67,178,700
ユニチカ	28,900	580.00	16,762,000
富士紡ホールディングス	5,100	3,475.00	17,722,500
倉敷紡績	9,400	2,810.00	26,414,000
シキボウ	5,200	1,169.00	6,078,800
日本毛織	32,400	930.00	30,132,000
トーア紡コーポレーション	4,100	548.00	2,246,800
ダイドーリミテッド	11,800	368.00	4,342,400
帝国繊維	11,100	2,673.00	29,670,300
帝人	80,200	1,954.00	156,710,800
東レ	762,400	901.00	686,922,400
サカイオーベックス	2,400	2,421.00	5,810,400
住江織物	2,600	2,736.00	7,113,600
日本フェルト	5,700	480.00	2,736,000
イチカワ	1,500	1,549.00	2,323,500
日東製網	1,100	1,560.00	1,716,000
アツギ	8,200	1,037.00	8,503,400
ダイニック	4,000	856.00	3,424,000
セーレン	24,200	1,979.00	47,891,800
ソトー	4,000	998.00	3,992,000
東海染工	1,400	1,155.00	1,617,000
小松マテーレ	16,200	926.00	15,001,200
ワコールホールディングス	28,700	3,080.00	88,396,000
ホギメディカル	12,200	3,245.00	39,589,000
レナウン	28,000	118.00	3,304,000
クラウディアホールディングス	2,500	512.00	1,280,000
T S Iホールディングス	36,400	813.00	29,593,200
マツオカコーポレーション	3,100	3,495.00	10,834,500
ワールド	10,200	2,311.00	23,572,200
三陽商会	5,900	1,965.00	11,593,500
ナイガイ	3,700	492.00	1,820,400
オンワードホールディングス	60,900	697.00	42,447,300
ルックホールディングス	3,700	1,203.00	4,451,100
ゴールドウイン	8,900	10,740.00	95,586,000
デサント	24,000	2,717.00	65,208,000
キング	5,300	494.00	2,618,200
ヤマトインターナショナル	6,600	464.00	3,062,400
特種東海製紙	6,200	4,270.00	26,474,000
王子ホールディングス	442,400	764.00	337,993,600
日本製紙	47,100	2,095.00	98,674,500
三菱製紙	16,000	589.00	9,424,000

北越コーポレーション	65,200	576.00	37,555,200
中越パルプ工業	4,200	1,563.00	6,564,600
巴川製紙所	3,200	1,145.00	3,664,000
大王製紙	47,800	1,385.00	66,203,000
阿波製紙	2,500	584.00	1,460,000
レンゴー	101,300	899.00	91,068,700
トモク	6,000	1,953.00	11,718,000
ザ・パック	7,400	3,405.00	25,197,000
クラレ	165,800	1,642.00	272,243,600
旭化成	699,100	1,243.00	868,981,300
共和レザー	6,200	873.00	5,412,600
昭和電工	65,300	4,865.00	317,684,500
住友化学	773,500	610.00	471,835,000
住友精化	4,800	4,840.00	23,232,000
日産化学	60,300	5,900.00	355,770,000
ラサ工業	3,500	1,854.00	6,489,000
クレハ	9,100	7,880.00	71,708,000
多木化学	1,400	8,130.00	11,382,000
テイカ	8,000	2,090.00	16,720,000
石原産業	18,900	1,506.00	28,463,400
片倉コープアグリ	2,800	1,166.00	3,264,800
日東エフシー	6,200	795.00	4,929,000
日本曹達	15,500	2,776.00	43,028,000
東ソー	151,900	1,561.00	237,115,900
トクヤマ	28,300	2,687.00	76,042,100
セントラル硝子	21,400	2,724.00	58,293,600
東亜合成	61,700	1,231.00	75,952,700
大阪ソーダ	10,500	2,749.00	28,864,500
関東電化工業	23,300	1,089.00	25,373,700
デンカ	38,600	3,590.00	138,574,000
信越化学工業	173,200	10,170.00	1,761,444,000
日本カーバイド工業	3,300	1,960.00	6,468,000
堺化学工業	6,500	2,846.00	18,499,000
第一稀元素化学工業	8,000	1,147.00	9,176,000
エア・ウォーター	80,500	1,872.00	150,696,000
大陽日酸	80,900	1,960.00	158,564,000
日本化学工業	3,300	2,701.00	8,913,300
東邦アセチレン	1,500	1,475.00	2,212,500
日本パーカライズिंग	53,700	1,488.00	79,905,600
高圧ガス工業	15,600	879.00	13,712,400
チタン工業	1,200	2,503.00	3,003,600
四国化成工業	16,500	1,222.00	20,163,000

戸田工業	2,100	2,495.00	5,239,500
ステラ ケミファ	5,800	3,395.00	19,691,000
保土谷化学工業	3,400	2,753.00	9,360,200
日本触媒	16,500	7,080.00	116,820,000
大日精化工業	8,100	3,390.00	27,459,000
カネカ	26,200	4,440.00	116,328,000
三菱瓦斯化学	101,100	1,844.00	186,428,400
三井化学	89,200	2,811.00	250,741,200
J S R	98,600	1,790.00	176,494,000
東京応化工業	16,900	3,160.00	53,404,000
大阪有機化学工業	9,100	1,431.00	13,022,100
三菱ケミカルホールディングス	657,000	940.40	617,842,800
K Hネオケム	14,900	3,315.00	49,393,500
ダイセル	152,600	1,279.00	195,175,400
住友ベークライト	17,000	4,170.00	70,890,000
積水化学工業	214,800	1,873.00	402,320,400
日本ゼオン	88,600	1,202.00	106,497,200
アイカ工業	29,500	3,425.00	101,037,500
宇部興産	49,600	2,563.00	127,124,800
積水樹脂	16,200	2,107.00	34,133,400
タキロンシーアイ	21,200	596.00	12,635,200
旭有機材	6,800	2,038.00	13,858,400
日立化成	45,400	1,803.00	81,856,200
ニチバン	5,200	2,244.00	11,668,800
リケンテクノス	26,700	518.00	13,830,600
大倉工業	5,000	2,111.00	10,555,000
積水化成成品工業	14,600	1,002.00	14,629,200
群栄化学工業	2,500	3,215.00	8,037,500
タイガースポリマー	5,200	704.00	3,660,800
ミライアル	2,900	999.00	2,897,100
ダイキアクス	3,500	1,350.00	4,725,000
ダイキョーニシカワ	20,800	1,026.00	21,340,800
竹本容器	1,800	2,847.00	5,124,600
森六ホールディングス	5,300	3,025.00	16,032,500
日本化薬	62,500	1,450.00	90,625,000
カーリットホールディングス	10,500	909.00	9,544,500
日本精化	7,900	1,119.00	8,840,100
扶桑化学工業	10,000	2,377.00	23,770,000
トリケミカル研究所	2,200	4,645.00	10,219,000
A D E K A	48,400	1,766.00	85,474,400
日油	37,900	3,705.00	140,419,500
ハリマ化成グループ	8,200	1,030.00	8,446,000

花王	243,600	7,752.00	1,888,387,200
第一工業製薬	3,700	2,605.00	9,638,500
石原ケミカル	2,500	2,110.00	5,275,000
日華化学	3,400	1,171.00	3,981,400
ニイタカ	1,600	1,788.00	2,860,800
三洋化成工業	6,600	5,450.00	35,970,000
有機合成薬品工業	7,600	256.00	1,945,600
大日本塗料	11,100	1,142.00	12,676,200
日本ペイントホールディングス	81,100	3,745.00	303,719,500
関西ペイント	110,400	1,716.00	189,446,400
神東塗料	7,900	189.00	1,493,100
中国塗料	32,300	982.00	31,718,600
日本特殊塗料	7,400	1,872.00	13,852,800
藤倉化成	13,100	633.00	8,292,300
太陽ホールディングス	8,100	3,790.00	30,699,000
D I C	44,500	3,385.00	150,632,500
サカタインクス	21,500	1,177.00	25,305,500
東洋インキS Cホールディングス	20,800	2,624.00	54,579,200
T & K T O K A	7,700	1,109.00	8,539,300
富士フィルムホールディングス	208,400	4,702.00	979,896,800
資生堂	199,400	7,039.00	1,403,576,600
ライオン	139,800	2,048.00	286,310,400
高砂香料工業	6,900	3,975.00	27,427,500
マンダム	22,600	3,190.00	72,094,000
ミルボン	12,400	4,215.00	52,266,000
ファンケル	22,300	5,430.00	121,089,000
コーセー	17,000	17,360.00	295,120,000
コタ	4,800	1,506.00	7,228,800
シーズ・ホールディングス	11,400	5,860.00	66,804,000
シーボン	1,200	2,712.00	3,254,400
ポーラ・オルビスホールディングス	42,800	3,045.00	130,326,000
ノエビアホールディングス	6,400	5,170.00	33,088,000
アジュバンコスメジャパン	2,300	996.00	2,290,800
エステー	7,200	2,140.00	15,408,000
アグロ カネショウ	4,100	2,309.00	9,466,900
コニシ	17,800	1,686.00	30,010,800
長谷川香料	12,000	2,045.00	24,540,000
星光P M C	6,800	932.00	6,337,600
小林製薬	28,100	7,360.00	206,816,000
荒川化学工業	9,000	1,601.00	14,409,000
メック	6,900	1,424.00	9,825,600
日本高純度化学	2,800	2,321.00	6,498,800

タカラバイオ	26,300	2,657.00	69,879,100
J C U	13,000	2,051.00	26,663,000
新田ゼラチン	6,400	778.00	4,979,200
O A Tアグリオ	1,400	2,510.00	3,514,000
デクセリアルズ	25,900	1,005.00	26,029,500
アース製薬	7,600	5,450.00	41,420,000
北興化学工業	10,300	594.00	6,118,200
大成ラミック	3,300	3,075.00	10,147,500
クミアイ化学工業	41,400	702.00	29,062,800
日本農薬	23,900	617.00	14,746,300
アキレス	7,300	2,299.00	16,782,700
有沢製作所	15,800	870.00	13,746,000
日東電工	75,800	6,200.00	469,960,000
レック	10,700	1,967.00	21,046,900
三光合成	7,700	410.00	3,157,000
きもと	17,000	230.00	3,910,000
藤森工業	9,000	3,245.00	29,205,000
前澤化成工業	6,900	1,106.00	7,631,400
ウェーブロックホールディングス	2,100	883.00	1,854,300
J S P	5,900	2,388.00	14,089,200
エフピコ	8,300	6,490.00	53,867,000
天馬	7,000	2,078.00	14,546,000
信越ポリマー	18,000	891.00	16,038,000
東リ	25,200	310.00	7,812,000
ニフコ	40,200	2,777.00	111,635,400
バルカー	8,200	2,737.00	22,443,400
ユニ・チャーム	212,700	3,149.00	669,792,300
協和発酵キリン	125,700	2,262.00	284,333,400
武田薬品工業	396,100	4,559.00	1,805,819,900
アステラス製薬	925,100	1,712.00	1,583,771,200
大日本住友製薬	74,400	2,936.00	218,438,400
塩野義製薬	131,300	7,528.00	988,426,400
田辺三菱製薬	104,900	1,710.00	179,379,000
わかもと製薬	11,800	281.00	3,315,800
あすか製薬	12,400	1,200.00	14,880,000
日本新薬	26,300	7,480.00	196,724,000
バイオフェルミン製薬	1,700	2,878.00	4,892,600
中外製薬	104,600	6,890.00	720,694,000
科研製薬	18,100	5,810.00	105,161,000
エーザイ	120,100	10,350.00	1,243,035,000
ロート製薬	51,500	3,610.00	185,915,000
小野薬品工業	237,000	2,709.50	642,151,500

久光製薬	29,600	6,930.00	205,128,000
持田製薬	7,600	9,690.00	73,644,000
参天製薬	190,200	1,870.00	355,674,000
扶桑薬品工業	3,500	2,768.00	9,688,000
日本ケミファ	1,300	4,085.00	5,310,500
ツムラ	31,100	3,570.00	111,027,000
日医工	24,600	1,655.00	40,713,000
キッセイ薬品工業	17,800	3,475.00	61,855,000
生化学工業	19,500	1,616.00	31,512,000
栄研化学	17,600	2,471.00	43,489,600
日水製薬	4,200	1,255.00	5,271,000
鳥居薬品	5,400	2,391.00	12,911,400
JCRファーマ	7,100	5,340.00	37,914,000
東和薬品	4,800	8,880.00	42,624,000
富士製薬工業	6,800	1,884.00	12,811,200
沢井製薬	20,600	5,910.00	121,746,000
ゼリア新薬工業	19,900	2,104.00	41,869,600
第一三共	287,100	4,468.00	1,282,762,800
キョーリン製薬ホールディングス	25,700	2,700.00	69,390,000
大幸薬品	4,500	2,150.00	9,675,000
ダイト	5,800	3,505.00	20,329,000
大塚ホールディングス	191,100	5,683.00	1,086,021,300
大正製薬ホールディングス	22,500	12,440.00	279,900,000
ペプチドリーム	46,200	4,395.00	203,049,000
日本コークス工業	84,600	107.00	9,052,200
昭和シェル石油	93,900	2,025.00	190,147,500
ニチレキ	12,800	1,089.00	13,939,200
ユシロ化学工業	5,200	1,400.00	7,280,000
ビーピー・カストロール	3,600	1,490.00	5,364,000
富士石油	24,300	380.00	9,234,000
MORESCO	3,600	1,675.00	6,030,000
出光興産	77,800	4,785.00	372,273,000
JXTGホールディングス	1,708,000	724.90	1,238,129,200
コスモエネルギーホールディングス	29,000	3,945.00	114,405,000
横浜ゴム	58,100	2,320.00	134,792,000
東洋ゴム工業	51,500	1,701.00	87,601,500
ブリヂストン	308,400	4,263.00	1,314,709,200
住友ゴム工業	90,100	1,572.00	141,637,200
藤倉ゴム工業	8,800	533.00	4,690,400
オカモト	7,000	5,620.00	39,340,000
フコク	4,400	966.00	4,250,400
ニッタ	11,300	4,095.00	46,273,500

住友理工	19,400	1,070.00	20,758,000
三ツ星ベルト	13,200	2,567.00	33,884,400
バンドー化学	19,100	1,330.00	25,403,000
日東紡績	14,900	2,291.00	34,135,900
A G C	101,200	3,880.00	392,656,000
日本板硝子	47,200	993.00	46,869,600
石塚硝子	1,500	2,221.00	3,331,500
日本山村硝子	4,200	1,747.00	7,337,400
日本電気硝子	43,400	2,975.00	129,115,000
オハラ	4,000	2,420.00	9,680,000
住友大阪セメント	20,300	4,580.00	92,974,000
太平洋セメント	63,400	3,655.00	231,727,000
日本ヒューム	10,100	931.00	9,403,100
日本コンクリート工業	21,700	323.00	7,009,100
三谷セキサン	4,700	2,808.00	13,197,600
アジアパイルホールディングス	14,300	702.00	10,038,600
東海カーボン	91,100	1,769.00	161,155,900
日本カーボン	4,800	6,290.00	30,192,000
東洋炭素	5,900	2,902.00	17,121,800
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	5,630.00	33,780,000
T O T O	77,200	4,365.00	336,978,000
日本碍子	122,500	1,683.00	206,167,500
日本特殊陶業	84,600	2,575.00	217,845,000
M A R U W A	3,500	6,440.00	22,540,000
品川リフラクトリーズ	2,600	5,050.00	13,130,000
黒崎播磨	2,000	7,260.00	14,520,000
ヨータイ	8,800	773.00	6,802,400
イソライト工業	5,200	509.00	2,646,800
東京窯業	12,700	424.00	5,384,800
ニッカトー	4,600	1,023.00	4,705,800
フジミインコーポレーテッド	9,000	2,544.00	22,896,000
クニミネ工業	3,400	1,002.00	3,406,800
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,136.00	2,158,400
ニチアス	27,500	2,381.00	65,477,500
ニチハ	14,000	2,575.00	36,050,000
新日鐵住金	444,000	2,197.50	975,690,000
神戸製鋼所	181,600	984.00	178,694,400
中山製鋼所	13,800	610.00	8,418,000
合同製鐵	4,800	2,006.00	9,628,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	268,000	2,172.50	582,230,000
日新製鋼	24,000	1,552.00	37,248,000
東京製鐵	53,100	920.00	48,852,000

共英製鋼	11,200	2,354.00	26,364,800
大和工業	21,100	3,070.00	64,777,000
東京鐵鋼	4,100	1,474.00	6,043,400
大阪製鐵	6,600	2,014.00	13,292,400
淀川製鋼所	13,400	2,435.00	32,629,000
丸一鋼管	35,100	3,345.00	117,409,500
モリ工業	3,000	3,030.00	9,090,000
大同特殊鋼	16,200	4,620.00	74,844,000
日本高周波鋼業	3,600	700.00	2,520,000
日本冶金工業	81,900	293.00	23,996,700
山陽特殊製鋼	12,500	2,713.00	33,912,500
愛知製鋼	5,600	4,155.00	23,268,000
日立金属	106,900	1,404.00	150,087,600
日本金属	2,300	1,509.00	3,470,700
大平洋金属	6,700	3,245.00	21,741,500
新日本電工	59,300	267.00	15,833,100
栗本鐵工所	5,000	1,671.00	8,355,000
虹技	1,500	1,672.00	2,508,000
日本鑄鉄管	1,000	1,318.00	1,318,000
三菱製鋼	7,300	1,952.00	14,249,600
日亜鋼業	14,300	324.00	4,633,200
日本精線	1,400	3,590.00	5,026,000
エンビプロ・ホールディングス	2,100	691.00	1,451,100
シンニッタン	15,200	367.00	5,578,400
新家工業	2,300	1,785.00	4,105,500
大紀アルミニウム工業所	16,500	704.00	11,616,000
日本軽金属ホールディングス	271,000	247.00	66,937,000
三井金属鉱業	26,800	2,587.00	69,331,600
東邦亜鉛	5,500	3,930.00	21,615,000
三菱マテリアル	65,600	3,025.00	198,440,000
住友金属鉱山	135,900	3,397.00	461,652,300
D O W Aホールディングス	23,200	3,530.00	81,896,000
古河機械金属	16,500	1,495.00	24,667,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,500	2,026.00	23,299,000
東邦チタニウム	17,900	1,408.00	25,203,200
U A C J	15,100	2,358.00	35,605,800
C Kサンエツ	1,900	2,927.00	5,561,300
古河電気工業	28,700	3,150.00	90,405,000
住友電気工業	371,100	1,578.00	585,595,800
フジクラ	120,100	480.00	57,648,000
昭和電線ホールディングス	11,400	691.00	7,877,400
東京特殊電線	1,300	2,050.00	2,665,000

タツタ電線	19,900	562.00	11,183,800
カナレ電気	1,700	2,055.00	3,493,500
平河ヒューテック	4,200	1,363.00	5,724,600
リョービ	12,200	3,410.00	41,602,000
アーレスティ	12,400	730.00	9,052,000
アサヒホールディングス	18,700	2,401.00	44,898,700
稲葉製作所	5,600	1,407.00	7,879,200
宮地エンジニアリンググループ	3,000	2,258.00	6,774,000
トーカロ	25,600	999.00	25,574,400
アルファC o	3,500	1,423.00	4,980,500
SUMCO	109,600	1,638.00	179,524,800
川田テクノロジーズ	2,200	7,520.00	16,544,000
RS Technologies	2,000	4,815.00	9,630,000
東洋製罐グループホールディングス	63,200	2,400.00	151,680,000
ホッカカンホールディングス	5,000	1,715.00	8,575,000
コロナ	5,500	1,138.00	6,259,000
横河ブリッジホールディングス	18,500	1,915.00	35,427,500
駒井ハルテック	1,900	2,303.00	4,375,700
高田機工	900	2,732.00	2,458,800
三和ホールディングス	102,500	1,349.00	138,272,500
文化シャッター	29,300	780.00	22,854,000
三協立山	13,800	1,324.00	18,271,200
アルインコ	7,900	1,067.00	8,429,300
東洋シャッター	2,400	640.00	1,536,000
LIXILグループ	146,400	1,451.00	212,426,400
日本フィルコン	7,500	605.00	4,537,500
ノーリツ	22,200	1,768.00	39,249,600
長府製作所	10,100	2,391.00	24,149,100
リンナイ	17,700	8,140.00	144,078,000
ダイニチ工業	5,300	747.00	3,959,100
日東精工	13,700	638.00	8,740,600
三洋工業	1,300	2,066.00	2,685,800
岡部	20,100	988.00	19,858,800
ジーテクト	11,000	1,743.00	19,173,000
東プレ	18,500	2,409.00	44,566,500
高周波熱錬	19,100	955.00	18,240,500
東京製綱	6,100	1,233.00	7,521,300
サンコール	5,600	785.00	4,396,000
モリテック スチール	7,700	475.00	3,657,500
パイオラックス	15,900	2,844.00	45,219,600
エイチワン	9,700	1,123.00	10,893,100
日本発條	98,900	991.00	98,009,900

中央発條	1,200	3,530.00	4,236,000
アドバネクス	1,300	1,902.00	2,472,600
立川ブラインド工業	4,400	1,196.00	5,262,400
三益半導体工業	7,800	1,530.00	11,934,000
日本ドライケミカル	2,700	1,299.00	3,507,300
日本製鋼所	30,200	2,466.00	74,473,200
三浦工業	43,000	2,779.00	119,497,000
タクマ	36,400	1,480.00	53,872,000
ツガミ	22,500	1,047.00	23,557,500
オークマ	12,700	5,600.00	71,120,000
東芝機械	11,300	2,004.00	22,645,200
アマダホールディングス	153,400	1,115.00	171,041,000
アイダエンジニアリング	27,800	966.00	26,854,800
滝澤鉄工所	3,100	1,634.00	5,065,400
F U J I	29,700	1,504.00	44,668,800
牧野フライス製作所	11,700	4,475.00	52,357,500
オーエスジー	48,900	2,325.00	113,692,500
ダイジェット工業	1,300	1,883.00	2,447,900
旭ダイヤモンド工業	26,300	744.00	19,567,200
D M G 森精機	62,900	1,563.00	98,312,700
ソディック	21,600	890.00	19,224,000
ディスコ	13,400	17,490.00	234,366,000
日東工器	5,400	2,570.00	13,878,000
日進工具	2,900	2,480.00	7,192,000
パンチ工業	6,800	617.00	4,195,600
富士ダイス	4,400	830.00	3,652,000
豊和工業	5,800	897.00	5,202,600
O K K	4,300	1,122.00	4,824,600
東洋機械金属	7,000	626.00	4,382,000
島精機製作所	13,800	3,355.00	46,299,000
オプトラン	9,700	2,140.00	20,758,000
N C ホールディングス	3,200	608.00	1,945,600
フリュー	7,900	936.00	7,394,400
ヤマシンフィルタ	17,200	880.00	15,136,000
日阪製作所	12,200	1,047.00	12,773,400
やまびこ	19,200	1,325.00	25,440,000
平田機工	4,700	7,310.00	34,357,000
ペガサスミシン製造	9,300	900.00	8,370,000
タツモ	3,100	1,124.00	3,484,400
ナプテスコ	54,700	2,836.00	155,129,200
三井海洋開発	10,500	3,100.00	32,550,000
レオン自動機	9,700	1,753.00	17,004,100

S M C	29,400	36,930.00	1,085,742,000
新川	5,900	507.00	2,991,300
ホソカワミクロン	3,500	5,320.00	18,620,000
ユニオンツール	4,300	3,980.00	17,114,000
オイレス工業	13,900	1,996.00	27,744,400
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,125.00	11,962,500
サトーホールディングス	12,000	3,015.00	36,180,000
技研製作所	6,800	3,945.00	26,826,000
日本エアーテック	3,100	725.00	2,247,500
カワタ	2,000	1,661.00	3,322,000
日精樹脂工業	8,600	1,097.00	9,434,200
オカダアイヨン	3,400	1,749.00	5,946,600
ワイエイシイホールディングス	4,000	782.00	3,128,000
小松製作所	454,400	3,115.00	1,415,456,000
住友重機械工業	57,500	3,690.00	212,175,000
日立建機	40,300	3,205.00	129,161,500
日工	2,800	2,503.00	7,008,400
巴工業	4,300	2,305.00	9,911,500
井関農機	10,200	2,025.00	20,655,000
T O W A	8,600	807.00	6,940,200
丸山製作所	2,400	1,650.00	3,960,000
北川鉄工所	4,600	2,909.00	13,381,400
ローツェ	4,400	1,878.00	8,263,200
タカキタ	3,400	672.00	2,284,800
クボタ	538,300	1,885.50	1,014,964,650
荏原実業	3,100	1,879.00	5,824,900
三菱化工機	3,600	1,716.00	6,177,600
月島機械	20,100	1,327.00	26,672,700
帝国電機製作所	7,000	1,786.00	12,502,000
新東工業	24,100	992.00	23,907,200
澁谷工業	8,800	4,210.00	37,048,000
アイチ コーポレーション	17,700	660.00	11,682,000
小森コーポレーション	27,400	1,255.00	34,387,000
鶴見製作所	7,900	2,012.00	15,894,800
住友精密工業	1,700	3,595.00	6,111,500
酒井重工業	1,900	2,930.00	5,567,000
荏原製作所	44,500	3,345.00	148,852,500
石井鐵工所	1,700	1,884.00	3,202,800
西島製作所	10,500	939.00	9,859,500
北越工業	10,300	1,235.00	12,720,500
ダイキン工業	137,000	12,905.00	1,767,985,000
オルガノ	3,700	3,090.00	11,433,000

トーヨーカネツ	3,900	2,493.00	9,722,700
栗田工業	54,400	3,010.00	163,744,000
椿本チエイン	13,200	4,295.00	56,694,000
大同工業	5,000	1,019.00	5,095,000
木村化工機	9,000	402.00	3,618,000
アネスト岩田	15,600	1,269.00	19,796,400
ダイフク	55,300	5,440.00	300,832,000
サムコ	2,800	1,194.00	3,343,200
加藤製作所	5,200	2,989.00	15,542,800
油研工業	1,800	2,170.00	3,906,000
タダノ	48,600	1,365.00	66,339,000
フジテック	36,500	1,351.00	49,311,500
C K D	27,900	1,261.00	35,181,900
キトー	7,600	1,919.00	14,584,400
平和	28,000	2,657.00	74,396,000
理想科学工業	8,900	2,062.00	18,351,800
SANKYO	25,100	4,445.00	111,569,500
日本金銭機械	11,100	1,071.00	11,888,100
マースグループホールディングス	6,400	2,362.00	15,116,800
福島工業	6,200	4,560.00	28,272,000
オーイズミ	4,100	495.00	2,029,500
ダイコク電機	4,600	1,645.00	7,567,000
竹内製作所	16,800	2,452.00	41,193,600
アマノ	28,700	2,333.00	66,957,100
JUKI	14,000	1,520.00	21,280,000
サンデンホールディングス	12,200	918.00	11,199,600
蛇の目ミシン工業	9,000	580.00	5,220,000
マックス	15,400	1,523.00	23,454,200
グローリー	27,800	3,015.00	83,817,000
新晃工業	9,300	1,628.00	15,140,400
大和冷機工業	14,500	1,275.00	18,487,500
セガサミーホールディングス	99,500	1,640.00	163,180,000
日本ピストンリング	3,700	2,145.00	7,936,500
リケン	4,600	5,560.00	25,576,000
T P R	13,500	2,718.00	36,693,000
ツバキ・ナカシマ	15,100	1,971.00	29,762,100
ホシザキ	29,300	9,110.00	266,923,000
大豊工業	8,200	1,144.00	9,380,800
日本精工	206,100	1,088.00	224,236,800
NTN	215,600	378.00	81,496,800
ジェイテクト	96,200	1,374.00	132,178,800
不二越	9,300	4,750.00	44,175,000

日本トムソン	29,700	596.00	17,701,200
THK	62,500	2,586.00	161,625,000
ユーシン精機	7,800	1,282.00	9,999,600
前澤給装工業	3,900	1,888.00	7,363,200
イーグル工業	12,400	1,506.00	18,674,400
前澤工業	7,200	388.00	2,793,600
日本ピラー工業	10,100	1,570.00	15,857,000
キット	40,700	963.00	39,194,100
マキタ	122,100	4,585.00	559,828,500
日立造船	80,200	412.00	33,042,400
三菱重工業	168,200	4,322.00	726,960,400
IHI	77,200	4,005.00	309,186,000
スター精密	17,300	1,625.00	28,112,500
日清紡ホールディングス	56,000	1,103.00	61,768,000
イビデン	61,700	1,620.00	99,954,000
コニカミノルタ	219,600	1,048.00	230,140,800
ブラザー工業	130,900	1,882.00	246,353,800
ミネベアミツミ	186,500	1,753.00	326,934,500
日立製作所	451,800	3,467.00	1,566,390,600
三菱電機	1,003,500	1,464.50	1,469,625,750
富士電機	65,200	3,615.00	235,698,000
東洋電機製造	4,200	1,595.00	6,699,000
安川電機	116,400	3,345.00	389,358,000
シンフォニアテクノロジー	14,200	1,625.00	23,075,000
明電舎	20,100	1,619.00	32,541,900
オリジン電気	2,900	1,947.00	5,646,300
山洋電気	4,900	4,470.00	21,903,000
デンヨー	9,500	1,641.00	15,589,500
東芝テック	12,700	3,200.00	40,640,000
芝浦メカトロニクス	1,900	4,270.00	8,113,000
マブチモーター	27,900	3,915.00	109,228,500
日本電産	120,800	14,530.00	1,755,224,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,500	2,532.00	13,926,000
トレックス・セミコンダクター	3,600	1,588.00	5,716,800
東光高岳	5,300	1,691.00	8,962,300
ダブル・スコープ	15,000	1,180.00	17,700,000
ダイヘン	11,100	2,644.00	29,348,400
ヤーマン	14,700	1,995.00	29,326,500
JVCケンウッド	74,600	315.00	23,499,000
ミマキエンジニアリング	9,400	917.00	8,619,800
第一精工	4,400	1,333.00	5,865,200
日新電機	23,900	931.00	22,250,900

大崎電気工業	20,400	846.00	17,258,400
オムロン	106,700	4,845.00	516,961,500
日東工業	16,300	2,010.00	32,763,000
I D E C	13,600	2,467.00	33,551,200
不二電機工業	1,400	1,380.00	1,932,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,200	2,575.00	93,215,000
サクサホールディングス	2,700	2,166.00	5,848,200
メルコホールディングス	4,300	3,915.00	16,834,500
テクノメディカ	1,800	2,157.00	3,882,600
日本電気	129,900	3,305.00	429,319,500
富士通	96,800	7,086.00	685,924,800
沖電気工業	43,700	1,540.00	67,298,000
岩崎通信機	4,700	797.00	3,745,900
電気興業	5,400	2,573.00	13,894,200
サンケン電気	11,900	2,539.00	30,214,100
ナカヨ	2,200	1,532.00	3,370,400
アイホン	5,900	1,595.00	9,410,500
ルネサスエレクトロニクス	104,500	611.00	63,849,500
セイコーエプソン	124,700	1,866.00	232,690,200
ワコム	73,200	595.00	43,554,000
アルバック	23,200	4,165.00	96,628,000
アクセル	4,700	603.00	2,834,100
E I Z O	9,300	4,005.00	37,246,500
日本信号	25,900	1,022.00	26,469,800
京三製作所	22,200	520.00	11,544,000
能美防災	13,400	2,405.00	32,227,000
ホーチキ	6,700	1,262.00	8,455,400
星和電機	4,700	506.00	2,378,200
エレコム	9,200	2,917.00	26,836,400
パナソニック	1,146,500	1,160.00	1,329,940,000
シャープ	99,500	1,768.00	175,916,000
アンリツ	64,800	1,818.00	117,806,400
富士通ゼネラル	30,900	1,604.00	49,563,600
ソニー	672,600	6,056.00	4,073,265,600
T D K	52,500	9,570.00	502,425,000
帝国通信工業	4,700	1,239.00	5,823,300
タムラ製作所	39,300	617.00	24,248,100
アルプス電気	92,800	2,664.00	247,219,200
池上通信機	3,200	1,405.00	4,496,000
日本電波工業	7,800	523.00	4,079,400
鈴木	5,400	753.00	4,066,200
日本トリム	1,900	6,120.00	11,628,000

ローランド ディー・ジー・	5,300	2,374.00	12,582,200
フォスター電機	12,000	1,605.00	19,260,000
クラリオン	10,300	2,471.00	25,451,300
S M K	3,000	2,463.00	7,389,000
ヨコオ	7,400	1,522.00	11,262,800
ホシデン	29,900	933.00	27,896,700
ヒロセ電機	14,400	12,100.00	174,240,000
日本航空電子工業	23,200	1,481.00	34,359,200
T O A	11,100	1,126.00	12,498,600
マクセルホールディングス	21,800	1,643.00	35,817,400
古野電気	13,200	1,272.00	16,790,400
ユニデンホールディングス	3,100	2,637.00	8,174,700
アルパイン	17,600	1,912.00	33,651,200
スミダコーポレーション	8,900	1,452.00	12,922,800
アイコム	5,700	2,405.00	13,708,500
リオン	4,800	2,214.00	10,627,200
本多通信工業	9,200	625.00	5,750,000
横河電機	100,600	2,284.00	229,770,400
新電元工業	3,600	4,655.00	16,758,000
アズビル	64,900	2,279.00	147,907,100
東亜ディーケーケー	5,300	1,041.00	5,517,300
日本光電工業	44,300	3,300.00	146,190,000
チノー	3,700	1,346.00	4,980,200
共和電業	11,300	430.00	4,859,000
日本電子材料	4,500	783.00	3,523,500
堀場製作所	19,900	5,370.00	106,863,000
アドバンテスト	68,500	2,324.00	159,194,000
小野測器	5,100	744.00	3,794,400
エスベック	9,100	2,071.00	18,846,100
キーエンス	49,200	60,840.00	2,993,328,000
日置電機	5,300	4,250.00	22,525,000
シスメックス	78,200	6,700.00	523,940,000
日本マイクロニクス	16,700	758.00	12,658,600
メガチップス	8,100	2,497.00	20,225,700
O B A R A G R O U P	5,900	4,785.00	28,231,500
澤藤電機	1,400	2,034.00	2,847,600
原田工業	3,500	873.00	3,055,500
コーセル	14,200	1,208.00	17,153,600
イリソ電子工業	9,300	4,995.00	46,453,500
オブテックスグループ	17,800	2,045.00	36,401,000
千代田インテグレ	4,400	2,396.00	10,542,400
アイ・オー・データ機器	4,500	1,293.00	5,818,500

レーザーテック	20,700	3,405.00	70,483,500
スタンレー電気	71,200	3,420.00	243,504,000
岩崎電気	4,100	1,571.00	6,441,100
ウシオ電機	61,200	1,324.00	81,028,800
岡谷電機産業	7,900	437.00	3,452,300
ハリオス テクノ ホールディング	9,600	764.00	7,334,400
日本セラミック	10,300	2,829.00	29,138,700
遠藤照明	5,500	829.00	4,559,500
古河電池	7,600	818.00	6,216,800
双信電機	5,700	432.00	2,462,400
山一電機	7,600	1,304.00	9,910,400
図研	6,700	1,896.00	12,703,200
日本電子	20,000	1,952.00	39,040,000
カシオ計算機	89,000	1,659.00	147,651,000
ファナック	95,400	20,085.00	1,916,109,000
日本シイエムケイ	26,000	877.00	22,802,000
エンプラス	4,700	3,160.00	14,852,000
大真空	4,000	1,127.00	4,508,000
ローム	48,500	8,140.00	394,790,000
浜松ホトニクス	72,100	3,840.00	276,864,000
三井ハイテック	11,400	1,233.00	14,056,200
新光電気工業	34,200	790.00	27,018,000
京セラ	153,000	6,077.00	929,781,000
太陽誘電	44,800	2,325.00	104,160,000
村田製作所	105,300	17,850.00	1,879,605,000
ユーシン	15,800	978.00	15,452,400
双葉電子工業	16,600	1,777.00	29,498,200
北陸電気工業	4,100	1,102.00	4,518,200
ニチコン	32,000	880.00	28,160,000
日本ケミコン	7,100	2,271.00	16,124,100
K O A	15,400	1,596.00	24,578,400
市光工業	15,500	766.00	11,873,000
小糸製作所	60,200	6,000.00	361,200,000
ミツバ	18,900	769.00	14,534,100
S C R E E Nホールディングス	17,500	5,950.00	104,125,000
キャノン電子	9,400	2,188.00	20,567,200
キャノン	540,200	3,298.00	1,781,579,600
リコー	302,000	1,133.00	342,166,000
象印マホービン	19,000	1,208.00	22,952,000
M U T O Hホールディングス	1,500	2,291.00	3,436,500
東京エレクトロン	66,900	15,295.00	1,023,235,500
トヨタ紡織	35,100	1,938.00	68,023,800

芦森工業	2,100	1,796.00	3,771,600
ユニプレス	19,400	2,264.00	43,921,600
豊田自動織機	81,200	5,720.00	464,464,000
モリタホールディングス	17,600	2,089.00	36,766,400
三櫻工業	12,800	672.00	8,601,600
デンソー	222,600	5,225.00	1,163,085,000
東海理化電機製作所	26,500	2,219.00	58,803,500
三井E & Sホールディングス	36,100	1,179.00	42,561,900
川崎重工業	78,100	2,707.00	211,416,700
名村造船所	30,100	550.00	16,555,000
日本車輛製造	3,700	2,618.00	9,686,600
三菱ロジスネクスト	11,900	1,293.00	15,386,700
近畿車輛	1,100	2,390.00	2,629,000
日産自動車	1,183,300	1,029.00	1,217,615,700
いすゞ自動車	317,100	1,614.50	511,957,950
トヨタ自動車	1,118,100	6,709.00	7,501,332,900
日野自動車	125,300	1,091.00	136,702,300
三菱自動車工業	371,400	762.00	283,006,800
エフテック	7,100	1,098.00	7,795,800
レシップホールディングス	3,500	726.00	2,541,000
G M B	2,000	1,181.00	2,362,000
ファルテック	1,800	988.00	1,778,400
武蔵精密工業	23,700	1,720.00	40,764,000
日産車体	19,600	988.00	19,364,800
新明和工業	46,700	1,491.00	69,629,700
極東開発工業	20,000	1,571.00	31,420,000
日信工業	18,400	1,548.00	28,483,200
トピー工業	8,300	2,725.00	22,617,500
ティラド	3,700	2,801.00	10,363,700
曙ブレーキ工業	54,900	194.00	10,650,600
タチエス	17,100	1,507.00	25,769,700
N O K	54,000	1,603.00	86,562,000
フタバ産業	27,900	667.00	18,609,300
K Y B	9,700	2,767.00	26,839,900
大同メタル工業	16,400	889.00	14,579,600
プレス工業	49,700	592.00	29,422,400
ミクニ	12,700	603.00	7,658,100
太平洋工業	21,000	1,642.00	34,482,000
ケーヒン	23,100	2,087.00	48,209,700
河西工業	12,400	997.00	12,362,800
アイシン精機	82,600	4,395.00	363,027,000
マツダ	314,900	1,204.50	379,297,050

今仙電機製作所	9,400	1,059.00	9,954,600
本田技研工業	846,400	3,282.00	2,777,884,800
スズキ	183,600	5,425.00	996,030,000
S U B A R U	311,500	2,674.50	833,106,750
安永	4,900	1,864.00	9,133,600
ヤマハ発動機	141,700	2,333.00	330,586,100
ショーワ	23,700	1,557.00	36,900,900
T B K	12,100	457.00	5,529,700
エクセディ	13,600	2,961.00	40,269,600
豊田合成	32,400	2,316.00	75,038,400
愛三工業	15,800	836.00	13,208,800
盟和産業	1,600	1,173.00	1,876,800
日本プラスト	7,900	916.00	7,236,400
ヨロズ	9,400	1,625.00	15,275,000
エフ・シー・シー	18,100	2,931.00	53,051,100
シマノ	40,400	15,370.00	620,948,000
テイ・エス テック	23,300	3,400.00	79,220,000
ジャムコ	5,000	2,964.00	14,820,000
テルモ	142,000	6,335.00	899,570,000
クリエートメディック	3,300	1,111.00	3,666,300
日機装	32,400	1,284.00	41,601,600
島津製作所	129,100	2,636.00	340,307,600
J M S	9,200	602.00	5,538,400
長野計器	7,900	980.00	7,742,000
ブイ・テクノロジー	2,400	14,490.00	34,776,000
東京計器	6,400	1,143.00	7,315,200
愛知時計電機	1,300	3,945.00	5,128,500
インターアクション	5,300	2,181.00	11,559,300
オーバル	9,700	278.00	2,696,600
東京精密	18,100	2,901.00	52,508,100
マニー	12,200	5,110.00	62,342,000
ニコン	174,800	1,876.00	327,924,800
トプコン	53,900	1,601.00	86,293,900
オリンパス	149,500	3,745.00	559,877,500
理研計器	8,900	2,300.00	20,470,000
タムロン	8,900	1,858.00	16,536,200
H O Y A	202,000	6,917.00	1,397,234,000
シード	4,300	1,937.00	8,329,100
ノーリツ鋼機	7,900	1,881.00	14,859,900
エー・アンド・デイ	9,200	936.00	8,611,200
朝日インテック	36,200	4,840.00	175,208,000
シチズン時計	109,800	631.00	69,283,800

リズム時計工業	3,400	1,982.00	6,738,800
大研医器	8,000	787.00	6,296,000
メニコン	13,800	2,493.00	34,403,400
シンシア	1,500	544.00	816,000
松風	4,900	1,267.00	6,208,300
セイコーホールディングス	15,500	2,676.00	41,478,000
ニプロ	69,400	1,496.00	103,822,400
中本パックス	2,800	1,844.00	5,163,200
スノーピーク	3,600	1,533.00	5,518,800
パラマウントベッドホールディングス	11,500	4,705.00	54,107,500
トランザクション	5,400	863.00	4,660,200
S H O - B I	2,900	398.00	1,154,200
ニホンフラッシュ	4,300	2,006.00	8,625,800
前田工織	11,000	2,545.00	27,995,000
永大産業	13,100	432.00	5,659,200
アートネイチャー	10,600	680.00	7,208,000
バンダイナムコホールディングス	103,700	4,750.00	492,575,000
アイフィスジャパン	2,200	711.00	1,564,200
共立印刷	16,700	268.00	4,475,600
S H O E I	4,800	4,845.00	23,256,000
フランスベッドホールディングス	14,200	978.00	13,887,600
パイロットコーポレーション	17,500	5,690.00	99,575,000
萩原工業	5,600	1,717.00	9,615,200
トッパン・フォームズ	21,500	996.00	21,414,000
フジシールインターナショナル	22,500	3,465.00	77,962,500
タカラトミー	42,000	1,295.00	54,390,000
廣済堂	9,200	452.00	4,158,400
エステールホールディングス	2,600	724.00	1,882,400
アーク	37,700	98.00	3,694,600
タカノ	3,900	872.00	3,400,800
プロネクサス	8,600	1,100.00	9,460,000
ホクシン	6,100	158.00	963,800
ウッドワン	3,400	1,149.00	3,906,600
大建工業	7,600	2,111.00	16,043,600
凸版印刷	141,600	1,723.00	243,976,800
大日本印刷	141,400	2,591.00	366,367,400
図書印刷	9,400	869.00	8,168,600
共同印刷	3,100	2,620.00	8,122,000
N I S S H A	20,600	2,086.00	42,971,600
光村印刷	900	2,284.00	2,055,600
宝印刷	5,200	1,834.00	9,536,800
アシックス	99,600	1,544.00	153,782,400

ツツミ	3,100	2,099.00	6,506,900
小松ウオール工業	3,100	2,157.00	6,686,700
ヤマハ	59,700	5,260.00	314,022,000
河合楽器製作所	3,100	3,955.00	12,260,500
クリナップ	9,200	654.00	6,016,800
ピジョン	60,600	5,160.00	312,696,000
兼松サステック	600	1,781.00	1,068,600
キングジム	8,300	901.00	7,478,300
リンテック	23,900	2,619.00	62,594,100
イトーキ	18,400	606.00	11,150,400
任天堂	61,800	36,290.00	2,242,722,000
三菱鉛筆	16,500	2,098.00	34,617,000
タカラスタANDARD	20,700	1,805.00	37,363,500
コクヨ	48,100	1,764.00	84,848,400
ナカバヤシ	9,900	601.00	5,949,900
グローブライド	4,900	2,967.00	14,538,300
オカムラ	35,000	1,637.00	57,295,000
美津濃	9,900	2,605.00	25,789,500
東京電力ホールディングス	800,900	598.00	478,938,200
中部電力	307,000	1,628.00	499,796,000
関西電力	409,400	1,819.50	744,903,300
中国電力	138,700	1,417.00	196,537,900
北陸電力	98,300	1,007.00	98,988,100
東北電力	235,000	1,447.00	340,045,000
四国電力	90,300	1,322.00	119,376,600
九州電力	206,800	1,330.00	275,044,000
北海道電力	93,900	696.00	65,354,400
沖縄電力	18,600	2,124.00	39,506,400
電源開発	79,800	2,981.00	237,883,800
エフオン	6,100	1,046.00	6,380,600
イーレックス	17,400	938.00	16,321,200
レノバ	10,400	1,292.00	13,436,800
東京瓦斯	196,800	2,847.50	560,388,000
大阪瓦斯	194,700	2,158.00	420,162,600
東邦瓦斯	49,700	4,300.00	213,710,000
北海道瓦斯	5,400	1,477.00	7,975,800
広島ガス	20,700	350.00	7,245,000
西部瓦斯	11,300	2,467.00	27,877,100
静岡ガス	30,900	1,004.00	31,023,600
メタウォーター	4,800	3,120.00	14,976,000
SBSホールディングス	9,900	1,425.00	14,107,500
東武鉄道	105,800	3,250.00	343,850,000

相鉄ホールディングス	34,400	3,465.00	119,196,000
東京急行電鉄	272,500	1,931.00	526,197,500
京浜急行電鉄	137,400	1,766.00	242,648,400
小田急電鉄	160,700	2,433.00	390,983,100
京王電鉄	56,100	6,130.00	343,893,000
京成電鉄	75,200	3,575.00	268,840,000
富士急行	13,700	3,000.00	41,100,000
新京成電鉄	2,600	2,156.00	5,605,600
東日本旅客鉄道	178,400	10,155.00	1,811,652,000
西日本旅客鉄道	89,900	7,886.00	708,951,400
東海旅客鉄道	89,800	22,105.00	1,985,029,000
西武ホールディングス	127,900	2,197.00	280,996,300
鴻池運輸	16,000	1,793.00	28,688,000
西日本鉄道	27,800	2,907.00	80,814,600
ハマキョウレックス	7,700	3,950.00	30,415,000
サカイ引越センター	5,300	6,280.00	33,284,000
近鉄グループホールディングス	95,000	4,500.00	427,500,000
阪急阪神ホールディングス	126,700	3,820.00	483,994,000
南海電気鉄道	42,400	2,767.00	117,320,800
京阪ホールディングス	42,300	4,650.00	196,695,000
神戸電鉄	2,400	3,995.00	9,588,000
名古屋鉄道	76,100	2,825.00	214,982,500
山陽電気鉄道	7,300	2,341.00	17,089,300
日本通運	37,300	7,440.00	277,512,000
ヤマトホールディングス	166,600	2,948.50	491,220,100
山九	26,400	5,670.00	149,688,000
丸運	5,300	330.00	1,749,000
丸全昭和運輸	7,600	3,045.00	23,142,000
センコーグループホールディングス	52,400	824.00	43,177,600
トナミホールディングス	2,300	6,100.00	14,030,000
ニッコンホールディングス	36,100	2,937.00	106,025,700
日本石油輸送	1,100	2,815.00	3,096,500
福山通運	12,200	4,850.00	59,170,000
セイノーホールディングス	71,200	1,760.00	125,312,000
エスライン	2,900	1,217.00	3,529,300
神奈川中央交通	2,400	3,825.00	9,180,000
日立物流	20,900	3,010.00	62,909,000
丸和運輸機関	5,000	3,595.00	17,975,000
C & F ロジホールディングス	9,600	1,420.00	13,632,000
九州旅客鉄道	79,700	3,540.00	282,138,000
S Gホールディングス	89,800	2,834.00	254,493,200
日本郵船	79,800	1,923.00	153,455,400

商船三井	56,600	2,718.00	153,838,800
川崎汽船	29,700	1,660.00	49,302,000
N S ユナイテッド海運	5,500	2,787.00	15,328,500
飯野海運	46,200	490.00	22,638,000
共栄タンカー	1,200	1,919.00	2,302,800
乾汽船	8,500	952.00	8,092,000
日本航空	174,000	4,111.00	715,314,000
A N A ホールディングス	173,700	4,030.00	700,011,000
パスコ	1,800	1,229.00	2,212,200
ランコム	2,700	6,550.00	17,685,000
日新	8,200	2,048.00	16,793,600
三菱倉庫	32,900	2,742.00	90,211,800
三井倉庫ホールディングス	11,600	2,058.00	23,872,800
住友倉庫	35,700	1,436.00	51,265,200
澁澤倉庫	5,200	1,638.00	8,517,600
東陽倉庫	16,900	308.00	5,205,200
日本トランスシティ	20,900	490.00	10,241,000
ケイヒン	1,800	1,436.00	2,584,800
中央倉庫	5,800	1,082.00	6,275,600
川西倉庫	1,900	1,667.00	3,167,300
安田倉庫	7,800	885.00	6,903,000
東洋埠頭	2,900	1,529.00	4,434,100
宇徳	8,000	536.00	4,288,000
上組	58,600	2,428.00	142,280,800
サンリツ	2,200	681.00	1,498,200
キムラユニティー	2,500	1,138.00	2,845,000
キューソー流通システム	2,400	2,628.00	6,307,200
近鉄エクスプレス	17,900	1,832.00	32,792,800
東海運	5,300	304.00	1,611,200
エーアイティー	6,200	1,089.00	6,751,800
内外トランスライン	3,000	1,716.00	5,148,000
日本コンセプト	2,600	1,130.00	2,938,000
N E C ネットズエスアイ	10,900	2,573.00	28,045,700
システナ	35,300	1,338.00	47,231,400
デジタルアーツ	5,300	6,090.00	32,277,000
新日鉄住金ソリューションズ	14,800	3,280.00	48,544,000
キューブシステム	5,500	814.00	4,477,000
エイジア	2,100	1,399.00	2,937,900
コア	4,300	1,407.00	6,050,100
ソリトンシステムズ	5,700	987.00	5,625,900
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,693.00	7,449,200
T I S	32,900	5,280.00	173,712,000

ネオス	2,600	1,293.00	3,361,800
電算システム	3,800	2,262.00	8,595,600
グリー	53,100	488.00	25,912,800
コーエーテクモホールディングス	20,200	1,810.00	36,562,000
三菱総合研究所	3,900	3,890.00	15,171,000
電算	1,200	2,104.00	2,524,800
A G S	5,800	788.00	4,570,400
ファインデックス	8,600	682.00	5,865,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,300	1,969.00	4,528,700
ブレインパッド	2,100	6,120.00	12,852,000
K L a b	17,500	1,065.00	18,637,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,600	2,387.00	15,754,200
イーブুকイニシアティブジャパン	1,700	1,545.00	2,626,500
ネクソン	250,800	1,197.00	300,207,600
アイスタイル	25,300	1,007.00	25,477,100
エムアップ	3,400	2,368.00	8,051,200
エイチーム	6,200	1,861.00	11,538,200
テクノスジャパン	8,500	970.00	8,245,000
コロプラ	28,400	828.00	23,515,200
ブロードリーフ	49,000	683.00	33,467,000
クロス・マーケティンググループ	3,100	467.00	1,447,700
デジタルハーツホールディングス	4,600	1,650.00	7,590,000
メディアドゥホールディングス	2,900	2,568.00	7,447,200
じげん	10,600	711.00	7,536,600
サイバーリンクス	1,700	1,055.00	1,793,500
フィックスターズ	9,600	1,366.00	13,113,600
VOYAGE GROUP	5,300	1,380.00	7,314,000
オブティム	2,200	3,780.00	8,316,000
セレス	3,300	2,099.00	6,926,700
ベリサーブ	1,000	6,020.00	6,020,000
ティーガイア	9,900	2,486.00	24,611,400
セック	1,600	4,560.00	7,296,000
日本アジアグループ	10,400	381.00	3,962,400
豆蔵ホールディングス	6,900	1,081.00	7,458,900
テクマトリックス	7,000	1,877.00	13,139,000
プロシップ	1,500	2,600.00	3,900,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	238,100	232.00	55,239,200
GMOペイメントゲートウェイ	16,200	5,710.00	92,502,000
ザッパラス	5,100	381.00	1,943,100
システムリサーチ	1,400	3,545.00	4,963,000
インターネットイニシアティブ	16,100	2,516.00	40,507,600
さくらインターネット	12,100	568.00	6,872,800

ヴィンクス	3,400	1,726.00	5,868,400
GMOクラウド	2,200	3,045.00	6,699,000
SRAホールディングス	5,300	2,922.00	15,486,600
Minorisoソリューションズ	2,100	1,504.00	3,158,400
朝日ネット	8,400	518.00	4,351,200
eBASE	3,100	1,531.00	4,746,100
アバント	2,800	1,327.00	3,715,600
アドソル日進	3,600	2,006.00	7,221,600
フリービット	6,800	864.00	5,875,200
コムチュア	5,600	3,355.00	18,788,000
サイバーコム	1,900	1,817.00	3,452,300
アステリア	5,100	894.00	4,559,400
マークラインズ	3,500	1,546.00	5,411,000
メディカル・データ・ビジョン	8,800	1,711.00	15,056,800
ショーケース・ティービー	2,300	995.00	2,288,500
モバイルファクトリー	2,900	1,443.00	4,184,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,536.00	6,912,000
PCIホールディングス	1,800	2,964.00	5,335,200
パイプドHD	1,700	1,032.00	1,754,400
アイビーシー	1,700	1,270.00	2,159,000
ネオジャパン	2,100	910.00	1,911,000
PR TIMES	700	1,987.00	1,390,900
ランドコンピュータ	1,300	1,095.00	1,423,500
オープンドア	4,900	2,589.00	12,686,100
マイネット	3,300	1,111.00	3,666,300
アカツキ	3,500	5,590.00	19,565,000
ベネフィットジャパン	800	775.00	620,000
Ubicomホールディングス	1,900	1,080.00	2,052,000
LINE	30,000	3,390.00	101,700,000
カナミックネットワーク	1,600	2,069.00	3,310,400
ノムラシステムコーポレーション	1,000	1,081.00	1,081,000
チェンジ	700	4,770.00	3,339,000
シンクロ・フード	4,300	621.00	2,670,300
オークネット	5,300	1,194.00	6,328,200
AOI TYO Holdings	10,900	1,259.00	13,723,100
マクロミル	12,500	1,952.00	24,400,000
ビーグリー	2,000	1,387.00	2,774,000
オロ	1,000	4,290.00	4,290,000
ソルクシーズ	4,400	855.00	3,762,000
フェイス	4,000	1,243.00	4,972,000
ハイマックス	1,300	1,796.00	2,334,800
野村総合研究所	62,700	5,170.00	324,159,000

サイバネットシステム	8,300	687.00	5,702,100
C Eホールディングス	2,800	791.00	2,214,800
日本システム技術	1,700	2,014.00	3,423,800
インテージホールディングス	12,800	1,085.00	13,888,000
東邦システムサイエンス	3,100	887.00	2,749,700
ソースネクスト	19,200	1,035.00	19,872,000
F I G	9,000	450.00	4,050,000
フォーカスシステムズ	6,800	1,078.00	7,330,400
クレスコ	3,000	3,520.00	10,560,000
フジ・メディア・ホールディングス	102,200	1,809.00	184,879,800
オービック	34,100	9,810.00	334,521,000
ジャストシステム	14,100	2,298.00	32,401,800
T D C ソフト	8,800	976.00	8,588,800
ヤフー	642,500	327.00	210,097,500
トレンドマイクロ	52,500	6,410.00	336,525,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,900	1,624.00	4,709,600
日本オラクル	16,000	7,430.00	118,880,000
アルファシステムズ	3,300	2,805.00	9,256,500
フューチャー	13,500	1,654.00	22,329,000
C A C H o l d i n g s	7,600	1,081.00	8,215,600
ソフトバンク・テクノロジー	4,200	2,075.00	8,715,000
トーセ	2,900	934.00	2,708,600
オービックビジネスコンサルタント	5,000	9,600.00	48,000,000
伊藤忠テクノソリューションズ	45,000	2,039.00	91,755,000
アイティフォー	12,200	797.00	9,723,400
東計電算	1,500	3,430.00	5,145,000
エクスネット	2,000	930.00	1,860,000
大塚商会	53,300	4,045.00	215,598,500
サイボウズ	11,800	741.00	8,743,800
ソフトブレーン	8,000	569.00	4,552,000
電通国際情報サービス	6,100	4,080.00	24,888,000
デジタルガレージ	19,200	3,190.00	61,248,000
E M システムズ	8,100	1,255.00	10,165,500
ウェザーニューズ	3,400	3,420.00	11,628,000
C I J	8,000	753.00	6,024,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,162.00	2,378,200
日本エンタープライズ	10,800	233.00	2,516,400
WOWOW	4,800	3,315.00	15,912,000
スカラ	8,100	918.00	7,435,800
I M A G I C A G R O U P	8,700	607.00	5,280,900
ネットワンシステムズ	34,900	2,287.00	79,816,300
システムソフト	24,900	115.00	2,863,500

アルゴグラフィックス	4,200	4,445.00	18,669,000
マーベラス	15,200	941.00	14,303,200
エイベックス	17,000	1,512.00	25,704,000
日本ユニシス	30,800	2,764.00	85,131,200
兼松エレクトロニクス	5,400	3,785.00	20,439,000
東京放送ホールディングス	65,400	2,050.00	134,070,000
日本テレビホールディングス	90,500	1,865.00	168,782,500
朝日放送グループホールディングス	9,900	804.00	7,959,600
テレビ朝日ホールディングス	27,100	2,292.00	62,113,200
スカパーJ S A Tホールディングス	75,500	536.00	40,468,000
テレビ東京ホールディングス	8,100	2,562.00	20,752,200
日本BS放送	3,500	1,247.00	4,364,500
ビジョン	3,100	4,340.00	13,454,000
ワイヤレスゲート	4,600	560.00	2,576,000
コネクシオ	7,100	1,604.00	11,388,400
クロップス	2,100	780.00	1,638,000
日本電信電話	673,400	4,573.00	3,079,458,200
K D D I	867,700	2,466.50	2,140,182,050
光通信	11,600	19,110.00	221,676,000
N T T ドコモ	707,000	2,550.00	1,802,850,000
エムティーアイ	11,600	589.00	6,832,400
G M O インターネット	36,000	1,662.00	59,832,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,400	557.00	1,336,800
カドカワ	28,900	1,373.00	39,679,700
学研ホールディングス	3,300	6,280.00	20,724,000
ゼンリン	19,700	2,750.00	54,175,000
昭文社	4,800	577.00	2,769,600
インプレスホールディングス	8,000	166.00	1,328,000
アイネット	5,700	1,626.00	9,268,200
松竹	6,500	11,280.00	73,320,000
東宝	64,800	3,710.00	240,408,000
東映	4,200	12,560.00	52,752,000
エヌ・ティ・ティ・データ	262,300	1,401.00	367,482,300
ピー・シー・エー	1,400	2,020.00	2,828,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,200.00	3,960,000
D T S	11,000	4,245.00	46,695,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,900	3,900.00	179,010,000
シーイーシー	10,600	2,414.00	25,588,400
カブコン	42,300	2,257.00	95,471,100
アイ・エス・ビー	2,000	2,289.00	4,578,000
ジャステック	5,900	1,117.00	6,590,300
S C S K	26,000	4,690.00	121,940,000

日本システムウエア	3,300	2,314.00	7,636,200
アイネス	12,600	1,290.00	16,254,000
T K C	8,400	4,135.00	34,734,000
富士ソフト	14,700	5,540.00	81,438,000
N S D	16,200	2,399.00	38,863,800
コナミホールディングス	40,300	5,050.00	203,515,000
福井コンピュータホールディングス	3,300	1,681.00	5,547,300
J B C Cホールディングス	7,900	1,659.00	13,106,100
ミロク情報サービス	9,800	2,473.00	24,235,400
ソフトバンクグループ	411,500	8,777.00	3,611,735,500
ハウスイ	800	939.00	751,200
高千穂交易	3,800	1,068.00	4,058,400
伊藤忠食品	2,400	5,210.00	12,504,000
エレマテック	4,600	2,298.00	10,570,800
J A L U X	2,800	2,761.00	7,730,800
あらた	5,500	4,710.00	25,905,000
トーメンデバイス	1,500	2,532.00	3,798,000
東京エレクトロン デバイス	3,600	2,055.00	7,398,000
フィールズ	8,600	1,001.00	8,608,600
双日	545,800	421.00	229,781,800
アルフレッサ ホールディングス	109,800	3,120.00	342,576,000
横浜冷凍	25,900	931.00	24,112,900
神栄	1,400	1,122.00	1,570,800
ラサ商事	5,300	957.00	5,072,100
ラクーンホールディングス	5,800	623.00	3,613,400
アルコニックス	10,500	1,325.00	13,912,500
神戸物産	14,900	3,095.00	46,115,500
あい ホールディングス	15,900	2,173.00	34,550,700
ディーブイエックス	3,900	1,236.00	4,820,400
ダイワボウホールディングス	9,000	6,770.00	60,930,000
マクニカ・富士エレホールディングス	27,400	1,713.00	46,936,200
ラクト・ジャパン	2,100	7,380.00	15,498,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,600	1,219.00	22,673,400
八洲電機	7,700	821.00	6,321,700
メディアスホールディングス	5,500	858.00	4,719,000
U K Cホールディングス	6,400	2,540.00	16,256,000
ジュテックホールディングス	2,300	1,054.00	2,424,200
大光	2,500	712.00	1,780,000
O C H Iホールディングス	2,900	1,252.00	3,630,800
T O K A Iホールディングス	52,200	954.00	49,798,800
黒谷	1,700	504.00	856,800
C o m i n i x	1,700	854.00	1,451,800

三洋貿易	5,000	2,078.00	10,390,000
ビューティガレージ	1,400	1,713.00	2,398,200
ウイン・パートナーズ	6,400	1,275.00	8,160,000
ミタチ産業	2,500	792.00	1,980,000
シップヘルスケアホールディングス	20,600	3,830.00	78,898,000
明治電機工業	3,100	2,252.00	6,981,200
デリカフーズホールディングス	1,800	1,474.00	2,653,200
スターティアホールディングス	1,900	702.00	1,333,800
コメダホールディングス	22,700	2,303.00	52,278,100
富士興産	3,800	612.00	2,325,600
協栄産業	1,200	1,715.00	2,058,000
小野建	8,800	1,705.00	15,004,000
佐島電機	7,300	1,071.00	7,818,300
エコートレーディング	2,300	650.00	1,495,000
伯東	6,800	1,352.00	9,193,600
コンドーテック	7,700	1,053.00	8,108,100
中山福	5,600	582.00	3,259,200
ナガイレーベン	14,300	2,658.00	38,009,400
三菱食品	10,900	3,040.00	33,136,000
松田産業	7,200	1,476.00	10,627,200
第一興商	14,700	5,200.00	76,440,000
メディバルホールディングス	106,600	2,522.00	268,845,200
S P K	2,100	2,409.00	5,058,900
萩原電気ホールディングス	3,700	3,325.00	12,302,500
アズワン	7,100	8,410.00	59,711,000
スズデン	3,400	1,346.00	4,576,400
尾家産業	3,200	1,346.00	4,307,200
シモジマ	6,100	1,125.00	6,862,500
ドウシシャ	9,300	1,998.00	18,581,400
小津産業	2,200	1,973.00	4,340,600
高速	5,900	1,143.00	6,743,700
たけびし	3,500	1,557.00	5,449,500
リックス	2,200	1,667.00	3,667,400
丸文	8,800	779.00	6,855,200
ハピネット	8,300	1,708.00	14,176,400
橋本総業ホールディングス	1,800	1,447.00	2,604,600
日本ライフライン	31,000	1,689.00	52,359,000
タカショー	4,800	477.00	2,289,600
エクセル	2,900	1,989.00	5,768,100
マルカキカイ	3,200	2,395.00	7,664,000
I D O M	33,300	392.00	13,053,600
日本エム・ディ・エム	5,800	1,494.00	8,665,200

進和	5,800	2,438.00	14,140,400
エスケイジャパン	2,400	891.00	2,138,400
ダイترون	4,500	1,672.00	7,524,000
シークス	12,600	1,665.00	20,979,000
田中商事	3,300	651.00	2,148,300
オーハシテクニカ	5,600	1,427.00	7,991,200
白銅	3,200	1,762.00	5,638,400
伊藤忠商事	725,200	2,080.00	1,508,416,000
丸紅	974,500	891.80	869,059,100
高島	1,600	2,036.00	3,257,600
長瀬産業	55,600	1,727.00	96,021,200
蝶理	6,300	1,953.00	12,303,900
豊田通商	110,300	4,050.00	446,715,000
三共生興	16,900	454.00	7,672,600
兼松	39,500	1,512.00	59,724,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,171.00	2,107,800
三井物産	814,100	1,896.00	1,543,533,600
日本紙パルプ商事	5,600	4,300.00	24,080,000
日立ハイテクノロジーズ	30,000	4,100.00	123,000,000
カメイ	12,900	1,379.00	17,789,100
東都水産	1,400	2,271.00	3,179,400
OUGホールディングス	1,600	2,695.00	4,312,000
スターゼン	3,600	4,655.00	16,758,000
山善	38,600	1,171.00	45,200,600
椿本興業	2,200	3,490.00	7,678,000
住友商事	584,400	1,782.00	1,041,400,800
内田洋行	4,600	2,741.00	12,608,600
三菱商事	693,400	3,117.00	2,161,327,800
第一実業	4,500	3,905.00	17,572,500
キャノンマーケティングジャパン	28,200	2,170.00	61,194,000
西華産業	5,600	1,806.00	10,113,600
佐藤商事	8,800	1,036.00	9,116,800
菱洋エレクトロ	10,000	1,713.00	17,130,000
東京産業	9,900	618.00	6,118,200
ユアサ商事	10,100	3,650.00	36,865,000
神鋼商事	2,200	2,891.00	6,360,200
小林産業	5,900	310.00	1,829,000
阪和興業	17,100	3,445.00	58,909,500
正栄食品工業	5,200	4,555.00	23,686,000
カナデン	9,500	1,282.00	12,179,000
菱電商事	7,800	1,605.00	12,519,000
フルサト工業	5,500	1,909.00	10,499,500

岩谷産業	21,900	4,020.00	88,038,000
すてきナイスグループ	4,200	1,157.00	4,859,400
昭光通商	3,500	822.00	2,877,000
ニチモウ	1,500	1,748.00	2,622,000
極東貿易	3,000	2,009.00	6,027,000
イワキ	11,900	551.00	6,556,900
三愛石油	26,600	1,215.00	32,319,000
稲畑産業	23,800	1,624.00	38,651,200
G S I クレオス	2,600	1,511.00	3,928,600
明和産業	9,200	447.00	4,112,400
ワキタ	21,100	1,262.00	26,628,200
東邦ホールディングス	29,300	3,125.00	91,562,500
サンゲツ	29,800	2,180.00	64,964,000
ミツウロコグループホールディングス	14,400	717.00	10,324,800
シナネンホールディングス	4,100	2,704.00	11,086,400
伊藤忠エネクス	21,900	1,099.00	24,068,100
サンリオ	30,500	2,190.00	66,795,000
サンワテクノス	6,000	1,314.00	7,884,000
リョーサン	10,900	3,515.00	38,313,500
新光商事	9,300	1,768.00	16,442,400
トーヨー	4,500	2,355.00	10,597,500
三信電気	8,200	2,036.00	16,695,200
東陽テクニカ	11,400	931.00	10,613,400
モスフードサービス	13,000	3,015.00	39,195,000
加賀電子	9,800	2,328.00	22,814,400
ソーダニッカ	10,100	655.00	6,615,500
立花エレテック	7,300	1,783.00	13,015,900
フォーバル	4,300	991.00	4,261,300
P A L T A C	17,800	5,760.00	102,528,000
三谷産業	11,400	320.00	3,648,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,200	5,140.00	11,308,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,265.00	1,012,000
国際紙パルプ商事	17,400	344.00	5,985,600
ヤマタネ	4,900	1,863.00	9,128,700
丸紅建材リース	1,000	2,195.00	2,195,000
日鉄住金物産	7,000	5,310.00	37,170,000
泉州電業	3,300	2,571.00	8,484,300
トラスコ中山	20,600	2,946.00	60,687,600
オートバックスセブン	39,300	1,805.00	70,936,500
モリト	7,200	882.00	6,350,400
加藤産業	15,500	3,495.00	54,172,500
イノテック	6,800	1,314.00	8,935,200

イエローハット	9,300	2,925.00	27,202,500
J Kホールディングス	9,000	691.00	6,219,000
日伝	8,200	1,795.00	14,719,000
北沢産業	7,400	240.00	1,776,000
杉本商事	5,300	1,870.00	9,911,000
因幡電機産業	14,000	4,725.00	66,150,000
バイテックホールディングス	4,500	2,545.00	11,452,500
東テク	3,300	2,778.00	9,167,400
ミスミグループ本社	123,700	2,377.00	294,034,900
アルテック	7,100	273.00	1,938,300
タキヒヨー	3,000	1,937.00	5,811,000
蔵王産業	1,600	1,477.00	2,363,200
スズケン	45,100	5,990.00	270,149,000
ジェコス	6,800	1,114.00	7,575,200
ルネサスイーストン	9,000	464.00	4,176,000
ローソン	25,000	7,490.00	187,250,000
サンエー	7,500	4,795.00	35,962,500
カワチ薬品	7,700	2,250.00	17,325,000
エービーシー・マート	15,400	6,420.00	98,868,000
ハードオフコーポレーション	4,000	943.00	3,772,000
アスクル	8,600	3,040.00	26,144,000
ゲオホールディングス	15,100	1,858.00	28,055,800
アダストリア	13,700	2,032.00	27,838,400
ジーフット	6,000	756.00	4,536,000
くらコーポレーション	5,800	6,880.00	39,904,000
キャンドウ	4,700	1,721.00	8,088,700
パルグループホールディングス	5,100	3,280.00	16,728,000
エディオン	41,900	1,222.00	51,201,800
サーラコーポレーション	20,100	685.00	13,768,500
ワッツ	3,400	828.00	2,815,200
ハローズ	3,700	2,632.00	9,738,400
あみやき亭	2,200	4,115.00	9,053,000
ひらまつ	19,800	407.00	8,058,600
大黒天物産	2,400	4,330.00	10,392,000
ハニーズホールディングス	9,600	920.00	8,832,000
ファーマライズホールディングス	2,300	641.00	1,474,300
アルペン	7,600	1,966.00	14,941,600
ハブ	3,200	943.00	3,017,600
クオールホールディングス	14,600	2,116.00	30,893,600
ジーンズ	6,700	6,940.00	46,498,000
ビックカメラ	52,800	1,535.00	81,048,000
D C Mホールディングス	53,300	1,128.00	60,122,400

ペッパーフードサービス	7,800	3,645.00	28,431,000
Monotaro	62,500	2,625.00	164,062,500
東京一番フーズ	2,500	633.00	1,582,500
DDホールディングス	2,200	2,573.00	5,660,600
きちり	2,700	838.00	2,262,600
アークランドサービスホールディングス	7,300	2,310.00	16,863,000
J.フロント リテイリング	126,500	1,615.00	204,297,500
ドトール・日レスホールディングス	17,400	2,128.00	37,027,200
マツモトキヨシホールディングス	40,900	4,225.00	172,802,500
ブロンコビリー	5,200	3,055.00	15,886,000
ZOZO	106,800	2,552.00	272,553,600
トレジャー・ファクトリー	3,000	714.00	2,142,000
物語コーポレーション	2,800	11,220.00	31,416,000
ココカラファイン	11,100	6,590.00	73,149,000
三越伊勢丹ホールディングス	184,900	1,363.00	252,018,700
Hamee	2,500	1,665.00	4,162,500
ウエルシアホールディングス	26,100	6,290.00	164,169,000
クリエイトSDホールディングス	14,600	2,990.00	43,654,000
丸善CHIホールディングス	11,400	355.00	4,047,000
ティーライフ	1,400	1,004.00	1,405,600
エー・ピーカンパニー	1,900	622.00	1,181,800
チムニー	3,000	2,776.00	8,328,000
シュッピン	6,800	1,120.00	7,616,000
ネクステージ	15,200	1,128.00	17,145,600
ジョイフル本田	29,000	1,653.00	47,937,000
鳥貴族	3,300	2,202.00	7,266,600
麒麟堂ホールディングス	3,900	1,558.00	6,076,200
ホットランド	5,200	1,472.00	7,654,400
すかいらーくホールディングス	92,100	1,778.00	163,753,800
綿半ホールディングス	3,700	2,797.00	10,348,900
ヨシックス	1,600	2,947.00	4,715,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,800	1,303.00	37,526,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,100	910.00	3,731,000
BEE NOS	2,400	1,572.00	3,772,800
あさひ	8,200	1,408.00	11,545,600
日本調剤	3,500	3,460.00	12,110,000
コスモス薬品	5,000	23,180.00	115,900,000
トーエル	4,900	858.00	4,204,200
一六堂	2,600	512.00	1,331,200
オンリー	1,700	1,224.00	2,080,800
セブン&アイ・ホールディングス	414,200	5,030.00	2,083,426,000
薬王堂	4,300	3,540.00	15,222,000

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	26,600	1,259.00	33,489,400
ツルハホールディングス	21,500	12,350.00	265,525,000
サンマルクホールディングス	7,800	2,750.00	21,450,000
フェリシモ	2,300	1,211.00	2,785,300
トリドールホールディングス	12,200	2,089.00	25,485,800
T O K Y O B A S E	8,800	645.00	5,676,000
ウイルプラスホールディングス	1,000	938.00	938,000
ジャパンミート	3,800	2,152.00	8,177,600
サツドラホールディングス	1,700	1,996.00	3,393,200
デファクトスタンダード	700	682.00	477,400
ダイユー・リックホールディングス	5,400	1,111.00	5,999,400
パロックジャパンリミテッド	8,000	1,034.00	8,272,000
クスリのアオキホールディングス	7,900	8,660.00	68,414,000
力の源ホールディングス	2,800	1,069.00	2,993,200
スシログローバルホールディングス	10,900	6,400.00	69,760,000
L I X I L ビバ	8,400	1,845.00	15,498,000
メディカルシステムネットワーク	10,700	484.00	5,178,800
はるやまホールディングス	4,700	906.00	4,258,200
ノジマ	17,600	2,629.00	46,270,400
カッパ・クリエイト	13,900	1,456.00	20,238,400
ライトオン	8,400	956.00	8,030,400
良品計画	14,000	29,580.00	414,120,000
三城ホールディングス	12,400	488.00	6,051,200
アドヴァン	15,200	1,096.00	16,659,200
アルビス	3,800	3,055.00	11,609,000
コナカ	12,800	514.00	6,579,200
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,901.00	2,281,200
G - 7ホールディングス	2,900	2,578.00	7,476,200
イオン北海道	10,000	814.00	8,140,000
コジマ	14,700	487.00	7,158,900
ヒマラヤ	3,100	978.00	3,031,800
コーナン商事	13,000	2,783.00	36,179,000
エコス	3,700	2,136.00	7,903,200
ワタミ	13,000	1,437.00	18,681,000
マルシェ	2,700	801.00	2,162,700
ドンキホーテホールディングス	64,100	7,040.00	451,264,000
西松屋チェーン	21,800	1,029.00	22,432,200
ゼンショーホールディングス	46,600	2,642.00	123,117,200
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,954.00	12,310,200
ハークスレイ	2,100	1,069.00	2,244,900
サイゼリヤ	16,300	2,245.00	36,593,500
V Tホールディングス	33,500	490.00	16,415,000

魚力	2,800	1,429.00	4,001,200
ポブラ	2,500	614.00	1,535,000
フジ・コーポレーション	2,000	2,041.00	4,082,000
ユナイテッドアローズ	11,300	4,160.00	47,008,000
ハイデイ日高	13,000	2,310.00	30,030,000
京都きもの友禅	6,300	467.00	2,942,100
コロワイド	32,900	2,867.00	94,324,300
ピーシーデポコーポレーション	13,300	556.00	7,394,800
巻番屋	7,000	4,415.00	30,905,000
P L A N T	2,300	1,138.00	2,617,400
スギホールディングス	21,700	5,330.00	115,661,000
ヴィア・ホールディングス	12,100	709.00	8,578,900
スクロール	15,300	461.00	7,053,300
ヨンドシーホールディングス	11,000	2,469.00	27,159,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	27,600	15,000.00	414,000,000
木曽路	12,100	2,622.00	31,726,200
S R Sホールディングス	11,700	1,011.00	11,828,700
タカキュー	7,900	196.00	1,548,400
ケーヨー	18,300	584.00	10,687,200
上新電機	11,700	2,950.00	34,515,000
日本瓦斯	18,200	3,650.00	66,430,000
ロイヤルホールディングス	17,600	2,729.00	48,030,400
いなげや	11,100	1,622.00	18,004,200
島忠	22,400	3,015.00	67,536,000
チヨダ	10,400	2,096.00	21,798,400
ライフコーポレーション	7,500	2,820.00	21,150,000
リンガーハット	12,200	2,393.00	29,194,600
M r M a x H D	13,700	535.00	7,329,500
テンアライド	9,000	424.00	3,816,000
A O K Iホールディングス	19,800	1,475.00	29,205,000
オークワ	14,200	1,198.00	17,011,600
コメリ	15,300	2,939.00	44,966,700
青山商事	19,000	2,991.00	56,829,000
しまむら	11,500	9,750.00	112,125,000
はせがわ	5,300	473.00	2,506,900
高島屋	77,600	1,893.00	146,896,800
松屋	20,000	1,116.00	22,320,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,700	1,914.00	97,039,800
近鉄百貨店	3,800	3,655.00	13,889,000
パルコ	9,500	1,267.00	12,036,500
丸井グループ	83,600	2,692.00	225,051,200
アクシアル リテイリング	8,200	3,915.00	32,103,000

イオン	380,300	2,774.00	1,054,952,200
イズミ	20,100	6,470.00	130,047,000
平和堂	20,100	3,040.00	61,104,000
フジ	12,000	2,183.00	26,196,000
ヤオコー	11,200	6,370.00	71,344,000
ゼビオホールディングス	12,000	1,593.00	19,116,000
ケーズホールディングス	102,800	1,262.00	129,733,600
Olympicグループ	5,900	776.00	4,578,400
日産東京販売ホールディングス	14,500	351.00	5,089,500
Genky DrugStores	3,900	3,545.00	13,825,500
総合メディカルホールディングス	8,600	2,640.00	22,704,000
ブックオフグループホールディングス	5,000	756.00	3,780,000
アインホールディングス	13,300	8,810.00	117,173,000
元気寿司	2,800	5,470.00	15,316,000
ヤマダ電機	301,200	543.00	163,551,600
アークランドサカモト	16,800	1,564.00	26,275,200
ニトリホールディングス	42,800	14,545.00	622,526,000
グルメ杵屋	7,100	1,222.00	8,676,200
愛眼	7,800	324.00	2,527,200
ケーユーホールディングス	5,200	937.00	4,872,400
吉野家ホールディングス	34,500	1,896.00	65,412,000
松屋フーズホールディングス	4,800	3,735.00	17,928,000
サガミホールディングス	13,300	1,380.00	18,354,000
関西スーパーマーケット	7,500	1,024.00	7,680,000
王将フードサービス	7,300	7,210.00	52,633,000
プレナス	11,100	1,877.00	20,834,700
ミニストップ	7,400	2,137.00	15,813,800
アークス	18,600	2,793.00	51,949,800
パローホールディングス	21,400	2,940.00	62,916,000
ベルク	4,900	5,970.00	29,253,000
大庄	5,300	1,714.00	9,084,200
ファーストリテイリング	13,200	60,800.00	802,560,000
サンドラッグ	37,200	4,205.00	156,426,000
サクスパー ホールディングス	8,400	1,105.00	9,282,000
ヤマザワ	2,100	1,691.00	3,551,100
やまや	1,700	2,446.00	4,158,200
ベルーナ	24,300	1,193.00	28,989,900
島根銀行	2,900	1,001.00	2,902,900
じもとホールディングス	66,700	154.00	10,271,800
めぶきフィナンシャルグループ	516,800	348.00	179,846,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,800	1,970.00	27,186,000
九州フィナンシャルグループ	164,100	537.00	88,121,700

ゆうちょ銀行	281,000	1,347.00	378,507,000
富山第一銀行	25,700	452.00	11,616,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	632,000	512.00	323,584,000
西日本フィナンシャルホールディングス	64,200	1,212.00	77,810,400
関西みらいフィナンシャルグループ	47,500	905.00	42,987,500
三十三フィナンシャルグループ	9,000	1,999.00	17,991,000
第四北越フィナンシャルグループ	17,400	4,025.00	70,035,000
新生銀行	72,600	1,762.00	127,921,200
あおぞら銀行	55,300	3,955.00	218,711,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,891,700	680.00	4,686,356,000
りそなホールディングス	1,086,000	611.00	663,546,000
三井住友トラスト・ホールディングス	194,500	4,610.00	896,645,000
三井住友フィナンシャルグループ	697,500	4,502.00	3,140,145,000
千葉銀行	351,700	739.00	259,906,300
群馬銀行	199,600	551.00	109,979,600
武蔵野銀行	15,000	3,135.00	47,025,000
千葉興業銀行	29,000	451.00	13,079,000
筑波銀行	41,100	254.00	10,439,400
七十七銀行	31,400	2,372.00	74,480,800
青森銀行	8,000	3,045.00	24,360,000
秋田銀行	6,700	2,596.00	17,393,200
山形銀行	11,500	2,400.00	27,600,000
岩手銀行	7,100	4,410.00	31,311,000
東邦銀行	88,500	393.00	34,780,500
東北銀行	5,000	1,314.00	6,570,000
みちのく銀行	6,400	1,824.00	11,673,600
ふくおかフィナンシャルグループ	80,700	2,843.00	229,430,100
静岡銀行	250,000	1,078.00	269,500,000
十六銀行	13,600	2,660.00	36,176,000
八十二銀行	180,900	508.00	91,897,200
山梨中央銀行	12,800	1,739.00	22,259,200
大垣共立銀行	16,000	2,620.00	41,920,000
福井銀行	8,900	2,005.00	17,844,500
北國銀行	10,700	4,265.00	45,635,500
清水銀行	4,500	1,936.00	8,712,000
富山銀行	2,200	3,940.00	8,668,000
滋賀銀行	20,200	2,801.00	56,580,200
南都銀行	11,900	2,659.00	31,642,100
百五銀行	91,200	443.00	40,401,600
京都銀行	35,600	5,350.00	190,460,000
紀陽銀行	35,600	1,732.00	61,659,200
ほくほくフィナンシャルグループ	66,500	1,490.00	99,085,000

広島銀行	147,400	711.00	104,801,400
山陰合同銀行	59,700	926.00	55,282,200
中国銀行	64,800	1,063.00	68,882,400
鳥取銀行	3,900	1,611.00	6,282,900
伊予銀行	132,400	686.00	90,826,400
百十四銀行	10,800	3,010.00	32,508,000
四国銀行	14,900	1,375.00	20,487,500
阿波銀行	16,100	3,115.00	50,151,500
大分銀行	6,300	3,750.00	23,625,000
宮崎銀行	6,900	3,295.00	22,735,500
佐賀銀行	6,400	2,179.00	13,945,600
十八銀行	6,400	3,130.00	20,032,000
沖縄銀行	9,300	3,945.00	36,688,500
琉球銀行	23,500	1,326.00	31,161,000
セブン銀行	336,800	377.00	126,973,600
みずほフィナンシャルグループ	13,446,700	196.60	2,643,621,220
高知銀行	3,600	973.00	3,502,800
山口フィナンシャルグループ	124,300	1,192.00	148,165,600
長野銀行	3,800	1,696.00	6,444,800
名古屋銀行	8,200	3,750.00	30,750,000
北洋銀行	151,800	342.00	51,915,600
愛知銀行	3,800	4,575.00	17,385,000
中京銀行	4,500	2,283.00	10,273,500
大光銀行	3,800	2,088.00	7,934,400
愛媛銀行	14,600	1,221.00	17,826,600
トマト銀行	4,500	1,345.00	6,052,500
京葉銀行	44,800	818.00	36,646,400
栃木銀行	54,100	316.00	17,095,600
北日本銀行	3,400	2,487.00	8,455,800
東和銀行	17,400	950.00	16,530,000
福島銀行	7,300	607.00	4,431,100
大東銀行	4,700	916.00	4,305,200
トモニホールディングス	78,500	456.00	35,796,000
フィデアホールディングス	95,800	151.00	14,465,800
池田泉州ホールディングス	107,600	359.00	38,628,400
F P G	31,800	1,289.00	40,990,200
マーキュリアインベストメント	4,000	854.00	3,416,000
S B Iホールディングス	117,900	3,165.00	373,153,500
ジャフコ	16,300	4,555.00	74,246,500
大和証券グループ本社	794,300	643.10	510,814,330
野村ホールディングス	1,816,200	528.00	958,953,600
岡三証券グループ	84,600	573.00	48,475,800

丸三証券	29,600	911.00	26,965,600
東洋証券	36,000	227.00	8,172,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	118,200	626.00	73,993,200
光世証券	2,500	1,092.00	2,730,000
水戸証券	29,000	342.00	9,918,000
いちよし証券	20,900	972.00	20,314,800
松井証券	48,600	1,222.00	59,389,200
だいこう証券ビジネス	4,200	519.00	2,179,800
マネックスグループ	92,700	507.00	46,998,900
カブドットコム証券	74,200	426.00	31,609,200
極東証券	13,400	1,367.00	18,317,800
岩井コスモホールディングス	10,200	1,500.00	15,300,000
藍澤証券	18,700	768.00	14,361,600
マネーパートナーズグループ	11,800	384.00	4,531,200
かんぽ生命保険	37,400	2,813.00	105,206,200
S O M P Oホールディングス	194,100	4,893.00	949,731,300
アニコム ホールディングス	7,700	3,770.00	29,029,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	258,700	3,548.00	917,867,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	81,300	2,654.00	215,770,200
第一生命ホールディングス	559,900	2,217.50	1,241,578,250
東京海上ホールディングス	358,700	5,542.00	1,987,915,400
T & Dホールディングス	306,100	1,870.50	572,560,050
アドバンスクリエイト	2,300	2,020.00	4,646,000
全国保証	27,900	4,270.00	119,133,000
ジェイリース	2,000	621.00	1,242,000
イントラスト	2,700	444.00	1,198,800
日本モーゲージサービス	1,300	1,258.00	1,635,400
アルヒ	9,000	1,782.00	16,038,000
クレディセゾン	69,300	1,854.00	128,482,200
芙蓉総合リース	11,300	6,400.00	72,320,000
興銀リース	18,600	2,873.00	53,437,800
東京センチュリー	19,900	5,650.00	112,435,000
日本証券金融	43,500	656.00	28,536,000
アイフル	151,000	310.00	46,810,000
リコーリース	7,800	3,685.00	28,743,000
イオンフィナンシャルサービス	63,200	2,285.00	144,412,000
アコム	198,900	433.00	86,123,700
ジャックス	10,900	2,282.00	24,873,800
オリエントコーポレーション	267,600	188.00	50,308,800
日立キャピタル	23,300	3,020.00	70,366,000
アプラスフィナンシャル	46,800	99.00	4,633,200
オリックス	660,200	1,809.50	1,194,631,900

三菱UFJリース	223,200	594.00	132,580,800
九州リースサービス	4,800	701.00	3,364,800
日本取引所グループ	267,300	2,158.00	576,833,400
イー・ギャランティ	9,200	990.00	9,108,000
アサックス	4,100	591.00	2,423,100
NECキャピタルソリューション	4,000	1,763.00	7,052,000
いちご	126,200	403.00	50,858,600
日本駐車場開発	120,000	161.00	19,320,000
ヒューリック	206,700	1,048.00	216,621,600
三栄建築設計	4,100	1,636.00	6,707,600
スター・マイカ	4,600	1,633.00	7,511,800
野村不動産ホールディングス	65,900	2,212.00	145,770,800
三重交通グループホールディングス	20,300	580.00	11,774,000
サムティ	8,300	1,550.00	12,865,000
ディア・ライフ	12,900	526.00	6,785,400
コーセーアールイー	3,100	874.00	2,709,400
エー・ディー・ワークス	115,000	38.00	4,370,000
日本商業開発	6,200	1,761.00	10,918,200
プレサンスコーポレーション	15,800	1,360.00	21,488,000
ユニゾホールディングス	15,000	2,328.00	34,920,000
THEグローバル社	4,800	653.00	3,134,400
日本管理センター	6,600	1,309.00	8,639,400
サンセイランディック	2,800	1,163.00	3,256,400
エストラスト	1,200	783.00	939,600
フージャースホールディングス	21,200	667.00	14,140,400
オープンハウス	16,200	4,620.00	74,844,000
東急不動産ホールディングス	266,400	630.00	167,832,000
飯田グループホールディングス	82,600	2,042.00	168,669,200
イーランド	1,600	740.00	1,184,000
ムゲンエステート	6,900	696.00	4,802,400
ファーストブラザーズ	2,800	1,299.00	3,637,200
ハウズドゥ	3,600	1,265.00	4,554,000
シーアールイー	3,400	992.00	3,372,800
ケイアイスター不動産	2,700	1,879.00	5,073,300
グッドコムアセット	1,800	1,512.00	2,721,600
ジェイ・エス・ビー	400	4,605.00	1,842,000
パーク24	57,800	3,015.00	174,267,000
パラカ	2,600	1,932.00	5,023,200
三井不動産	525,100	2,751.50	1,444,812,650
三菱地所	693,400	1,859.00	1,289,030,600
平和不動産	18,800	2,011.00	37,806,800
東京建物	108,200	1,207.00	130,597,400

ダイビル	29,200	1,184.00	34,572,800
京阪神ビルディング	17,800	905.00	16,109,000
住友不動産	222,500	4,154.00	924,265,000
大京	15,300	2,965.00	45,364,500
テオオーシー	22,800	910.00	20,748,000
東京楽天地	1,400	5,040.00	7,056,000
レオパレス21	125,900	490.00	61,691,000
スターツコーポレーション	13,500	2,658.00	35,883,000
フジ住宅	12,800	893.00	11,430,400
空港施設	11,800	593.00	6,997,400
明和地所	5,600	635.00	3,556,000
ゴールドクレスト	7,900	1,891.00	14,938,900
日本エスリード	3,900	1,523.00	5,939,700
日神不動産	14,900	530.00	7,897,000
日本エスコン	18,000	720.00	12,960,000
タカラレーベン	46,700	329.00	15,364,300
サンヨーハウジング名古屋	5,700	1,036.00	5,905,200
イオンモール	49,700	2,143.00	106,507,100
ファースト住建	3,800	1,210.00	4,598,000
カチタス	11,100	3,120.00	34,632,000
トーセイ	13,700	1,036.00	14,193,200
穴吹興産	1,100	3,055.00	3,360,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	54,800	1,679.00	92,009,200
サンフロンティア不動産	13,800	1,178.00	16,256,400
エフ・ジェー・ネクスト	8,800	924.00	8,131,200
インテリックス	3,000	797.00	2,391,000
ランドビジネス	4,900	556.00	2,724,400
グランディハウス	9,000	445.00	4,005,000
日本空港ビルデング	31,600	4,215.00	133,194,000
日本工営	6,500	2,722.00	17,693,000
LIFULL	33,400	753.00	25,150,200
ジェイエイシーリクルートメント	7,800	2,390.00	18,642,000
日本M&Aセンター	71,500	2,750.00	196,625,000
メンバーズ	3,300	1,121.00	3,699,300
中広	1,100	766.00	842,600
タケエイ	10,100	839.00	8,473,900
E・Jホールディングス	1,300	1,275.00	1,657,500
トラスト・テック	4,600	2,990.00	13,754,000
コシダカホールディングス	25,700	1,325.00	34,052,500
アルトナー	1,900	812.00	1,542,800
パソナグループ	9,200	1,348.00	12,401,600
CDS	2,500	1,315.00	3,287,500

リンクアンドモチベーション	17,700	1,071.00	18,956,700
G C A	9,800	845.00	8,281,000
エス・エム・エス	35,300	1,978.00	69,823,400
パーソルホールディングス	95,900	2,084.00	199,855,600
リニカル	5,500	1,691.00	9,300,500
クックパッド	30,300	419.00	12,695,700
エスクリ	2,700	734.00	1,981,800
アイ・ケイ・ケイ	4,800	722.00	3,465,600
学情	4,000	1,465.00	5,860,000
スタジオアリス	4,900	2,630.00	12,887,000
シミックホールディングス	5,400	2,173.00	11,734,200
N J S	2,200	1,768.00	3,889,600
総合警備保障	38,200	5,000.00	191,000,000
カカクコム	72,200	2,154.00	155,518,800
アイロムグループ	3,600	2,266.00	8,157,600
セントケア・ホールディング	5,300	591.00	3,132,300
サイネックス	1,700	812.00	1,380,400
ルネサンス	5,400	2,299.00	12,414,600
ディップ	15,500	2,384.00	36,952,000
オプトホールディング	5,900	1,977.00	11,664,300
ツクイ	22,700	976.00	22,155,200
キャリアデザインセンター	2,500	1,622.00	4,055,000
エムスリー	201,900	1,804.00	364,227,600
ツカダ・グローバルホールディング	6,200	615.00	3,813,000
プラス	900	675.00	607,500
アウトソーシング	50,500	1,405.00	70,952,500
ウェルネット	9,800	1,119.00	10,966,200
ワールドホールディングス	2,700	2,784.00	7,516,800
ディー・エヌ・エー	51,700	2,143.00	110,793,100
博報堂D Yホールディングス	133,300	1,781.00	237,407,300
ぐるなび	13,800	932.00	12,861,600
エスアールジータカミヤ	10,100	645.00	6,514,500
ジャパンベストレスキューシステム	7,600	1,365.00	10,374,000
ファンコミュニケーションズ	26,500	614.00	16,271,000
ライク	3,800	1,672.00	6,353,600
ビジネス・ブレークスルー	4,200	378.00	1,587,600
W D Bホールディングス	4,400	2,903.00	12,773,200
ティア	4,500	771.00	3,469,500
C D G	900	1,481.00	1,332,900
バリューコマース	6,500	1,480.00	9,620,000
インフォマート	52,600	1,469.00	77,269,400
J Pホールディングス	27,700	341.00	9,445,700

エコナックホールディングス	18,000	112.00	2,016,000	
E P S ホールディングス	14,500	2,110.00	30,595,000	
レグス	2,500	1,137.00	2,842,500	
プレステージ・インターナショナル	18,000	1,272.00	22,896,000	
アミューズ	5,800	2,933.00	17,011,400	
ドリームインキュベータ	2,900	1,905.00	5,524,500	
クイック	6,000	1,601.00	9,606,000	
T A C	5,600	256.00	1,433,600	
ケネディクス	89,800	559.00	50,198,200	
電通	116,800	5,340.00	623,712,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	2,233.00	8,262,100	
ぴあ	2,800	5,380.00	15,064,000	
イオンファンタジー	3,100	3,700.00	11,470,000	
シーティーエス	10,900	733.00	7,989,700	
ネクシィーズグループ	3,000	1,994.00	5,982,000	
みらかホールディングス	26,800	2,943.00	78,872,400	
アルプス技研	8,500	2,155.00	18,317,500	
ダイオーズ	2,300	1,320.00	3,036,000	
日本空調サービス	11,000	792.00	8,712,000	
オリエンタルランド	113,300	10,955.00	1,241,201,500	
ダスキン	25,800	2,463.00	63,545,400	
明光ネットワークジャパン	12,200	998.00	12,175,600	
ファルコホールディングス	5,300	1,652.00	8,755,600	
ラウンドワン	29,800	1,152.00	34,329,600	
リゾートトラスト	40,600	1,722.00	69,913,200	
ビー・エム・エル	12,400	2,869.00	35,575,600	
ワタベウェディング	1,700	791.00	1,344,700	
りらいあコミュニケーションズ	17,400	1,054.00	18,339,600	
リソー教育	16,300	1,222.00	19,918,600	
早稲田アカデミー	1,400	2,412.00	3,376,800	
ユー・エス・エス	117,100	2,068.00	242,162,800	
東京個別指導学院	3,500	1,400.00	4,900,000	
サイバーエージェント	59,100	4,805.00	283,975,500	
楽天	447,000	934.00	417,498,000	
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,031.00	5,876,700	
テー・オー・ダブリュー	9,300	881.00	8,193,300	
セントラルスポーツ	3,600	3,775.00	13,590,000	
フルキャストホールディングス	9,600	2,152.00	20,659,200	
エン・ジャパン	10,500	4,100.00	43,050,000	
リソルホールディングス	1,100	4,150.00	4,565,000	
テクノプロ・ホールディングス	18,100	5,640.00	102,084,000	
アトラ	2,100	498.00	1,045,800	

インターワークス	2,000	794.00	1,588,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	1,277.00	3,958,700
K e e P e r 技研	3,200	1,108.00	3,545,600
ファーストロジック	2,000	843.00	1,686,000
三機サービス	1,500	1,929.00	2,893,500
G u n o s y	5,900	2,816.00	16,614,400
デザインワン・ジャパン	2,100	483.00	1,014,300
イー・ガーディアン	4,600	2,615.00	12,029,000
リブセンス	5,500	353.00	1,941,500
ジャパンマテリアル	26,300	1,149.00	30,218,700
ベクトル	11,700	1,973.00	23,084,100
ウチヤマホールディングス	4,900	493.00	2,415,700
ライクキッズネクスト	2,100	1,092.00	2,293,200
キャリアリンク	3,700	432.00	1,598,400
I B J	6,500	733.00	4,764,500
アサンテ	3,900	2,231.00	8,700,900
N・フィールド	6,200	1,438.00	8,915,600
バリューHR	2,000	2,261.00	4,522,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,500	4,600.00	11,500,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	1,305.00	5,220,000
E R Iホールディングス	2,800	948.00	2,654,400
アビスト	1,500	3,760.00	5,640,000
シグマクシス	4,700	1,107.00	5,202,900
ウィルグループ	6,300	1,108.00	6,980,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,400	486.00	6,512,400
日本ビューホテル	3,100	1,274.00	3,949,400
リクルートホールディングス	686,800	3,028.00	2,079,630,400
エラン	3,300	3,325.00	10,972,500
土木管理総合試験所	4,300	634.00	2,726,200
日本郵政	785,900	1,374.00	1,079,826,600
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,528.00	24,600,800
鎌倉新書	7,100	1,062.00	7,540,200
一蔵	1,200	733.00	879,600
L I T A L I C O	2,200	2,166.00	4,765,200
グローバルグループ	1,200	1,470.00	1,764,000
エボラブルアジア	2,800	2,255.00	6,314,000
アトラエ	1,900	2,392.00	4,544,800
ストライク	2,400	3,030.00	7,272,000
ソラスト	23,400	1,320.00	30,888,000
セラク	2,300	802.00	1,844,600
インソース	3,200	2,419.00	7,740,800
アイモバイル	2,400	705.00	1,692,000

キャリアインデックス	3,300	1,416.00	4,672,800
MS - Japan	3,900	1,497.00	5,838,300
船場	1,600	1,033.00	1,652,800
グレイステクノロジー	2,600	2,386.00	6,203,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,700	2,016.00	11,491,200
フルテック	1,100	1,136.00	1,249,600
グリーンズ	2,100	1,476.00	3,099,600
ツナグ・ソリューションズ	1,000	811.00	811,000
日総工産	2,400	2,280.00	5,472,000
キュービーネットホールディングス	5,000	2,013.00	10,065,000
スプリックス	2,700	2,740.00	7,398,000
アドバンテッジリスクマネジメント	3,800	1,086.00	4,126,800
リログループ	52,400	2,897.00	151,802,800
東祥	6,000	3,740.00	22,440,000
エイチ・アイ・エス	17,100	3,600.00	61,560,000
ラックランド	1,900	2,977.00	5,656,300
共立メンテナンス	14,700	5,390.00	79,233,000
イチネンホールディングス	10,000	1,514.00	15,140,000
建設技術研究所	6,700	1,587.00	10,632,900
スペース	6,300	1,251.00	7,881,300
長大	3,900	888.00	3,463,200
燦ホールディングス	2,100	2,743.00	5,760,300
スバル興業	700	5,370.00	3,759,000
東京テアトル	3,800	1,332.00	5,061,600
タナベ経営	1,900	1,712.00	3,252,800
ナガワ	2,700	5,490.00	14,823,000
よみうりランド	2,100	4,140.00	8,694,000
東京都競馬	6,300	3,505.00	22,081,500
カナモト	13,500	4,120.00	55,620,000
東京ドーム	35,900	1,011.00	36,294,900
西尾レントオール	9,800	4,180.00	40,964,000
トランス・コスモス	10,700	2,580.00	27,606,000
乃村工藝社	22,500	2,596.00	58,410,000
藤田観光	3,800	3,070.00	11,666,000
KNT - CTホールディングス	5,100	1,225.00	6,247,500
日本管財	10,300	2,071.00	21,331,300
トーカイ	9,300	2,578.00	23,975,400
白洋舎	1,100	3,105.00	3,415,500
セコム	101,800	9,085.00	924,853,000
セントラル警備保障	4,600	5,150.00	23,690,000
丹青社	18,200	1,132.00	20,602,400
メイテック	12,200	4,940.00	60,268,000

応用地質	10,400	1,336.00	13,894,400	
船井総研ホールディングス	20,000	2,308.00	46,160,000	
進学会ホールディングス	4,500	559.00	2,515,500	
オオバ	7,600	696.00	5,289,600	
いであ	2,000	1,074.00	2,148,000	
学究社	3,200	1,696.00	5,427,200	
ベネッセホールディングス	35,200	3,205.00	112,816,000	
イオンディライト	11,800	4,005.00	47,259,000	
ナック	6,200	1,136.00	7,043,200	
ニチイ学館	13,700	1,154.00	15,809,800	
ダイセキ	16,100	2,815.00	45,321,500	
ステップ	3,600	1,659.00	5,972,400	
合計	114,296,600		237,533,160,100	

(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
新株予約権証券	サムティ株式会社第19回新株予約権	8,300	1,303,100	
	合計	8,300	1,303,100	

(注) 券面総額欄の数値は、証券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

注記表(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11月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	14,161,888,218
金銭信託	29,970,962
コール・ローン	204,853,214
株式	323,956,033,467
投資信託受益証券	231,468,562
投資証券	7,971,614,024
派生商品評価勘定	71,263,682

	2018年11月12日現在
項目	金額（円）
未収入金	133,665,114
未収配当金	406,315,861
前払金	454,140,982
差入委託証拠金	2,090,083,939
流動資産合計	349,711,298,025
資産合計	349,711,298,025
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	525,448,584
未払金	142,340,482
未払解約金	118,294,231
未払利息	580
その他未払費用	2,483
流動負債合計	786,086,360
負債合計	786,086,360
純資産の部	
元本等	
元本	137,716,718,181
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	211,208,493,484
元本等合計	348,925,211,665
純資産合計	348,925,211,665
負債純資産合計	349,711,298,025

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年11月12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>

2018年11月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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。 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11月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,716,718,181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 2,5336円 (1万口当たり純資産額) (25,336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11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	137,860,073,599円
期中追加設定元本額	8,931,038,880円
期中一部解約元本額	9,074,394,298円
期末元本額	137,716,718,181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）	2,301,135,715円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,762,938円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,327,437,805円
世界経済インデックスファンド	7,221,832,168円
外国株式インデックス・オープン	928,405,279円
D C マイセレクション 2 5	964,823,967円
D C マイセレクション 5 0	4,688,887,653円
D C マイセレクション 7 5	5,069,191,551円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,917,890,463円
D C マイセレクション S 2 5	378,994,333円

区分	2018年11月12日現在
DCマイセレクションS50	1,869,160,962円
DCマイセレクションS75	1,455,050,772円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	112,512,495円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	178,505,757円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	115,841,294円
DC世界経済インデックスファンド	5,869,346,639円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,745,216,530円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	12,464,355円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,692,257円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	58,110,927円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	77,611,964円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	270,494,468円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	43,984,231円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	401,511,568円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	791,387,519円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	403,209,134円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,679,597,249円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,037,260,408円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	93,774,898円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	389,363,320円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	62,300,241円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	130,502,510円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,103,233,783円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,308,660,631円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,435,575,685円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,820,124,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,271,561,240円
分散投資コア戦略ファンドA	2,136,710,006円
分散投資コア戦略ファンドS	4,365,460,790円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	734,639,989円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	877,674,853円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,235,593,266円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	862,530,239円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,159,162円
SMT インデックスバランス・オープン	291,891,229円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,830,348,521円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,121,741,638円
SMT 世界経済インデックス・オープン	38,659,753円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	279,194,959円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,674,278円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	726,840円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	29,319,421円
グローバル経済コア	1,269,177,502円

区分	2018年11月12日現在
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,976,196円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	160,949円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	37,400円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	83,495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)	1,534,789,676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)	1,313,218,674円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,149,531,657円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,934,748,307
投資信託受益証券	15,775,147
投資証券	374,471,701
合計	2,576,051,753

(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11月12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	17,051,371,588	-	16,597,230,606	454,140,982
	合計	17,051,371,588	-	16,597,230,606	454,140,982

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2018年11月12日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	98,943,320	-	98,891,240	52,080
	アメリカドル	98,943,320	-	98,891,240	52,080
	売建	92,966,880	-	92,958,720	8,160
	アメリカドル	92,966,880	-	92,958,720	8,160
合計		191,910,200	-	191,849,960	43,920

(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	58.21	2,583,359.80	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	15.70	292,585.20	
	APACHE CORP	29,810	37.08	1,105,354.80	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	25.51	898,207.10	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	25.61	918,861.19	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	62.35	978,333.85	
	CHEVRON CORP	154,681	119.51	18,485,926.31	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	90.32	686,341.68	
	CONCHO RESOURCES INC	16,193	136.52	2,210,668.36	
	CONOCOPHILLIPS	96,082	66.73	6,411,551.86	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	50.73	387,932.31	
	DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	33.01	1,433,294.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	113.85	938,010.15	
	EOG RESOURCES INC	46,520	105.51	4,908,325.20	
	EXXON MOBIL	342,921	80.87	27,732,021.27	
	HALLIBURTON CO	71,448	34.98	2,499,251.04	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	62.59	520,435.85	
	HESS CORP	22,081	59.15	1,306,091.15	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	64.70	912,917.00	
	KINDER MORGAN INC	157,150	17.53	2,754,839.50	

MARATHON OIL CORP	65,596	17.84	1,170,232.64
MARATHON PETROLEUM CORP	57,562	67.18	3,867,015.16
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	35.26	1,068,765.86
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	21.83	350,873.59
NOBLE ENERGY INC	38,291	26.52	1,015,477.32
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	73.55	4,581,208.85
ONEOK INC	33,743	63.09	2,128,845.87
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	24.47	501,023.25
PHILLIPS 66	36,131	99.74	3,603,705.94
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	159.82	2,149,579.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	22.05	218,074.50
SCHLUMBERGER	112,385	50.40	5,664,204.00
TARGA RESOURCES CORP	16,467	50.55	832,406.85
TECHNIPFMC PLC	36,005	25.65	923,528.25
VALERO ENERGY CORP	35,381	87.58	3,098,667.98
WILLIAMS COS	98,038	25.33	2,483,302.54
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	159.90	2,865,727.80
ALBEMARLE CORP	8,647	102.38	885,279.86
AVERY DENNISON CORP	7,457	92.00	686,044.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	25.34	446,136.04
BALL CORP	27,142	48.68	1,321,272.56
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	102.76	1,135,806.28
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	52.22	925,390.62
CHEMOURS CO/THE	15,493	32.09	497,170.37
CROWN HOLDINGS INC	10,321	45.79	472,598.59
DOWDUPONT INC	187,231	58.68	10,986,715.08
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	82.82	982,079.56
ECOLAB INC	20,812	159.33	3,315,975.96
FMC CORP	10,402	83.57	869,295.14
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	11.35	1,264,344.60
INT'L PAPER CO	30,605	46.22	1,414,563.10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,824	145.85	995,280.40
LINDE PLC	23,446	161.52	3,786,997.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	96.06	2,566,723.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	184.29	919,422.81
MOSAIC CO/THE	27,677	36.63	1,013,808.51
NEWMONT MINING CORP	42,952	32.02	1,375,323.04
NUCOR CORP	24,915	62.78	1,564,163.70
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	96.00	691,680.00
PPG INDUSTRIES INC	19,958	107.71	2,149,676.18
SEALED AIR CORP	14,689	35.10	515,583.90
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	414.84	2,875,670.88

STEEL DYNAMICS INC	18,273	40.28	736,036.44
VULCAN MATERIALS CO	10,740	105.76	1,135,862.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	75.90	262,234.50
WESTROCK CO	21,244	45.81	973,187.64
3 M COMPANY	48,314	201.10	9,715,945.40
ACUITY BRANDS INC	3,505	126.94	444,924.70
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	52.25	591,992.50
AGCO CORP	4,669	55.78	260,436.82
ALLEGION PLC	7,168	89.39	640,747.52
AMETEK INC	18,866	74.45	1,404,573.70
ARCONIC INC	36,550	20.77	759,143.50
BOEING CO	45,238	369.34	16,708,202.92
CATERPILLAR	48,537	126.91	6,159,830.67
CUMMINS INC	12,421	143.07	1,777,072.47
DEERE&CO	25,056	144.81	3,628,359.36
DOVER CORP	12,008	86.42	1,037,731.36
EATON CORP	35,279	73.43	2,590,536.97
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	68.49	3,487,990.23
FASTENAL CO	23,228	54.76	1,271,965.28
FLOWSERVE CORP	10,826	50.22	543,681.72
FLUOR CORP	11,267	46.60	525,042.20
FORTIVE CORP	25,813	75.22	1,941,653.86
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	43.49	557,106.90
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	184.50	3,701,439.00
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	8.58	6,042,773.88
GRAINGER (WW) INC	3,976	293.75	1,167,950.00
HARRIS CORP	9,793	153.14	1,499,700.02
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	38.75	590,007.50
HONEYWELL INTL INC	61,022	150.32	9,172,827.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	223.65	787,695.30
IDEX CORP	5,756	135.53	780,110.68
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	132.56	3,251,431.68
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	102.86	2,082,812.14
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	77.25	748,784.25
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	60.30	1,000,980.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	35.21	580,965.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	34.35	2,558,662.80
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	195.38	1,195,139.46
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	211.75	610,898.75
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	313.12	6,540,137.44
MASCO CORP	24,547	31.03	761,693.41
MIDDLEBY CORP	4,364	117.69	513,599.16

NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	285.73	3,851,354.67
OWENS CORNING	7,979	47.37	377,965.23
PACCAR INC	27,548	58.36	1,607,701.28
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	167.33	1,732,534.82
PENTAIR PLC	13,583	42.53	577,684.99
RAYTHEON COMPANY	23,492	188.02	4,416,965.84
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	169.27	1,779,196.97
ROCKWELL COLLIN	13,112	133.22	1,746,780.64
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	296.81	2,404,161.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	46.76	646,597.28
SMITH (A.O.) CORP	12,146	45.76	555,800.96
SNAP-ON INC	4,900	161.49	791,301.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	89.24	756,844.44
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	125.74	1,510,766.10
TEXTRON	21,877	56.88	1,244,363.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	357.46	1,455,577.12
UNITED RENTALS INC	6,446	126.67	816,514.82
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	130.71	7,952,527.11
WABCO HOLDINGS INC	3,841	111.17	427,003.97
WABTEC CORP	7,158	87.05	623,103.90
XYLEM INC	13,941	70.88	988,138.08
CINTAS CORP	7,034	179.22	1,260,633.48
COPART INC	17,540	50.27	881,735.80
COSTAR GROUP INC	3,008	365.01	1,097,950.08
EQUIFAX INC	9,276	102.12	947,265.12
IHS MARKIT LTD	32,775	52.91	1,734,125.25
MANPOWER GROUP	5,123	79.61	407,842.03
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	26.46	727,755.84
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	74.74	1,379,775.14
ROBERT HALF INTL INC	9,566	62.84	601,127.44
ROLLINS INC	7,031	61.37	431,492.47
STERICYCLE INC	6,767	47.66	322,515.22
TRANSUNION	15,344	66.44	1,019,455.36
VERISK ANALYTICS INC	12,301	123.38	1,517,697.38
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	76.96	1,570,599.68
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	90.46	3,159,858.26
AMERCO	602	335.54	201,995.08
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	36.22	359,302.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	89.61	1,025,855.28
CSX CORP	68,519	70.66	4,841,552.54
DELTA AIR LINES INC	15,095	56.65	855,131.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	71.73	990,089.19

FEDEX CORP	20,716	224.40	4,648,670.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	106.72	761,340.48
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	102.42	895,458.06
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	33.48	358,236.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	170.32	3,883,125.68
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	134.99	708,022.55
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	52.49	601,797.85
UNION PACIFIC CORP	63,871	150.25	9,596,617.75
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	92.35	554,377.05
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	109.51	6,046,266.12
XPO LOGISTICS INC	10,037	81.03	813,298.11
APTIV PLC	20,954	75.62	1,584,541.48
AUTOLIV INC	6,639	81.75	542,738.25
BORGWARNER INC	15,953	38.79	618,816.87
FORD MOTOR COMPANY	299,765	9.38	2,811,795.70
GENERAL MOTORS CO	101,158	35.70	3,611,340.60
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	21.99	475,577.73
HARLEY-DAVIDSON	14,677	40.73	597,794.21
LEAR CORP	5,287	138.01	729,658.87
TESLA INC	10,369	350.51	3,634,438.19
DR HORTON INC	28,586	34.40	983,358.40
GARMIN LTD	9,564	66.11	632,276.04
HANESBRANDS INC	31,136	16.56	515,612.16
HASBRO INC	9,007	97.32	876,561.24
LEGGETT & PLATT INC	10,594	37.57	398,016.58
LENNAR CORP-CL A	23,545	41.90	986,535.50
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	137.56	1,165,408.32
MATTEL INC	27,399	13.55	371,256.45
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	47.78	551,715.66
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	125.65	636,040.30
NEWELL BRANDS INC	37,563	19.90	747,503.70
NIKE B	105,293	76.36	8,040,173.48
NVR INC	264	2,315.05	611,173.20
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	90.96	426,693.36
PULTE GROUP INC	21,959	24.44	536,677.96
PVH CORP	5,820	121.41	706,606.20
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	123.93	567,351.54
TAPESTRY INC	22,032	42.00	925,344.00
TOLL BROTHERS INC	11,211	32.38	363,012.18
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	22.75	362,862.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	20.74	337,709.42
VF CORP	26,718	84.16	2,248,586.88

WHIRLPOOL CORP	5,324	116.36	619,500.64
ARAMARK	19,980	35.60	711,288.00
BLOCK H & R INC	16,984	28.73	487,950.32
CARNIVAL CORPORATION	35,126	58.54	2,056,276.04
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	490.76	969,251.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	112.44	1,127,885.64
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	274.35	947,330.55
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	71.16	1,673,896.68
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	52.09	1,684,642.69
MARRIOTT INTL A	25,016	117.04	2,927,872.64
MCDONALD'S CORP	63,834	185.94	11,869,293.96
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	15.60	275,527.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	25.54	1,140,514.24
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	48.75	869,602.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	107.17	1,488,055.45
STARBUCKS CORP	113,248	68.60	7,768,812.80
VAIL RESORTS INC	2,987	265.37	792,660.19
WYNN RESORTS LTD	8,052	98.32	791,672.64
YUM BRANDS INC	27,323	90.72	2,478,742.56
CBS CORP-CL B	28,628	57.55	1,647,541.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	321.11	4,377,371.52
COMCAST CORP-CL A	373,142	38.34	14,306,264.28
DISCOVERY INC - A	12,804	32.98	422,275.92
DISCOVERY INC-C	23,672	29.71	703,295.12
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	31.73	578,057.14
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	23.84	806,602.56
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	82.17	711,838.71
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	25.12	389,761.92
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	24.51	1,134,102.21
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	32.66	457,566.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	40.74	620,592.42
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.63	259,381.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	56.40	712,726.80
NEWS CORP-CLASS A	33,479	14.24	476,740.96
OMNICOM GROUP	19,030	75.57	1,438,097.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.21	804,226.05
THE WALT DISNEY CO	121,890	118.00	14,383,020.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	48.16	4,148,261.60
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	47.71	1,739,458.89
VIACOM INC-CLASS B	26,755	32.10	858,835.50
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	171.18	1,058,919.48
AMAZON.COM	33,277	1,712.43	56,984,533.11

AUTOZONE INC	2,151	793.87	1,707,614.37
BEST BUY COMPANY INC	21,836	67.79	1,480,262.44
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	1,937.64	7,574,234.76
CARMAX INC	14,253	65.72	936,707.16
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	116.10	2,592,513.00
DOLLAR TREE INC	19,550	86.38	1,688,729.00
EXPEDIA GROUP INC	9,800	124.04	1,215,592.00
GAP	16,326	27.48	448,638.48
GENUINE PARTS CO	11,245	100.61	1,131,359.45
HOME DEPOT	94,571	185.99	17,589,260.29
KOHL'S CORP	12,602	81.97	1,032,985.94
L BRANDS INC	19,499	36.50	711,713.50
LKQ CORP	24,693	27.73	684,736.89
LOWES COMPANIES	66,782	96.82	6,465,833.24
MACY'S INC	25,926	37.78	979,484.28
NETFLIX INC	35,175	303.47	10,674,557.25
NORDSTROM INC	10,094	65.46	660,753.24
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	354.74	2,342,348.22
QURATE RETAIL INC	35,071	24.52	859,940.92
ROSS STORES INC	30,239	102.76	3,107,359.64
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	86.94	3,637,221.84
TIFFANY & CO	9,326	110.36	1,029,217.36
TJX COMPANIES INC	103,034	55.64	5,732,811.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	97.13	918,461.28
TRIPADVISOR INC	10,393	63.30	657,876.90
ULTA BEAUTY INC	4,911	308.12	1,513,177.32
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	237.74	8,481,136.76
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	8.72	295,608.00
KROGER CO	72,735	31.39	2,283,151.65
SYSCO CORP	40,229	66.81	2,687,699.49
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	82.39	5,585,794.83
WALMART INC	119,581	105.56	12,622,970.36
ALTRIA GROUP INC	152,862	63.42	9,694,508.04
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	48.26	2,150,803.42
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	48.92	1,078,196.80
BUNGE LIMITED	11,767	63.27	744,498.09
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	38.97	548,385.84
COCA-COLA CO	328,376	49.68	16,313,719.68
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	47.95	818,794.20
CONAGRA BRANDS INC	33,243	34.39	1,143,226.77
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	203.13	2,847,476.34
GENERAL MILLS INC	44,875	45.31	2,033,286.25

HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	108.58	1,216,096.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	45.02	1,056,394.30
INGREDION INC	5,835	104.75	611,216.25
JM SMUCKER CO	9,442	112.88	1,065,812.96
KELLOGG CO	21,051	65.01	1,368,525.51
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	53.99	2,693,669.08
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	150.40	1,395,110.40
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	64.50	973,950.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	44.30	5,326,720.60
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	56.84	1,985,534.88
PEPSICO INC	115,115	117.48	13,523,710.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	89.18	11,235,788.20
TYSON FOODS INC	24,363	62.08	1,512,455.04
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	65.55	1,250,890.65
CLOROX COMPANY	10,045	158.77	1,594,844.65
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	63.80	4,324,619.20
COTY INC-CL A	39,000	8.49	331,110.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	140.23	2,499,179.06
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	109.45	3,063,505.50
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	92.41	18,741,302.46
ABBOTT LABORATORIES	142,028	72.79	10,338,218.12
ABIOMED INC	3,502	405.17	1,418,905.34
AETNA INC	26,686	209.36	5,586,980.96
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	235.96	1,478,053.44
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	88.86	1,141,584.42
ANTHEM INC	20,871	287.06	5,991,229.26
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	63.48	2,670,667.08
BECTON DICKINSON & CO	21,729	243.26	5,285,796.54
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	38.60	4,345,163.40
CARDINAL HEALTH	25,252	55.31	1,396,688.12
CENTENE CORP	16,736	142.31	2,381,700.16
CERNER CORP	23,088	57.57	1,329,176.16
CIGNA CORP	19,408	217.65	4,224,151.20
CVS HEALTH CORP	81,494	79.83	6,505,666.02
DANAHER CORP	50,460	104.39	5,267,519.40
DAVITA INC	11,875	69.70	827,687.50
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	36.06	643,094.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	153.18	2,569,747.68
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	98.48	4,548,692.72
HCA HEALTHCARE INC	23,027	143.95	3,314,736.65
HENRY SCHEIN INC	12,492	85.43	1,067,191.56
HOLOGIC INC	21,094	41.78	881,307.32

HUMANA INC	11,281	338.95	3,823,694.95
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	207.17	1,492,659.85
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	532.56	4,825,526.16
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	170.15	1,353,202.95
MCKESSON CORP	16,655	130.81	2,178,640.55
MEDTRONIC PLC	110,187	94.36	10,397,245.32
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	97.33	1,025,079.56
RESMED INC	10,895	106.94	1,165,111.30
STRYKER CORP	27,181	171.25	4,654,746.25
TELEFLEX INC	3,697	265.88	982,958.36
THE COOPER COS INC	4,135	267.80	1,107,353.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	276.55	21,714,152.90
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	131.49	953,039.52
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	119.37	838,693.62
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	93.60	913,629.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	117.62	1,889,330.06
ABBVIE INC	122,922	88.79	10,914,244.38
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	67.27	1,703,478.21
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	123.44	2,188,467.76
ALKERMES PLC	12,547	37.67	472,645.49
ALLERGAN PLC	26,330	165.52	4,358,141.60
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	72.41	535,761.59
AMGEN	54,777	193.16	10,580,725.32
BIOGEN INC	17,262	325.20	5,613,602.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	95.67	1,372,003.47
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	53.39	7,096,598.80
CELGENE CORP	61,389	74.02	4,544,013.78
GILEAD SCIENCES INC	106,635	71.18	7,590,279.30
ILLUMINA INC	12,043	329.25	3,965,157.75
INCYTE CORP	14,121	66.03	932,409.63
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	124.17	1,616,817.57
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	145.57	723,628.47
JOHNSON & JOHNSON	217,581	145.34	31,623,222.54
LILLY (ELI) & CO	79,730	112.21	8,946,503.30
MERCK & CO	218,364	74.86	16,346,729.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	608.03	1,219,708.18
MYLAN NV	42,644	36.95	1,575,695.80
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	34.02	459,508.14
PERRIGO CO PLC	11,333	64.07	726,105.31
PFIZER	483,121	44.28	21,392,597.88
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	356.66	2,336,123.00
SEATTLE GENETICS INC	9,601	58.06	557,434.06

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	23.45	1,892,180.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	243.45	7,848,341.10
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	114.39	371,424.33
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	180.55	3,755,259.45
WATERS CORP	6,513	199.44	1,298,952.72
ZOETIS INC	39,742	95.27	3,786,220.34
BANK OF AMERICA CORP	787,725	28.52	22,465,917.00
BB&T CORP	64,293	50.76	3,263,512.68
CIT GROUP INC	10,713	46.71	500,404.23
CITIGROUP	208,262	65.76	13,695,309.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	38.06	1,522,780.60
COMERICA INC	14,360	84.69	1,216,148.40
EAST WEST BANCORP INC	10,794	54.00	582,876.00
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	27.96	1,627,747.32
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	92.90	1,168,496.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	14.67	1,282,422.06
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	111.29	30,824,213.88
KEY CORP	87,033	18.89	1,644,053.37
M & T BANK CORP	11,745	166.72	1,958,126.40
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	9.60	375,312.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	15.70	429,928.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	134.23	5,087,182.77
REGIONS FINL CORP	96,209	17.24	1,658,643.16
SIGNATURE BANK	4,354	115.74	503,931.96
SUNTRUST BANKS	38,353	63.53	2,436,566.09
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	247.36	1,085,910.40
US BANCORP	127,580	53.15	6,780,877.00
WELLS FARGO & CO	378,753	53.04	20,089,059.12
ZIONS BANCORPORATION	15,186	50.16	761,729.76
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	115.24	510,858.92
ALLY FINANCIAL INC	36,028	25.76	928,081.28
AMERICAN EXPRESS	59,473	108.28	6,439,736.44
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	127.66	1,512,771.00
BANK NEW YORK CO	81,361	48.50	3,946,008.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	219.63	22,710,620.52
BLACKROCK INC	9,812	413.95	4,061,677.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	90.40	3,589,060.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	108.90	1,031,283.00
CME GROUP INC	27,733	189.74	5,262,059.42
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	70.56	2,086,106.40
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	52.94	1,117,457.52
EATON VANCE CORP	10,061	44.18	444,494.98

FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	30.87	804,780.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	222.65	6,529,879.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	79.08	3,709,326.48
INVESCO LTD	30,943	20.88	646,089.84
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	21.99	565,274.94
MOODY'S CORP	14,116	153.50	2,166,806.00
MORGAN STANLEY	108,682	45.73	4,970,027.86
MSCI INC	6,934	149.79	1,038,643.86
NASDAQ INC	9,070	90.40	819,928.00
NORTHERN TRUST CORP	17,320	97.94	1,696,320.80
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	98.48	1,976,099.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	79.50	789,594.00
S&P GLOBAL INC	20,491	186.27	3,816,858.57
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	47.64	4,697,446.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	54.77	591,625.54
STATE STREET CORP	29,345	72.25	2,120,176.25
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	27.62	1,666,784.14
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	52.50	1,228,710.00
VOYA FINANCIAL INC	14,081	45.63	642,516.03
AFLAC	61,894	45.04	2,787,705.76
ALLEGHANY CORP	1,276	628.99	802,591.24
ALLSTATE CORP	28,446	93.72	2,665,959.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	106.49	590,913.01
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	43.82	3,177,432.02
AON PLC	20,163	164.54	3,317,620.02
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	28.35	979,520.85
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	78.05	1,168,564.60
ASSURANT INC	4,769	104.78	499,695.82
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	47.49	633,849.03
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	56.95	415,848.90
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	41.57	282,509.72
CHUBB LTD	37,790	131.17	4,956,914.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	81.32	1,009,425.16
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	221.22	741,750.66
FNF GROUP	20,786	33.66	699,656.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	46.59	1,335,362.58
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	65.08	1,157,773.20
LOEWS CORP	22,051	49.59	1,093,509.09
MARKEL CORP	1,132	1,121.99	1,270,092.68
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	87.76	3,583,942.88
METLIFE INC	71,520	45.19	3,231,988.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	49.30	1,141,541.50

PROGRESSIVE CORP	46,702	73.19	3,418,119.38
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	95.85	3,215,384.10
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	148.76	807,915.56
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	124.92	405,865.08
TORCHMARK CORP	8,473	86.92	736,473.16
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	131.03	2,857,895.33
UNUM GROUP	18,574	37.71	700,425.54
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	159.93	1,748,034.90
WR BERKLEY CORP	7,296	78.41	572,079.36
CBRE GROUP INC-A	26,855	42.99	1,154,496.45
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.17	608,979.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	140.02	514,293.46
WEYERHAEUSER CO	62,107	26.83	1,666,330.81
ACCENTURE PLC-CL A	52,076	165.15	8,600,351.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	55.01	3,186,509.26
ADOBE INC	39,430	244.84	9,654,041.20
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	70.94	1,005,787.32
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	208.26	836,372.16
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,077.02	26,017,572.14
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,066.15	27,165,502.00
ANSYS INC	6,865	165.86	1,138,628.90
AUTODESK INC	18,086	135.55	2,451,557.30
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	147.19	5,264,691.92
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	107.21	1,034,576.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	46.26	998,522.10
CDK GLOBAL INC	10,687	50.77	542,578.99
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	112.64	1,216,624.64
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	107.01	1,214,777.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	70.34	3,377,726.80
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	98.05	1,551,837.35
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	62.00	1,456,876.00
EBAY	78,686	29.63	2,331,466.18
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	88.89	2,228,472.30
FACEBOOK INC-A	193,825	144.96	28,096,872.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	107.47	2,915,123.75
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	18.65	732,161.70
FISERV INC	33,784	80.24	2,710,828.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	199.82	1,431,310.66
FORTINET INC	10,871	74.73	812,389.83
GARTNER INC	7,002	147.64	1,033,775.28
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	112.17	1,403,583.21
GODADDY INC - CLASS A	12,570	64.46	810,262.20

IAC/INTERACTIVECORP	6,364	186.55	1,187,204.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	123.54	9,229,179.24
INTUIT INC	19,851	222.17	4,410,296.67
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	141.50	846,028.50
LEIDOS HOLDINGS	10,999	65.23	717,464.77
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	205.62	15,447,613.74
MERCADOLIBRE INC	3,264	325.69	1,063,052.16
MICROSOFT CORP	591,521	109.57	64,812,955.97
ORACLE CORP	250,503	50.61	12,677,956.83
PAYCHEX INC	25,506	69.02	1,760,424.12
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	86.76	7,947,823.32
RED HAT INC	13,963	173.75	2,426,071.25
SABRE CORP	17,243	25.57	440,903.51
SALESFORCE.COM INC	57,092	136.92	7,817,036.64
SERVICENOW INC	13,794	177.59	2,449,676.46
SPLUNK INC	11,773	98.54	1,160,111.42
SQUARE INC - A	22,319	73.27	1,635,313.13
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	49.94	882,989.14
SYMANTEC CORP	48,508	22.25	1,079,303.00
SYNOPSYS INC	12,264	93.35	1,144,844.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	113.05	1,079,853.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	91.97	1,159,741.70
TWITTER INC	55,701	34.08	1,898,290.08
VERISIGN INC	7,289	160.10	1,166,968.90
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	143.93	21,008,598.52
VMWARE INC-CLASS A	5,821	150.82	877,923.22
WESTERN UNION CO	38,757	18.82	729,406.74
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	139.93	1,495,991.63
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	90.11	2,110,195.98
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	30.25	301,350.50
AMPHENOL CORPORATION	24,215	91.14	2,206,955.10
APPLE INC	398,252	204.47	81,430,586.44
ARISTA NETWORKS INC	4,324	244.43	1,056,915.32
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	74.33	495,483.78
AVNET INC	10,936	43.66	477,465.76
CDW CORP/DE	12,482	91.08	1,136,860.56
CISCO SYSTEMS	390,187	47.11	18,381,709.57
COGNEX CORP	12,660	45.06	570,459.60
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	19.39	289,550.87
CORNING	71,752	33.56	2,407,997.12
F5 NETWORKS INC	5,350	183.24	980,334.00
FLEX LTD	40,465	8.22	332,622.30

FLIR SYSTEMS INC	11,686	48.40	565,602.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	15.72	2,039,449.92
HP INC	134,066	25.00	3,351,650.00
IPG PHOTONICS CORP	3,207	137.79	441,892.53
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	29.12	911,572.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	59.19	938,339.07
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	129.65	1,636,183.00
NETAPP INC	20,821	81.66	1,700,242.86
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	183.09	1,320,261.99
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	43.03	982,633.08
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	79.13	2,216,352.17
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	36.81	759,095.82
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	45.73	1,078,176.21
XEROX CORP	16,718	28.43	475,292.74
AT&T INC	587,152	30.69	18,019,694.88
CENTURYLINK INC	73,994	18.91	1,399,226.54
SPRINT CORP	64,825	6.19	401,266.75
T-MOBILE US INC	28,273	68.68	1,941,789.64
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	58.46	19,547,094.82
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	23.26	355,622.14
AES CORP	52,646	15.52	817,065.92
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	44.61	859,010.16
AMEREN CORPORATION	18,723	67.32	1,260,432.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	75.32	2,927,839.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	89.61	1,279,899.63
ATMOS ENERGY CORP	9,385	96.69	907,435.65
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	28.13	884,435.33
CMS ENERGY CORP	21,593	50.14	1,082,673.02
CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	79.00	2,020,109.00
DOMINION ENERGY INC	53,227	72.25	3,845,650.75
DTE ENERGY COMPANY	14,355	118.14	1,695,899.70
DUKE ENERGY CORP	57,060	85.58	4,883,194.80
EDISON INTL	26,184	61.00	1,597,224.00
ENERGY CORP	13,854	85.56	1,185,348.24
EVERGY INC	21,492	58.35	1,254,058.20
EVERSOURCE ENERGY	25,381	65.14	1,653,318.34
EXELON CORP	77,742	45.04	3,501,499.68
FIRSTENERGY CORP	39,519	38.00	1,501,722.00
NEXTERA ENERGY INC	37,780	176.56	6,670,436.80
NISOURCE INC	26,021	26.16	680,709.36
OGE ENERGY CORP	15,686	38.23	599,675.78
PG&E CORP	41,241	39.92	1,646,340.72

	PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	88.47	833,033.52	
	PPL CORPORATION	53,473	31.69	1,694,559.37	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	53.79	2,184,196.74	
	SCANA CORP	11,459	40.18	460,422.62	
	SEMPRA ENERGY	19,952	116.70	2,328,398.40	
	SOUTHERN CO	81,059	46.81	3,794,371.79	
	UGI CORP	13,950	56.03	781,618.50	
	VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.08	711,828.88	
	WEC ENERGY GROUP INC	25,287	70.00	1,770,090.00	
	XCEL ENERGY INC	40,763	50.34	2,052,009.42	
	ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	21.03	1,622,843.04	
	ANALOG DEVICES	30,277	87.59	2,651,962.43	
	APPLIED MATERIALS	84,218	34.28	2,886,993.04	
	BROADCOM INC	33,321	238.99	7,963,385.79	
	INTEL CORP	378,881	48.11	18,227,964.91	
	KLA-TENCOR CORP	12,266	95.28	1,168,704.48	
	LAM RESEARCH CORP	12,814	147.85	1,894,549.90	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	16.39	618,771.67	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	52.09	1,137,072.61	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	72.13	1,343,349.12	
	MICRON TECHNOLOGY	92,766	39.11	3,628,078.26	
	NVIDIA CORP	46,674	205.67	9,599,441.58	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	83.69	2,283,314.27	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	17.88	643,608.48	
	QORVO INC	10,609	68.15	723,003.35	
	QUALCOMM	113,870	56.72	6,458,706.40	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	76.66	1,112,336.60	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,005	96.10	7,592,380.50	
	XILINX INC	20,299	85.64	1,738,406.36	
	アメリカドル 小計	24,858,792		1,945,714,994.49 (221,694,766,472)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	27,117	10.49	284,457.33	
	CAMECO CORP	28,709	15.77	452,740.93	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	37.16	3,719,344.40	
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	11.82	919,631.46	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	5.64	243,896.16	
	ENBRIDGE	138,840	43.49	6,038,151.60	
	ENCANA CORP	76,271	11.67	890,082.57	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	18.26	574,076.14	
	IMPERIAL OIL	24,763	40.88	1,012,311.44	
	INTER PIPELINE LTD	30,317	23.34	707,598.78	
	KEYERA CORP	14,929	29.53	440,853.37	

PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	45.32	1,915,948.32
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	19.35	355,072.50
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	12.45	249,124.50
SUNCOR ENERGY	134,041	44.41	5,952,760.81
TOURMALINE OIL CORP	19,965	19.75	394,308.75
TRANSCANADA CORP	70,703	51.32	3,628,477.96
VERMILION ENERGY INC	10,067	31.62	318,318.54
AGNICO EAGLE MINES	17,661	45.25	799,160.25
BARRICK GOLD CORP	94,395	17.09	1,613,210.55
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	52.77	693,345.03
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	11.97	681,093.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	85.69	1,221,682.33
GOLDCORP INC	68,688	12.16	835,246.08
KINROSS GOLD CORP	107,615	3.42	368,043.30
LUNDIN MINING CORP	62,243	5.34	332,377.62
METHANEX CORP	7,099	85.13	604,337.87
NUTRIEN LTD	51,428	74.08	3,809,786.24
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	27.52	1,257,031.04
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	2.37	168,270.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	65.37	282,855.99
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	21.54	793,490.52
BOMBARDIER B	157,835	2.65	418,262.75
CAE INC	18,372	24.38	447,909.36
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	27.70	325,862.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	46.57	685,184.41
WSP GLOBAL INC	9,471	67.47	639,008.37
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	113.17	6,851,198.63
CP RAILWAY LIMITED	11,959	275.65	3,296,498.35
LINAMAR CORP	3,889	48.21	187,488.69
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	65.36	1,828,642.08
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	41.78	737,793.02
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	75.04	1,378,634.88
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	24.64	885,734.08
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	162.64	879,719.76
DOLLARAMA INC	26,700	36.98	987,366.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	66.66	2,270,639.58
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	24.31	279,540.69
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	58.33	910,997.94
METRO INC	19,179	43.63	836,779.77
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	93.77	645,418.91
SAPUTO INC	20,412	38.84	792,802.08
AURORA CANNABIS INC	53,000	9.36	496,080.00

	CANOPY GROWTH CORP	16,400	51.49	844,436.00
	BANK MONTREAL	52,905	98.87	5,230,717.35
	BANK NOVA SCOTIA	96,431	70.79	6,826,350.49
	CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	115.23	4,072,804.35
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	60.45	1,706,382.60
	ROYAL BANK OF CANADA	116,879	95.95	11,214,540.05
	TORONTO-DOMINION BANK	148,256	73.24	10,858,269.44
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	57.18	3,906,480.42
	CI FINANCIAL CORP	18,671	20.12	375,660.52
	IGM FINANCIAL INC	7,685	34.21	262,903.85
	ONEX CORP	6,603	86.28	569,706.84
	THOMSON REUTERS CORP	22,284	63.50	1,415,034.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	626.21	1,443,414.05
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	30.54	726,485.52
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	48.57	399,731.10
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	105.04	1,099,348.64
	MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	22.33	3,584,813.54
	POWER CORP OF CANADA	29,774	26.89	800,622.86
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	28.45	590,053.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	48.45	2,400,019.20
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	19.62	244,563.30
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	12.28	483,832.00
	CGI GROUP INC - CL A	21,192	81.68	1,730,962.56
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	893.66	1,520,115.66
	OPEN TEXT CORP	19,994	43.58	871,338.52
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	186.23	1,367,300.66
	BCE INC	12,539	54.10	678,359.90
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	67.54	1,950,622.74
	TELUS CORP	16,454	45.88	754,909.52
	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	15.75	187,204.50
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.52	207,124.32
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.43	324,483.32
	EMERA INC	4,086	43.08	176,024.88
	FORTIS INC	34,128	45.60	1,556,236.80
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.30	419,620.60
	カナダドル 小計	3,312,220		138,139,120.63 (11,926,931,675)
ユーロ	ENAGAS	18,299	24.60	450,155.40
	ENI	202,686	15.45	3,132,714.81
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	14.77	589,034.92
	NESTE OIL OYJ	11,086	71.06	787,771.16
	OMV AG	12,139	48.83	592,747.37

REPSOL SA	110,036	15.85	1,744,070.60
SNAM SPA	173,485	3.87	672,774.83
TENARIS SA	40,648	12.94	526,188.36
TOTAL SA	195,662	50.49	9,878,974.38
VOPAK	6,360	40.55	257,898.00
AIR LIQUIDE	34,556	106.65	3,685,397.40
AKZO NOBEL	19,791	74.46	1,473,637.86
ARCELORMITTAL	53,985	22.26	1,201,706.10
ARKEMA	5,335	94.96	506,611.60
BASF SE	73,727	68.85	5,076,103.95
COVESTRO AG	16,178	57.50	930,235.00
CRH PLC	71,124	25.80	1,834,999.20
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	26.72	359,490.88
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	40.82	235,204.84
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	60.10	685,560.70
IMERYS SA	3,000	52.15	156,450.00
K+S AG	14,355	17.28	248,054.40
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	79.10	1,205,009.40
LANXESS	7,293	56.02	408,553.86
LINDE PLC	23,503	143.50	3,372,680.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	26.86	525,515.90
SOLVAY SA	5,511	101.95	561,846.45
STORA ENSO OYJ R	47,237	12.88	608,412.56
SYMRISE AG	9,083	72.02	654,157.66
THYSSEN KRUPP	33,044	17.33	572,652.52
UMICORE	17,605	42.61	750,149.05
UPM KYMMENE OYJ	43,990	26.79	1,178,492.10
VOESTALPINE AG	8,140	31.13	253,398.20
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	34.74	715,331.34
AIRBUS SE	46,842	94.68	4,435,000.56
ALSTOM	13,816	38.02	525,284.32
ANDRITZ AG	5,242	43.08	225,825.36
BOUYGUES ORD	16,815	33.06	555,903.90
BRENTAG AG	11,626	43.20	502,243.20
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	8.79	674,239.78
DASSAULT AVIATION SA	213	1,400.00	298,200.00
EIFFAGE	6,079	89.02	541,152.58
FERROVIAL SA	37,634	17.79	669,697.03
FERROVIAL SA-RTS	37,634	0.41	15,520.26
GEA GROUP AG	13,382	26.45	353,953.90
HOCHTIEF AG	1,354	133.70	181,029.80
KION GROUP AG	5,887	50.52	297,411.24

KONE OYJ-B	26,924	43.41	1,168,770.84
LEGRAND SA	21,312	55.18	1,175,996.16
LEONARDO SPA	35,425	8.86	313,936.35
METSO OYJ	9,561	26.81	256,330.41
MTU AERO ENGINES AG	3,907	182.60	713,418.20
OSRAM LICHT AG	7,440	34.42	256,084.80
PRYSMIAN SPA	14,715	17.82	262,221.30
REXEL SA	24,339	10.56	257,141.53
SAFRAN SA	27,252	112.45	3,064,487.40
SAINT-GOBAIN	39,044	31.89	1,245,113.16
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	63.88	2,862,718.32
SIEMENS	61,389	102.34	6,282,550.26
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.24	214,089.84
THALES SA	8,109	113.60	921,182.40
VINCI S.A.	40,049	78.84	3,157,463.16
WARTSILA OYJ	34,386	15.51	533,498.79
BUREAU VERITAS SA	19,558	19.63	383,923.54
EDENRED	18,941	34.30	649,676.30
RANDSTAD NV	9,588	43.72	419,187.36
SOCIETE BIC SA	2,424	89.05	215,857.20
TELEPERFORMANCE	4,523	150.90	682,520.70
WOLTERS KLUWER	23,031	52.14	1,200,836.34
ADP	2,382	185.10	440,908.20
AENA SME SA	5,610	139.40	782,034.00
ATLANTIA SPA	42,039	18.47	776,460.33
BOLLORE	61,805	3.78	233,870.12
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	20.24	342,642.96
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	28.57	2,245,373.44
FRAPORT AG	3,561	71.02	252,902.22
GETLINK	36,478	11.53	420,773.73
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.38	342,003.96
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	73.36	1,972,797.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	64.75	323,167.25
CONTINENTAL AG	8,828	138.05	1,218,705.40
DAIMLER AG	74,263	50.76	3,769,589.88
FAURECIA	5,945	40.98	243,626.10
FERRARI NV	9,947	97.92	974,010.24
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	14.29	1,236,699.47
MICHELIN	13,802	89.66	1,237,487.32
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	27.35	281,486.20
PEUGEOT SA	46,029	20.68	951,879.72
PIRELLI & C SPA	39,097	6.19	242,010.43

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	56.56	658,019.04
RENAULT SA	15,041	64.94	976,762.54
SCHAEFFLER AG	15,247	8.34	127,190.47
VALEO SA	19,350	26.03	503,680.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	146.06	2,158,766.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	143.20	371,460.80
ADIDAS AG	14,964	203.90	3,051,159.60
HERMES INTERNATIONAL	2,561	495.20	1,268,207.20
HUGO BOSS AG	4,852	62.22	301,891.44
KERING	6,060	393.20	2,382,792.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	55.44	738,405.36
LVMH	22,399	266.00	5,958,134.00
MONCLER SPA	15,736	30.32	477,115.52
PUMA AG	772	447.00	345,084.00
SEB SA	2,075	125.70	260,827.50
ACCOR	14,931	39.80	594,253.80
PADDY POWER PLC	7,143	75.20	537,153.60
SODEXO	7,035	93.70	659,179.50
AXEL SPRINGER SE	3,827	58.10	222,348.70
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	18.38	220,118.88
JC DECAUX SA	4,674	29.12	136,106.88
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	16.97	325,382.78
PUBLICIS GROUPE	17,601	52.34	921,236.34
RTL GROUP	3,513	51.90	182,324.70
SES	31,369	18.69	586,443.45
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.26	216,213.48
VIVENDI	83,098	21.41	1,779,128.18
INDITEX	86,470	26.42	2,284,537.40
ZALANDO SE	9,155	31.40	287,467.00
CARREFOUR	43,442	17.57	763,493.15
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	38.04	140,253.48
COLRUYT SA	4,160	55.30	230,048.00
JERONIMO MARTINS	20,234	10.76	217,717.84
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	22.60	2,272,091.00
METRO AG	13,712	13.82	189,499.84
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	65.68	3,995,905.52
DANONE (GROUPE)	48,771	65.61	3,199,865.31
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.43	316,180.81
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	76.80	689,664.00
HEINEKEN NV	20,246	79.50	1,609,557.00
KERRY GROUP PLC-A	13,146	94.10	1,237,038.60
PERNOD-RICARD	17,495	142.40	2,491,288.00

REMY COINTREAU	1,575	107.90	169,942.50
BEIERSDORF AG	7,693	91.78	706,063.54
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	87.00	749,766.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	96.96	1,387,885.44
LOREAL	20,321	205.60	4,177,997.60
UNILEVER NV-CVA	125,731	48.54	6,103,611.39
BIOMERIEUX	3,246	68.40	222,026.40
ESSILORLUXOTTICA	17,239	120.20	2,072,127.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	70.82	1,274,476.72
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	52.82	1,787,957.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	33.60	2,502,228.30
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	132.70	430,744.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	38.86	485,750.00
BAYER	75,550	71.00	5,364,050.00
EUROFINS SCIENTIFIC	971	437.60	424,909.60
GRIFOLS SA	22,128	26.10	577,540.80
IPSEN	2,722	127.50	347,055.00
MERCK KGAA	10,480	94.86	994,132.80
ORION OYJ-CLASS B	7,975	30.00	239,250.00
QIAGEN N.V.	17,548	31.77	557,499.96
RECORDATI SPA	7,493	30.23	226,513.39
SANOFI	91,271	80.20	7,319,934.20
UCB (GROUPE)	10,465	75.88	794,084.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	23.08	766,002.12
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	4.91	2,660,161.71
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.18	525,351.74
BANCO SANTANDER SA	1,313,133	4.23	5,566,370.78
BANKIA SA	110,053	2.90	319,593.91
BANKINTER SA	58,881	7.54	444,433.78
BNP PARIBAS	90,844	46.36	4,211,982.06
CAIXABANK	277,342	3.67	1,017,845.14
COMMERZBANK AG	80,494	8.71	701,424.71
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	11.35	1,054,408.57
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	36.68	847,601.44
ING GROEP NV-CVA	314,846	11.31	3,562,167.64
INTESA SANPAOLO	1,163,318	2.00	2,333,034.24
KBC GROEP NV	20,232	61.84	1,251,146.88
MEDIOBANCA	53,990	7.86	424,469.38
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	24.95	311,625.50
SOCIETE GENERALE	63,719	33.69	2,146,693.11
UNICREDIT SPA	163,189	11.23	1,832,612.47
AMUNDI SA	4,764	51.96	247,537.44

DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	8.95	1,443,635.44
DEUTSCHE BOERSE	15,552	111.15	1,728,604.80
EURAZEO SA	3,198	66.00	211,068.00
EXOR NV	7,813	51.16	399,713.08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	81.50	509,130.50
NATIXIS	69,996	5.28	369,718.87
WENDEL	2,023	111.20	224,957.60
AEGON	133,499	5.56	742,521.43
AGEAS	16,065	45.19	725,977.35
ALLIANZ SE-REG	36,019	192.00	6,915,648.00
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.43	1,467,303.31
AXA	157,703	22.30	3,517,565.41
CNP ASSURANCES	11,830	20.32	240,385.60
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	125.30	589,661.80
MAPFRE SA	90,939	2.54	231,712.57
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	192.75	2,441,178.75
NN GROUP NV	23,899	38.55	921,306.45
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.87	316,260.45
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	41.36	1,497,769.68
SCOR SE	13,354	43.57	581,833.78
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	41.33	1,138,765.49
VONOVIA SE	40,469	41.96	1,698,079.24
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	69.86	2,527,953.96
ATOS SE	7,634	77.36	590,566.24
CAPGEMINI SA	13,238	109.60	1,450,884.80
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	111.80	1,170,434.20
DELIVERY HERO SE	8,671	36.86	319,613.06
SAP SE	78,835	95.17	7,502,726.95
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	72.62	495,994.60
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.49	347,129.37
WIRECARD AG	9,864	157.40	1,552,593.60
INGENICO GROUP	4,681	66.02	309,039.62
NOKIA OYJ	458,694	5.17	2,372,365.36
1&1 DRILLISCH AG	3,773	39.06	147,373.38
DEUTSCHE TELEKOM	268,918	14.69	3,951,750.01
ELISA A	11,722	37.37	438,051.14
ILIAD SA	2,053	100.15	205,607.95
KPN (KON.)	261,596	2.38	623,906.46
ORANGE	164,543	14.63	2,407,264.09
PROXIMUS	13,141	22.85	300,271.85
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.51	439,916.83
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.44	208,510.19

	TELEFONICA	377,880	7.46	2,822,385.72
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.43	229,964.67
	E.ON SE	183,255	8.74	1,601,831.95
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	15.63	777,373.68
	ENDESA	24,774	19.85	491,763.90
	ENEL	656,974	4.48	2,945,214.44
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.11	600,982.62
	ENGIE	151,158	12.57	1,900,811.85
	FORTUM OYJ	38,328	19.32	740,496.96
	IBERDROLA SA	476,207	6.57	3,128,679.99
	INNOGY SE	11,000	39.50	434,500.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	26,034	23.16	602,947.44
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	19.28	633,964.96
	RWE STAMM	42,828	18.56	795,101.82
	SUEZ	28,043	13.55	380,122.86
	TERNA SPA	105,905	4.80	509,191.24
	UNIPER SE	14,751	26.16	385,886.16
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	18.89	864,066.38
	ASML HOLDING NV	33,413	152.22	5,086,126.86
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	18.19	1,650,615.17
	STMICROELECTRONICS	57,598	12.99	748,486.01
	ユーロ 小計	15,503,126		297,262,145.09 (38,334,926,230)
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.23	8,470,902.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	24.18	9,021,292.02
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	24.62	7,491,368.25
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	6.65	359,100.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	16.87	1,475,576.02
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	7.78	279,031.39
	BHP BILLITTON PLC	168,203	15.85	2,667,026.76
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	48.02	491,868.86
	FRESNILLO PLC	17,743	8.61	152,767.23
	GLENCORE PLC	943,407	3.03	2,867,013.87
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	29.47	415,851.17
	MONDI PLC	27,192	17.50	475,995.96
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	61.96	451,936.24
	RIO TINTO PLC REG	96,058	38.49	3,697,752.71
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	19.00	798,399.00
	BAE SYSTEMS PLC	256,884	5.29	1,359,430.12
	BUNZL PLC	27,712	22.32	618,531.84
	DCC PLC	7,320	63.60	465,552.00
	FERGUSON PLC	19,208	51.80	994,974.40

MEGGITT PLC	66,268	5.07	336,111.29
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.70	697,081.35
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	8.14	1,089,773.07
SMITHS GROUP PLC	28,628	13.55	387,909.40
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	10.70	198,631.27
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	15.50	288,175.93
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	6.00	118,236.77
EXPERIAN PLC	75,041	18.15	1,361,994.15
G4S PLC	132,555	1.83	242,708.20
INTERTEK GROUP PLC	12,430	46.09	572,898.70
RELX PLC	162,365	15.58	2,530,458.52
EASYJET PLC	11,633	12.54	145,877.82
ROYAL MAIL PLC	75,133	3.45	259,809.91
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.44	388,698.88
BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.73	626,542.08
PERSIMMON PLC	26,389	23.86	629,641.54
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.68	454,601.28
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	36.40	385,803.60
CARNIVAL PLC	13,721	43.71	599,744.91
COMPASS GROUP PLC	126,022	15.37	1,937,588.25
GVC HOLDINGS PLC	42,500	8.38	356,150.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	40.59	566,798.76
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.30	214,953.59
TUI AG-DI	37,945	12.83	487,024.07
WHITBREAD PLC	14,664	45.93	673,517.52
INFORMA PLC	100,899	7.10	716,988.29
ITV PLC	295,435	1.50	444,925.11
PEARSON	66,305	9.21	611,199.49
WPP PLC	98,371	8.57	843,039.47
KINGFISHER PLC	170,994	2.55	436,205.69
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.12	422,967.40
NEXT PLC	11,202	54.24	607,596.48
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.51	422,582.18
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.22	477,638.70
TESCO	786,019	2.18	1,719,023.55
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	26.38	760,931.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	33.14	6,178,857.75
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.72	426,011.20
DIAGEO	200,277	27.46	5,500,607.80
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	27.50	2,116,070.00
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	62.55	3,355,119.45
UNILEVER PLC	99,877	41.46	4,141,399.80

CONVATEC GROUP PLC	112,565	1.56	176,164.22	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	3.58	107,526.68	
NMC HEALTH PLC	9,509	35.30	335,667.70	
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.95	990,826.65	
ASTRAZENECA	101,347	61.72	6,255,136.84	
GLAXOSMITHKLINE	403,375	15.70	6,334,601.00	
SHIRE PLC	74,526	46.12	3,437,511.75	
BARCLAYS	1,365,547	1.76	2,414,287.09	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	6.33	10,358,643.39	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.59	3,555,014.61	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.51	996,324.95	
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	5.69	1,329,423.66	
3I GROUP PLC	79,251	8.65	685,679.65	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	19.16	392,186.04	
INVESTEC PLC	54,280	4.97	269,825.88	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	42.13	1,107,850.48	
SCHRODERS PLC	8,614	26.07	224,566.98	
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	10.62	475,468.75	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.70	522,619.19	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.54	333,877.70	
AVIVA PIC	318,261	4.33	1,380,297.95	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.25	369,801.18	
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.61	1,269,856.10	
PRUDENTIAL	212,799	16.04	3,413,295.96	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.45	472,324.40	
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.47	357,644.70	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	12.84	450,037.42	
SAGE GROUP PLC	89,321	5.51	492,515.99	
BT GROUP PLC	663,615	2.54	1,686,577.52	
VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.43	3,133,892.54	
CENTRICA PLC	440,558	1.54	679,780.99	
NATIONAL GRID PLC	272,668	8.55	2,333,220.07	
SEVERN TRENT PLC	18,112	19.80	358,708.16	
SSE PLC	80,824	11.52	931,496.60	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.72	454,630.80	
イギリスボンド 小計	24,583,254		145,373,548.17 (21,426,607,264)	
スイスフラン				
CLARIANT AG-REG	17,398	21.90	381,016.20	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	558.50	375,312.00	
GIVAUDAN-REG	740	2,406.00	1,780,440.00	
LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	46.88	1,890,857.92	
SIKA AG-BR	10,500	129.70	1,361,850.00	

ABB LTD	149,127	20.27	3,022,804.29	
GEBERIT AG-REG	3,021	385.50	1,164,595.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	205.20	303,490.80	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	210.40	628,885.60	
ADECCO GROUP AG-REG	13,224	50.06	661,993.44	
SGS SA	437	2,312.00	1,010,344.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	137.85	546,575.25	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	69.10	2,867,304.50	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	322.40	800,519.20	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	63.05	248,290.90	
DUFREY AG-REG	2,548	106.30	270,852.40	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,988.00	318,080.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	81,400.00	651,200.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	7,095.00	532,125.00	
NESTLE SA - REGISTERED	252,246	85.40	21,541,808.40	
SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	163.40	676,476.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	689.00	536,731.00	
LONZA GROUP AG-REG	5,757	327.30	1,884,266.10	
NOVARTIS	180,510	89.72	16,195,357.20	
ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	251.35	14,336,249.95	
VIFOR PHARMA AG	3,601	139.00	500,539.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	12.98	2,748,625.84	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	45.48	784,711.92	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	73.45	249,509.65	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	708.00	1,055,628.00	
UBS GROUP AG	317,371	14.12	4,481,278.52	
BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	149.00	577,673.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	391.00	1,153,059.00	
SWISS RE LTD	26,239	92.40	2,424,483.60	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	314.40	3,868,692.00	
SWISS PRIME SITE-REG	6,277	83.00	520,991.00	
TEMENOS AG - REG	5,252	136.40	716,372.80	
SWISSCOM	2,064	462.80	955,219.20	
スイスフラン 小計	1,408,816		94,024,209.18 (10,650,122,173)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	264.00	3,746,424.00
	BOLIDEN AB	20,141	201.00	4,048,341.00
	ALFA LAVAL AB	25,639	218.80	5,609,813.20
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	177.25	14,232,288.75
	ATLAS COPCO A	53,833	217.90	11,730,210.70
	ATLAS COPCO B	29,972	203.05	6,085,814.60
	EPIROC AB-A	53,833	75.46	4,062,238.18

	EPIROC AB-B	29,972	72.19	2,163,678.68	
	SANDVIK AB	87,313	138.65	12,105,947.45	
	SKANSKA B	28,530	147.20	4,199,616.00	
	SKF AB-B	28,335	142.15	4,027,820.25	
	VOLVO B	123,214	135.20	16,658,532.80	
	SECURITAS B	22,844	155.30	3,547,673.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	193.45	3,514,986.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	69.04	2,672,676.48	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	159.04	11,762,916.48	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	322.20	1,846,206.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	478.40	7,247,281.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	212.60	10,326,194.60	
	NORDEA BANK ABP	244,135	80.70	19,701,694.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	95.06	13,185,772.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	100.65	12,095,815.05	
	SWEDBANK AB-A	71,353	208.10	14,848,559.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	189.70	2,426,642.40	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	393.00	14,443,536.00	
	KINNEVIK AB - B	18,104	240.40	4,352,201.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	284.60	2,071,888.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	81.84	20,310,150.96	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	458.20	9,853,132.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	533.50	3,304,499.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,266	102.80	3,419,744.80	
	TELIA CO AB	235,437	42.09	9,909,543.33	
	スウェーデンクローナ 小計	1,992,279		259,511,840.81 (3,254,278,483)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	250.20	2,579,812.20	
	EQUINOR ASA	92,696	208.20	19,299,307.20	
	NORSK HYDRO	106,150	42.38	4,498,637.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	380.00	5,118,600.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	284.00	1,979,764.00	
	MARINE HARVEST	32,238	203.50	6,560,433.00	
	ORKLA	69,804	72.40	5,053,809.60	
	DNB ASA	80,217	156.70	12,570,003.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	137.40	2,552,067.60	
	TELENOR ASA	60,821	158.45	9,637,087.45	
	ノルウェークローネ 小計	491,252		69,849,521.95 (942,968,546)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	643.00	4,758,843.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	331.30	5,859,703.10	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	484.50	8,585,340.00	

	ISS A/S	14,253	224.30	3,196,947.90
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,100.00	2,421,900.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	8,662.00	4,400,296.00
	DSV A/S	14,599	525.40	7,670,314.60
	PANDORA A/S	8,431	349.40	2,945,791.40
	CARLSBERG AS-B	8,236	731.40	6,023,810.40
	COLOPLAST-B	9,476	633.40	6,002,098.40
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	212.00	1,573,040.00
	GENMAB A/S	4,512	992.40	4,477,708.80
	H LUNDBECK A/S	4,871	285.20	1,389,209.20
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	295.50	42,534,861.00
	DANSKE BANK A/S	59,378	144.15	8,559,338.70
	TRYG A/S	9,828	167.60	1,647,172.80
	ORSTED A/S	15,908	455.30	7,242,912.40
	デンマーククローネ 小計	344,469		119,289,287.70 (2,062,511,784)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	27.11	559,252.19
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.70	914,613.70
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	7.06	947,466.12
	SANTOS	156,437	6.42	1,004,325.54
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	33.77	2,597,453.32
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.49	424,440.42
	AMCOR	88,486	13.65	1,207,833.90
	BHP BILLITON LTD	258,265	33.41	8,628,633.65
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	13.73	677,273.44
	BORAL LIMITED	81,732	5.55	453,612.60
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.25	572,373.00
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	4.24	638,539.76
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	16.90	631,434.70
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	20.88	1,276,999.92
	ORICA LTD	29,211	18.47	539,527.17
	RIO TINTO LTD	32,522	81.23	2,641,762.06
	SOUTH32 LTD	408,172	3.54	1,444,928.88
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	46.58	429,467.60
	BRAMBLES LTD	129,297	10.56	1,365,376.32
	SEEK LTD	26,358	17.81	469,435.98
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.27	681,009.49
	TRANSURBAN GROUP	214,921	11.45	2,460,845.45
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	27.13	1,186,259.25
CROWN RESORTS LTD	30,328	11.77	356,960.56	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	49.12	271,289.76	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.62	148,858.06	

	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.63	772,496.98	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.26	147,231.38	
	WESFARMERS LTD	93,277	47.42	4,423,195.34	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	29.42	3,024,993.82	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.18	469,603.40	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	15.34	895,472.50	
	COCHLEAR LIMITED	4,811	176.13	847,361.43	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.08	291,780.32	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	56.68	694,216.64	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	22.49	714,664.73	
	CSL LIMITED	36,265	190.58	6,911,383.70	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	27.13	6,372,050.23	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.92	353,152.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.55	447,678.70	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	70.95	9,953,078.85	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	24.90	5,541,071.70	
	WESTPAC BANKING	277,750	27.70	7,693,675.00	
	AMP LTD	244,230	2.67	652,094.10	
	ASX LTD	15,814	61.18	967,500.52	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	9.84	433,629.12	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	123.64	3,310,831.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	178,174	7.22	1,286,416.28	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.82	604,923.84	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.49	1,299,438.57	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.08	1,449,127.68	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	20.43	665,282.52	
	REA GROUP LTD	3,593	80.50	289,236.50	
	TELSTRA CORP	342,339	3.04	1,040,710.56	
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.48	235,433.00	
	AGL ENERGY LTD	51,344	17.90	919,057.60	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.71	205,593.30	
	オーストラリアドル 小計	5,843,656		95,442,355.07 (7,853,951,398)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.10	467,528.40	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.20	611,640.00	
	A2 MILK CO LTD	66,854	10.42	696,618.68	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	13.90	632,561.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.32	447,425.44	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.06	591,250.18	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.24	358,162.56	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		3,805,186.46 (292,010,008)	

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	79.00	16,826,684.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.54	1,538,460.00	
	MTR CORP	114,000	38.30	4,366,200.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	25.45	1,170,700.00	
	LI & FUNG	554,800	1.65	915,420.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	41.00	4,879,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	22.90	1,568,650.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	42.90	8,494,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	11.68	784,896.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	31.70	6,428,760.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	11.06	1,083,880.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.49	856,680.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	16.16	2,275,328.00	
	WH GROUP LTD	699,000	6.10	4,263,900.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	25.65	2,799,954.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	29.05	9,005,500.00	
	HANG SENG BANK	61,100	177.90	10,869,690.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	221.40	21,453,660.00	
	AIA GROUP LTD	968,600	62.65	60,682,790.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	53.25	11,501,787.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	19.74	1,598,940.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.68	2,539,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	37.35	4,252,073.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	37.45	2,209,550.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	25.15	1,622,175.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.24	5,032,960.00	
	SINO LAND CO	235,400	12.40	2,918,960.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	106.00	13,992,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	83.25	3,371,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	28.05	2,698,410.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	20.60	1,874,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	47.30	4,304,300.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	43.00	2,795,000.00	
PCCW LTD	357,000	4.31	1,538,670.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	57.45	2,872,500.00		
CLP HOLDINGS	133,500	85.70	11,440,950.00		
HONG KONG & CHINA GAS	737,913	14.82	10,935,870.66		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	52.30	5,805,300.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	74.95	1,776,315.00		
	香港ドル 小計	7,660,909		255,345,978.06 (3,715,283,980)	
	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.20	696,260.00	

シンガポールドル	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.63	281,410.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.47	378,230.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.30	259,870.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.18	362,970.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.52	412,530.16	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.88	249,856.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.95	403,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.65	336,815.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	34.30	339,570.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.25	104,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.15	562,590.00	
	DBS GROUP	145,600	23.74	3,456,544.00	
	OCBC BANK	260,000	11.46	2,979,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	24.66	2,729,862.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.19	447,937.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.13	585,623.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	8.45	263,640.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.28	298,300.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.70	377,790.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.10	1,986,923.30		
シンガポールドル 小計		3,459,876		17,514,820.46	(1,447,074,466)
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	23.62	1,600,396.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	459.60	671,016.00	
	BANK HAPOLIM BM	84,067	26.42	2,221,050.14	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	24.68	2,857,795.92	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	66.77	547,514.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	189.90	820,937.70	
	NICE LTD	4,894	418.20	2,046,670.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.42	684,440.76	
イスラエルシェケル 小計		441,100		11,449,822.04	(354,600,988)
合 計		90,466,015		323,956,033,467	(323,956,033,467)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	795,390.48	
		LENLEASE GROUP	44,009	627,128.25	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	590,380.20	
			223,440	2,012,898.93	

		オーストラリアドル 小計		(165,641,452)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,640,520.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,883,680.00	
		香港ドル 小計	488,500	4,524,200.00	
				(65,827,110)	
		投資信託受益証券合計	711,940	231,468,562	
				(231,468,562)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	650,446.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,055,296.34	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	5,748,865.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	973,888.48	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,972,419.18	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,528,646.52	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,000	365,940.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	656,293.68	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,636,646.87	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,861,070.88	
		DUKE REALTY CORP	29,929	855,370.82	
		EQUINIX INC	6,496	2,500,570.24	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,937,958.12	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,289,202.61	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	915,849.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	775,691.14	
		HCP INC	36,011	1,037,837.02	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,122,433.20	
		INVITATION HOMES INC	24,000	521,040.00	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	671,424.53	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	576,425.96	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	520,640.88	
		MACERICH CO/THE	10,128	517,743.36	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	876,132.32	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	541,633.00	
		PROLOGIS INC	50,653	3,422,623.21	
		PUBLIC STORAGE	12,835	2,648,502.25	
		REALTY INCOME CORP	21,691	1,361,327.16	
		REGENCY CENTERS CORP	11,717	764,534.25	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,606,362.66	
		SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,928,394.11	
		SL GREEN REALTY CORP	8,067	766,445.67	
		UDR INC	20,960	856,006.40	
		VENTAS INC	27,813	1,670,726.91	
		VEREIT INC	77,798	598,266.62	

	VORNADO REALTY TRUST	13,295	931,447.70	
	WELLTOWER INC	29,615	2,057,650.20	
	WP CAREY INC	13,017	840,507.69	
	アメリカドル 小計	902,256	55,562,260.92 (6,330,764,009)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	196,285.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	382,138.30	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	175,630.89	
	カナダドル 小計	30,576	754,054.99 (65,105,107)	
ユーロ	COVIVIO	3,578	320,588.80	
	GECINA SA	3,549	467,048.40	
	ICADE	2,845	214,228.50	
	KLEPIERRE	17,225	533,975.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,790	1,745,822.00	
	ユーロ 小計	37,987	3,281,662.70 (423,203,221)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	496,178.67	
	HAMMERSON PLC	61,184	272,085.24	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	504,818.10	
	SEGRO PLC	81,695	516,475.79	
	イギリスポンド 小計	280,843	1,789,557.80 (263,762,924)	
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	746,086.30	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,465,831.95	
	GPT GROUP	136,015	718,159.20	
	MIRVAC GROUP	306,089	673,395.80	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,719,451.89	
	STOCKLAND	207,412	759,127.92	
	VICINITY CENTERS	291,115	783,099.35	
	オーストラリアドル 小計	1,581,655	6,865,152.41 (564,933,391)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	12,924,000.00	
	香港ドル 小計	179,500	12,924,000.00 (188,044,200)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	503,625.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	410,670.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	426,639.00	
	SUNTEC REIT	173,000	302,750.00	
	シンガポールドル 小計	813,800	1,643,684.00 (135,801,172)	
		3,826,617	7,971,614,024	

投資証券合計		(7,971,614,024)	
合計		8,203,082,586	(8,203,082,586)

(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 595銘柄	97.2%			66.7%
	投資証券 38銘柄			2.8%	1.9%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.6%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	98.9%			11.5%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 96銘柄	98.8%			6.5%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	91.5%			2.4%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	93.6%			1.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.7%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.4%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8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

注記表(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11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,338,430,585
金銭信託	4,107,789
コール・ローン	28,076,970
株式	48,048,687,951
投資信託受益証券	79,148,615
投資証券	193,265,981
派生商品評価勘定	11,506,637
未収入金	370,735
未収配当金	46,943,858
前払金	35,343,049
差入委託証拠金	209,824,325
流動資産合計	49,995,706,495
資産合計	49,995,706,495
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,819,086
未払解約金	17,216,669
未払利息	79
その他未払費用	610
流動負債合計	64,036,444
負債合計	64,036,444
純資産の部	
元本等	
元本	18,612,081,328
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,319,588,723
元本等合計	49,931,670,051
純資産合計	49,931,670,051
負債純資産合計	49,995,706,495

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	2018年11月12日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2018年11月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,612,081,328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 2.6828円 (1万口当たり純資産額) (26,828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11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2018年11月12日現在
期首	2018年 5月11日
期首元本額	17,117,018,689円
期中追加設定元本額	1,972,103,940円
期中一部解約元本額	477,041,301円
期末元本額	18,612,081,328円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,133,013,925円
世界経済インデックスファンド	3,066,718,586円
D C 新興国株式インデックス・オープン	3,779,975,822円
D C 世界経済インデックスファンド	2,515,257,409円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	173,585,267円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	314,775,704円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	370,481,542円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	374,260,024円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,798,333円
S M T インデックスバランス・オープン	123,518,350円
S M T 世界経済インデックス・オープン	23,734,756円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	172,603,689円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,641,906円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	614,884円
グローバル経済コア	514,476,790円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	7,624,341円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,744,691,446
投資信託受益証券	12,991,246
投資証券	52,579,035
合計	5,784,279,235

(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11月12日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,627,841,410	-	1,592,498,361	35,343,049
合計		1,627,841,410	-	1,592,498,361	35,343,049

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2018年11月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	10,223,100	-	10,253,700	30,600
	アメリカドル	10,223,100	-	10,253,700	30,600
合計		10,223,100	-	10,253,700	30,600

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	487,161	4.51	2,197,096.11	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	1.16	120,952.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	42,814	75.40	3,228,175.60	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	168.70	1,453,687.90	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	6.97	753,484.88	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	3.97	637,437.54	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	72.00	1,593,432.00	

	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	13.86	234,649.80
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	56,475	17.27	975,323.25
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	23.81	369,269.29
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	13.00	242,060.00
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	32.05	228,324.20
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	15.21	385,573.50
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	37.93	204,897.86
	51JOB INC-ADR	1,655	63.30	104,761.50
	DP WORLD LTD	21,152	18.66	394,696.32
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	25.85	282,643.90
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	12,213	57.40	701,026.20
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	29,537	27.27	805,473.99
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	36.50	1,215,669.00
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	26.13	994,795.23
	JD.COM INC-ADR	68,369	21.70	1,483,607.30
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	5.06	183,369.34
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	13.60	421,178.40
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	129,064	4.59	592,403.76
	CREDICORP LTD	5,824	224.23	1,305,915.52
	SBERBANK-SPONSORED ADR	239,500	12.00	2,874,000.00
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.26	259,865.99
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	43.38	87,670.98
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.27	58,015.44
	58.COM INC-ADR	7,312	60.50	442,376.00
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	101,658	144.85	14,725,161.30
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	68.66	363,760.68
	BAIDU INC - SPON ADR	24,165	183.75	4,440,318.75
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	40.19	140,986.52
	FANG HOLDINGS LTD-ADR	12,536	1.78	22,314.08
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	23.80	104,839.00
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	32.65	424,352.05
	NETEASE INC-ADR	6,861	221.91	1,522,524.51
	SINA CORP	5,725	61.82	353,919.50
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	57.16	300,032.84
	YY INC-ADR	4,344	64.73	281,187.12
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.24	328,396.96
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	0.76	83,733.63
	アメリカドル 小計	2,332,280		47,923,359.74 (5,460,387,608)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	10.71	13,184,663.31
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	46.94	14,119,176.48
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	272.28	3,948,060.00

	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	54.11	5,240,661.72	
	ALFA S.A.B.-A	242,900	22.99	5,584,271.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	60.03	2,251,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	307.16	4,756,372.60	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	154.27	4,794,711.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	191.48	3,251,330.40	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	52.47	1,799,721.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	209,790	61.10	12,818,169.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	135.53	1,477,277.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	50.05	23,452,429.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	106.07	3,571,907.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	123.66	5,354,478.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	181.63	32,537,198.20	
	GRUMA S.A.B.-B	14,210	235.33	3,344,039.30	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	40.66	5,383,384.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	30.29	5,506,722.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	26.41	4,481,777.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	219,300	105.41	23,116,413.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	26.92	6,797,300.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	14.57	44,261,328.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	75.29	2,838,433.00	
	メキシコペソ 小計	7,012,285		233,870,948.66 (1,326,048,278)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	34.31	631,304.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	28.13	7,125,329.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	346,340	25.46	8,817,816.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	40.49	1,162,063.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	52.79	781,292.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	71,700	9.58	686,886.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	22,500	69.70	1,568,250.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	16.12	1,402,440.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	34.40	1,386,320.00	
	VALE SA	278,178	54.65	15,202,427.70	
	EMBRAER SA	69,700	20.38	1,420,486.00	
	WEG SA	66,872	18.60	1,243,819.20	
	CCR SA	101,100	10.45	1,056,495.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	26.96	1,590,693.92	
	RUMO SA	97,700	16.48	1,610,096.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.35	1,430,204.40	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	17.26	1,099,738.16	
	LOJAS RENNER S.A.	60,370	36.79	2,221,012.30	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,100	146.40	1,039,440.00	

	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	27,700	22.13	613,001.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	15.63	648,645.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	80.80	1,195,840.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	66.00	1,392,600.00	
	AMBEV SA	406,600	16.08	6,538,128.00	
	BRF SA	52,500	20.57	1,079,925.00	
	JBS SA	111,900	9.96	1,114,524.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	43.33	272,979.00	
	NATURA COSMETICOS SA	20,700	35.80	741,060.00	
	ODONTOPREV S.A.	12,400	13.38	165,912.00	
	HYPERA SA	35,300	30.00	1,059,000.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	96,969	31.80	3,083,614.20	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	292,161	35.68	10,424,304.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	41.50	2,867,650.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	284,521	50.78	14,447,976.38	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	370,067	11.55	4,274,273.85	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	25.69	4,431,602.07	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	26.61	1,498,143.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,200	67.73	487,656.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	53.03	387,119.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	11.68	666,495.84	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	22.46	1,019,684.00	
	CIELO SA	99,269	10.60	1,052,251.40	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	43.50	1,383,300.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.07	879,903.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	26.10	461,970.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,000	23.64	709,200.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	11.29	745,049.68	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	27.06	706,266.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	13.88	369,208.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	40.96	548,864.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	24,000	69.25	1,662,000.00	
	ブラジルリアル 小計	4,442,107		118,404,257.98	(3,616,066,038)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	9,870.80	441,520,884.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	2,479.70	337,152,410.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	30,680.00	302,412,760.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	6,353.30	140,452,403.10	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	5,282.20	280,447,844.60	
	CENCOSUD SA	137,988	1,434.70	197,971,383.60	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,651.50	80,657,934.50	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,445.30	37,197,903.60	

	BANCO DE CHILE	2,335,280	98.84	230,819,075.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,530	43,882.00	111,021,460.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONS-RIGHTS	194	2,230.00	432,620.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	51.79	325,231,929.59	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	6.45	108,132,551.13	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,515.80	102,329,121.60	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	370.04	60,408,289.92	
	COLBUN SA	475,888	135.74	64,597,037.12	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	107.70	232,909,973.70	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	62.64	160,438,453.92	
	チリペソ 小計	31,176,803		3,214,134,036.08 (534,831,903)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,440.00	1,682,087,760.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	6,910.00	221,196,010.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	15,620.00	276,833,260.00	
	BANCOLOMBIA SA	20,302	31,320.00	635,858,640.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	32,100.00	1,228,723,800.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,175.00	356,856,900.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	31,560.00	657,079,200.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	30,000.00	376,830,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,200.00	666,745,200.00	
	コロンビアペソ 小計	984,893		6,102,210,770.00 (218,459,145)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	19.38	174,420.00	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	19.38	84,458.04	
	OPAP SA	17,668	8.40	148,411.20	
	JUMBO SA	8,599	12.82	110,239.18	
	ALPHA BANK AE	129,138	1.27	165,038.36	
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.59	88,343.95	
	NATIONAL BANK OF GREECE	40,152	1.39	55,971.88	
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	1.16	21,725.96	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.43	211,655.99	
	ユーロ 小計	396,787		1,060,264.56 (136,731,717)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	120.70	1,400,482.10	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	9.10	1,062,470.50	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	52,814	4.95	261,429.30	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	27.72	660,040.92	
	KOC HOLDING AS	62,460	15.38	960,634.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.97	214,544.96	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	22.58	222,096.88	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	15.17	943,437.47	

	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	56.65	184,565.70	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	18.54	125,145.00	
	ARCELIK AS	15,358	16.20	248,799.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,412	77.00	1,648,724.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	20.12	225,947.60	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	28.76	127,032.92	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	16.38	157,673.88	
	AKBANK T.A.S.	176,098	7.23	1,273,188.54	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.82	1,876,737.44	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	7.26	380,649.06	
	TURKIYE IS BANKASI-C	331,617	4.03	1,336,416.51	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	3.69	191,669.67	
	YAPI VE KREDI BANKASI	213,344	1.68	358,417.92	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	7.60	466,989.60	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	11.65	1,107,868.40	
	トルコリラ 小計	1,676,656		15,434,962.77 (322,590,721)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	913.00	6,813,719.00	
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	77.40	2,067,895.80	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	245.50	1,104,750.00	
	CEZ AS	13,737	556.50	7,644,640.50	
	チェココルナ 小計	52,417		17,631,005.30 (87,626,096)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,078.00	101,180,016.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,400.00	81,961,200.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	11,100.00	216,993,900.00	
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		400,135,116.00 (160,494,195)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	74.00	408,184.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	96.44	2,547,366.16	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	6.30	922,931.10	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	26.16	72,881.76	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	75.90	316,578.90	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	89.30	1,172,687.60	
	CCC SA	3,138	189.00	593,082.00	
	LPP SA	124	7,830.00	970,920.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	22.72	533,965.44	
	DINO POLSKA SA	4,430	79.50	352,185.00	
	ALIOR BANK SA	8,830	56.20	496,246.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	71.70	144,117.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	9.50	313,661.50	
	BANK PEKAO SA	15,510	111.00	1,721,610.00	

	M BANK SA	747	416.80	311,349.60
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	41.72	3,191,788.60
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,398	353.60	847,932.80
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	41.64	2,121,599.64
	CD PROJEKT SA	6,704	149.80	1,004,259.20
	ORANGE POLSKA SA	55,658	4.66	259,366.28
	PLAY COMMUNICATIONS SA	18,973	16.21	307,552.33
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.66	676,867.36
	ポーランドズロチ 小計	564,509		19,287,132.27 (579,964,067)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.50	343,000.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.55	1,449,600.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,175,400	6.71	14,596,934.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	287,000	18.60	5,338,200.00
	CNOOC LTD-R	1,538,000	13.54	20,824,520.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	9.94	2,564,520.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	5.91	11,678,160.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	7.52	1,067,840.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.99	1,016,600.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	6.79	393,820.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	41.50	4,565,000.00
	BBMG CORPORATION - H	131,000	2.25	294,750.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	3.28	1,102,080.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.13	2,022,900.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	7.20	1,512,000.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.44	273,824.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.21	764,430.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.54	1,085,640.00
	MMG LIMITED	168,000	3.43	576,240.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.49	966,210.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.55	706,450.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	6.83	618,115.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.93	2,135,970.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.43	673,320.00
	BOC AVIATION LTD	32,500	59.85	1,945,125.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	617,000	7.44	4,590,480.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	24.05	3,835,975.00
	CHINA INTL MARINE CO-H	26,500	7.19	190,535.00
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	10.32	1,976,280.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	7.39	2,217,000.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.63	957,100.00
	CITIC LTD	502,000	12.12	6,084,240.00

CRRG CORP LTD-H	511,050	7.09	3,623,344.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.98	3,450,240.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	3.07	1,711,525.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	16.14	564,900.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.93	275,990.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.68	450,240.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	16.56	629,280.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	7.39	528,385.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	11.90	505,750.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	143,800	8.25	1,186,350.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	26,400	7.01	185,064.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	39,500	42.45	1,676,775.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	6.80	2,618,503.20
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	5.44	979,200.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.14	842,520.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	8.80	950,400.00
CAR INC	42,000	6.08	255,360.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	4.77	314,820.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	13.90	1,355,903.30
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.69	825,440.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	227,000	0.85	192,950.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.24	364,640.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	146,500	2.91	426,315.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	7.66	799,275.04
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.50	714,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	52,000	14.98	778,960.00
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	3.02	332,200.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.12	538,560.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.40	514,800.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	6.78	1,695,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	53.30	2,638,350.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	3.03	757,500.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	45,500	4.91	223,405.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.67	2,040,220.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	24.55	667,760.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	421,000	14.56	6,129,760.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	4.63	943,362.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.92	1,998,564.48
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	11.56	1,063,520.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	34.45	3,823,950.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	17.16	1,990,560.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.27	455,400.00

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	92.15	6,450,500.00
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	108,000	1.87	201,960.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	2.19	258,420.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.06	1,537,000.00
CHINA LITERATURE LTD	11,800	42.80	505,040.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.77	457,347.66
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	14.92	626,640.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	9.47	1,846,650.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.67	275,010.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	24.50	6,296,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	27.30	3,876,600.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.52	665,160.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	12.50	1,850,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	31.65	886,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.30	584,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	379,000	5.53	2,095,870.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	62.85	4,179,525.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	7.23	2,067,780.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	7.44	803,520.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	18.48	2,372,832.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	39.15	3,899,340.00
3SBIO INC	119,000	12.92	1,537,480.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	10.00	1,000,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	18.30	6,954,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	11.90	1,874,250.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	5.10	846,600.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	64,000	12.84	821,760.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.09	496,335.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	26.45	1,467,975.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.67	536,070.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	7.89	4,568,310.00
SSY GROUP LTD	114,000	7.75	883,500.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	11.02	407,740.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	39,000	63.55	2,478,450.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.50	8,463,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	3.35	24,817,470.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.95	5,637,476.25
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.85	4,613,320.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,422,620	6.43	54,157,446.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.40	758,200.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	357,423	31.75	11,348,180.25

CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.70	3,142,980.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	463,000	4.37	2,023,310.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,239,515	5.34	33,319,010.10
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	202,000	4.78	965,560.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.96	1,630,720.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	14.06	871,720.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.96	1,300,860.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.44	1,334,880.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	63,600	13.80	877,680.00
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	1,148,000	0.35	407,540.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	14.26	2,837,740.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.46	1,051,860.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	10.78	1,138,368.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	15.50	917,600.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	7.99	2,211,632.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	13.00	2,064,400.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	667,000	16.28	10,858,760.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	226,400	30.50	6,905,200.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	1,140,000	1.47	1,675,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	26.55	3,765,427.20
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	36.75	2,462,250.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.40	2,352,800.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.03	4,924,702.64
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	77.15	34,447,475.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	29.00	310,300.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.11	1,293,620.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	18.68	4,445,840.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	3.40	1,965,200.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	25.20	8,241,408.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	27.15	6,600,463.65
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	25.25	3,050,200.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	3.32	916,320.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	657,285	8.69	5,711,806.65
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	182,000	11.00	2,002,000.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	4.56	583,680.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	5.75	322,000.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	11.64	800,832.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	14.72	1,030,400.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.02	315,120.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	6.08	541,120.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	7.86	738,840.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	20.35	2,513,225.00

SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.42	813,120.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	17.06	2,260,450.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.70	356,150.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	3.25	609,670.75
SOHO CHINA LTD	113,000	2.78	314,140.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	21.65	4,568,150.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	358,000	1.32	472,560.00
YUZHOU PROPERTIES CO	100,000	2.85	285,000.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	7.12	1,723,040.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	11.76	776,160.00
TENCENT HOLDINGS LTD	501,500	279.20	140,018,800.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	18.92	1,494,680.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	54.90	3,294,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	10.32	877,200.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	57,000	5.26	299,820.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	21.50	1,440,500.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.50	448,500.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	22.10	466,310.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	5.80	3,352,400.00
MEITU INC	143,000	4.19	599,170.00
SUNNY OPTICAL TECH	61,100	72.30	4,417,530.00
ZTE CORP-H	48,508	15.20	737,321.60
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	350,000	6.27	2,194,500.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	545,000	72.90	39,730,500.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.83	4,213,000.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	2,918,000	1.16	3,384,880.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	8.41	4,272,280.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	45.05	1,756,950.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.23	1,725,840.00
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.93	2,590,060.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	25.90	3,522,400.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	6.22	1,573,660.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.60	264,000.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	30.30	2,605,800.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	13.86	2,431,044.00
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	1.80	248,400.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	61,000	68.75	4,193,750.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	14.20	3,152,400.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.10	570,400.00
HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.58	1,694,600.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.35	719,100.00
TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.60	257,600.00

	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	0.56	579,600.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	16.36	736,200.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	6.35	1,682,750.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	151,725	2.90	440,002.50	
	香港ドル 小計	82,372,272		745,122,796.87 (10,841,536,694)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	3.34	744,713.12	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	27.00	677,700.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	9.59	2,014,859.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.86	701,298.00	
	GAMUDA BHD	139,200	2.40	334,080.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.85	376,270.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.71	338,751.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.45	409,752.70	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	2.68	173,664.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.03	430,359.82	
	MISC BHD	125,040	6.45	806,508.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.77	263,900.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	4.65	158,100.00	
	GENTING BHD	205,300	6.78	1,391,934.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.58	802,278.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	1.25	148,125.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	37.90	413,110.00	
	FGV HOLDINGS BHD	80,300	1.36	109,208.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	33.84	287,640.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.78	136,920.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.56	819,158.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.88	1,363,424.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	143.70	991,530.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	16.98	894,506.40	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.25	878,041.50	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	72,000	6.30	453,600.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	4.85	1,112,105.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	5.78	568,752.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.90	275,340.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.04	526,008.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.57	2,403,844.90		
HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.62	1,263,841.04		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	18.80	280,740.40		
MALAYAN BANKING BHD	352,318	9.29	3,273,034.22		
PUBLIC BANK BERHAD	256,420	24.70	6,333,574.00		

	RHB BANK BHD	53,119	5.26	279,405.94	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.49	229,199.25	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.01	168,918.46	
	SP SETIA BHD	180,947	2.10	379,988.70	
	MY EG SERVICES BHD	320,300	1.26	403,578.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	278,374	3.58	996,578.92	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.45	1,387,065.00	
	MAXIS BHD	135,500	5.45	738,475.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	2.36	166,502.72	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	18.76	1,416,380.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	15.00	4,417,125.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.08	272,554.20	
	マレーシアリングット 小計	6,626,450		43,012,441.69 (1,171,658,911)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	17.90	2,121,150.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	49.75	9,228,625.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	5.90	3,379,520.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	138.00	17,208,600.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	49.75	47,819,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	81.00	9,728,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	55.25	5,629,975.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	79.00	17,769,786.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	27,200	432.00	11,750,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	65.00	27,826,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	8.70	3,403,440.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.35	3,436,125.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	36.75	5,946,517.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	14.90	3,451,361.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	67.75	2,357,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	55.50	3,762,900.00	
	CP ALL PCL-NVDR	408,000	68.25	27,846,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	25.00	8,517,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.00	4,320,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	24.80	11,301,360.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	187.50	4,800,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	220.00	3,564,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	209.00	26,417,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	207.00	10,681,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	20.30	5,019,175.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	139.50	20,646,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.32	3,100,680.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	78.25	10,336,825.00	

	LAND & HOUSES PUB - NVDR	132,300	10.80	1,428,840.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	69.00	2,228,700.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	182.00	19,273,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	5.85	3,555,097.65	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	230.00	5,336,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	86.50	2,560,400.00	
	タイパーツ 小計	8,578,738		345,753,577.65	(1,189,392,307)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	47.00	11,183,180.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	11.12	6,567,472.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	12.50	4,318,125.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	46.45	10,700,222.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	888.00	20,250,840.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	92.15	5,827,566.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	278.00	16,960,780.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	125.00	7,922,500.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	80.00	4,787,600.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	118.00	20,499,078.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	51,502	65.05	3,350,205.10	
	SECURITY BANK CORP	30,810	145.00	4,467,450.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	902.00	20,177,740.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,350	728.00	4,622,800.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	4.75	3,494,575.00	
	AYALA LAND INC	637,000	38.00	24,206,000.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.50	2,871,000.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	20.35	1,892,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	32.70	29,022,885.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,728.00	3,093,120.00	
PLDT INC	6,225	1,220.00	7,594,500.00		
ABOITIZ POWER CORP	89,500	32.50	2,908,750.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	380.80	11,085,088.00		
	フィリピンペソ 小計	5,077,258		227,804,026.10	(489,778,656)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,580.00	2,274,094,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	34,900.00	4,498,610,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	11,275.00	2,753,355,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	17,650.00	3,353,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	9,725.00	2,281,485,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	1,575.00	618,030,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	3,990.00	492,765,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	8,175.00	14,070,810,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,730.00	922,090,000.00	

	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	5,275.00	978,512,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	979,900	5,325.00	5,217,967,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	77,500.00	2,387,000,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,400.00	3,120,860,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,575.00	1,380,575,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	5,775.00	2,478,052,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	40,325.00	4,782,545,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,420.00	1,779,828,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	24,000.00	19,948,800,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	7,450.00	1,463,925,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,225.00	13,135,743,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,000.00	6,481,600,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	2,350.00	2,102,310,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	3,340.00	16,319,574,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,200.00	820,080,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	545.00	877,668,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	3,920.00	17,808,952,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	4,190.00	558,946,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,110.00	1,670,065,000.00	
	インドネシアルピア 小計	26,281,796		134,577,743,100.00 (1,049,706,396)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	50,900.00	215,154,300.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	115,000.00	391,115,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,130	200,000.00	1,226,000,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	17,700.00	189,496,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	43,900.00	317,923,800.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	404,500.00	316,723,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	87,400.00	91,857,400.00	
	LG CHEM LTD	4,436	327,500.00	1,452,790,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	190,000.00	91,010,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	281,500.00	394,100,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	96,800.00	109,093,600.00	
	POSCO	7,270	265,500.00	1,930,185,000.00	
	CJ CORP	1,230	119,000.00	146,370,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	78,500.00	311,174,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,710.00	38,951,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,750.00	154,011,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	11,450.00	38,265,900.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	41,350.00	140,507,300.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	29,300.00	82,772,500.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	41,600.00	91,561,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	50,900.00	324,742,000.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	129,000.00	428,022,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	376,500.00	304,965,000.00
KCC CORP	870	267,000.00	232,290,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	31,800.00	164,596,800.00
LG CORP	8,323	67,900.00	565,131,700.00
LOTTE CORP	2,370	51,600.00	122,292,000.00
POSCO DAEWOO CORP	5,988	19,150.00	114,670,200.00
SAMSUNG C&T CORP	6,354	105,000.00	667,170,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	10,311	18,150.00	187,144,650.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,190.00	267,115,690.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	262,000.00	725,478,000.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	28,500.00	26,818,500.00
S-1 CORPORATION	960	93,600.00	89,856,000.00
CJ LOGISTICS	862	155,500.00	134,041,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	120,500.00	175,327,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	30,000.00	165,120,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,750.00	141,246,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	41,250.00	291,472,500.00
HANON SYSTEMS	19,000	10,800.00	205,200,000.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	193,000.00	1,076,361,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	105,000.00	1,383,480,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	70,800.00	204,753,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	65,800.00	197,597,400.00
KIA MOTORS CORPORATION	26,869	28,850.00	775,170,650.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	69,700.00	277,545,400.00
HANSSEM CO LTD	615	51,700.00	31,795,500.00
HLB INC	2,398	88,200.00	211,503,600.00
LG ELECTRONICS INC	9,197	71,400.00	656,665,800.00
KANGWON LAND INC	8,683	30,100.00	261,358,300.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	22,650.00	114,835,500.00
CJ ENM CO LTD	830	227,000.00	188,410,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	72,700.00	221,807,700.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	87,400.00	106,802,800.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	218,000.00	225,412,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	264,000.00	139,920,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	170,500.00	93,604,500.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	18,100.00	27,530,100.00
EMART	1,661	202,500.00	336,352,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,900.00	47,064,900.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	343,000.00	265,825,000.00
KT&G CORP	10,696	100,500.00	1,074,948,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	92,000.00	183,356,000.00

OTTOGI CORPORATION	68	661,000.00	44,948,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	157,000.00	451,061,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	87,800.00	62,338,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,110,000.00	1,027,860,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	675,000.00	91,125,000.00
PACIFIC CORP	2,115	60,400.00	127,746,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,499	67,000.00	167,433,000.00
CELLTRION INC	7,588	229,500.00	1,741,446,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	53,900.00	59,936,800.00
HANMI PHARM CO LTD	472	418,500.00	197,532,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	616	68,000.00	41,888,000.00
MEDY-TOX INC	317	544,000.00	172,448,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	368,000.00	575,184,000.00
SILLAJEN INC	5,667	72,200.00	409,157,400.00
VIROMED CO LTD	1,015	193,600.00	196,504,000.00
YUHAN CORPORATION	600	235,000.00	141,000,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	7,740.00	179,691,840.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,010.00	110,606,760.00
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	38,300.00	1,012,690,300.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	15,100.00	272,494,600.00
KB FINANCIAL GROUP INC	34,088	47,800.00	1,629,406,400.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37,696	43,350.00	1,634,121,600.00
WOORI BANK	45,214	15,800.00	714,381,200.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	64,700.00	297,749,400.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,160.00	222,618,720.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	13,250.00	149,698,500.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	33,550.00	63,711,450.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	29,450.00	170,103,200.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	70,200.00	295,471,800.00
HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	4,580.00	136,928,260.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	42,850.00	185,026,300.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	32,200.00	127,995,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	280,000.00	707,280,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	92,300.00	684,589,100.00
KAKAO CORP	4,122	100,500.00	414,261,000.00
NAVER CORP	11,955	115,000.00	1,374,825,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	440,500.00	726,825,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	118,500.00	292,102,500.00
PEARL ABYSS CORP	338	207,500.00	70,135,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	191,000.00	596,111,000.00
LG DISPLAY CO LTD	18,774	17,950.00	336,993,300.00
LG INNOTEK CO LTD	1,415	110,500.00	156,357,500.00

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	120,000.00	547,920,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	421,533	44,300.00	18,673,911,900.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	76,736	37,150.00	2,850,742,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	216,500.00	1,022,746,000.00	
	KT CORP	3,800	29,600.00	112,480,000.00	
	LG UPLUS CORP	27,906	15,550.00	433,938,300.00	
	SK TELECOM	1,647	266,000.00	438,102,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	28,150.00	688,746,050.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	53,600.00	76,755,200.00	
	SK HYNIX INC	51,320	72,900.00	3,741,228,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,334,002		67,820,214,370.00 (6,843,059,629)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	117.00	12,781,080.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	33.05	9,821,666.80	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.25	27,166,329.25	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	107.50	33,761,557.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	101.00	39,271,224.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,752	76.60	30,621,003.20	
	TAIWAN CEMENT	465,721	34.90	16,253,662.90	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	261.00	3,132,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	432,028	30.95	13,371,266.60	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,619	215.50	4,443,394.50	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	17.95	1,992,450.00	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.65	1,256,458.95	
	EVA AIRWAYS CORP	151,127	14.40	2,176,228.80	
	EVERGREEN MARINE	125,802	11.25	1,415,272.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	31.10	5,504,700.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	41.50	7,348,031.50	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	383.50	4,577,839.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	191.00	6,286,956.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.25	1,370,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	122.50	3,119,340.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	214.50	3,432,000.00	
	POU CHEN	153,780	31.50	4,844,070.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	78.20	1,728,845.60	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	217.50	5,655,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	317.50	14,460,220.00	
	STANDARD FOODS CORP	35,756	47.00	1,680,532.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	72.10	32,185,079.50	
	TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	158.00	2,054,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	412,224	17.85	7,358,198.40	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	10.10	12,693,478.00	

CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	21.15	29,128,562.55
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	714,614	21.20	15,149,816.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	724,153	20.25	14,664,098.25
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	852,972	17.70	15,097,604.40
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	26.45	23,866,866.55
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	10.70	12,378,712.30
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	945,114	13.95	13,184,340.30
TAIWAN BUSINESS BANK	199,639	10.55	2,106,191.45
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	747,205	17.90	13,374,969.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	140,177	92.10	12,910,301.70
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	51.10	28,160,290.20
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	15.55	12,006,979.15
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	51.00	37,329,501.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163,157	29.85	4,870,236.45
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	624,638	10.30	6,433,771.40
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	46.20	1,945,944.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	43.85	1,466,344.00
ACER INC	255,803	21.30	5,448,603.90
ADVANTECH CO LTD	56,402	231.00	13,028,862.00
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	229.50	14,479,614.00
AU OPTRONICS CORP	1,040,090	12.20	12,689,098.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	268.50	15,492,450.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	60.70	1,747,674.40
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	10.10	7,827,500.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	17.45	7,534,212.00
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	128.00	23,923,584.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	67.20	6,239,520.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	98.80	1,383,200.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,116,248	76.10	84,946,472.80
HTC CORPORATION	37,430	38.50	1,441,055.00
INVENTEC CO LTD	349,511	26.30	9,192,139.30
LARGAN PRECISION CO LTD	10,040	3,080.00	30,923,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	38.00	5,717,176.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	75,000	73.50	5,512,500.00
PEGATRON CORP	159,474	52.20	8,324,542.80
QUANTA COMPUTER INC	242,270	49.40	11,968,138.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	34.00	4,355,400.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	162.00	4,374,000.00
WISTRON CORP	242,695	18.65	4,526,261.75
WPG HOLDINGS LTD	143,692	35.80	5,144,173.60
YAGEO CORPORATION	22,764	329.00	7,489,356.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	69.20	1,517,002.40

	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	107.00	38,232,705.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	73.20	11,492,400.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	109.00	16,589,800.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	60.60	17,774,889.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	294.00	5,292,000.00
	MACRONIX INTERNATIONAL	129,540	18.65	2,415,921.00
	MEDIATEK INC	129,804	228.50	29,660,214.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	54.20	5,582,600.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	133.50	7,081,507.50
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	210.00	2,435,790.00
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	69.10	3,300,907.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	62,944	124.00	7,805,056.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,168,389	231.00	500,897,859.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	10.60	10,356,200.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	59.90	5,331,100.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	113.50	3,632,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	13.65	2,784,600.00
	新台湾ドル 小計	28,363,570		1,521,727,699.95 (5,630,392,489)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	296.85	19,627,722.00
	COAL INDIA LTD	41,924	268.45	11,254,497.80
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	241.30	14,339,252.50
	INDIAN OIL CORP LTD	117,608	141.65	16,659,173.20
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	156.40	16,080,109.60
	PETRONET LNG LTD	49,423	225.40	11,139,944.20
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	250,229	1,093.45	273,612,900.05
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	205.30	7,634,080.50
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,295.60	32,338,176.00
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	868.00	23,732,856.00
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	134,281	238.80	32,066,302.80
	JSW STEEL LTD	80,284	347.50	27,898,690.00
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,042.00	8,448,536.00
	SHREE CEMENT LTD	901	15,389.35	13,865,804.35
	TATA STEEL LTD	25,839	572.20	14,785,075.80
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	3,817.85	28,076,468.90
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	740.00	19,401,320.00
	VEDANTA LTD	110,508	209.05	23,101,697.40
	ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	118.25	16,981,054.75
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	70.00	3,569,650.00
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	646.55	15,178,407.80
	LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,368.60	48,522,344.40
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	949.95	5,089,832.10

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	337.60	21,108,777.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,674	669.95	4,471,246.30
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	991.95	8,292,702.00
BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,693.05	25,489,718.25
BHARAT FORGE LTD	13,392	583.50	7,814,232.00
BOSCH LTD	431	19,846.20	8,553,712.20
EICHER MOTORS LTD	1,381	22,495.25	31,065,940.25
HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,956.70	9,606,318.30
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	795.25	50,059,397.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	7,283.50	69,185,966.50
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	170.65	13,112,234.05
TATA MOTORS LTD	147,050	195.25	28,711,512.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	30,197.25	18,148,547.25
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	847.65	23,580,775.35
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	450.15	22,195,546.05
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,396.75	15,400,565.50
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,739	5,746.45	15,739,526.55
ITC LTD	316,525	277.25	87,756,556.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	10,226.00	24,491,270.00
UNITED SPIRITS LTD	17,805	625.45	11,136,137.25
DABUR INDIA LTD	58,111	377.20	21,919,469.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	694.85	19,411,329.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,672.60	99,837,494.00
MARICO LTD	42,465	340.45	14,457,209.25
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	815.30	16,579,940.80
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	360.25	3,784,786.50
CIPLA LTD	31,308	526.95	16,497,750.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,400.00	25,017,600.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	676.15	10,842,741.40
LUPIN LTD	16,340	854.90	13,969,066.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,290.80	15,350,650.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	597.45	49,558,477.50
AXIS BANK LTD	152,061	613.20	93,243,805.20
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	140,211	1,816.10	254,637,197.10
ICICI BANK LTD	230,892	356.85	82,393,810.20
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	862.15	23,207,353.70
LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	436.25	12,202,348.75
STATE BANK OF INDIA	167,428	283.25	47,423,981.00
YES BANK LTD	152,956	227.90	34,858,672.40
BAJAJ FINANCE LTD	17,670	2,375.35	41,972,434.50
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	429.35	11,991,316.15
REC LTD	48,168	123.80	5,963,198.40

	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,229.85	14,926,689.45	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	5,701.40	18,056,333.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,027.90	47,117,908.10	
	INFOSYS LTD	314,410	659.50	207,353,395.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	81,948	1,909.20	156,455,121.60	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	707.20	33,984,496.00	
	WIPRO LTD	89,034	324.85	28,922,694.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	124,727	299.75	37,386,918.25	
	BHARTI INFRATEL LTD	45,240	265.85	12,027,054.00	
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	42.25	6,010,273.75	
	GAIL INDIA LTD	53,170	367.35	19,531,999.50	
	NTPC LTD	145,475	154.45	22,468,613.75	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	113,285	191.70	21,716,734.50	
	TATA POWER CO LTD	93,250	75.90	7,077,675.00	
	インドルピー 小計	4,946,437		2,727,481,117.95	(4,309,420,166)
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	110,000	152.52	16,777,200.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	139.10	9,250,150.00	
	MCB BANK LTD	53,300	198.51	10,580,583.00	
	パキスタンルピー 小計	229,800		36,607,933.00	(31,482,822)
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	15,948	140.30	2,237,504.40	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	41.70	850,638.30	
	DOHA BANK QSC	12,309	21.81	268,459.29	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	39.15	1,055,014.20	
	QATAR ISLAMIC BANK	8,258	152.11	1,256,124.38	
	QATAR NATIONAL BANK	41,282	191.98	7,925,318.36	
	QATAR INSURANCE CO	18,964	35.95	681,755.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,751	39.20	343,039.20	
	EZDAN HOLDING GROUP	67,796	11.27	764,060.92	
	OOREDOO QSC	7,280	72.89	530,639.20	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	184.97	699,556.54	
	カタールリアル 小計	231,717		16,612,110.59	(520,789,666)
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	148.52	2,916,635.76	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	515.94	1,646,880.48	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	137.82	6,670,763.64	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	38.86	2,509,617.66	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	285.89	1,535,801.08	
	MONDI LTD	9,893	329.91	3,263,799.63	
	SAPPI LIMITED	49,985	83.48	4,172,747.80	
	SASOL LTD	48,270	472.96	22,829,779.20	

	BIDVEST GROUP LTD	27,702	195.59	5,418,234.18	
	NASPERS LTD-N SHS	38,108	2,744.92	104,603,411.36	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	163.57	2,034,810.80	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	247.47	5,270,863.53	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	171.52	4,121,968.64	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	83.99	3,978,354.33	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	55.63	4,655,340.92	
	BID CORP LTD	26,440	290.81	7,689,016.40	
	CLICKS GROUP LTD	20,499	194.50	3,987,055.50	
	PICK N PAY STORES LTD	52,108	73.00	3,803,884.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	194.26	6,694,782.38	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	183.89	2,687,184.57	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	86.76	763,921.80	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	280.86	3,657,639.78	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	79,877	25.84	2,064,021.68	
	NETCARE LTD	99,170	25.50	2,528,835.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	162.20	4,886,275.00	
	ABSA GROUP LTD	61,049	158.19	9,657,341.31	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,094.05	3,525,029.10	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	262.30	9,977,105.10	
	STANDARD BANK GROUP LTD	112,744	174.71	19,697,504.24	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	48.98	494,893.92	
	FIRSTRAND LTD	284,395	69.35	19,722,793.25	
	INVESTEC LTD	28,883	93.00	2,686,119.00	
	PSG GROUP LTD	18,494	230.87	4,269,709.78	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	248.03	2,888,805.41	
	REMGRO LTD	46,153	203.94	9,412,442.82	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	80.93	6,021,030.14	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	163.95	5,737,594.20	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	112.75	701,981.50	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	18.70	1,273,058.60	
	OLD MUTUAL LTD	407,000	23.65	9,625,550.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	37.17	1,501,965.36	
	SANLAM LTD	172,493	77.02	13,285,410.86	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	124.99	3,863,940.86	
	MTN GROUP LTD	142,669	85.00	12,126,865.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	56.94	646,439.82	
	VODACOM GROUP	71,266	130.32	9,287,385.12	
	南アフリカランド 小計	2,557,617		360,794,590.51 (2,864,709,048)	
アラブ首長国連 邦ディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	296,657	1.61	477,617.77	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	8.23	1,518,764.20	

	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.32	684,088.16	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	14.34	1,542,023.22	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	1.75	475,093.50	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	2.10	380,538.90	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	4.92	150,281.40	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.92	344,914.56	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	5.16	1,551,209.52	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	17.22	2,371,624.50	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,818,544		9,496,155.73 (294,095,942)	
香港・オフショア 人民元	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.57	228,906.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.19	253,171.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	25.35	271,245.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	9.00	212,400.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	7.47	253,980.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	23.87	272,118.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	14.83	252,110.00	
	CHINA NUCLEAR ENGINEERING -A	31,800	7.12	226,416.00	
	LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	16,640	15.15	252,096.00	
	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.49	191,874.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	16,900	9.89	167,141.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	23.20	241,280.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	7.82	202,538.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.24	209,600.00	
	COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	98,400	2.31	227,304.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	8.06	494,078.00	
	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.05	193,065.00	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	49.64	264,035.16	
	SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	34.40	285,520.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.27	830,671.00	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	27.22	1,159,572.00	
	HEILAN HOME CO LTD -A	21,400	8.08	172,912.00	
	MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	39.77	819,262.00	
	CHINA FILM CO LTD-A	17,000	13.85	235,450.00	
	SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	21,060	9.39	197,753.40	
	LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	11.26	191,420.00	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,300	65.67	282,381.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	562.00	1,348,800.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	38.97	171,468.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,800	50.01	190,038.00	
	CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	23.95	244,290.00	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,800	64.47	760,746.00	

	SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	25.28	176,960.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.65	1,290,640.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.72	839,328.00	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	6.18	1,187,796.00	
	ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.82	153,758.00	
	CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	232,100	5.16	1,197,636.00	
	EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	9.79	996,622.00	
	HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	5.04	218,736.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	23,800	64.62	1,537,956.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	21,100	12.18	256,998.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	14.65	1,007,920.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.64	1,085,812.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.00	750,000.00	
	ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	113,300	4.63	524,579.00	
	香港・オフショア人民元 小計	2,660,319		22,528,381.56 (369,465,457)	
	合 計	219,784,856		48,048,687,951 (48,048,687,951)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	1,166,200.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	997,310.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	428,127.70	
		ブラジルリアル 小計	99,662	2,591,637.70 (79,148,615)	
投資信託受益証券合計			99,662	79,148,615 (79,148,615)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,824,892.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	6,824,892.00 (38,697,137)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	226,502.10	
		トルコリラ 小計	135,630	226,502.10 (4,733,893)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	855,220.50	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	1,356,513.81	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,287,660.90	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		22,923	2,175,392.70		
	REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,671,644.75		
	RESILIENT REIT LTD	23,098	1,524,468.00		

	南アフリカランド 小計	1,024,432	18,870,900.66 (149,834,951)	
	投資証券合計	1,468,462	193,265,981 (193,265,981)	
	合計		272,414,596 (272,414,596)	

(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 44銘柄	100.0%			11.3%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.2%			2.7%
	投資証券 1銘柄			2.8%	0.1%
ブラジルリアル	株式 51銘柄	97.9%			7.5%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.1%		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%			0.5%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 23銘柄	98.6%			0.7%
	投資証券 1銘柄			1.4%	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 205銘柄	100.0%			22.4%
マレーシアリングギット	株式 47銘柄	100.0%			2.4%
タイバーツ	株式 34銘柄	100.0%			2.5%
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 28銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式 115銘柄	100.0%			14.2%
新台湾ドル	株式 89銘柄	100.0%			11.7%
インドルピー	株式 79銘柄	100.0%			8.9%
パキスタンルピー	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%			1.1%
南アフリカランド	株式 46銘柄	95.0%			5.9%

	投資証券 6銘柄			5.0%	0.3%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 10銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人 民元	株式 46銘柄	100.0%			0.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(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11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	203,859,178
コール・ローン	1,393,388,979
国債証券	349,622,338,850
地方債証券	23,370,180,714
特殊債証券	29,632,544,738
社債証券	17,343,048,440
未収入金	37,408
未収利息	859,633,742
前払費用	28,238,774
流動資産合計	422,453,270,823
資産合計	422,453,270,823
負債の部	
流動負債	
未払金	1,003,897,200
未払解約金	234,935,791
未払利息	3,946
その他未払費用	12,267
流動負債合計	1,238,849,204
負債合計	1,238,849,204
純資産の部	
元本等	
元本	304,499,496,806
剰余金	
剰余金又は欠損金()	116,714,924,813
元本等合計	421,214,421,619
純資産合計	421,214,421,619
負債純資産合計	422,453,270,823

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年11月12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11月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	304,499,496,806口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 100,139,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3833円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,833円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年11月12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11月12日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	268,346,768,030円
期中追加設定元本額	45,951,486,047円
期中一部解約元本額	9,798,757,271円
期末元本額	304,499,496,806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）	3,996,220,158円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,041,468円
S M T 国内債券インデックス・オープン	14,249,816,900円
世界経済インデックスファンド	1,782,235,165円
D C マイセレクション 2 5	19,791,333,288円
D C マイセレクション 5 0	21,637,853,975円
D C マイセレクション 7 5	6,492,421,638円
D C 日本債券インデックス・オープン	451,360,136円
D C 日本債券インデックス・オープン S	78,158,663,233円
D C 日本債券インデックス・オープン P	36,081,305,485円
D C マイセレクション S 2 5	7,874,785,564円
D C マイセレクション S 5 0	8,620,763,059円
D C マイセレクション S 7 5	1,857,233,006円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,222,175,907円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,201,195,653円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	400,949,566円
D C 世界経済インデックスファンド	1,468,963,221円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	89,660,533円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,748,184円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	57,470,985円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	16,311,643円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	987,888円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	294,649,159円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	415,627,224円

区分	2018年11月12日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	73,113,240円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	194,577,387円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,097,874,345円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,097,983,577円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,183,951,911円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	846,718,666円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	119,197,912円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,456,530,362円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	201,940,307円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,631,862,352円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,076,131,334円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	180,040,805円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,730,424,771円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,207,173,293円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,755,088円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	676,055,610円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	57,175,901円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,464,975円
SMT インデックスバランス・オープン	65,673,943円
SMT 世界経済インデックス・オープン	5,196,897円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	7,791,403円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,450,170円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,143,155円
グローバル経済コア	284,471,396円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,558,853円
DCターゲット・イヤーフンド2055	250,056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）	63,008,988,819円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,988,018,100
地方債証券	139,176,005
特殊債証券	149,859,720
社債証券	69,231,170
合計	4,346,284,995

(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383回利付国債(2年)	780,000,000	782,160,600	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,725,039,600	
	第385回利付国債(2年)	700,000,000	702,198,000	
	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	3,000,166,000	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,716,070,500	
	第388回利付国債(2年)	2,130,000,000	2,138,157,900	
	第389回利付国債(2年)	2,780,000,000	2,790,758,600	
	第390回利付国債(2年)	5,090,000,000	5,110,360,000	
	第391回利付国債(2年)	2,850,000,000	2,861,998,500	
	第392回利付国債(2年)	560,000,000	562,475,200	
	第393回利付国債(2年)	740,000,000	743,418,800	
	第394回利付国債(2年)	620,000,000	622,932,600	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,529,891,200	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,150,581,800	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,957,644,000	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,626,064,500	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,975,273,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,805,859,800	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,619,434,600	
	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,220,128,000	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,369,098,400	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,579,998,800	
	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,030,360,000	
	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,778,488,800	
	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,196,754,800	
	第135回利付国債(5年)	7,650,000,000	7,716,784,500	
	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	5,953,100,000	
	第137回利付国債(5年)	880,000,000	887,928,800	

第1回利付国債（40年）	400,000,000	558,080,000	
第2回利付国債（40年）	420,000,000	566,349,000	
第3回利付国債（40年）	520,000,000	704,220,400	
第4回利付国債（40年）	730,000,000	992,624,800	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,163,488,100	
第6回利付国債（40年）	560,000,000	717,276,000	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	880,365,600	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	905,832,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	891,554,600	
第10回利付国債（40年）	1,960,000,000	1,900,396,400	
第11回利付国債（40年）	730,000,000	681,075,400	
第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,940,445,400	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,194,406,200	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	713,657,000	
第308回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,524,523,300	
第309回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,498,902,000	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,439,835,600	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,098,846,000	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,917,175,300	
第313回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,292,087,500	
第314回利付国債（10年）	310,000,000	318,977,600	
第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	3,248,518,400	
第316回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,124,825,500	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	921,069,900	
第318回利付国債（10年）	1,270,000,000	1,310,703,500	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,774,655,100	
第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,021,324,000	
第321回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,582,852,100	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	775,447,500	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,005,220,700	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,321,856,000	
第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,370,150,000	
第326回利付国債（10年）	860,000,000	888,328,400	
第327回利付国債（10年）	740,000,000	767,424,400	
第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	2,390,388,800	
第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,342,497,500	
第330回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,501,718,400	
第331回利付国債（10年）	1,380,000,000	1,425,705,600	
第332回利付国債（10年）	3,430,000,000	3,548,540,800	
第333回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,413,786,800	
第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	2,894,262,300	
第335回利付国債（10年）	4,220,000,000	4,358,753,600	

第336回利付国債(10年)	510,000,000	527,324,700	
第337回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,964,312,400	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,520,192,500	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,003,237,900	
第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,161,700,900	
第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,202,365,600	
第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,934,589,500	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,175,137,000	
第344回利付国債(10年)	3,050,000,000	3,071,533,000	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,991,998,800	
第346回利付国債(10年)	3,020,000,000	3,036,338,200	
第347回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,441,445,300	
第348回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,234,329,600	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,218,699,100	
第350回利付国債(10年)	4,620,000,000	4,626,421,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,510,000,000	2,510,000,000	
第352回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,597,648,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	140,750,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	199,459,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	148,615,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	144,773,200	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,944,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	241,353,200	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	227,347,200	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	59,972,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	274,785,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	176,513,600	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	106,950,600	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,941,400	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	357,860,000	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	388,446,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	446,151,400	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	486,550,000	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	741,883,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	444,218,550	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	360,847,200	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	555,735,600	
第21回利付国債(30年)	320,000,000	413,676,800	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	530,668,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	570,962,600	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	505,384,800	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	376,333,000	

第26回利付国債(30年)	410,000,000	539,555,900
第27回利付国債(30年)	600,000,000	801,900,000
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,513,996,600
第29回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,628,520,000
第30回利付国債(30年)	960,000,000	1,255,939,200
第31回利付国債(30年)	1,020,000,000	1,317,574,800
第32回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,631,195,200
第33回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,698,718,500
第34回利付国債(30年)	1,185,000,000	1,543,403,250
第35回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,097,526,200
第36回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,974,897,600
第37回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,882,275,400
第38回利付国債(30年)	870,000,000	1,066,854,900
第39回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,261,702,100
第40回利付国債(30年)	820,000,000	1,006,681,200
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,073,135,300
第42回利付国債(30年)	830,000,000	1,001,137,700
第43回利付国債(30年)	900,000,000	1,085,949,000
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,339,781,100
第45回利付国債(30年)	800,000,000	928,936,000
第46回利付国債(30年)	970,000,000	1,126,334,900
第47回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,587,297,000
第48回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,727,312,800
第49回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,238,414,400
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,059,300,000
第51回利付国債(30年)	1,000,000,000	866,390,000
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,407,513,800
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,002,493,700
第54回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,469,616,800
第55回利付国債(30年)	1,000,000,000	985,090,000
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,239,651,000
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,139,816,000
第58回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,265,928,600
第59回利付国債(30年)	170,000,000	162,241,200
第60回利付国債(30年)	350,000,000	351,652,000
第44回利付国債(20年)	170,000,000	176,072,400
第45回利付国債(20年)	290,000,000	299,967,300
第46回利付国債(20年)	170,000,000	176,414,100
第47回利付国債(20年)	90,000,000	93,915,900
第48回利付国債(20年)	130,000,000	137,242,300
第49回利付国債(20年)	140,000,000	147,351,400
第50回利付国債(20年)	220,000,000	230,513,800
第51回利付国債(20年)	100,000,000	105,535,000

第52回利付国債(20年)	110,000,000	116,978,400	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	85,501,600	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	214,376,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	149,934,400	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	161,409,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	257,388,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	323,262,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	214,824,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	371,619,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,472,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	333,155,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	217,460,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	350,860,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	242,248,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	361,683,300	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,747,500	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	213,151,500	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	435,427,200	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	455,416,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	225,460,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	709,701,300	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,165,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,316,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	147,751,500	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	303,431,400	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	327,752,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	191,760,000	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	306,347,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,070,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	444,358,200	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	687,744,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	333,720,400	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	537,515,500	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	334,993,500	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	245,670,600	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	639,375,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	493,416,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	408,520,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	738,246,600	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	530,851,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,027,628,800	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	477,055,500	

第94回利付国債(20年)	610,000,000	714,846,800
第95回利付国債(20年)	610,000,000	727,839,800
第96回利付国債(20年)	320,000,000	376,332,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	475,580,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	519,261,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,361,738,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	574,416,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	868,910,900
第102回利付国債(20年)	410,000,000	499,904,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	483,904,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	428,666,400
第105回利付国債(20年)	680,000,000	812,280,400
第106回利付国債(20年)	380,000,000	457,626,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	311,378,600
第108回利付国債(20年)	660,000,000	777,249,000
第109回利付国債(20年)	230,000,000	271,565,600
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,141,083,000
第111回利付国債(20年)	490,000,000	595,428,400
第112回利付国債(20年)	790,000,000	951,728,800
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,630,233,000
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,138,283,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	855,288,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,298,839,200
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,032,061,500
第118回利付国債(20年)	690,000,000	831,746,700
第119回利付国債(20年)	530,000,000	626,846,900
第120回利付国債(20年)	790,000,000	915,902,300
第121回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,985,559,200
第122回利付国債(20年)	200,000,000	236,910,000
第123回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,503,453,600
第124回利付国債(20年)	500,000,000	605,265,000
第125回利付国債(20年)	450,000,000	556,771,500
第126回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,248,895,600
第127回利付国債(20年)	670,000,000	804,341,700
第128回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,371,442,800
第129回利付国債(20年)	250,000,000	297,697,500
第130回利付国債(20年)	935,000,000	1,114,763,100
第131回利付国債(20年)	470,000,000	554,510,700
第132回利付国債(20年)	840,000,000	992,619,600
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,289,898,000
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,195,570,000
第135回利付国債(20年)	590,000,000	697,798,900
第136回利付国債(20年)	570,000,000	666,808,800

第137回利付国債（20年）	710,000,000	840,980,800	
第138回利付国債（20年）	340,000,000	393,567,000	
第139回利付国債（20年）	510,000,000	597,021,300	
第140回利付国債（20年）	1,680,000,000	1,991,472,000	
第141回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,304,809,000	
第142回利付国債（20年）	520,000,000	623,833,600	
第143回利付国債（20年）	1,010,000,000	1,184,901,700	
第144回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,727,625,200	
第145回利付国債（20年）	1,995,000,000	2,370,738,300	
第146回利付国債（20年）	1,720,000,000	2,044,925,200	
第147回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,338,389,300	
第148回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,508,962,000	
第149回利付国債（20年）	2,030,000,000	2,357,885,600	
第150回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,281,535,000	
第151回利付国債（20年）	1,765,000,000	1,968,169,150	
第152回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,128,122,000	
第153回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,247,784,600	
第154回利付国債（20年）	1,680,000,000	1,870,041,600	
第155回利付国債（20年）	2,060,000,000	2,224,017,200	
第156回利付国債（20年）	1,730,000,000	1,692,908,800	
第157回利付国債（20年）	2,010,000,000	1,894,063,200	
第158回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,762,662,800	
第159回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,749,987,600	
第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	1,990,443,000	
第161回利付国債（20年）	1,710,000,000	1,711,419,300	
第162回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,046,515,000	
第163回利付国債（20年）	1,680,000,000	1,674,254,400	
第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,737,084,200	
第165回利付国債（20年）	910,000,000	885,493,700	
第166回利付国債（20年）	670,000,000	675,293,000	
国債証券合計	326,230,000,000	349,622,338,850	
地方債証券			
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,847,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,231,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	128,385,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	125,736,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,013,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,990,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	233,500,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	232,172,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	102,769,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	103,037,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	102,844,000	

第702回東京都公募公債	200,000,000	206,328,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	103,075,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,651,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	103,885,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	103,133,000	
第764回東京都公募公債	150,000,000	150,900,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,494,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,169,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	102,849,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	206,042,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,192,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,608,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,586,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,448,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	132,483,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,090,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,120,000	
第172回神奈川県公募公債	100,000,000	101,782,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,630,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,669,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	200,576,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	234,244,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,627,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,337,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,203,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,331,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,705,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,623,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	154,244,990	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,824,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,604,000	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,720,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,126,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	116,940,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,680,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,071,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	105,700,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,936,000	
第4回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	208,936,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,945,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,610,000	

平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,282,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,632,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,843,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,355,647	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,963,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,819,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,169,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,339,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,261,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	120,409,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,340,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,022,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,004,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,659,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,320,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,964,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,154,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,682,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	94,898,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,207,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,074,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,171,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,518,539	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	200,084,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	119,061,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,742,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	198,560,330	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,553,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,430,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,238,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,607,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,571,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,727,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,127,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,041,000	

平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,504,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,988,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,326,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	206,086,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,696,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	125,207,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,571,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,898,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	116,086,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,394,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,819,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,215,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,010,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,572,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	220,444,400	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,606,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,687,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,881,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	367,826,320	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,935,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,339,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,328,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,550,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,070,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,030,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,853,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,590,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,724,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,136,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,088,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,368,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,789,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,125,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,882,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,605,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,182,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,074,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,307,464	

第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,766,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,734,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,770,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,260,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,206,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,202,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,695,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,170,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,538,344	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,220,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	206,120,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,012,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,133,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	238,800,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,178,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	130,499,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	117,874,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,227,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,947,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	103,987,980	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,253,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,054,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,472,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,404,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	141,910,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	240,446,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,725,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,938,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,180,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,162,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,110,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,815,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	200,840,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,945,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,177,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,187,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,928,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,080,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,319,000	

	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,470,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,174,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	119,278,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,590,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,030,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,899,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,351,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,084,000	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,309,400	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	206,310,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	203,154,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	118,224,000	
	地方債証券合計	22,280,220,000	23,370,180,714	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,059,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,986,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,195,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,839,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,161,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,633,000	
	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	104,435,000	
	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	209,166,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,842,000	
	第14回道路債券	100,000,000	107,618,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,102,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	467,892,000	
	第21回道路債券	100,000,000	131,058,000	
	第28回道路債券	200,000,000	265,274,000	
	第33回道路債券	200,000,000	268,772,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,751,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,665,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,458,000	
	第42回道路債券	100,000,000	113,346,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,348,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,069,000	

第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,323,000	
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	136,011,000	
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	238,940,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,012,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,886,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,289,000	
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	126,893,000	
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	101,863,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,331,000	
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	101,949,000	
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	203,836,000	
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	205,258,000	
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	120,628,000	
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	102,737,000	
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	103,290,000	
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	103,081,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,311,000	
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	309,204,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,359,000	
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	310,069,130	
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	206,648,000	
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	103,380,000	
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	103,161,000	
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	309,339,000	
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	116,228,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,605,000	
	300,000,000	310,767,000	

第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	205,978,000	
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	204,958,000	
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	308,463,000	
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	208,310,000	
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	153,857,840	
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	103,439,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,522,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,667,920	
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	103,529,000	
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	103,313,000	
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	103,076,000	
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	102,695,000	
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	305,397,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,728,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,575,000	
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	106,146,140	
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	315,361,680	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,082,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,207,000	
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	300,501,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,130,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	521,424,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,342,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,733,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	316,914,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,684,900	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,512,000	

第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,395,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	131,843,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,664,800	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	237,828,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,120,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,880,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,903,850	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,581,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,618,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,142,110	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,271,390	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,459,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,122,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,997,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,710,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,030,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,564,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,469,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,796,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,018,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,894,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,608,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,040,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,298,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,285,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,664,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,300,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,839,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,040,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,416,660	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,257,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,173,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,350,900	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,773,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,528,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,202,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,286,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	112,951,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,030,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,900,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,257,000	

第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,987,800	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,367,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,921,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	106,578,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,919,800	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,759,000	16,504,558	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,985,000	16,830,766	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,395,000	17,423,950	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	290,805,000	291,249,931	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,761,000	17,716,041	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,538,000	18,558,010	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,149,000	14,625,962	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,348,000	30,867,639	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,003,000	17,894,637	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,198,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,491,000	16,326,894	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,932,000	18,941,930	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,439,000	16,282,432	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,656,000	18,579,938	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,524,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,951,000	18,393,671	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,350,000	18,788,932	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,281,000	26,142,624	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,598,000	26,556,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,880,000	29,116,953	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,356,000	32,497,008	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,408,000	34,697,949	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,407,000	35,677,005	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,328,000	75,143,358	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,846,000	16,487,604	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,725,000	37,924,231	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,895,000	16,526,190	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,647,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,714,000	16,558,941	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,609,000	41,132,098	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,535,000	15,261,023	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,549,000	41,158,381	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,290,000	38,755,542
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,510,000	17,505,387
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,218,000	76,474,528
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,055,000	41,402,596
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,505,000	17,380,755
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,607,000	53,369,636
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,320,000	50,958,755
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,469,000	51,157,090
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,904,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,056,000	108,390,178
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,771,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,830,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,016,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,244,000	114,816,921
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,737,000	57,979,856
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,468,000	58,192,033
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,907,000	59,773,974
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,723,000	53,120,168
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,792,000	52,779,998
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,395,000	59,287,499
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,835,000
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,977,000	54,007,221
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,886,000	61,062,426
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,011,000	62,284,816
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,112,000	62,220,127
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,575,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,660,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,998,000	132,430,570
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,753,000	66,714,368
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,936,000	136,964,292
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,989,000
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,001,000	76,942,025
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,971,000	80,737,581
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,026,000	80,195,903
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,466,000	165,442,050
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,617,000	80,885,886
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,376,000	85,820,584
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,174,000
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,442,000	91,345,071
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,740,000	91,382,214

第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,967,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,860,000	91,908,685	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,360,000	92,838,424	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,839,000	93,154,652	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,615,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,739,000	94,939,846	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,192,000	95,502,325	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,311,000	95,354,843	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,708,000	95,743,411	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,019,000	96,096,775	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,912,000	192,663,143	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,393,000	96,420,953	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,080,000	194,640,891	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,292,000	97,312,431	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,492,000	195,134,249	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,282,000	98,273,154	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,630,000	197,054,896	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,260,000	197,564,107	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	124,314,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,779,000	99,992,527	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,442,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,513,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,888,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,178,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,987,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,686,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,232,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,981,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,554,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,384,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,944,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,884,000	

	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,284,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,393,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,000,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,041,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,084,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,045,000	
	第218号商工債（3年）	300,000,000	300,069,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,000,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,994,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,771,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,861,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,961,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,142,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,075,000	
	特殊債券合計	28,133,449,000	29,632,544,738	
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	99,834,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,992,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,724,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,530,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,528,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,890,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,441,000	
	第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,422,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,821,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,549,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA円貨社債	100,000,000	100,208,000	
	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	100,469,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	106,800,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,162,000	
	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	200,000,000	200,686,000	

第12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	200,000,000	200,168,000	
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	100,317,000	
第27回ラボバンク・ネーデルラント円貨社債	200,000,000	200,756,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,634,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,755,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,695,000	
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	99,909,000	
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	100,106,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,437,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,095,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,943,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,418,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,805,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,116,000	
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	99,907,000	
第18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	99,853,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,033,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,934,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
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	101,368,000	
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	99,777,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,460,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,858,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,149,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,711,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,578,000	
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	101,004,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,634,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,012,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,420,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,940,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,573,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,212,000	

第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,504,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,500,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,240,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,406,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,947,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,091,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,207,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,272,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,070,000	
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	100,511,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,092,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,091,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,781,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,748,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,362,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,330,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,909,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,014,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,847,000	
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	124,075,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,416,000	
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	103,820,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	117,166,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,923,000	
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	102,555,000	
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	102,616,000	
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	102,366,000	
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)	300,000,000	309,225,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,493,000	
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	103,396,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,918,000	
	100,000,000	100,405,000	

第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債			
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,751,000	
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	100,579,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,480,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,531,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,947,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,914,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	
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	100,317,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,182,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,514,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,494,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,402,000	
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	102,874,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,093,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,326,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,553,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,003,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,178,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,493,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,507,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,270,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,820,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,497,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,348,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,402,390	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,597,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,597,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,160,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,475,800	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	128,431,000	

第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,013,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	96,799,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,096,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,846,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,712,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,861,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,791,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,058,900	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,064,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,847,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,732,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,028,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,074,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,592,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,118,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,335,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,533,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,810,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,210,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,864,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,300,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,834,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,744,340	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,167,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,591,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,607,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,298,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,164,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,162,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,806,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,314,010	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,869,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,326,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,744,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,223,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,665,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,938,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,381,000	
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	101,404,000	

第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,773,000	
社債券合計	16,976,000,000	17,343,048,440	
合計		419,968,112,742	

(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11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	107,858,183
金銭信託	292,856,793
コール・ローン	2,001,692,694
国債証券	246,197,910,541
派生商品評価勘定	20,147,199
未収入金	4,081,494
未収利息	1,899,814,384
前払金	688,764
前払費用	126,134,729
差入委託証拠金	113,431,602
流動資産合計	250,764,616,383
資産合計	250,764,616,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,866,922
未払金	16,979,206
未払解約金	80,685,073
未払利息	5,670
その他未払費用	20,517
流動負債合計	101,557,388
負債合計	101,557,388
純資産の部	
元本等	
元本	92,247,899,512
剰余金	
剰余金又は欠損金()	158,415,159,483
元本等合計	250,663,058,995
純資産合計	250,663,058,995
負債純資産合計	250,764,616,383

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2018年11月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	92,247,899,512口

		2018年11月12日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7173円 (27,173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11月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	90,563,196,023円
期中追加設定元本額	12,094,208,535円
期中一部解約元本額	10,409,505,046円
期末元本額	92,247,899,512円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,965,131,153円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	806,207,581円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	544,931,793円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,097,734,137円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,870,561円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,183,763,144円

区分	2018年11月12日現在
世界経済インデックスファンド	6,610,972,987円
DCマイセレクション25	1,578,933,347円
DCマイセレクション50	1,395,178,192円
DCマイセレクション75	899,776,546円
DC外国債券インデックス・オープン	1,760,187,771円
DCマイセレクションS25	630,712,953円
DCマイセレクションS50	556,176,666円
DCマイセレクションS75	260,228,062円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,989,501円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	57,384,718円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	26,946,489円
DC世界経済インデックスファンド	5,394,881,903円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	598,103,037円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,587,091円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,707,126円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,192,335円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	60,973,688円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	165,215,349円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	245,734,130円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	187,705,635円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	570,996,167円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,469,127,846円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	684,743,444円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,456,731,103円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	905,887,335円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	97,376,273円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	713,528,105円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	256,623,226円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	265,170,082円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	337,884,439円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,088,219,304円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	967,934,481円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	939,054,179円
外国債券ファンド・シリーズ1	603,757,894円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,233,014,655円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,768,990,860円
分散投資コア戦略ファンドA	909,364,086円
分散投資コア戦略ファンドS	2,632,950,110円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	231,176,475円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,384,479,054円
コア投資戦略ファンド（切替型）	486,935,896円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	266,107,268円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	115,424,364円

区分	2018年11月12日現在
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,001,306,345円
S M T インデックスバランス・オープン	266,126,583円
外国債券S M T Bセレクション(S M A専用)	22,799,363,325円
S M T 世界経済インデックス・オープン	35,379,617円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	88,770,053円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	109,640,657円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	678,974円
グローバル経済コア	1,164,771,974円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	3,646,151円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	30,707円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	15,589円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	20,067円
F O F s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)	860,410,989円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	9,041,644,288円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	355,391,652円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,070,810,982
合計		4,070,810,982

(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11月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,707,419,258	-	1,706,730,494	688,764
合計		1,707,419,258	-	1,706,730,494	688,764

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2018年11月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,266,708,359	-	2,283,677,400	16,969,041
	アメリカドル	1,115,352,994	-	1,127,709,000	12,356,006
	カナダドル	93,735,192	-	94,088,800	353,608
	ユーロ	900,042,511	-	902,720,000	2,677,489
	イギリスポンド	157,577,662	-	159,159,600	1,581,938
	合計	2,266,708,359	-	2,283,677,400	16,969,041

(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 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,236,678.24	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,900,028.16	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,344,516.77	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,758,273.75	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,656,693.64	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,918,605.06	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,439,512.73	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,331,056.56	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,363,508.68	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,193,584.71	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,422,301.83	

T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,506,703.20	
T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,917,013.95	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,913,441.50	
T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,638,143.56	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,906,830.35	
T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,113,848.55	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	978,645.58	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,142,184.30	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,514,575.94	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,398,876.94	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,641,680.90	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,314,400.72	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,887,468.52	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,396,469.68	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,822,039.64	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,533,565.47	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,292,754.48	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,318,681.03	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,748,501.16	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,640,545.35	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,035,090.12	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,759,472.80	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,709,077.82	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,916,611.94	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,933,980.45	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,309,220.97	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,427,852.35	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,293,912.30	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,435,049.63	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,700,292.00	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,939,418.75	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,892,330.90	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,376,377.85	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,318,014.30	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,411,859.45	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,772,731.89	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,970,469.96	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,166,493.29	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,402,160.62	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,164,977.52	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,736,891.31	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,640,723.49	

T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,556,964.02
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,144,830.07
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,696,250.19
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,676,134.25
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,909,403.72
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	7,999,610.20
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,411,494.57
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,688,527.48
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,638,142.85
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,835,531.72
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,021,004.88
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,225,292.01
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,184,296.15
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,946,843.33
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	8,685,891.76
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,057,416.11
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,305,459.07
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,339,225.87
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,035,840.59
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,561,279.92
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,961,461.80
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,409,398.51
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,952,167.60
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,588,520.64
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,913,657.10
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,382,512.78
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,356,758.55
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,000,062.04
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,440,529.82
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,942,564.70
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,291,542.23
T 2.25% 08/15/46	6,700,000.00	5,322,830.34
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,013,359.57
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,681,627.53
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,158,310.76
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	13,586,510.34
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,923,684.46
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,005,005.70
T 2.375% 05/15/27	6,950,000.00	6,542,480.42
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,033,822.37
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,272,889.32
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,832,529.15
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,324,008.03

T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	13,878,638.23	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	3,961,228.45	
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,816,733.92	
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,142,514.64	
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,866,762.44	
T 2.5% 06/30/20	6,500,000.00	6,458,270.39	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,440,337.21	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,377,233.17	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,049,725.42	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,089,510.48	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,318,740.98	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,471,433.99	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,931,336.90	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,955,230.67	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,037,067.04	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,509,056.65	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	10,272,341.20	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	5,923,530.78	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	10,928,212.46	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,689,308.45	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	8,773,960.84	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,805,466.75	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,760,484.28	
T 2.75% 11/15/47	10,850,000.00	9,562,385.01	
T 2.875% 05/15/28	6,900,000.00	6,724,222.22	
T 2.875% 05/15/43	6,000,000.00	5,487,414.89	
T 2.875% 08/15/28	5,220,000.00	5,081,880.62	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	9,908,475.17	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,422,605.02	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,492,905.55	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,876,295.53	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,914,868.92	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,709,420.88	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	9,920,475.91	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,120,272.09	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,892,876.84	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,463,588.93	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,620,468.71	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,915,533.75	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,490,944.08	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,331,868.56	
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,076,605.16	

T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,397,224.47
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,921,962.48
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,134,478.30
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,256,317.41
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	4,782,350.00
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,319,807.05
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	5,729,896.32
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,122,845.91
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,599,561.86
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,801,190.03
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,081,350.22
T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,701,167.53
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,067,230.03
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,260,321.85
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,201,547.90
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,079,069.56
T 3.75% 11/15/43	7,050,000.00	7,479,970.47
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,402,337.14
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,830,912.64
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,262,450.94
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	7,194,820.14
T 3% 08/15/48	2,800,000.00	2,595,208.19
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	5,645,961.33
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,023,543.01
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,309,184.23
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,153,749.32
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,198,111.93
T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	4,811,130.64
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,121,684.11
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,139,632.72
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,172,616.92
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	293,643.18
T 4.625% 02/15/40	1,700,000.00	2,030,622.44
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	3,592,793.67
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,362,342.96
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,472,188.27
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,526,794.82
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	1,947,263.24
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,430,453.92
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,017,804.22
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,782,727.32
T 6.25% 05/15/30	400,000.00	516,379.04
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,883,862.00

	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,944,042.34	
アメリカドル 小計		1,030,090,000.00	993,428,598.43 (113,191,254,505)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,915,410.50	
	CAN 0.75% 03/01/21	5,000,000.00	4,822,775.00	
	CAN 0.75% 09/01/20	4,200,000.00	4,084,941.00	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,559,143.90	
	CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,471,400.00	
	CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,042,721.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,305,416.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,145,279.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	1,900,000.00	1,848,358.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,744,691.10	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,423,702.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	2,050,000.00	2,022,335.25	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,180,000.00	1,182,820.20	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,580,204.75	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,750,000.00	1,832,136.25	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	663,809.20	
	CAN 2% 06/01/28	1,300,000.00	1,244,815.00	
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	353,512.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,176,689.60	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,833,336.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,400,000.00	2,850,420.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,497,650.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,000,000.00	2,595,640.00	
CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,223,352.00		
CAN 5% 06/01/37	1,710,000.00	2,330,251.20		
CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	512,141.40		
カナダドル 小計		56,450,000.00	58,262,950.85 (5,030,423,176)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	18,851,382.25	
	MBONO 10% 12/05/24	42,030,000.00	44,554,952.25	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,070,000.00	21,044,259.40	
	MBONO 5% 12/11/19	35,680,000.00	34,399,444.80	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	43,643,718.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,950,000.00	34,208,402.25	
	MBONO 7.5% 06/03/27	33,010,000.00	30,340,316.25	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	15,545,952.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	21,298,150.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,287,794.75	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	15,196,974.00	

	MBONO 8.5% 11/18/38	15,850,000.00	15,053,537.50
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,527,677.50
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	8,190,412.50
	MBONO 8% 12/07/23	8,800,000.00	8,568,252.00
	メキシコペソ 小計	363,540,000.00	346,711,226.45 (1,965,852,653)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	400,000.00	402,864.00
	BGB 0.5% 10/22/24	880,000.00	892,764.40
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,159,314.50
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,129,401.45
	BGB 0.8% 06/22/28	1,470,000.00	1,467,111.45
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	852,482.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	796,260.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,304,079.75
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,174,640.50
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,172,607.50
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,287,078.00
	BGB 2.15% 06/22/66	570,000.00	587,715.60
	BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,948,029.60
	BGB 2.25% 06/22/57	450,000.00	483,743.25
	BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,724,576.00
	BGB 3.75% 06/22/45	1,380,000.00	1,991,146.80
	BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,971,925.00
	BGB 3% 06/22/34	1,450,000.00	1,798,696.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	3,478,051.50
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,664,853.00
	BGB 4.25% 09/28/22	1,580,000.00	1,853,679.70
	BGB 4.5% 03/28/26	1,420,000.00	1,835,641.10
	BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,577,183.75
	BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,400,094.45
	BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,237,043.20
	BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,484,004.60
	BKO 0% 12/13/19	800,000.00	805,864.00
	BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,496,858.25
	BTPS 0.35% 06/15/20	800,000.00	792,628.00
	BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,649,349.00
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,362,585.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,191,996.00
	BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,533,911.00
	BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	1,992,720.00
	BTPS 0.9% 08/01/22	500,000.00	477,362.50
	BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,225,360.50
	BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,886,250.00

BTPS 1.05% 12/01/19	3,250,000.00	3,264,771.25
BTPS 1.25% 12/01/26	1,400,000.00	1,227,037.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,831,661.50
BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	639,254.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,020,983.25
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	2,934,720.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,450,928.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,522,408.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	1,911,220.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	2,922,592.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,522,200.00
BTPS 2.2% 06/01/27	2,950,000.00	2,737,954.00
BTPS 2.25% 09/01/36	1,750,000.00	1,447,013.75
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,136,304.00
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,298,688.00
BTPS 2.7% 03/01/47	2,000,000.00	1,640,060.00
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	735,751.60
BTPS 2.8% 12/01/28	950,000.00	904,058.00
BTPS 2.95% 09/01/38	1,760,000.00	1,556,095.20
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,494,231.75
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,219,517.00
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,399,960.00
BTPS 3.45% 03/01/48	2,310,000.00	2,122,197.00
BTPS 3.5% 03/01/30	3,160,000.00	3,170,744.00
BTPS 3.75% 03/01/21	3,430,000.00	3,605,616.00
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,256,937.50
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,202,840.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,254,963.00
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,693,702.50
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,722,468.00
BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	3,746,769.00
BTPS 4.5% 03/01/26	5,300,000.00	5,799,286.50
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,234,444.50
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,617,711.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,259,225.75
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	3,911,225.55
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,693,940.00
BTPS 4% 02/01/37	3,700,000.00	3,851,367.00
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,617,866.00
BTPS 5.0% 08/01/39	2,750,000.00	3,172,015.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,248,399.25
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,796,729.00

BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,856,548.00
BTPS 5.75% 02/01/33	3,320,000.00	4,083,085.40
BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,278,085.00
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	2,966,595.50
BTPS 5% 08/01/34	3,250,000.00	3,760,087.50
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,334,594.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,550,000.00	4,421,542.75
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	4,856,748.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,801,856.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,037,680.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,458,610.75
DBR 0.25% 08/15/28	2,210,000.00	2,177,192.55
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,301,968.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,497,359.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,316,352.25
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,107,568.75
DBR 0% 08/15/26	3,160,000.00	3,119,536.20
DBR 1.25% 08/15/48	1,260,000.00	1,326,912.30
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,747,242.50
DBR 1.5% 05/15/23	850,000.00	918,029.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,493,649.70
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,001,068.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,815,140.25
DBR 1.75% 07/04/22	3,650,000.00	3,937,309.75
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,124,050.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,247,274.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,631,762.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,156,640.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,535,005.00
DBR 2.5% 07/04/44	3,350,000.00	4,505,448.50
DBR 2.5% 08/15/46	3,390,000.00	4,613,976.45
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,557,812.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,323,996.50
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,562,663.25
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,742,448.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,850,000.00	2,767,183.75
DBR 3% 07/04/20	5,940,000.00	6,299,043.30
DBR 4.0% 01/04/37	3,050,000.00	4,709,718.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,043,361.00
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,333,502.80
DBR 4.75% 07/04/34	2,450,000.00	3,925,769.75
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,717,105.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,040,000.00	3,241,539.60

DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,964,700.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,663,230.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,041,212.50	
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	999,654.50	
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,073,650.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,752,418.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	6,988,630.35	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,312,216.40	
FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,781,680.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	3,600,000.00	3,609,072.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	2,700,000.00	2,690,779.50	
FRTR 0% 03/25/23	1,950,000.00	1,955,791.50	
FRTR 0% 03/25/24	2,450,000.00	2,433,732.00	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,141,574.00	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,595,704.25	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,361,967.75	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,400,000.00	4,366,142.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,970,000.00	6,321,603.15	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,810,000.00	6,290,051.25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,250,000.00	1,205,768.75	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,150,000.00	2,282,149.75	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,289,953.75	
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,775,760.75	
FRTR 1% 11/25/25	5,050,000.00	5,276,997.50	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,466,730.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,100,000.00	5,588,911.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,170,462.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,770,705.25	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	5,933,675.00	
FRTR 2% 05/25/48	2,930,000.00	3,157,587.75	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,575,145.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,580,723.75	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,648,835.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	2,130,000.00	2,621,103.45	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,070,000.00	5,589,548.25	
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,116,652.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,571,375.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,250,000.00	6,761,941.25	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,613,160.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,289,378.75	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,711,742.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,300,000.00	4,849,185.00	

FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	5,979,440.25
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,618,568.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,643,660.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,383,605.00
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,000,773.25
IRISH 0.9% 05/15/28	600,000.00	595,965.00
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	510,153.80
IRISH 1.35% 03/18/31	410,000.00	412,488.70
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	760,710.00
IRISH 1% 05/15/26	1,950,000.00	1,995,854.25
IRISH 2.4% 05/15/30	1,230,000.00	1,388,768.40
IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	1,151,188.50
IRISH 3.4% 03/18/24	800,000.00	933,732.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,230,000.00	1,436,670.75
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,229,791.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,024,625.50
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	254,549.05
NETHER 0.25% 01/15/20	1,320,000.00	1,334,968.80
NETHER 0.25% 07/15/25	1,710,000.00	1,719,909.45
NETHER 0.5% 07/15/26	2,800,000.00	2,845,388.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,050,000.00	2,105,155.25
NETHER 0.75% 07/15/28	1,330,000.00	1,356,613.30
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,822,167.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	901,476.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,124,534.75
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,818,413.80
NETHER 2.5% 01/15/33	1,870,000.00	2,299,193.05
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,425,018.85
NETHER 2% 07/15/24	2,750,000.00	3,059,127.50
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,257,552.25
NETHER 3.5% 07/15/20	2,800,000.00	2,996,280.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,570,744.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,030,000.00	3,193,697.50
NETHER 4% 01/15/37	2,090,000.00	3,182,787.85
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,661,698.20
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	265,104.00
OBL 0.25% 10/16/20	2,250,000.00	2,287,653.75
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,811,113.05
OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,837,582.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,648,798.00
OBL 0% 10/08/21	3,800,000.00	3,855,043.00
OBL 0% 10/13/23	2,490,000.00	2,512,260.60
RAGB 0.5% 04/20/27	1,100,000.00	1,098,570.00

RAGB 0.75% 02/20/28	600,000.00	607,308.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,506,611.50	
RAGB 0% 07/15/23	630,000.00	632,299.50	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,109,515.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,860,000.00	1,979,997.90	
RAGB 1.5% 02/20/47	640,000.00	651,948.80	
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	367,236.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,910,930.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,525,811.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	559,922.50	
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,119,276.80	
RAGB 3.15% 06/20/44	900,000.00	1,258,299.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,720,740.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,414,667.50	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,251,090.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	806,583.45	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,881,985.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,870,000.00	2,798,277.35	
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	665,657.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	193,640.20	
RFGB 0.375% 09/15/20	790,000.00	803,354.95	
RFGB 0.5% 04/15/26	650,000.00	655,999.50	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	348,356.75	
RFGB 0.5% 09/15/28	350,000.00	344,081.50	
RFGB 0.75% 04/15/31	630,000.00	621,340.65	
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	312,286.50	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	545,302.80	
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	762,033.00	
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	579,196.95	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	697,056.75	
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	824,901.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	772,026.80	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	863,100.00	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	663,858.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	739,669.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	877,272.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,410,703.30	
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,102,876.50	
SPGB 0.35% 07/30/23	480,000.00	475,284.00	
SPGB 0.4% 04/30/22	3,070,000.00	3,091,674.20	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,361,961.50	
SPGB 0.75% 07/30/21	3,400,000.00	3,471,859.00	

	SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,071,685.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	1,900,000.00	1,901,719.50	
	SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,411,141.20	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,220,000.00	2,194,902.90	
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,090,000.00	2,053,362.30	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,597,660.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,073,012.25	
	SPGB 1.6% 04/30/25	2,900,000.00	3,015,739.00	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,105,671.50	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,970,000.00	3,011,490.90	
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,801,002.75	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,200,000.00	2,271,588.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,210,000.00	1,206,357.90	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,551,760.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,100,000.00	2,206,029.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,347,528.60	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,599,673.50	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,680,000.00	3,468,603.40	
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,350,000.00	3,502,642.75	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,070,958.75	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,550,000.00	3,148,191.75	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,850,000.00	3,968,368.50	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,687,907.50	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,306,587.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,198,296.25	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,190,050.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,702,380.50	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,700,000.00	2,528,546.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,109,189.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,800,000.00	4,320,144.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,770,000.00	4,044,019.95	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,950,000.00	3,489,230.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,191,996.50	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,483,660.50	
	ユーロ 小計	667,600,000.00	746,158,573.25 (96,224,609,606)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,443,685.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	3,230,000.00	3,182,712.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,200,000.00	4,150,734.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	2,700,000.00	2,740,999.50	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,641,457.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,670,000.00	2,421,476.40	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,360,000.00	2,389,098.80	

UKT 1.625% 10/22/71	400,000.00	373,576.00	
UKT 1.75% 01/22/49	390,000.00	374,669.10	
UKT 1.75% 07/22/57	1,980,000.00	1,924,906.50	
UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,500,215.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,840,000.00	1,801,166.80	
UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,903,642.50	
UKT 2.5% 07/22/65	2,300,000.00	2,788,566.00	
UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,398,869.00	
UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,449,750.60	
UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,367,708.75	
UKT 3.25% 01/22/44	3,650,000.00	4,593,488.50	
UKT 3.5% 01/22/45	2,910,000.00	3,832,586.40	
UKT 3.5% 07/22/68	2,400,000.00	3,697,692.00	
UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,006,407.00	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	790,136.25	
UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,431,338.75	
UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,807,216.00	
UKT 4.25% 06/07/32	2,000,000.00	2,622,130.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,740,588.50	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	835,108.10	
UKT 4.25% 12/07/40	2,240,000.00	3,186,512.00	
UKT 4.25% 12/07/46	2,250,000.00	3,371,265.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,740,552.95	
UKT 4.25% 12/07/55	2,820,000.00	4,617,425.70	
UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,340,739.70	
UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,817,732.50	
UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,787,932.50	
UKT 4.75% 12/07/30	2,070,000.00	2,788,683.30	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,817,320.00	
UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,165,308.25	
UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,597,247.50	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,341,873.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,785,743.75	
UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,832,952.50	
イギリスポンド 小計	93,340,000.00	112,401,214.40 (16,566,814,990)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,700,000.00	6,768,407.00
	SGB 1.5% 11/13/23	10,250,000.00	10,959,505.00
	SGB 1% 11/12/26	8,250,000.00	8,595,015.00
	SGB 2.5% 05/12/25	8,150,000.00	9,304,569.75
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	8,124,275.25
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	15,884,396.85

	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,338,240.00
スウェーデンクローナ 小計		65,270,000.00	72,974,408.85 (915,099,086)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,260,000.00	5,138,888.50
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,593,967.50
	NGB 1.75% 03/13/25	5,100,000.00	5,095,002.00
	NGB 2% 04/26/28	2,930,000.00	2,936,709.70
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,813,095.75
	NGB 3.75% 05/25/21	10,900,000.00	11,565,554.00
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	5,923,626.00
ノルウェークローネ 小計		43,040,000.00	44,066,843.45 (594,902,386)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	3,500,000.00	3,559,955.00
	DGB 0.5% 11/15/27	7,700,000.00	7,800,870.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,850,000.00	8,499,862.25
	DGB 1.75% 11/15/25	14,230,000.00	15,855,990.95
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,821,627.50
	DGB 4.5% 11/15/39	16,800,000.00	28,725,732.00
	DGB 4% 11/15/19	10,840,000.00	11,352,623.60
デンマーククローネ 小計		71,620,000.00	87,616,661.30 (1,514,892,073)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,200,814.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,095,308.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,160,000.00	2,171,577.60
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,300,000.00	5,331,482.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,485,738.75
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,903,507.50
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,530,000.00	2,435,390.65
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,599,589.60
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,080,000.00	4,178,450.40
	POLGB 4% 10/25/23	2,600,000.00	2,785,640.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,372,232.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	734,052.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,071,186.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,278,322.75
ポーランドズロチ 小計		47,780,000.00	48,643,291.75 (1,462,703,782)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,832,985.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,800,000.00	3,648,038.00
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	400,124.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,480,000.00	1,440,091.80
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,570,442.20
	ACGB 2.75% 05/21/41	440,000.00	409,860.00

	ACGB 2.75% 06/21/35	700,000.00	676,546.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,563,206.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,055,200.25	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,650,000.00	1,649,843.25	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,385,006.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,200,000.00	3,340,016.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,470,000.00	2,585,386.05	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,200,000.00	1,223,094.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,645,890.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,530,824.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	4,958,962.50	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,170,000.00	3,280,490.35	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,495,367.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,456,894.75	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,540,700.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,170,000.00	4,541,526.15	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,454,870.55	
	オーストラリアドル 小計	59,620,000.00	62,685,364.85 (5,158,378,673)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	243,781.25	
	SIGB 1.75% 04/01/22	510,000.00	502,439.25	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	831,929.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	872,183.70	
	SIGB 2.25% 08/01/36	240,000.00	221,787.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	720,000.00	719,085.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	170,000.00	171,842.80	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	679,476.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	605,321.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	825,884.10	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	287,415.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	481,106.10	
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	319,652.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,136,080.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,091,833.35	
	SIGB 3.375% 09/01/33	730,000.00	783,585.65	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,023,843.50	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	827,788.00	
	シンガポールドドル 小計	11,460,000.00	11,625,036.00 (960,460,474)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,467,850.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,660,688.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	1,999,950.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,274,252.00	

	MGS 3.654% 10/31/19	960,000.00	962,126.40
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,153,145.25
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,264,035.50
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,099,818.50
	MGS 3.8% 08/17/23	400,000.00	398,200.00
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,055,481.50
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	753,558.75
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,508,977.50
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,103,919.60
	MGS 3.9% 11/30/26	1,080,000.00	1,060,878.60
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,684,556.00
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,070,940.75
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,902,508.00
	MGS 4.127% 04/15/32	1,000,000.00	953,440.00
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,671,532.50
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,562,958.00
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	1,940,110.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,322,412.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,220,779.00
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,826,712.00
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,652,912.25
	MGS 4.736% 03/15/46	1,050,000.00	1,017,681.00
	MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,636,470.00
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,843,164.25
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	642,900.00
	マレーシアリングット 小計	45,170,000.00	44,711,957.35 (1,217,953,718)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	27,500,000.00	29,529,500.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,739,290.90
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,645,249.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,169,658.50
	SAGB 7.25% 01/15/20	4,170,000.00	4,205,674.35
	SAGB 7.75% 02/28/23	7,750,000.00	7,542,571.25
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,418,104.50
	SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,541,724.40
	SAGB 8.5% 01/31/37	17,700,000.00	15,517,678.50
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,927,438.20
	SAGB 8.75% 02/28/48	16,450,000.00	14,465,060.75
	SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,666,595.75
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	13,962,088.50
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,307,327.50
	南アフリカランド 小計	195,190,000.00	175,637,962.10

		(1,394,565,419)	
合計		246,197,910,541	
		(246,197,910,541)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 182銘柄	100.0%	46.0%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 283銘柄	100.0%	39.1%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.7%
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%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23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 29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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	867,651,431

	2018年11月12日現在
項目	金額（円）
金銭信託	38,322,564
コール・ローン	261,936,883
国債証券	43,700,447,415
未収利息	772,146,609
前払費用	78,319,590
流動資産合計	45,718,824,492
資産合計	45,718,824,492
負債の部	
流動負債	
未払解約金	168,368,637
未払利息	741
その他未払費用	3,705
流動負債合計	168,373,083
負債合計	168,373,083
純資産の部	
元本等	
元本	27,958,931,928
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,591,519,481
元本等合計	45,550,451,409
純資産合計	45,550,451,409
負債純資産合計	45,718,824,492

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2018年11月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		27,958,931,928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)	1.6292円 (16,292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11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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

	2018年11月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	25,386,326,416円
期中追加設定元本額	4,011,780,876円
期中一部解約元本額	1,439,175,364円
期末元本額	27,958,931,928円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,049,643,064円
世界経済インデックスファンド	5,279,520,780円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,811,092,671円
DC世界経済インデックスファンド	4,285,520,173円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,872,615,938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)	565,758,627円

区分	2018年11月12日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	105,146,569円
分散投資コア戦略ファンドA	131,096,344円
分散投資コア戦略ファンドS	405,302,672円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	175,603,714円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,925,236,192円
コア投資戦略ファンド（切替型）	79,323,611円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,079,930円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,964,547円
SMT インデックスバランス・オープン	214,511,555円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,224,840,410円
SMT 世界経済インデックス・オープン	41,127,289円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	96,371,713円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	125,354,708円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,084,055円
グローバル経済コア	940,526,398円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	2,893円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,956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）	127,090,767円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,587,544,605
合計	1,587,544,605

(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）

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	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	31,200,000.00	33,899,892.00	
		MBONO 10% 12/05/24	77,350,000.00	81,996,801.25	
		MBONO 5.75% 03/05/26	52,300,000.00	43,901,666.00	
		MBONO 5% 12/11/19	44,000,000.00	42,420,840.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	91,600,000.00	85,605,238.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	87,257,593.50	
		MBONO 7.25% 12/09/21	21,600,000.00	20,791,404.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	73,700,000.00	67,739,512.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	35,800,000.00	32,546,496.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	49,600,000.00	43,206,064.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	21,328,920.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	28,400,000.00	27,666,286.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	29,869,637.50	
		MBONO 8% 06/11/20	85,000,000.00	84,385,450.00	
		MBONO 8% 11/07/47	28,500,000.00	25,235,325.00	
		MBONO 8% 12/07/23	41,700,000.00	40,601,830.50	
			メキシコペソ 小計		807,900,000.00
国債証券	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/20	3,750,000.00	3,468,242.62	
		BLTN 0% 01/01/22	9,950,000.00	7,622,772.61	
		BLTN 0% 04/01/20	21,600,000.00	19,573,578.72	
		BLTN 0% 07/01/20	37,550,000.00	33,325,272.03	
		BLTN 0% 07/01/21	16,500,000.00	13,312,290.75	
		BNTNF 10% 01/01/21	13,800,000.00	14,285,605.34	
		BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000.00	26,404,761.48	
		BNTNF 10% 01/01/25	11,450,000.00	11,539,009.92	
		BNTNF 10% 01/01/27	10,700,000.00	10,588,953.17	
		BNTNF 10% 01/01/29	1,850,000.00	1,812,664.76	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,523,375.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	500,062.50	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,889,312.50	
			ブラジルリアル 小計		156,750,000.00
国債証券	チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	7,310,000,000.00	7,531,639,200.00	
	チリペソ 小計		7,310,000,000.00	7,531,639,200.00 (1,253,264,762)	
国債証券	コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	22,342,036,750.00	
		COLOM 7.75% 04/14/21	14,000,000,000.00	14,621,810,000.00	

	COLOM 9.85% 06/28/27	47,000,000,000.00	57,936,665,000.00	
コロンビアペソ 小計		84,650,000,000.00	94,900,511,750.00 (3,397,438,320)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,250,000.00	5,422,200.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,100,000.00	6,129,829.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,100,000.00	7,396,354.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	4,700,000.00	4,966,960.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,750,000.00	7,296,750.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	2,250,000.00	2,454,648.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	7,594,665.00	
ペルーヌエボソル 小計		38,650,000.00	41,261,406.75 (1,394,635,548)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	16,900,000.00	14,492,003.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	18,450,000.00	18,303,230.25	
ウルグアイペソ 小計		35,350,000.00	32,795,233.75 (114,455,365)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,034,126.00	
ドミニカペソ 小計		20,400,000.00	20,034,126.00 (45,878,148)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,635,938.00	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,900,000.00	6,243,948.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	7,257,205.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	7,314,011.25	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,300,000.00	6,038,669.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	8,691,375.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	6,944,914.50	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	7,894,752.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,750,000.00	8,130,915.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,207,112.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	5,950,000.00	4,060,696.50	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	5,750,000.00	4,948,133.75	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	3,753,669.50	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	6,050,000.00	4,368,977.25	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,067,602.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	8,750,000.00	6,889,006.25	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	7,750,000.00	6,565,451.25	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,346,810.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	5,296,523.75	
	トルコリラ 小計		137,550,000.00	107,655,711.00 (2,250,004,359)
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	30,000,000.00	26,073,300.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	20,400,000.00	19,113,168.00	

	CZGB 0.95% 05/15/30	30,500,000.00	26,692,380.00	
	CZGB 0% 02/10/20	15,200,000.00	14,953,608.00	
	CZGB 1% 06/26/26	28,100,000.00	26,056,568.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	50,500,000.00	51,861,227.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	46,500,000.00	48,263,977.50	
	CZGB 3.75% 09/12/20	40,700,000.00	42,417,947.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	41,600,000.00	44,219,552.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	38,000,000.00	42,223,320.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	36,800,000.00	44,656,616.00	
	チェココルナ 小計	378,300,000.00	386,531,664.00 (1,921,062,370)	
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	297,000,000.00	288,890,415.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	596,000,000.00	587,733,480.00	
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	230,616,400.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	349,316,990.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	280,000,000.00	264,702,200.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	522,000,000.00	544,712,220.00	
	HGB 3% 06/26/24	529,000,000.00	532,218,965.00	
	HGB 3% 10/27/27	531,000,000.00	504,710,190.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	556,000,000.00	635,102,120.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	453,000,000.00	528,911,475.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	195,000,000.00	243,846,525.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	267,881,100.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	556,646,452.50	
	ハンガリーフォリント 小計	5,242,500,000.00	5,535,288,532.50 (2,220,204,230)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000.00	13,354,939.50	
	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000.00	13,337,718.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000.00	14,075,040.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	11,300,000.00	11,367,122.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000.00	14,036,021.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000.00	12,519,786.25	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,250,000.00	5,053,676.25	
	POLGB 2% 04/25/21	9,750,000.00	9,808,841.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	11,000,000.00	11,265,430.00	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,606,860.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,707,960.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,538,181.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,947,832.75	
	ポーランドズロチ 小計	137,500,000.00	139,619,409.00 (4,198,355,628)	
ロシアルー ブル	RFLB 6.4% 05/27/20	98,800,000.00	96,854,628.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	84,000,000.00	76,371,960.00	

	RFLB 6.8% 12/11/19	71,200,000.00	70,674,544.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	39,000,000.00	34,151,715.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	151,000,000.00	135,289,205.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	152,640,897.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	55,000,000.00	47,972,375.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	167,400,915.50	
	RFLB 7.5% 08/18/21	159,200,000.00	156,750,708.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	63,833,913.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	61,238,437.50	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	159,215,316.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	153,833,062.50	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	92,540,718.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	101,516,256.00	
	RFLB 7% 12/15/21	129,000,000.00	124,673,985.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	170,343,360.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	120,701,778.00	
	ロシアルーブル 小計	2,091,300,000.00	1,986,003,773.50	(3,336,486,339)
マレーシア リンギット	MGS 3.492% 03/31/20	8,400,000.00	8,399,790.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	11,900,000.00	11,889,587.50	
	MGS 3.659% 10/15/20	6,150,000.00	6,166,820.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	5,300,000.00	5,153,375.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,200,000.00	7,167,600.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	10,950,000.00	10,703,789.25	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	7,907,474.75	
	MGS 3.955% 09/15/25	5,950,000.00	5,915,966.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	6,550,000.00	6,558,646.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,128,952.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,900,000.00	9,982,764.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,200,000.00	6,149,160.00	
		マレーシアリンギット 小計	92,600,000.00	92,123,925.75
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	98,461,227.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	110,000,000.00	105,356,350.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	12,000,000.00	12,008,760.00	
	THAIGB 2.55% 06/26/20	44,350,000.00	44,821,440.50	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	27,000,000.00	27,141,885.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	108,500,000.00	107,296,192.50	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	167,500,000.00	170,946,312.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	88,685,100.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	144,051,656.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000.00	105,703,065.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	18,900,000.00	20,033,905.50	

	THAIGB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	96,243,710.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	111,556,600.00	
	タイバーツ 小計	1,093,850,000.00	1,132,306,204.50 (3,895,133,343)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	23,120,000.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	19,623,600.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	18,526,000.00	
	フィリピンペソ 小計	65,000,000.00	61,269,600.00 (131,729,640)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,325,293,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,265,463,500.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,753,282,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,624,024,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	44,900,000,000.00	41,062,397,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	35,700,000,000.00	31,083,097,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	24,751,210,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	21,082,113,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	22,800,000,000.00	21,022,626,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	39,200,000,000.00	38,270,568,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	47,800,000,000.00	44,526,417,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,252,140,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	18,594,954,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	35,000,000,000.00	35,478,450,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	45,200,000,000.00	45,723,416,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	32,296,387,500.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	45,584,325,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	33,587,968,500.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,374,301,000.00	
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	34,054,475,000.00		
	インドネシアルピア 小計	571,500,000,000.00	558,712,909,000.00 (4,357,960,690)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	76,750,000.00	82,414,150.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,369,636.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	20,171,438.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	21,500,000.00	21,116,117.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	11,550,000.00	11,648,810.25	
	SAGB 7.75% 02/28/23	27,500,000.00	26,763,962.50	
	SAGB 7% 02/28/31	40,800,000.00	32,950,284.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	36,900,000.00	32,682,883.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	41,029,794.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	56,800,000.00	50,076,584.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000.00	51,572,997.75	

	SAGB 8.875% 02/28/35	26,800,000.00	24,555,902.00	
	SAGB 8% 01/31/30	39,800,000.00	35,394,339.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	31,792,250.00	
	南アフリカランド 小計	542,850,000.00	486,539,149.50 (3,863,120,847)	
	合計		43,700,447,415 (43,700,447,415)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルレアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.9%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	3.2%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	5.1%
チェココルナ	国債証券 11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%	5.1%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.6%
ロシアルーブル	国債証券 18銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券 12銘柄	100.0%	5.7%
タイバーツ	国債証券 13銘柄	100.0%	8.9%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

貸借対照表

項目	2018年11月12日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	197,306,802
コール・ローン	1,348,603,117
投資証券	100,863,765,380
派生商品評価勘定	69,638,800
未収入金	26,626,630
未収配当金	1,025,523,583
差入委託証拠金	76,076,000
流動資産合計	103,607,540,312
資産合計	103,607,540,312
負債の部	
流動負債	
前受金	69,638,800
未払解約金	62,674,885
未払利息	3,820
その他未払費用	12,341
流動負債合計	132,329,846
負債合計	132,329,846
純資産の部	
元本等	
元本	61,232,689,286
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,242,521,180
元本等合計	103,475,210,466
純資産合計	103,475,210,466
負債純資産合計	103,607,540,312

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年11月12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> <p>先物取引</p>

2018年11月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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 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11月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,232,689,286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 1.6899円 (1万口当たり純資産額) (16,899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11月12日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>

	2018年11月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	61,085,196,735円
期中追加設定元本額	7,047,928,615円
期中一部解約元本額	6,900,436,064円
期末元本額	61,232,689,286円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,785,205,907円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,543,056円
SMT J-REITインデックス・オープン	10,427,070,892円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	31,211,573,763円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,883,977,898円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,807,710,817円
分散投資コア戦略ファンドA	2,079,870,536円
分散投資コア戦略ファンドS	3,244,761,096円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,170,998,710円
SMT インデックスバランス・オープン	36,967,112円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	725,337,473円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,081,300円
グローバル経済コア	394,883,884円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,059,174円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	36,702円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	47,286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）	1,349,860,395円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	1,102,703,285円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	8,591,543,379
合計	8,591,543,379

(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11月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	2,535,232,700	-	2,604,871,500	69,638,800
合計		2,535,232,700	-	2,604,871,500	69,638,800

(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。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	3,852	2,018,448,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	13,062	1,139,006,400	
	森ヒルズリート投資法人	13,293	1,851,714,900	
	産業ファンド投資法人	13,504	1,527,302,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,296	3,359,430,400	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,876	1,186,797,600	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	5,554	2,693,690,000	
	G L P 投資法人	28,721	3,233,984,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,421	1,212,238,200	
	日本プロロジスリート投資法人	15,547	3,718,842,400	
	星野リゾート・リート投資法人	1,764	947,268,000	
	O n e リート投資法人	1,689	426,810,300	
	イオンリート投資法人	11,898	1,503,907,200	

ヒューリックリート投資法人	9,370	1,540,428,000	
日本リート投資法人	3,741	1,380,429,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	68,708	1,113,756,680	
日本ヘルスケア投資法人	531	91,756,800	
積水ハウス・リート投資法人	29,906	2,117,344,800	
トーセイ・リート投資法人	2,231	243,625,200	
ケネディクス商業リート投資法人	4,248	1,027,591,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,535	172,380,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,320	209,264,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	34,355	5,039,878,500	
いちごホテルリート投資法人	2,027	274,658,500	
ラサールロジポート投資法人	8,744	935,608,000	
スターアジア不動産投資法人	3,598	382,827,200	
マリモ地方創生リート投資法人	997	108,673,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,979	661,975,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,871	162,589,900	
さくら総合リート投資法人	2,508	221,707,200	
投資法人みらい	3,122	573,823,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,719	379,844,300	
三菱地所物流リート投資法人	1,227	311,044,500	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,160	123,192,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,069	122,186,700	
タカラレーベン不動産投資法人	1,735	155,803,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,793	164,418,100	
日本ビルファンド投資法人	11,224	7,621,096,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,591	7,058,919,000	
日本リテールファンド投資法人	21,906	4,701,027,600	
オリックス不動産投資法人	23,095	4,097,053,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,337	3,048,523,500	
プレミア投資法人	11,020	1,353,256,000	
東急リアル・エステート投資法人	7,771	1,254,239,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,411	855,229,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,564	4,535,053,600	
森トラスト総合リート投資法人	8,284	1,346,150,000	
インヴィンシブル投資法人	40,561	1,882,030,400	
フロンティア不動産投資法人	3,943	1,742,806,000	
平和不動産リート投資法人	7,218	823,573,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,648	1,746,803,200	
福岡リート投資法人	5,995	1,017,951,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,586	2,599,850,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,616	900,057,600	
大和証券オフィス投資法人	2,675	1,928,675,000	

阪急阪神リート投資法人	4,808	699,564,000	
スターツプロシード投資法人	1,826	308,046,200	
大和ハウスリート投資法人	14,512	3,594,622,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,561	2,698,304,400	
日本賃貸住宅投資法人	13,037	1,173,330,000	
ジャパンエクセレント投資法人	10,379	1,543,357,300	
合計	617,539	100,863,765,380	

(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

注記表(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

	2018年11月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	305,719,403
金銭信託	4,343,151
コール・ローン	29,685,680
投資証券	74,345,524,575
派生商品評価勘定	61,200
未収入金	1,410,546
未収配当金	141,089,408
流動資産合計	74,827,833,963
資産合計	74,827,833,963
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,500
未払解約金	9,216,271
未払利息	84
その他未払費用	873
流動負債合計	9,218,728
負債合計	9,218,728
純資産の部	
元本等	
元本	41,278,052,911
剰余金	
剰余金又は欠損金()	33,540,562,324
元本等合計	74,818,615,235
純資産合計	74,818,615,235
負債純資産合計	74,827,833,963

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2018年11月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,278,052,911口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.8126円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,126円)</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年11月12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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク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11月12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11月12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11月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月11日
期首元本額	38,608,528,990円
期中追加設定元本額	6,368,768,245円
期中一部解約元本額	3,699,244,324円
期末元本額	41,278,052,911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）	171,850,132円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,636,322,550円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,940,245円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,561,296,000円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,844,632,540円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,223,908,161円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,752,983,694円
分散投資コア戦略ファンドA	876,177,771円
分散投資コア戦略ファンドS	1,924,198,090円
コア投資戦略ファンド（切替型）	534,243,030円

区分	2018年11月12日現在
SMT インデックスバランス・オープン	199,003,796円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	609,392,597円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	995,086円
グローバル経済コア	364,183,249円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,816,030円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	16,635円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,902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）	858,093,930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）	710,963,473円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	871,582,464
合計	871,582,464

(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11月12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	37,535,700	-	37,595,400	59,700
	アメリカドル	37,535,700	-	37,595,400	59,700
合計		37,535,700	-	37,595,400	59,700

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,910	1,352,884.40	
		AGREE REALTY CORP	17,490	1,030,510.80	
		ALEXANDER'S INC	2,050	652,945.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	61,550	7,660,513.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,370	880,930.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	80,740	3,337,791.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,340	3,126,016.80	
		AMERICOLD REALTY TRUST	35,380	932,616.80	
		APARTMENT INVEST & MGMT	92,343	4,214,534.52	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,163	1,977,818.97	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	237,975.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	81,240	14,828,737.20	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	82,260.00	
		BOSTON PROPERTIES	89,640	11,138,666.40	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	142,535.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	101,518	1,461,859.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	171,350	2,765,589.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	57,900.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	53,410	4,942,561.40	
		CARETRUST REIT INC	48,290	935,860.20	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	305,510.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	197,929.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	23,860	475,768.40	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	34,960	1,037,612.80	
		CITY OFFICE REIT INC	20,000	223,600.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	102,784.00	
		COLONY CAPITAL INC	282,000	1,728,660.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,160	1,608,927.60	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	290,612.00	
		CORECIVIC INC	68,050	1,486,892.50	
		CORESITE REALTY CORP	20,830	1,999,471.70	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	60,820	1,592,267.60	
COUSINS PROPERTIES INC	236,963	2,033,142.54			
CUBESMART	109,640	3,204,777.20			

CYRUSONE INC	59,660	3,270,561.20	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	1,262,522.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	121,160	13,402,719.20	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	94,950	3,432,442.50	
DUKE REALTY CORP	209,580	5,989,796.40	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	33,000	595,980.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,750	2,150,422.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	82,810	1,324,131.90	
EPR PROPERTIES	42,600	3,036,954.00	
EQUITY COMMONWEALTH	72,400	2,232,816.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,950	5,165,272.50	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	216,500	14,609,420.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	38,370	9,743,294.10	
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,750	6,692,812.50	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	142,120.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,620	5,612,149.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	76,310	2,419,790.10	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	156,790	3,947,972.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	37,890	1,023,787.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	416,412.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	221,940.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	116,050	3,886,514.50	
GEO GROUP INC/THE	69,850	1,532,509.00	
GETTY REALTY CORP	17,300	485,784.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	290,850.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	65,500.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	88,160.00	
GLOBAL NET LEASE INC	39,000	826,020.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	56,710	527,970.10	
HCP INC	273,690	7,887,745.80	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	74,700	2,163,312.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	122,370	3,222,002.10	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	323,620.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	62,290	2,733,908.10	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	93,120	2,465,817.60	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	431,300	8,151,570.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	93,060	2,897,888.40	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	499,500.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,000	222,200.00	
INFREAREIT INC	23,000	489,440.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,990	311,124.90	

INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	346,922.70	
INVITATION HOMES INC	177,160	3,846,143.60	
IRON MOUNTAIN INC	167,160	5,477,833.20	
JBG SMITH PROPERTIES	62,900	2,455,616.00	
KILROY REALTY CORPORATION	57,560	4,071,794.40	
KIMCO REALTY CORP	247,550	4,030,114.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	811,362.50	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	63,160	2,113,965.20	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	125,366	1,054,328.06	
LIBERTY PROPERTY TRUST	87,390	3,848,655.60	
LIFE STORAGE INC	27,070	2,603,321.90	
LTC PROPERTIES INC	23,290	1,062,256.90	
MACERICH CO/THE	60,370	3,086,114.40	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	1,135,884.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	650,080	507,062.40	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	18,500	161,505.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	218,850	3,659,172.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,340	6,668,496.80	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	828,572.40	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	93,550	4,597,982.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	854,688.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,730	1,878,985.40	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	220,000.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	339,900.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	494,109.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	117,626	4,138,082.68	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	208,080.00	
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	1,758,016.80	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	118,330	3,650,480.50	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	39,900	1,363,782.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	292,525.50	
PHYSICIANS REALTY TRUST	104,360	1,783,512.40	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	77,800	1,442,412.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	356,960.00	
PROLOGIS INC	369,171	24,944,884.47	
PS BUSINESS PARKS INC	11,900	1,632,680.00	
PUBLIC STORAGE	87,980	18,154,673.00	
QTS REALTY TRUST INC	29,310	1,187,348.10	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	51,580	695,814.20	
REALTY INCOME CORP	168,490	10,574,432.40	
REGENCY CENTERS CORP	98,810	6,447,352.50	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,150	1,114,349.50	

RETAIL PROPERTISE OF AME-A	131,000	1,611,300.00
RETAIL VALUE	8,405	237,693.40
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	54,880	1,809,942.40
RLJ LODGING TRUST	99,770	1,999,390.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31,070	2,353,241.80
SABRA HEALTH CARE REIT INC	104,520	2,224,185.60
SAFETY INCOME & GROWTH INC	4,700	86,621.00
SAUL CENTERS INC	6,700	337,479.00
SELECT INCOME REIT	54,050	1,072,352.00
SENIOR HOUSING PROP TRUST	143,800	2,339,626.00
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	18,340	698,754.00
SIMON PROPERTY GROUP	181,170	34,184,967.30
SITE CENTERS CORP	84,059	1,009,548.59
SL GREEN REALTY CORP	50,920	4,837,909.20
SPIRIT MTA REIT	23,901	257,891.79
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	242,200	1,983,618.00
STAG INDUSTRIAL INC	59,410	1,569,018.10
STORE CAPITAL CORP	104,780	3,139,208.80
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	764,034.90
SUN COMMUNITIES INC	50,750	5,211,010.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	137,090	2,061,833.60
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	1,303,667.10
TAUBMAN CENTERS INC	34,900	1,919,849.00
TERRENO REALTY CORP	34,490	1,344,420.20
TIER REIT INC	31,300	720,526.00
UDR INC	156,890	6,407,387.60
UMH PROPERTIES INC	20,000	265,000.00
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	527,290.00
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	1,443,016.80
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	336,765.00
VENTAS INC	206,840	12,424,878.80
VEREIT INC	567,620	4,364,997.80
VICI PROPERTIES INC	39,000	846,300.00
VORNADO REALTY TRUST	100,850	7,065,551.00
WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	716,752.50
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	1,347,900.40
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	67,320	1,950,933.60
WELLTOWER INC	218,700	15,195,276.00
WHITESTONE REIT	22,610	314,279.00
WP CAREY INC	62,890	4,060,807.30
XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	1,396,255.00

	アメリカドル 小計	13,210,041	473,454,867.82 (53,945,447,639)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	86,784.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	28,790	1,262,441.50
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	449,257.50
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	693,439.20
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	40,340	1,916,956.80
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,430	1,064,817.60
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	605,260.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	293,673.81
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	184,690.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	59,940	813,985.20
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	21,000	210,840.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	447,539.60
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,410	810,562.50
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	83,630	1,736,158.80
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	26,000	333,840.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	424,065.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	136,891.50
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	410,851.70
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	33,000	361,680.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	88,380	2,180,334.60
SLATE OFFICE REI	17,000	127,500.00	
SLATE RETAIL REIT	10,300	130,604.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,810	1,210,483.90	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,000	186,000.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	95,700.00	
	カナダドル 小計	804,860	16,174,357.21 (1,396,494,001)
ユーロ	AEDIFICA	10,400	794,560.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	95,240	1,190,500.00
	ALTAREA	2,000	394,000.00
	BEFIMMO S.C.A.	12,800	636,160.00
	BENI STABILI SPA	547,000	413,532.00
	COFINIMMO	12,400	1,326,800.00
	COVIVIO	31,410	2,814,336.00
	EUROCOMMERCIAL	22,540	690,625.60

	GECINA SA	32,020	4,213,832.00
	GREEN REIT PLC	377,170	542,370.46
	HAMBORNER REIT AG	44,000	399,520.00
	HIBERNIA REIT PLC	402,550	542,637.40
	ICADE	25,651	1,931,520.30
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	210,140.01
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	178,000	1,585,980.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	10,500	242,550.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	190,021	275,530.45
	KLEPIERRE	121,540	3,767,740.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	396,187.68
	MERCIALYS	34,020	455,527.80
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,470	2,413,930.05
	NSI NV	11,700	428,805.00
	RETAIL ESTATES	4,200	304,500.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	80,830	13,078,294.00
	VASTNED RETAIL	8,500	297,925.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	10,350	1,173,690.00
	WERELDHAVE NV	24,970	755,342.50
	ユーロ 小計	2,581,464	41,276,536.25 (5,323,022,114)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	1,400,150	798,085.50
	BIG YELLOW GROUP PLC	95,070	884,151.00
	BRITISH LAND CO PLC	591,810	3,697,628.88
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	116,000.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	104,370.00
	DERWENT LONDON PLC	65,620	2,040,125.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	276,660.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	168,000	1,251,600.00
	HAMMERSON PLC	468,440	2,083,152.68
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	255,672.60
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	1,020,692.78
	LAND SECURITIES GROUP PLC	439,150	3,786,351.30
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	418,110	789,391.68
	LXI REIT PLC	195,817	234,980.40
	NEWRIVER REIT PL	173,000	415,200.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	391,755	431,714.01
	RDI REIT PLC	772,000	263,252.00
	REGIONAL REIT LTD	170,000	172,040.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	694,400.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	149,500.00
SEGRO PLC	593,710	3,753,434.62	

	SHAFTESBURY PLC	132,430	1,229,612.55
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	110,117	114,521.68
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	846,780	1,190,572.68
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	354,000	309,396.00
	UNITE GROUP PLC	157,310	1,359,158.40
	WORKSPACE GROUP PLC	72,420	721,665.30
	イギリスポンド 小計	9,453,229	28,143,329.86 (4,148,045,388)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	204,440	678,740.80
	ARENA REIT	141,000	317,250.00
	BWP TRUST	298,560	1,033,017.60
	CHARTER HALL GROUP	271,600	1,925,644.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	101,000	421,170.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	834,929.20
	CROMWELL PROPERTY GROUP	855,940	881,618.20
	DEXUS	600,720	6,049,250.40
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	130,800	380,628.00
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	359,557.50
	GOODMAN GROUP	933,420	9,754,239.00
	GPT GROUP	1,053,190	5,560,843.20
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	135,200	489,424.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	242,580.00
	INDUSTRIA REIT	75,000	192,750.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	98,270	289,896.50
	INVESTA OFFICE FUND	290,740	1,622,329.20
	MIRVAC GROUP	2,177,360	4,790,192.00
	NATIONAL STORAGE REIT	333,729	577,351.17
	PROPERTYLINK GROUP	207,000	244,260.00
	RURAL FUNDS GROUP	158,600	356,850.00
SCENTRE GROUP	3,139,590	12,652,547.70	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	514,230	1,347,282.60	
STOCKLAND	1,460,470	5,345,320.20	
VICINITY CENTERS	1,897,540	5,104,382.60	
VIVA ENERGY REIT	230,000	510,600.00	
	オーストラリアドル 小計	15,865,279	61,962,653.87 (5,098,906,786)
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	464,800.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	630,000	957,600.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,053,000.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	615,000	867,150.00
	STRIDE STAPLED GROUP	228,000	426,360.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	391,791.40
		2,855,460	4,160,701.40

ニュージーランドドル 小計			(319,292,225)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,133,000	5,982,240.00	
	FORTUNE REIT	779,000	6,808,460.00	
	LINK REIT	1,252,500	90,180,000.00	
	PROSPERITY REIT	782,000	2,189,600.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	3,078,240.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	740,000	3,663,000.00	
香港ドル 小計		5,322,500	111,901,540.00	(1,628,167,407)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	340,000	442,000.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	337,125.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,469,566	3,747,393.30	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	739,370.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	711,000	483,480.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,647,928	2,784,998.32	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,596,100	3,399,693.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	316,560	436,852.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	678,284.00	
	ESR REIT	1,130,579	553,983.71	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	292,800.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	395,460.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	355,800	768,528.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	489,600.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	977,820	1,026,711.00	
	KEPPEL DC REIT	519,460	701,271.00	
	KEPPEL REIT	1,074,800	1,214,524.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	228,960.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,135,830	1,851,402.90	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	714,860	1,329,639.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,387,152	1,692,325.44	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,251,800	1,389,498.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	680,000	472,600.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	652,500.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	191,416.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	184,690.00	
	SPH REIT	322,300	320,688.50	
STARHILL GLOBAL REIT	706,300	480,284.00		
SUNTEC REIT	1,339,800	2,344,650.00		
		22,443,695	29,630,728.57	

	シンガポールドル 小計			(2,448,090,794)	
	イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	83,370	1,228,873.80	
	イスラエルシェケル 小計		83,370	1,228,873.80	
				(38,058,221)	
	合計		72,619,898	74,345,524,575	
				(74,345,524,575)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 158銘柄	100.0%	72.6%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	7.2%
イギリスポンド	投資証券 27銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券 26銘柄	100.0%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.2%
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

注記表(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11月30日現在)

資産総額	14,826,533円
負債総額	10,228円
純資産総額(-)	14,816,305円
発行済口数	14,254,897口
1口当たり純資産額(/)	1.0394円
(1万口当たり純資産額)	(10,394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11月30日現在)

資産総額	248,303,570,861円
負債総額	1,625,269,764円
純資産総額(-)	246,678,301,097円
発行済口数	162,978,796,591口
1口当たり純資産額(/)	1.5136円
(1万口当たり純資産額)	(15,136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11月30日現在)

資産総額	347,226,781,535円
負債総額	1,678,970,584円
純資産総額(-)	345,547,810,951円
発行済口数	138,639,060,766口
1口当たり純資産額(/)	2.4924円
(1万口当たり純資産額)	(24,924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11月30日現在)

資産総額	51,375,759,882円
負債総額	22,656,848円
純資産総額（ - ）	51,353,103,034円
発行済口数	18,788,284,490口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7333円
（1万口当たり純資産額）	（27,333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11月30日現在)

資産総額	437,226,190,631円
負債総額	8,933,405,784円
純資産総額（ - ）	428,292,784,847円
発行済口数	308,326,950,271口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3891円
（1万口当たり純資産額）	（13,891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11月30日現在)

資産総額	255,374,310,367円
負債総額	485,629,155円
純資産総額（ - ）	254,888,681,212円
発行済口数	93,393,001,356口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7292円
（1万口当たり純資産額）	（27,292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11月30日現在)

資産総額	46,540,307,433円
負債総額	9,324,653円
純資産総額（ - ）	46,530,982,780円
発行済口数	28,214,343,280口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6492円
（1万口当たり純資産額）	（16,492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11月30日現在)

資産総額	108,908,264,979円
負債総額	712,566,674円
純資産総額（ - ）	108,195,698,305円
発行済口数	62,770,079,638口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7237円
（1万口当たり純資産額）	（17,237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11月30日現在)

資産総額	75,468,651,512円
負債総額	2,189,383円
純資産総額（ - ）	75,466,462,129円
発行済口数	41,646,734,170口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8121円
（1万口当たり純資産額）	（18,121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します。）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2018年11月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2019年 2月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年11月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	11,454,354
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	303,466
単位型公社債投資信託	0	0
合計	601	11,757,820

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

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

（単位：千円）

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
	建 物	62,231	千円	63,830
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
長期前払費用償却	4,644	"	-	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日現在)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成30年3月31日現在)

(単位:千円)

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

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

有形固定資産

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

無形固定資産

476,662

投資その他の資産

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

固定資産合計

920,589

資産合計

32,413,396

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

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

中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

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

法人税等合計
中間純利益

730,051

1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

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

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

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

重要な会計方針

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

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

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

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

影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末
（2018年9月30日）

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

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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

(4)投資有価証券

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

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

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

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

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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

（関連情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

（共通支配下の取引等）

1．取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2．実施する会計処理の概要

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

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年2月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2018年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2018年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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 : 2000年6月20日
資本金の額 : 51,000百万円（2018年3月末日現在）
事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）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

2019年1月11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2018年5月11日から2018年11月12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11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。