

【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8月9日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	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 民野 誠
【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。また、消費税率が10%になった場合は、3.3%（税込）となります。

（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 8月10日から2020年 2月10日までとします。

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

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎて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 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ン グ				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

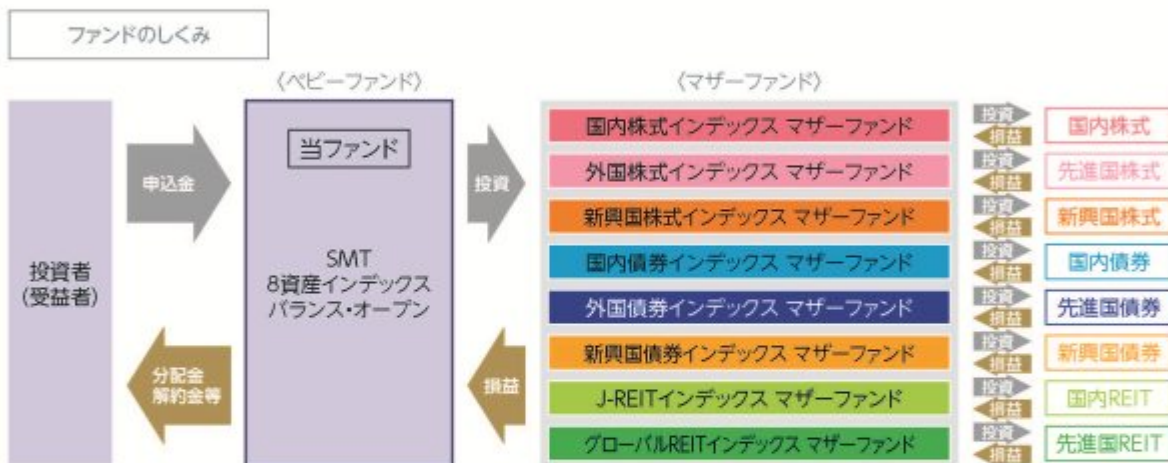
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

< ファンドの特色 >

特色1

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

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「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。

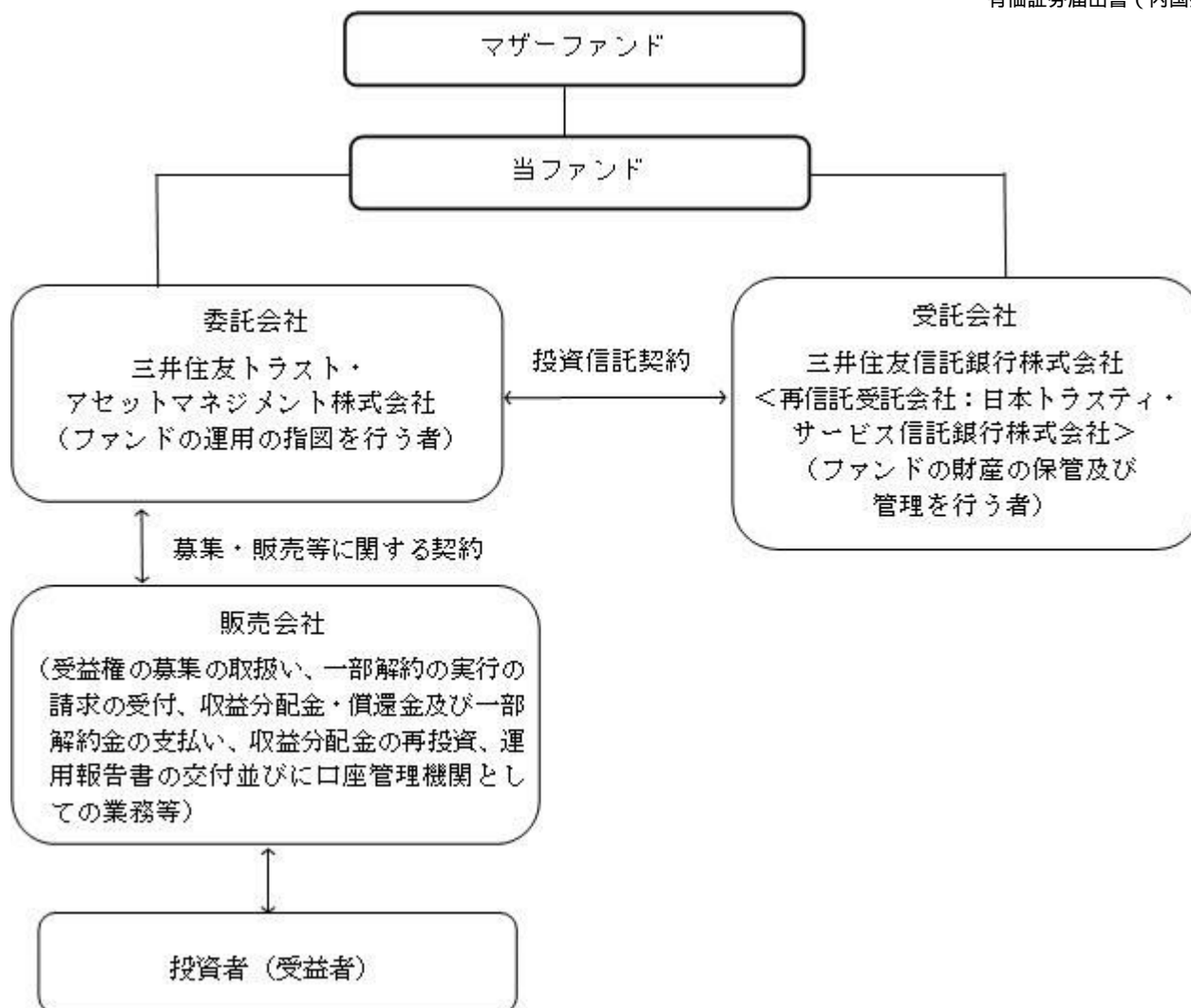
(2) 【ファンドの沿革】

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（2019年 5月31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たがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

なるよう調整を行うこととします。

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

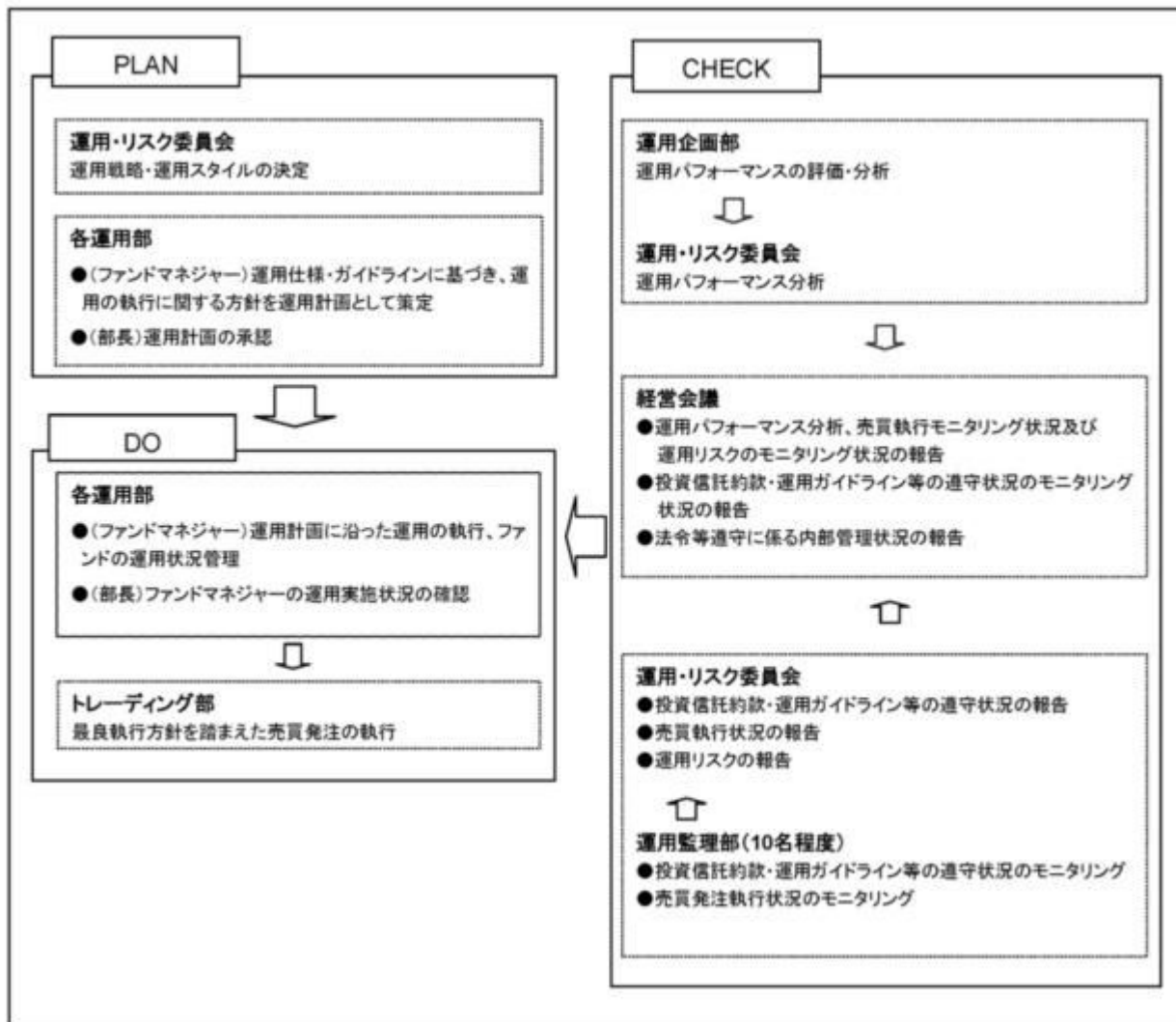
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(3)【運用体制】

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

ることがあります。



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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様はに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

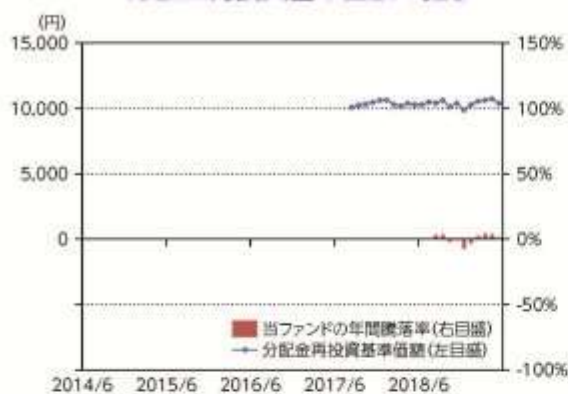
ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

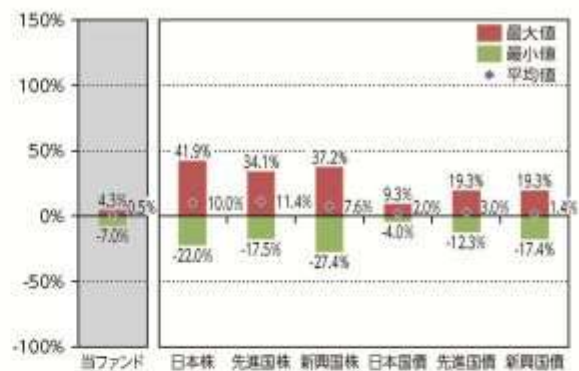
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【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～2019年5月の10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年6月～2019年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

※各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

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

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

- ※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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報告に対しても、責任を負いません。
- ※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また、「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また、「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより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されています。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。

*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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

*消費税率が10%になった場合は、0.55%となります。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 0.22% (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 0.275% (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 0.055% (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、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。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、）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、2019年5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年5月31日現在の状況について記載してあります。

【SMT 8資産インデックスパランス・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	24,188,423	99.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		187,771	0.77
合計(純資産総額)		24,376,194	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	1,720,515	1.8271	3,143,561	1.8575	3,195,856	13.11
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	1,234,900	2.5534	3,153,309	2.4841	3,067,615	12.58
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	1,651,846	1.8697	3,088,620	1.8570	3,067,478	12.58
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	1,116,331	2.7350	3,053,276	2.7402	3,058,970	12.55
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	1,836,495	1.6383	3,008,730	1.6320	2,997,159	12.30
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	2,125,338	1.4245	3,027,753	1.3912	2,956,770	12.13
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	2,073,620	1.4144	2,932,929	1.4221	2,948,895	12.10
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	1,093,535	2.7441	3,000,866	2.6480	2,895,680	11.88

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.23
合計	99.23

(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
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
2018年 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	
12月末日	15,383,985		9,873	
2019年 1月末日	18,719,191		10,292	
2月末日	20,601,752		10,536	
3月末日	21,935,234		10,618	
4月末日	23,547,218		10,731	
5月末日	24,376,194		10,373	

【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
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2

(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
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915

(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	262,942,204,080	98.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,273,750,443	1.97
合計(純資産総額)		268,215,954,523	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	5,617,380,000	2.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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	1,349,600	6,580.44	8,880,969,000	6,384.00	8,615,846,400	3.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	496,600	10,499.29	5,213,950,000	10,250.00	5,090,150,000	1.90
日本	株式	ソニー	電気機器	812,600	5,313.83	4,318,025,300	5,257.00	4,271,838,200	1.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,222,700	505.48	4,156,472,770	501.10	4,120,394,970	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	812,900	4,919.84	3,999,343,800	4,866.00	3,955,571,400	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,057,300	3,849.50	4,070,080,100	3,669.00	3,879,233,700	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	59,400	62,668.04	3,722,482,000	61,510.00	3,653,694,000	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	841,900	3,818.89	3,215,129,700	3,783.00	3,184,907,700	1.19
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,047,300	2,790.99	2,923,007,050	2,788.50	2,920,396,050	1.09
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	829,000	3,612.59	2,994,843,500	3,468.00	2,874,972,000	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,021,700	2,758.69	2,818,557,100	2,651.00	2,708,526,700	1.01
日本	株式	任天堂	その他製品	69,300	38,959.24	2,699,876,000	38,700.00	2,681,910,000	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	16,231,300	155.29	2,520,647,610	153.70	2,494,750,810	0.93
日本	株式	花王	化学	294,000	8,691.42	2,555,278,400	8,480.00	2,493,120,000	0.93
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	108,400	22,789.59	2,470,392,500	22,645.00	2,454,718,000	0.92
日本	株式	三菱商事	卸売業	837,000	2,842.97	2,379,568,000	2,833.00	2,371,221,000	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	427,100	5,552.57	2,371,503,900	5,401.00	2,306,767,100	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	215,400	10,454.52	2,251,905,500	10,310.00	2,220,774,000	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	165,300	13,798.62	2,280,912,000	13,230.00	2,186,919,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	115,100	18,335.36	2,110,400,500	18,475.00	2,126,472,500	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	545,300	3,767.75	2,054,559,200	3,686.00	2,009,975,800	0.75
日本	株式	キャノン	電気機器	652,000	3,075.96	2,005,532,200	3,065.00	1,998,380,000	0.75
日本	株式	日本電産	電気機器	145,800	13,689.65	1,995,952,000	13,590.00	1,981,422,000	0.74
日本	株式	信越化学工業	化学	209,000	9,223.49	1,927,709,800	9,047.00	1,890,823,000	0.70
日本	株式	資生堂	化学	240,700	8,050.36	1,937,723,100	7,833.00	1,885,403,100	0.70

日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	752,500	2,509.95	1,888,744,550	2,495.50	1,877,863,750	0.70
日本	株式	HOYA	精密機器	243,800	7,869.10	1,918,487,600	7,558.00	1,842,640,400	0.69
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	500,000	3,759.73	1,879,868,400	3,666.00	1,833,000,000	0.68
日本	株式	第一三共	医薬品	346,600	5,381.63	1,865,274,200	5,255.00	1,821,383,000	0.68
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	136,800	13,429.47	1,837,152,000	13,250.00	1,812,600,000	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.25
		建設業	2.81
		食料品	4.14
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.17
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.88
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.52
		機械	4.89
		電気機器	12.86
		輸送用機器	7.55
		精密機器	2.08
		その他製品	2.15
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.82
		海運業	0.15
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.96		
卸売業	4.86		
小売業	4.52		
銀行業	5.87		
証券、商品先物取引業	0.74		
保険業	2.27		

	その他金融業	1.09
	不動産業	2.43
	サービス業	5.23
	小計	98.03
合計		98.03

(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	373	円	5,710,776,000	5,617,380,000	2.09

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	211,436,255,547	61.49
	イギリス	20,806,660,609	6.05
	カナダ	12,751,052,637	3.71
	フランス	12,406,604,119	3.61
	スイス	12,303,293,563	3.58
	ドイツ	10,674,163,211	3.10
	オーストラリア	7,987,332,456	2.32
	アイルランド	5,940,221,475	1.73
	オランダ	5,931,750,245	1.73
	スペイン	3,782,922,285	1.10
	香港	3,352,393,328	0.97
	スウェーデン	2,990,678,628	0.87
	イタリア	2,301,221,654	0.67
	デンマーク	2,097,946,435	0.61
	シンガポール	1,469,408,708	0.43
	バミューダ	1,434,723,557	0.42

	フィンランド	1,425,103,298	0.41
	ベルギー	1,212,519,635	0.35
	ノルウェー	814,563,070	0.24
	ジャージー	798,194,083	0.23
	ケイマン	793,795,443	0.23
	イスラエル	710,618,988	0.21
	キュラソー	458,203,925	0.13
	ルクセンブルク	354,292,998	0.10
	ニュージーランド	306,499,077	0.09
	オーストリア	287,598,523	0.08
	パナマ	198,023,106	0.06
	ポルトガル	194,233,043	0.06
	リベリア	186,695,100	0.05
	パプアニューギニア	63,958,532	0.02
	英ヴァージン諸島	42,669,333	0.01
	マン島	34,944,950	0.01
	モーリシャス	8,801,744	0.00
	小計	325,557,343,305	94.68
投資信託受益証券	オーストラリア	165,592,535	0.05
	香港	87,068,403	0.03
	小計	252,660,938	0.07
投資証券	アメリカ	7,273,720,542	2.12
	オーストラリア	624,860,534	0.18
	フランス	398,326,170	0.12
	香港	238,462,519	0.07
	イギリス	222,744,063	0.06
	シンガポール	147,310,373	0.04
	カナダ	64,880,198	0.02
	小計	8,970,304,399	2.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,066,828,086	2.64
合計(純資産総額)		343,847,136,728	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,225,226,137	1.81
	買建	カナダ	342,970,144	0.10
	買建	ドイツ	1,533,425,277	0.45
	買建	イギリス	656,103,135	0.19

買建	オーストラリア	337,959,552	0.10
----	---------	-------------	------

(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		713,966,000	0.21
	売建		85,218,000	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	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	618,610	13,796.85	8,534,874,080	13,749.83	8,505,784,068	2.47
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	402,575	19,491.23	7,846,683,045	19,498.88	7,849,764,837	2.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,539	200,831.98	7,137,367,908	198,632.75	7,059,209,487	2.05
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	203,629	20,156.14	4,104,374,958	20,013.97	4,075,425,430	1.19
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	227,778	14,989.97	3,414,386,571	14,447.54	3,290,833,953	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,644	124,030.64	3,304,672,479	122,259.01	3,257,469,116	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,755	11,867.74	3,284,458,376	11,708.08	3,240,270,123	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,292	124,622.28	3,151,946,746	122,637.39	3,101,745,060	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	358,711	7,940.62	2,848,391,184	7,870.63	2,823,284,858	0.82
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	261,828	10,726.91	2,808,606,753	10,686.71	2,798,080,168	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,028	17,903.32	2,668,096,808	17,799.43	2,652,613,991	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	210,947	11,423.74	2,409,804,863	11,518.88	2,429,875,036	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	109,623	21,839.19	2,394,077,744	21,843.56	2,394,557,279	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	789,496	3,051.14	2,408,865,983	2,970.21	2,344,974,914	0.68

アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	152,138	14,503.32	2,206,506,585	14,457.39	2,199,518,704	0.64
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	374,632	5,897.78	2,209,498,915	5,858.41	2,194,749,803	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	349,784	6,422.71	2,246,562,174	6,214.92	2,173,882,655	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,621	26,471.68	2,160,645,124	26,629.15	2,173,498,668	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	77,757	27,715.10	2,155,043,404	27,798.21	2,161,506,068	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	616,020	3,491.86	2,151,058,554	3,484.20	2,146,342,798	0.62
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	467,485	4,582.18	2,142,102,287	4,582.18	2,142,102,287	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	161,747	12,938.38	2,092,744,409	12,617.95	2,040,916,659	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,597	20,947.90	2,002,557,161	20,896.50	1,997,643,552	0.58
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	220,538	8,777.23	1,935,713,544	8,713.80	1,921,725,083	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	386,406	4,764.81	1,841,153,182	4,891.67	1,890,171,720	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	342,026	5,369.57	1,836,534,601	5,385.97	1,842,145,195	0.54
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	363,409	4,985.72	1,811,856,391	4,926.66	1,790,395,491	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	383,994	4,644.51	1,783,467,505	4,564.68	1,752,812,189	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,639	38,809.67	1,771,234,839	38,261.78	1,746,229,523	0.51
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	184,125	9,612.06	1,769,821,211	9,444.72	1,739,010,396	0.51

(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	5.90
		素材	4.22
		資本財	6.81
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.07
		耐久消費財・アパレル	1.81
		消費者サービス	1.86
		メディア・娯楽	5.90

	小売	4.73
	食品・生活必需品小売り	1.45
	食品・飲料・タバコ	4.91
	家庭用品・パーソナル用品	2.12
	ヘルスケア機器・サービス	4.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.86
	銀行	7.74
	各種金融	4.20
	保険	3.90
	不動産	0.59
	ソフトウェア・サービス	9.39
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.03
	電気通信サービス	2.34
	公益事業	3.40
	半導体・半導体製造装置	2.68
	小計	94.68
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.61
合計		97.36

(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	408	アメリカドル	57,191,809.5	6,254,496,286	56,924,160	6,225,226,137	1.81
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	22	カナダドル	4,286,557	346,353,806	4,244,680	342,970,144	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	37	スイスフラン	3,582,827	389,309,982	3,533,500	383,950,110	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	285	ユーロ	9,504,053.5	1,157,023,473	9,442,050	1,149,475,167	0.33
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	4,533,646	342,380,946	4,475,100	337,959,552	0.10
	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	66	イギリスポンド	4,790,375	660,209,482	4,760,580	656,103,135	0.19

(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	5,005,000.00	548,015,000	547,180,000	0.16
	カナダドル	買建	700,000.00	56,736,400	56,546,000	0.02
	イギリスポンド	買建	800,000.00	110,658,400	110,240,000	0.03
	ユーロ	売建	700,000.00	85,443,400	85,218,000	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。

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	8,012,730,054	15.52
	韓国	6,151,428,809	11.91
	中国	5,760,438,357	11.16
	台湾	5,496,521,104	10.65
	インド	4,908,281,897	9.51
	ブラジル	3,731,635,212	7.23
	南アフリカ	2,815,642,967	5.45
	ロシア	2,008,044,293	3.89
	香港	1,750,519,318	3.39
	タイ	1,454,578,609	2.82
	メキシコ	1,295,892,427	2.51
	マレーシア	1,130,018,201	2.19
	インドネシア	1,054,904,485	2.04
	フィリピン	574,687,644	1.11
	ポーランド	568,543,510	1.10
	カタール	531,810,639	1.03
	バミューダ	511,445,718	0.99
	チリ	471,658,885	0.91
	アラブ首長国連邦	377,949,364	0.73
	トルコ	254,427,086	0.49
コロンビア	208,576,398	0.40	
アメリカ	163,194,612	0.32	

	ハンガリー	160,064,835	0.31
	ギリシャ	152,756,065	0.30
	アルゼンチン	113,407,594	0.22
	チェコ	89,772,760	0.17
	エジプト	64,429,225	0.12
	ルクセンブルク	50,928,098	0.10
	シンガポール	29,991,910	0.06
	マン島	27,986,586	0.05
	ペルー	27,123,959	0.05
	パキスタン	20,718,153	0.04
	小計	49,970,108,774	96.78
投資信託受益証券	アイルランド	564,248,388	1.09
	ブラジル	103,559,173	0.20
	メキシコ	29,544,637	0.06
	小計	697,352,198	1.35
投資証券	南アフリカ	95,602,699	0.19
	メキシコ	43,919,490	0.09
	小計	139,522,189	0.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		826,652,509	1.60
合計(純資産総額)		51,633,635,670	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	772,884,302	1.50

(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		10,197,029	0.02
	売建		1,448,269	0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	513,900	3,916.16	2,012,516,782	4,522.13	2,323,925,690	4.50
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	125,894	16,091.23	2,025,790,550	16,521.01	2,079,896,688	4.03
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,207,389	798.70	1,763,055,721	799.25	1,764,277,732	3.42
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	429,313	4,064.71	1,745,036,939	3,910.34	1,678,761,943	3.25
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	39,483	19,599.87	773,861,975	24,133.78	952,874,067	1.85
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,580,620	89.63	769,117,009	86.42	741,605,825	1.44
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	474,000	1,076.48	510,252,637	1,209.99	573,536,208	1.11
アイルラ ンド	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI SAUDI CAPD USDA		1,100,000	518.28	570,118,833	512.95	564,248,388	1.09
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信 サービス	557,500	1,020.12	568,722,029	976.49	544,397,078	1.05
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	254,198	1,736.16	441,330,230	2,101.00	534,071,269	1.03
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	147,455	2,883.38	425,170,184	3,451.35	508,919,109	0.99
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,109,515	74.71	456,493,186	78.06	476,933,179	0.92
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	442,781	933.62	413,391,845	962.94	426,374,193	0.83
ブラジル	株式	VALE SA	素材	285,178	1,497.39	427,024,824	1,372.77	391,485,086	0.76
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	365,953	823.76	301,460,965	1,018.12	372,584,251	0.72
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	233,869	1,306.85	305,632,171	1,592.28	372,385,306	0.72
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	507,578	494.30	250,899,460	709.96	360,362,675	0.70
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	308,929	1,047.16	323,498,338	1,159.00	358,051,491	0.69
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	38,742	8,261.05	320,049,769	8,759.73	339,369,692	0.66
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	46.69	345,955,532	45.30	335,628,501	0.65
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	24,875	20,045.68	498,636,489	12,228.63	304,187,301	0.59
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	50,048	6,653.62	333,000,544	6,056.20	303,101,198	0.59
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,626,000	187.73	305,264,165	182.05	296,023,706	0.57
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	1,113,248	261.85	291,507,106	253.96	282,724,915	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	80,692	3,016.53	243,410,323	3,391.15	273,638,999	0.53
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	341,340	700.52	239,116,862	717.81	245,019,825	0.47
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信 サービス	3,037,840	81.88	248,748,668	79.01	240,041,611	0.46

韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	73,732	3,414.28	251,741,816	3,165.95	233,432,194	0.45
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	41,282	5,755.56	237,601,045	5,636.24	232,675,260	0.45
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	278,100	769.15	213,901,948	791.93	220,236,428	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.09
		素材	6.97
		資本財	3.19
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	2.42
		耐久消費財・アパレル	1.26
		消費者サービス	1.29
		メディア・娯楽	7.01
		小売	7.90
		食品・生活必需品小売り	1.65
		食品・飲料・タバコ	3.64
		家庭用品・パーソナル用品	1.17
		ヘルスケア機器・サービス	0.74
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.93
		銀行	18.07
		各種金融	2.58
		保険	3.77
		不動産	2.58
		ソフトウェア・サービス	1.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54		
電気通信サービス	4.47		
公益事業	2.57		
半導体・半導体製造装置	4.92		
		小計	96.78
投資信託受益証券			1.35
投資証券			0.27
合計			98.40

(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	142	アメリカドル	7,079,224	774,183,936	7,067,340	772,884,302	1.50

(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	93,268.36	10,221,000	10,197,029	0.02
	ブラジルリアル	売建	52,760.29	1,454,600	1,448,269	0.00

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	385,946,587,000	83.29
地方債証券	日本	25,528,712,926	5.51
特殊債券	日本	31,828,753,559	6.87
社債券	日本	16,145,086,690	3.48
	フランス	1,399,892,000	0.30
	オーストラリア	601,453,000	0.13
	アメリカ	105,528,000	0.02
	イギリス	100,489,000	0.02
	スウェーデン	100,213,000	0.02
	小計	18,452,661,690	3.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,612,808,918	0.35
合計(純資産総額)		463,369,524,093	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138回利付国債(5年)	8,960,000,000	101.35	9,081,497,600	101.37	9,083,289,600	0.100	2023/12/20	1.96
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	101.20	5,971,154,000	101.22	5,972,157,000	0.100	2023/6/20	1.29
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	101.13	5,744,240,800	101.14	5,745,149,600	0.100	2023/3/20	1.24
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.81	5,585,261,800	100.82	5,585,871,200	0.100	2022/3/20	1.21
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.89	4,842,768,000	100.90	4,843,392,000	0.100	2022/6/20	1.05
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	102.02	4,805,518,800	102.02	4,805,424,600	0.100	2028/12/20	1.04
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.50	4,804,234,600	100.50	4,804,091,200	0.100	2021/3/20	1.04
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.98	4,786,546,800	100.99	4,787,210,400	0.100	2022/9/20	1.03
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	103.03	4,708,608,100	1.000	2021/12/20	1.02
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	103.80	4,484,407,500	103.82	4,485,326,400	0.400	2025/9/20	0.97
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	4,120,000,000	101.43	4,179,104,400	101.45	4,179,822,400	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	103.64	4,031,868,300	103.67	4,032,840,800	0.400	2025/6/20	0.87
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	102.13	4,024,276,600	102.18	4,025,970,800	0.100	2028/3/20	0.87
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	102.07	3,970,561,900	102.11	3,972,312,400	0.100	2028/9/20	0.86
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	102.14	3,891,876,900	102.12	3,891,000,600	1.200	2020/12/20	0.84
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	103.72	3,754,953,600	103.74	3,755,677,600	0.500	2024/9/20	0.81
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.35	3,622,779,400	100.35	3,622,671,100	0.100	2020/9/20	0.78
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.65	3,555,400,800	103.67	3,555,915,300	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	103.31	3,543,773,100	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,460,000,000	102.04	3,530,662,400	102.06	3,531,483,600	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	102.78	3,473,997,800	102.80	3,474,809,000	0.300	2024/12/20	0.75
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	3,430,000,000	101.28	3,473,972,600	101.30	3,474,590,000	0.100	2023/9/20	0.75
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	100.66	3,362,077,400	100.65	3,361,943,800	0.100	2021/9/20	0.73
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	3,320,000,000	100.29	3,329,760,800	100.29	3,329,661,200	0.100	2020/7/1	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	102.16	3,279,560,700	102.20	3,280,876,800	0.100	2027/12/20	0.71

日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	102.84	3,229,458,600	102.83	3,228,987,600	1.200	2021/6/20	0.70
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.05	3,203,506,900	101.07	3,203,950,700	0.100	2022/12/20	0.69
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	3,030,000,000	102.11	3,093,963,300	102.14	3,094,963,200	0.100	2026/6/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	120.58	3,062,935,200	120.66	3,064,840,200	1.500	2034/6/20	0.66
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	2,455,000,000	122.69	3,012,039,500	122.75	3,013,708,900	1.700	2033/6/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.29
地方債証券	5.51
特殊債券	6.87
社債券	3.98
合計	99.65

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	144,071,851,566	46.15
	フランス	29,964,959,855	9.60
	イタリア	26,141,589,376	8.37
	ドイツ	19,850,149,554	6.36
	イギリス	19,640,093,511	6.29
	スペイン	17,645,296,413	5.65
	ベルギー	7,472,385,070	2.39
	オーストラリア	6,103,479,747	1.96
	オランダ	5,974,653,204	1.91

	カナダ	5,914,950,890	1.89
	オーストリア	4,432,475,616	1.42
	メキシコ	2,462,552,369	0.79
	アイルランド	2,141,575,339	0.69
	ポーランド	1,811,363,457	0.58
	フィンランド	1,794,579,589	0.57
	南アフリカ	1,655,541,702	0.53
	デンマーク	1,551,628,656	0.50
	マレーシア	1,382,247,753	0.44
	シンガポール	1,224,783,913	0.39
	スウェーデン	1,067,592,714	0.34
	ノルウェー	741,403,053	0.24
	小計	303,045,153,347	97.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,108,520,852	2.92
合計(純資産総額)		312,153,674,199	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	2,036,355,864	0.65
	買建	ドイツ	2,469,447,812	0.79

(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		6,005,109,300	1.92

(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	10,806.56	1,891,148,378	10,821.94	1,893,839,659	1.750	2023/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,254.68	1,879,531,882	11,283.73	1,884,383,023	2.625	2025/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,499.03	1,830,646,081	11,543.46	1,837,718,939	2.875	2028/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,517.35	1,735,363,781	10,643.80	1,756,227,618	2.500	2046/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,490.91	1,723,637,489	11,518.68	1,727,802,563	3.000	2025/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,510.52	1,681,683,400	10,636.96	1,701,915,000	2.500	2046/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,738.25	1,690,309,178	11,784.39	1,696,952,798	3.125	2028/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,053.90	1,658,085,563	11,065.86	1,659,879,750	2.500	2022/1/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,495.61	1,639,274,795	11,536.62	1,645,122,821	2.875	2028/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,955.65	1,605,002,824	10,993.24	1,610,510,125	2.250	2027/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,872.34	1,592,799,141	10,886.44	1,594,864,375	1.875	2022/10/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	10,955.65	1,528,313,269	10,957.14	1,528,521,831	2.500	2020/5/31	0.49
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000	13,307.70	1,443,885,856	13,306.42	1,443,747,164	3.250	2021/10/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/31/20	13,000,000	11,034.89	1,434,536,209	11,041.08	1,435,341,463	2.875	2020/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/20	12,700,000	10,979.57	1,394,405,793	10,982.34	1,394,758,428	2.625	2020/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/23	12,680,000	10,963.76	1,390,205,676	10,979.14	1,392,155,701	2.125	2023/11/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,088.93	1,386,116,647	11,108.15	1,388,519,573	2.375	2024/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,444.73	1,378,704,944	10,478.90	1,383,216,044	1.500	2026/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/15/21	12,250,000	11,134.64	1,363,993,664	11,146.17	1,365,406,590	2.875	2021/10/15	0.44
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000	13,180.24	1,343,066,657	13,175.25	1,342,558,039	3.250	2021/7/4	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,848.85	1,334,409,011	10,876.19	1,337,771,831	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	11,327.30	1,302,639,930	11,452.89	1,317,083,146	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,935.57	1,312,268,741	10,960.34	1,315,241,959	2.125	2025/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	10,780.07	1,309,779,305	10,793.74	1,311,440,210	1.625	2022/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,000,000	10,913.78	1,309,654,349	10,927.45	1,311,294,749	2.000	2023/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 01/31/22	12,000,000	10,880.03	1,305,604,610	10,892.42	1,307,091,232	1.875	2022/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/23	11,500,000	11,201.71	1,288,196,728	11,217.94	1,290,063,531	2.625	2023/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/23	11,500,000	11,020.15	1,267,317,929	11,036.81	1,269,233,868	2.250	2023/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/15/21	11,500,000	10,982.77	1,263,019,354	10,992.17	1,264,100,145	2.375	2021/4/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	11,313.63	1,233,186,078	11,443.49	1,247,341,363	2.875	2045/8/15	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	97.08
合計	97.08

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

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	71	アメリカドル	8,286,840.31	906,248,857	8,297,570.49	907,422,309	0.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	42	アメリカドル	5,280,980.76	577,528,055	5,292,656.46	578,804,910	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	33	アメリカドル	4,998,918.25	546,681,700	5,030,437.5	550,128,645	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	37	ユーロ	4,146,238	504,763,013	4,146,405	504,783,344	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	39	ユーロ	5,216,442	635,049,649	5,218,200	635,263,668	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	65	ユーロ	10,907,906	1,327,928,477	10,920,000	1,329,400,800	0.43

(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	27,730,000.00	3,027,215,780	3,028,947,900	0.97
	カナダドル	買建	2,860,000.00	231,444,295	230,887,800	0.07
	ユーロ	買建	19,280,000.00	2,353,068,318	2,347,147,200	0.75
	イギリスポンド	買建	2,890,000.00	399,464,942	398,126,400	0.13

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	ブラジル	4,792,817,924	10.06
	インドネシア	4,706,625,485	9.88
	メキシコ	4,636,102,557	9.73
	ポーランド	4,303,317,735	9.03
	タイ	4,129,082,626	8.67
	南アフリカ	3,972,526,715	8.34
	ロシア	3,647,005,827	7.66
	コロンビア	3,235,002,078	6.79

	マレーシア	2,850,620,718	5.98
	ハンガリー	2,113,982,880	4.44
	チェコ	2,090,961,511	4.39
	トルコ	1,732,783,765	3.64
	ペルー	1,675,266,984	3.52
	チリ	1,503,231,322	3.16
	フィリピン	139,445,583	0.29
	ウルグアイ	100,056,468	0.21
	ドミニカ共和国	44,136,745	0.09
	小計	45,672,966,923	95.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,968,698,352	4.13
合計(純資産総額)		47,641,665,275	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		3,677,817	0.01
	売建		3,630,544	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。

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	54,050,000,000	4.01	2,167,520,954	4.01	2,169,809,549	9.850	2027/6/28	4.55
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	9,530,000,000	15.87	1,512,560,112	15.77	1,503,231,322	5.500	2020/8/5	3.16
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,436.16	914,778,717	2,569.34	964,787,493	0.000	2020/7/1	2.03
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000	2,813.01	805,929,702	2,946.38	844,140,286	10.000	2023/1/1	1.77
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.07	726,116,194	3.12	739,859,209	4.375	2023/3/21	1.55
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000	795.33	691,545,599	820.04	713,030,997	10.500	2026/12/21	1.50
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	23,800,000	2,854.10	679,276,430	2,878.72	685,135,703	10.000	2021/1/1	1.44
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	351.76	619,459,128	372.24	655,530,982	3.400	2036/6/17	1.38

ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,872.07	607,444,853	2,893.39	611,953,626	2.500	2023/1/25	1.28
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	18,600,000	2,812.82	523,185,677	2,975.86	553,511,515	10.000	2025/1/1	1.16
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	361.97	495,537,697	380.72	521,208,418	3.650	2031/6/20	1.09
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	77,450,000	652.85	505,633,349	661.33	512,205,166	8.750	2048/2/28	1.08
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	597.02	491,050,785	618.50	508,721,423	10.000	2024/12/5	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	534.77	490,387,675	548.26	502,758,748	6.500	2021/6/10	1.06
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	15,700,000	2,738.60	429,960,596	2,990.28	469,474,545	10.000	2027/1/1	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000	518.11	441,952,673	548.19	467,609,883	7.500	2027/6/3	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	525.84	426,982,894	542.92	440,853,403	6.500	2022/6/9	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	76,100,000	557.89	424,559,921	562.61	428,148,173	8.000	2020/6/11	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,950,000	2,739.59	409,569,071	2,841.26	424,768,923	2.500	2026/7/25	0.89
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000	2,122.65	378,893,312	2,295.10	409,675,446	0.000	2022/1/1	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000	2,853.21	399,449,635	2,872.83	402,197,103	2.250	2022/4/25	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	403.95	383,754,704	417.09	396,243,366	4.875	2029/6/22	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000	2,707.57	379,059,904	2,819.62	394,747,354	2.500	2027/7/25	0.83
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	67,600,000	546.74	369,596,394	567.35	383,534,461	8.000	2023/12/7	0.81
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,910.66	369,654,750	2,986.31	379,261,862	3.250	2025/7/25	0.80
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000	0.76	370,696,962	0.78	377,577,014	8.375	2024/3/15	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	102,100,000	360.04	367,600,884	359.28	366,830,638	3.650	2021/12/17	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000	650.62	348,082,128	661.42	353,864,413	8.750	2044/1/31	0.74
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	14,600,000	2,232.26	325,910,757	2,390.45	349,005,865	0.000	2021/7/1	0.73
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.76	346,440,870	0.77	348,793,830	8.375	2026/9/15	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.87
合計	95.87

(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	33,639.60	3,696,156	3,677,817	0.01
	ロシアルーブル	売建	2,187,075.00	3,696,156	3,630,544	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。

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	110,265,545,250	97.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,709,564,035	2.40
合計(純資産総額)		112,975,109,285	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	2,595,618,000	2.30

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,208	682,111.79	7,645,108,942	742,000	8,316,336,000	7.36
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,574	611,238.73	7,074,477,061	645,000	7,465,230,000	6.61
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,013	147,521.09	5,312,677,014	168,400	6,064,589,200	5.37
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,876	215,204	4,707,802,704	218,600	4,782,093,600	4.23
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,528	177,151.08	4,522,312,770	179,000	4,569,512,000	4.04

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,062	178,163.87	4,108,815,169	194,600	4,487,865,200	3.97
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,530	247,676.8	3,846,420,704	256,600	3,984,998,000	3.53
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,526	238,922.75	3,709,514,616	236,100	3,665,688,600	3.24
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,280	298,319.8	3,365,047,344	314,000	3,541,920,000	3.14
日本	投資証券	G L P投資法人	28,681	112,958.74	3,239,769,621	120,800	3,464,664,800	3.07
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,327	417,651.95	3,060,135,837	464,000	3,399,728,000	3.01
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,257	80,535.66	3,000,517,084	88,100	3,282,341,700	2.91
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	6,081	480,426.14	2,921,471,357	469,500	2,855,029,500	2.53
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,581	726,629.33	2,602,059,630	747,000	2,675,007,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,863	71,295.16	2,129,087,363	81,100	2,421,889,300	2.14
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,931	46,708.6	1,865,121,106	57,800	2,308,011,800	2.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,846	526,656.07	2,025,519,245	573,000	2,203,758,000	1.95
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,672	723,083.95	1,932,080,314	751,000	2,006,672,000	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,274	139,564.15	1,852,574,527	149,500	1,984,463,000	1.76
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,205	114,354.72	1,624,408,797	130,100	1,848,070,500	1.64
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,563	228,530.88	1,728,379,045	241,800	1,828,733,400	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,937	442,790.63	1,743,266,710	458,500	1,805,114,500	1.60
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,357	165,370.46	1,547,371,394	179,800	1,682,388,600	1.49
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,365	149,338.26	1,547,891,064	161,200	1,670,838,000	1.48
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,881	126,645.19	1,504,671,502	136,000	1,615,816,000	1.43
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,736	371,401.59	1,387,556,340	424,500	1,585,932,000	1.40
日本	投資証券	プレミアム投資法人	11,005	123,503.96	1,359,161,079	138,500	1,524,192,500	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,800	276,656.39	1,327,950,672	297,500	1,428,000,000	1.26
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,272	163,038.4	1,348,653,644	172,500	1,426,920,000	1.26
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,760	161,998.35	1,257,107,196	177,100	1,374,296,000	1.22

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	97.60
合計	97.60

(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	1,354	円	2,490,601,760	2,595,618,000	2.30

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	54,874,367,724	72.58
	オーストラリア	5,161,041,616	6.83
	イギリス	3,633,059,658	4.80
	フランス	2,979,584,905	3.94
	シンガポール	2,831,935,607	3.75
	香港	1,869,212,509	2.47
	カナダ	1,462,146,139	1.93
	ベルギー	700,295,300	0.93
	スペイン	528,257,924	0.70
	ニュージーランド	352,838,407	0.47
	オランダ	209,565,477	0.28
	ドイツ	209,417,586	0.28
	アイルランド	190,493,166	0.25
	ガーンジー	142,442,483	0.19
	イスラエル	52,938,912	0.07
	イタリア	24,969,519	0.03
	マン島	23,364,790	0.03
	韓国	10,276,717	0.01
	小計	75,256,208,439	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		353,791,621	0.47
合計(純資産総額)		75,610,000,060	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		101,129,800	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	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	177,980	20,575.47	3,662,022,186	17,831.14	3,173,587,721	4.20
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	363,000	7,376.33	2,677,608,516	8,018.27	2,910,633,898	3.85
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	86,390	22,569.71	1,949,797,834	25,509.31	2,203,749,602	2.91
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	222,630	7,630.39	1,698,755,640	8,831.91	1,966,248,925	2.60
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	214,510	7,399.39	1,587,245,225	8,291.67	1,778,647,247	2.35
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,020	20,028.80	1,602,704,707	22,024.01	1,762,361,312	2.33
香港	投資証券	LINK REIT	1,221,500	1,014.70	1,239,461,447	1,328.48	1,622,740,763	2.15
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	120,800	12,115.78	1,463,586,588	12,873.85	1,555,162,191	2.06
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	205,190	6,569.25	1,347,945,474	7,016.53	1,439,723,350	1.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	175,060	6,895.33	1,207,096,691	7,569.89	1,325,186,554	1.75
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	79,310	19,624.48	1,556,418,143	16,428.81	1,302,969,159	1.72
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	88,840	13,586.88	1,207,058,987	14,305.38	1,270,890,101	1.68
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	37,970	27,786.18	1,055,041,589	31,217.90	1,185,343,876	1.57
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	13,707.10	890,139,591	15,916.25	1,033,601,561	1.37
アメリカ	投資証券	HCP INC	273,990	3,153.94	864,148,678	3,433.90	940,855,357	1.24
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	919,750	789.93	726,546,580	1,002.90	922,422,426	1.22
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	97,520	7,276.32	709,587,381	8,976.26	875,365,733	1.16
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,056,490	304.34	930,229,283	286.22	874,831,013	1.16
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	430,670	2,068.80	890,970,839	2,012.22	866,604,510	1.15
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	74,220	9,986.49	741,197,349	11,554.97	857,610,437	1.13
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,170	10,998.33	716,761,505	12,394.86	807,773,183	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	157,830	4,467.35	705,082,798	4,835.89	763,249,971	1.01
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	99,150	7,661.76	759,663,663	7,266.97	720,520,274	0.95
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	96,960	7,132.45	691,563,244	7,141.20	692,411,528	0.92
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	209,860	3,130.47	656,960,622	3,280.80	688,508,688	0.91
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	50,370	11,385.44	573,484,833	13,510.33	680,515,544	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,570	10,779.13	566,659,147	12,901.19	678,216,042	0.90
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,700	10,167.59	566,335,009	11,176.59	622,536,174	0.82
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,270	14,081.77	609,318,341	14,285.69	618,142,101	0.82
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	631,010	874.34	551,722,736	955.64	603,020,845	0.80

(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	99.53
合計	99.53

(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

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	925,000.00	101,349,800	101,129,800	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。

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：2019年5月31日

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,373円
純資産総額	0.24億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2017年11月	2018年5月	2018年11月	2019年5月	-
分配金	0円	0円	0円	0円	-

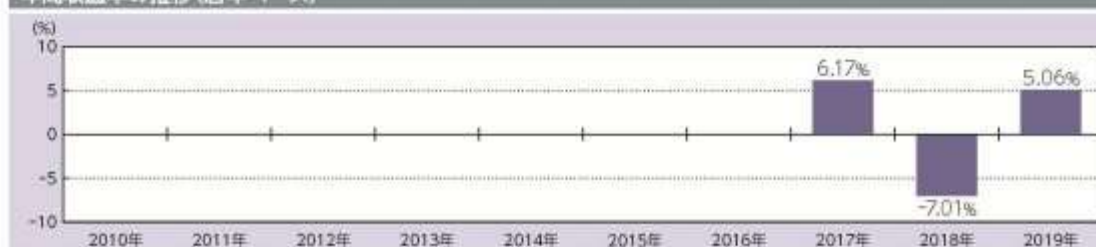
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
J-REIT インデックス マザーファンド	13.1%	日本ビルファンド投資法人 フューチャリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.0%
外国株式 インデックス マザーファンド	12.6%	MICROSOFT CORP APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス テクノロジー・ソフトウェア開発	-	-	0.3%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	12.6%	SIMON PROPERTY GROUP PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	12.5%	T 2.625% 12/31/25 T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	2.625% 1.750%	2025/12/31 2023/05/15	0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	12.3%	COLOM 9.85% 06/28/27 CHILE 5.5% 08/05/20	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.6%
国内株式 インデックス マザーファンド	12.1%	トヨタ自動車 ソフトバンクグループ	日本	株式	輸送用機器 情報・通信業	-	-	0.4%
国内債券 インデックス マザーファンド	12.1%	第138回利付国債(5年) 第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20 2023/06/20	0.2%
新興国株式 インデックス マザーファンド	11.9%	TENCENT HOLDINGS LTD ALIBABA GROUP HOLDING SPACR	ケイマン島	株式	メディア・娯楽 小売	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンDには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（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え、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に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、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4期計算期間(2018年11月13日から2019年5月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2018年11月12日現在)	第4期 (2019年5月10日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	22,555	-
コール・ローン	154,168	232,317
親投資信託受益証券	14,059,261	23,295,072
流動資産合計	14,235,984	23,527,389
資産合計	14,235,984	23,527,389
負債の部		
流動負債		
未払解約金	301	395
未払受託者報酬	2,964	4,983
未払委託者報酬	26,589	44,793
その他未払費用	222	454
流動負債合計	30,076	50,625
負債合計	30,076	50,625
純資産の部		
元本等		
元本	13,730,817	22,420,915
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	475,091	1,055,849
(分配準備積立金)	234,270	462,609
元本等合計	14,205,908	23,476,764
純資産合計	14,205,908	23,476,764
負債純資産合計	14,235,984	23,527,389

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2018年5月11日 至 2018年11月12日	自	2018年11月13日 至 2019年5月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		44,587		365,051
営業収益合計		44,587		365,051
営業費用				
支払利息		-		35
受託者報酬		2,964		4,983
委託者報酬		26,589		44,793
その他費用		222		454
営業費用合計		29,775		50,265
営業利益又は営業損失（ ）		74,362		314,786
経常利益又は経常損失（ ）		74,362		314,786
当期純利益又は当期純損失（ ）		74,362		314,786
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（ ）		7,586		43,929
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		335,399		475,091
剰余金増加額又は欠損金減少額		254,246		349,356
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		254,246		349,356
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,778		39,455
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,778		39,455
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		475,091		1,055,849

(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、前計算期間末日が休業日のため、第4期計算期間は2018年11月13日から2019年 5月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 (2018年11月12日現在)	第4期 (2019年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,730,817口	22,420,915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) 1.0346円 (10,346円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0471円 (10,471円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 5月11日 至 2018年11月12日	第4期 自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>137,116円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>348,929円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>97,154円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>583,199円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,730,817口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>424円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			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	収益調整金額	C	348,929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	583,199円	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	424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	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>242,777円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>746,379円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>219,832円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,208,988円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>22,420,915口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>539円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	242,777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	746,379円	分配準備積立金額	D	219,832円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,208,988円	当ファンドの期末残存口数	F	22,420,915口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	539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
項目																																																													
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																																																											
収益調整金額	C	348,929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	583,199円																																																											
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	424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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	242,777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	746,379円																																																											
分配準備積立金額	D	219,832円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,208,988円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	22,420,915口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	539円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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4期 (2019年 5月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第3期	第4期
	自 2018年 5月11日 至 2018年11月12日	自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,106,595円	13,730,817円
期中追加設定元本額	6,807,776円	9,998,798円
期中一部解約元本額	1,183,554円	1,308,700円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	(2018年11月12日現在)	(2019年 5月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	38,724	334,871
合計	38,724	334,871

（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	1,644,544	3,002,608	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,577,322	2,947,699	
	新興国株式インデックス マザーファンド	1,041,247	2,860,617	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,025,992	2,887,241	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,179,420	3,012,592	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,982,091	2,803,667	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,064,887	2,912,465	
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,750,707	2,868,183	
合計		12,266,210	23,295,072	

(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

	2019年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,723,766,885
株式	264,183,767,920
派生商品評価勘定	59,460
未収入金	1,573,052
未収配当金	3,118,558,221
前払金	191,610,300
差入委託証拠金	182,926,090
流動資産合計	271,402,261,928
資産合計	271,402,261,928
負債の部	

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	191,697,840
未払金	1,093,668,840
未払解約金	89,526,637
未払利息	5,218
その他未払費用	19,562
流動負債合計	1,374,918,097
負債合計	1,374,918,097
純資産の部	
元本等	
元本	189,478,719,904
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,548,623,927
元本等合計	270,027,343,831
純資産合計	270,027,343,831
負債純資産合計	271,402,261,928

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		189,478,719,904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)	1.4251円 (14,251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

	2019年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

	2019年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2019年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	159,356,089,061円
期中追加設定元本額	38,185,332,822円
期中一部解約元本額	8,062,701,979円
期末元本額	189,478,719,904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）	616,336,060円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,969,868,632円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,954,537円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,768,471,325円
世界経済インデックスファンド	1,981,594,978円
日本株式インデックス・オープン	5,502,211,364円
DCマイセレクション25	6,671,930,086円

区分	2019年 5月10日現在
DCマイセレクション50	19,080,444,778円
DCマイセレクション75	17,590,760,468円
DC日本株式インデックス・オープン	5,519,672,922円
DCマイセレクションS25	2,693,458,414円
DCマイセレクションS50	7,714,000,963円
DCマイセレクションS75	5,100,196,988円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,287,008,101円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	374,303,237円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	634,115,150円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	416,941,999円
DC世界経済インデックスファンド	1,746,122,514円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,107,390,288円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	17,397,189円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	43,826,513円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	41,876,524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）	308,931,662円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,717,839円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	109,822,874円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	387,288,339円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	63,109,636円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	559,331,949円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,933,692,735円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	764,445,345円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,426,437,443円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	669,437,707円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,570,713円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	859,792,639円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,847,094円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	485,373,654円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	606,988,952円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	56,382,579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）	910,491,068円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,163,043,332円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,310,560,311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	1,010,794,099円
分散投資コア戦略ファンドS	2,122,008,187円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	230,288,725円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	261,853,223円
コア投資戦略ファンド（切替型）	792,730,531円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	223,528,402円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,110,454円

区分	2019年 5月10日現在
SMT インデックスバランス・オープン	75,776,973円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,785,336,789円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	673,595,588円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,371,124円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	52,749,742円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	7,548,251円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,025,992円
グローバル経済コア	318,968,154円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,629,171円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	43,354,876円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	890,404円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,896,111円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,502,029円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,834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）	50,488,568,352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）	654,462,222円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	26,779,857,826
合計	26,779,857,826

(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

（2019年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,981,130,300	-	5,789,520,000	191,610,300
合計		5,981,130,300	-	5,789,520,000	191,610,300

(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	5,200	2,690.00	13,988,000	
日本水産	161,300	718.00	115,813,400	
マルハニチロ	23,300	3,410.00	79,453,000	
カネコ種苗	4,900	1,318.00	6,458,200	
サカタのタネ	19,600	3,380.00	66,248,000	
ホクト	13,500	1,857.00	25,069,500	
ホクリヨウ	2,200	613.00	1,348,600	
住石ホールディングス	34,700	111.00	3,851,700	
日鉄鉱業	3,700	4,135.00	15,299,500	
三井松島ホールディングス	6,800	1,214.00	8,255,200	
国際石油開発帝石	647,100	1,000.00	647,100,000	
石油資源開発	23,200	2,356.00	54,659,200	
K&Oエナジーグループ	7,900	1,572.00	12,418,800	
ヒノキヤグループ	4,500	2,122.00	9,549,000	
ショーボンドホールディングス	11,500	7,160.00	82,340,000	
ミライト・ホールディングス	45,400	1,626.00	73,820,400	
タマホーム	7,800	1,100.00	8,580,000	
サンヨーホームズ	2,300	734.00	1,688,200	
日本アクア	5,100	595.00	3,034,500	
ファーストコーポレーション	5,000	902.00	4,510,000	
ベステラ	3,100	1,305.00	4,045,500	
TATERU	14,200	254.00	3,606,800	
スペースバリューホールディングス	19,700	562.00	11,071,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	601.00	1,863,100	
第一カッター興業	2,000	1,737.00	3,474,000	
安藤・間	104,200	723.00	75,336,600	
東急建設	48,200	709.00	34,173,800	
コムシスホールディングス	57,200	2,820.00	161,304,000	
ミサワホーム	13,600	995.00	13,532,000	
ビーアールホールディングス	17,600	313.00	5,508,800	
高松コンストラクショングループ	10,300	2,209.00	22,752,700	

東建コーポレーション	5,100	6,160.00	31,416,000
ソネック	1,700	700.00	1,190,000
ヤマウラ	6,900	886.00	6,113,400
大成建設	132,600	4,835.00	641,121,000
大林組	399,700	1,019.00	407,294,300
清水建設	407,700	981.00	399,953,700
飛鳥建設	11,900	1,363.00	16,219,700
長谷工コーポレーション	166,800	1,216.00	202,828,800
松井建設	15,500	666.00	10,323,000
銭高組	1,600	4,995.00	7,992,000
鹿島建設	312,300	1,576.00	492,184,800
不動テトラ	9,500	1,436.00	13,642,000
大末建設	5,400	977.00	5,275,800
鉄建建設	8,300	2,803.00	23,264,900
西松建設	29,000	2,325.00	67,425,000
三井住友建設	95,800	704.00	67,443,200
大豊建設	9,200	2,885.00	26,542,000
前田建設工業	95,500	1,023.00	97,696,500
佐田建設	10,200	354.00	3,610,800
ナカノフドー建設	11,500	456.00	5,244,000
奥村組	22,100	3,650.00	80,665,000
東鉄工業	16,000	3,005.00	48,080,000
イチケン	2,700	1,805.00	4,873,500
富士ピー・エス	5,500	410.00	2,255,000
浅沼組	5,000	2,330.00	11,650,000
戸田建設	155,600	634.00	98,650,400
熊谷組	19,200	3,190.00	61,248,000
青木あすなる建設	7,200	822.00	5,918,400
北野建設	3,000	2,847.00	8,541,000
植木組	1,900	2,240.00	4,256,000
矢作建設工業	18,200	716.00	13,031,200
ピーエス三菱	15,000	622.00	9,330,000
日本ハウスホールディングス	25,600	420.00	10,752,000
大東建託	47,500	12,810.00	608,475,000
新日本建設	16,500	880.00	14,520,000
N I P P O	35,200	2,164.00	76,172,800
東亜道路工業	2,500	2,665.00	6,662,500
前田道路	41,700	2,075.00	86,527,500
日本道路	3,600	6,270.00	22,572,000
東亜建設工業	9,700	1,554.00	15,073,800
日本国土開発	21,700	736.00	15,971,200
若築建設	6,700	1,325.00	8,877,500

東洋建設	48,900	380.00	18,582,000
五洋建設	158,200	510.00	80,682,000
世紀東急工業	19,500	600.00	11,700,000
福田組	4,400	4,360.00	19,184,000
住友林業	94,700	1,447.00	137,030,900
日本基礎技術	13,600	349.00	4,746,400
巴コーポレーション	18,200	337.00	6,133,400
大和ハウス工業	368,700	3,006.00	1,108,312,200
ライト工業	25,600	1,363.00	34,892,800
積水ハウス	407,900	1,750.00	713,825,000
日特建設	11,400	591.00	6,737,400
北陸電気工事	6,500	869.00	5,648,500
ユアテック	21,400	745.00	15,943,000
四電工	2,000	2,633.00	5,266,000
中電工	17,200	2,278.00	39,181,600
関電工	60,600	889.00	53,873,400
きんでん	88,500	1,669.00	147,706,500
東京エネシス	13,800	938.00	12,944,400
トーエネック	3,700	3,015.00	11,155,500
住友電設	9,200	1,830.00	16,836,000
日本電設工業	22,700	2,277.00	51,687,900
協和エクシオ	52,100	2,897.00	150,933,700
新日本空調	11,500	1,697.00	19,515,500
九電工	26,200	3,245.00	85,019,000
三機工業	30,600	1,157.00	35,404,200
日揮	115,000	1,346.00	154,790,000
中外炉工業	4,100	1,740.00	7,134,000
ヤマト	13,300	498.00	6,623,400
太平電業	9,000	2,388.00	21,492,000
高砂熱学工業	32,700	1,686.00	55,132,200
三晃金属工業	1,800	2,599.00	4,678,200
朝日工業社	3,000	2,850.00	8,550,000
明星工業	24,200	696.00	16,843,200
大気社	18,300	3,065.00	56,089,500
ダイダン	9,100	2,366.00	21,530,600
日比谷総合設備	12,000	1,758.00	21,096,000
東芝プラントシステム	29,100	1,965.00	57,181,500
OSJBホールディングス	59,100	254.00	15,011,400
東洋エンジニアリング	10,100	538.00	5,433,800
新興プランテック	24,000	1,185.00	28,440,000
日本製粉	37,800	1,803.00	68,153,400
日清製粉グループ本社	134,700	2,494.00	335,941,800

日東富士製粉	900	6,080.00	5,472,000
昭和産業	10,900	2,945.00	32,100,500
鳥越製粉	10,600	723.00	7,663,800
中部飼料	14,600	1,117.00	16,308,200
フィード・ワン	80,400	162.00	13,024,800
東洋精糖	1,800	960.00	1,728,000
日本甜菜製糖	6,800	1,856.00	12,620,800
三井製糖	9,400	2,549.00	23,960,600
塩水港精糖	12,900	220.00	2,838,000
日新製糖	5,600	1,869.00	10,466,400
森永製菓	30,000	4,345.00	130,350,000
中村屋	3,100	4,265.00	13,221,500
江崎グリコ	35,800	5,550.00	198,690,000
名糖産業	5,800	1,388.00	8,050,400
井村屋グループ	5,100	2,261.00	11,531,100
不二家	6,700	1,956.00	13,105,200
山崎製パン	97,500	1,696.00	165,360,000
第一屋製パン	2,100	992.00	2,083,200
モロゾフ	2,000	4,940.00	9,880,000
亀田製菓	7,400	4,900.00	36,260,000
寿スピリッツ	12,600	4,660.00	58,716,000
カルビー	54,300	2,889.00	156,872,700
森永乳業	23,900	3,595.00	85,920,500
六甲バター	8,700	2,050.00	17,835,000
ヤクルト本社	88,300	7,020.00	619,866,000
明治ホールディングス	84,500	8,220.00	694,590,000
雪印メグミルク	28,700	2,316.00	66,469,200
プリマハム	16,800	1,921.00	32,272,800
日本ハム	49,400	4,420.00	218,348,000
林兼産業	4,000	571.00	2,284,000
丸大食品	12,700	1,840.00	23,368,000
S Foods	10,700	3,755.00	40,178,500
伊藤ハム米久ホールディングス	76,800	675.00	51,840,000
サッポロホールディングス	43,600	2,202.00	96,007,200
アサヒグループホールディングス	249,700	4,628.00	1,155,611,600
キリンホールディングス	539,300	2,254.00	1,215,582,200
宝ホールディングス	89,300	1,186.00	105,909,800
オエノンホールディングス	34,000	386.00	13,124,000
養命酒製造	3,700	1,992.00	7,370,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	91,300	2,696.00	246,144,800
サントリー食品インターナショナル	79,800	4,640.00	370,272,000
ダイドーグループホールディングス	6,700	4,695.00	31,456,500

伊藤園	36,200	5,250.00	190,050,000
キーコーヒー	11,700	2,038.00	23,844,600
ユニカフェ	3,300	985.00	3,250,500
ジャパンフーズ	1,700	1,068.00	1,815,600
日清オイリオグループ	15,300	3,070.00	46,971,000
不二製油グループ本社	29,100	3,470.00	100,977,000
かどや製油	1,300	5,090.00	6,617,000
J・オイルミルズ	6,200	3,825.00	23,715,000
キッコーマン	78,600	4,920.00	386,712,000
味の素	263,300	1,865.50	491,186,150
キューピー	66,400	2,451.00	162,746,400
ハウス食品グループ本社	44,600	4,385.00	195,571,000
カゴメ	47,800	2,677.00	127,960,600
焼津水産化学工業	5,800	1,097.00	6,362,600
アリアケジャパン	10,900	6,340.00	69,106,000
ピエトロ	1,600	1,615.00	2,584,000
エバラ食品工業	2,900	2,092.00	6,066,800
ニチレイ	61,900	2,527.00	156,421,300
東洋水産	61,300	4,035.00	247,345,500
イトアンド	4,100	1,603.00	6,572,300
大冷	1,300	1,789.00	2,325,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	883.00	2,913,900
日清食品ホールディングス	50,700	6,890.00	349,323,000
永谷園ホールディングス	6,400	2,052.00	13,132,800
一正蒲鉾	4,700	1,110.00	5,217,000
フジッコ	12,900	2,130.00	27,477,000
ロック・フィールド	12,900	1,601.00	20,652,900
日本たばこ産業	688,400	2,470.00	1,700,348,000
ケンコーマヨネーズ	6,700	2,162.00	14,485,400
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,685.00	13,143,000
なとり	6,700	1,596.00	10,693,200
イフジ産業	2,100	660.00	1,386,000
ピククルスコーポレーション	2,800	1,976.00	5,532,800
北の達人コーポレーション	47,000	516.00	24,252,000
ユーグレナ	50,800	733.00	37,236,400
ミヨシ油脂	4,600	1,117.00	5,138,200
理研ビタミン	5,600	3,430.00	19,208,000
片倉工業	14,400	1,217.00	17,524,800
ゲンゼ	7,800	4,465.00	34,827,000
東洋紡	49,300	1,314.00	64,780,200
ユニチカ	34,400	416.00	14,310,400
富士紡ホールディングス	6,100	2,634.00	16,067,400

倉敷紡績	11,200	1,947.00	21,806,400
シキボウ	6,100	979.00	5,971,900
日本毛織	38,400	864.00	33,177,600
トーア紡コーポレーション	4,900	442.00	2,165,800
ダイドーリミテッド	14,200	315.00	4,473,000
帝国繊維	13,100	2,313.00	30,300,300
帝人	95,000	1,787.00	169,765,000
東レ	902,600	701.80	633,444,680
サカイオーベックス	2,900	1,602.00	4,645,800
住江織物	3,400	2,813.00	9,564,200
日本フェルト	6,800	446.00	3,032,800
イチカワ	1,700	1,307.00	2,221,900
日東製網	1,400	1,369.00	1,916,600
アツギ	9,700	912.00	8,846,400
ダイニック	4,700	694.00	3,261,800
セーレン	28,700	1,531.00	43,939,700
ソトー	4,700	969.00	4,554,300
東海染工	1,700	1,085.00	1,844,500
小松マテーレ	19,300	822.00	15,864,600
ワコールホールディングス	33,900	2,632.00	89,224,800
ホギメディカル	14,500	3,605.00	52,272,500
レナウン	33,600	99.00	3,326,400
クラウドシアホールディングス	3,000	474.00	1,422,000
T S Iホールディングス	43,100	647.00	27,885,700
マツオカコーポレーション	3,700	3,405.00	12,598,500
ワールド	15,300	2,421.00	37,041,300
三陽商会	7,100	1,791.00	12,716,100
ナイガイ	4,400	504.00	2,217,600
オンワードホールディングス	70,100	574.00	40,237,400
ルックホールディングス	4,300	1,372.00	5,899,600
ゴールドウイン	10,500	17,630.00	185,115,000
デサント	28,400	2,163.00	61,429,200
キング	6,400	644.00	4,121,600
ヤマトインターナショナル	7,800	410.00	3,198,000
特種東海製紙	7,400	3,905.00	28,897,000
王子ホールディングス	523,700	621.00	325,217,700
日本製紙	55,700	2,134.00	118,863,800
三菱製紙	19,100	521.00	9,951,100
北越コーポレーション	77,200	580.00	44,776,000
中越パルプ工業	5,000	1,355.00	6,775,000
巴川製紙所	3,900	1,016.00	3,962,400
大王製紙	56,700	1,248.00	70,761,600

阿波製紙	3,000	465.00	1,395,000	
レンゴー	119,900	950.00	113,905,000	
トーモク	7,100	1,808.00	12,836,800	
ザ・パック	8,800	3,185.00	28,028,000	
クラレ	196,300	1,361.00	267,164,300	
旭化成	827,600	1,112.50	920,705,000	
共和レザー	7,400	760.00	5,624,000	
昭和電工	77,300	3,175.00	245,427,500	
住友化学	915,700	513.00	469,754,100	
住友精化	5,700	4,080.00	23,256,000	
日産化学	71,400	4,640.00	331,296,000	
ラサ工業	4,100	1,402.00	5,748,200	
クレハ	10,800	5,870.00	63,396,000	
多木化学	3,400	4,740.00	16,116,000	
テイカ	9,500	2,352.00	22,344,000	
石原産業	22,300	1,108.00	24,708,400	
片倉コープアグリ	3,400	1,132.00	3,848,800	
日東エフシー	7,400	1,199.00	8,872,600	
日本曹達	18,400	2,731.00	50,250,400	
東ソー	179,800	1,617.00	290,736,600	
トクヤマ	33,500	2,653.00	88,875,500	
セントラル硝子	25,400	2,440.00	61,976,000	
東亜合成	73,000	1,175.00	85,775,000	
大阪ソーダ	12,500	2,533.00	31,662,500	
関東電化工業	27,700	758.00	20,996,600	
デンカ	45,700	3,090.00	141,213,000	
信越化学工業	205,000	9,469.00	1,941,145,000	
日本カーバイド工業	4,000	1,468.00	5,872,000	
堺化学工業	7,700	2,524.00	19,434,800	
第一稀元素化学工業	12,700	794.00	10,083,800	
エア・ウォーター	95,300	1,553.00	148,000,900	
大陽日酸	95,800	1,820.00	174,356,000	
日本化学工業	3,900	1,957.00	7,632,300	
東邦アセチレン	1,800	1,361.00	2,449,800	
日本パーカライズン	63,600	1,295.00	82,362,000	
高压ガス工業	18,600	788.00	14,656,800	
チタン工業	1,500	2,265.00	3,397,500	
四国化成工業	19,600	1,069.00	20,952,400	
戸田工業	2,500	2,105.00	5,262,500	
ステラ ケミファ	6,800	2,813.00	19,128,400	
保土谷化学工業	4,000	2,917.00	11,668,000	
日本触媒	19,600	6,580.00	128,968,000	

大日精化工業	9,600	2,966.00	28,473,600
カネカ	30,100	3,980.00	119,798,000
三菱瓦斯化学	119,600	1,474.00	176,290,400
三井化学	105,600	2,505.00	264,528,000
J S R	116,700	1,586.00	185,086,200
東京応化工業	20,000	3,380.00	67,600,000
大阪有機化学工業	10,900	1,019.00	11,107,100
三菱ケミカルホールディングス	777,700	736.10	572,464,970
K Hネオケム	17,700	2,978.00	52,710,600
ダイセル	171,400	943.00	161,630,200
住友ベークライト	20,100	3,875.00	77,887,500
積水化学工業	254,300	1,650.00	419,595,000
日本ゼオン	104,900	1,079.00	113,187,100
アイカ工業	34,900	3,595.00	125,465,500
宇部興産	58,700	2,133.00	125,207,100
積水樹脂	19,200	2,052.00	39,398,400
タキロンシーアイ	25,300	638.00	16,141,400
旭有機材	8,000	1,633.00	13,064,000
日立化成	53,800	2,889.00	155,428,200
ニチバン	6,100	2,133.00	13,011,300
リケンテクノス	31,800	511.00	16,249,800
大倉工業	6,000	1,654.00	9,924,000
積水化成成品工業	17,400	735.00	12,789,000
群栄化学工業	3,000	2,536.00	7,608,000
タイガースポリマー	6,300	596.00	3,754,800
ミライアル	3,400	1,119.00	3,804,600
ダイキアクシス	4,200	848.00	3,561,600
ダイキョーニシカワ	24,600	993.00	24,427,800
竹本容器	4,200	1,249.00	5,245,800
森六ホールディングス	6,300	2,504.00	15,775,200
日本化薬	74,000	1,240.00	91,760,000
カーリットホールディングス	12,600	774.00	9,752,400
日本精化	9,400	1,266.00	11,900,400
扶桑化学工業	11,800	1,944.00	22,939,200
トリケミカル研究所	2,600	5,210.00	13,546,000
A D E K A	57,300	1,525.00	87,382,500
日油	43,800	3,910.00	171,258,000
ハリマ化成グループ	9,700	1,003.00	9,729,100
花王	288,300	8,430.00	2,430,369,000
第一工業製薬	4,400	3,155.00	13,882,000
石原ケミカル	3,000	1,611.00	4,833,000
日華化学	4,000	888.00	3,552,000

ニイタカ	1,900	1,556.00	2,956,400
三洋化成工業	7,800	5,310.00	41,418,000
有機合成薬品工業	9,200	229.00	2,106,800
大日本塗料	13,200	976.00	12,883,200
日本ペイントホールディングス	96,000	3,990.00	383,040,000
関西ペイント	130,700	1,927.00	251,858,900
神東塗料	9,500	162.00	1,539,000
中国塗料	38,200	974.00	37,206,800
日本特殊塗料	8,800	1,150.00	10,120,000
藤倉化成	15,800	565.00	8,927,000
太陽ホールディングス	9,600	3,595.00	34,512,000
D I C	52,600	2,972.00	156,327,200
サカタインクス	25,400	934.00	23,723,600
東洋インキS Cホールディングス	24,600	2,400.00	59,040,000
T & K T O K A	9,100	956.00	8,699,600
富士フィルムホールディングス	246,700	5,250.00	1,295,175,000
資生堂	236,000	8,430.00	1,989,480,000
ライオン	165,500	2,111.00	349,370,500
高砂香料工業	8,200	3,160.00	25,912,000
マンダム	26,700	2,715.00	72,490,500
ミルボン	14,700	5,400.00	79,380,000
ファンケル	52,900	3,110.00	164,519,000
コーセー	20,100	18,320.00	368,232,000
コタ	6,300	1,170.00	7,371,000
シーボン	1,400	2,500.00	3,500,000
ポーラ・オルビスホールディングス	50,700	3,065.00	155,395,500
ノエビアホールディングス	11,300	5,840.00	65,992,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	882.00	2,381,400
エステー	8,500	1,723.00	14,645,500
アグロ カネショウ	4,800	2,235.00	10,728,000
コニシ	21,100	1,500.00	31,650,000
長谷川香料	15,700	1,710.00	26,847,000
星光P M C	8,100	744.00	6,026,400
小林製薬	33,300	8,550.00	284,715,000
荒川化学工業	10,700	1,324.00	14,166,800
メック	8,200	1,042.00	8,544,400
日本高純度化学	3,300	2,197.00	7,250,100
タカラバイオ	31,100	2,323.00	72,245,300
J C U	15,400	2,149.00	33,094,600
新田ゼラチン	7,600	632.00	4,803,200
O A T アグリオ	1,700	1,564.00	2,658,800
デクセリアルズ	30,800	698.00	21,498,400

アース製薬	9,000	4,985.00	44,865,000
北興化学工業	12,200	487.00	5,941,400
大成ラミック	3,900	2,657.00	10,362,300
クミアイ化学工業	49,100	737.00	36,186,700
日本農薬	21,100	422.00	8,904,200
アキレス	8,700	2,015.00	17,530,500
有沢製作所	18,800	819.00	15,397,200
日東電工	82,000	5,303.00	434,846,000
レック	12,800	1,372.00	17,561,600
三光合成	13,800	341.00	4,705,800
きもと	20,500	163.00	3,341,500
藤森工業	10,700	2,827.00	30,248,900
前澤化成工業	8,200	993.00	8,142,600
未来工業	6,400	2,101.00	13,446,400
ウェーブロックホールディングス	3,400	769.00	2,614,600
J S P	7,000	2,035.00	14,245,000
エフピコ	13,100	6,220.00	81,482,000
天馬	8,200	1,891.00	15,506,200
信越ポリマー	21,400	787.00	16,841,800
東リ	30,000	255.00	7,650,000
ニフコ	47,600	2,836.00	134,993,600
バルカー	9,600	2,194.00	21,062,400
ユニ・チャーム	251,900	3,502.00	882,153,800
ショーエイコーポレーション	1,000	736.00	736,000
協和発酵キリン	139,400	2,030.00	282,982,000
武田薬品工業	1,037,000	4,291.00	4,449,767,000
アステラス製薬	1,095,100	1,444.50	1,581,871,950
大日本住友製薬	88,000	2,412.00	212,256,000
塩野義製薬	151,900	6,651.00	1,010,286,900
田辺三菱製薬	124,200	1,336.00	165,931,200
わかもと製薬	14,100	272.00	3,835,200
あすか製薬	14,700	1,139.00	16,743,300
日本新薬	31,100	7,830.00	243,513,000
バイオフェルミン製薬	2,000	2,257.00	4,514,000
中外製薬	123,800	7,100.00	878,980,000
科研製薬	21,400	4,855.00	103,897,000
エーザイ	142,200	6,363.00	904,818,600
ロート製薬	60,900	2,915.00	177,523,500
小野薬品工業	280,500	1,957.00	548,938,500
久光製薬	35,100	4,505.00	158,125,500
持田製薬	18,000	5,080.00	91,440,000
参天製薬	221,100	1,661.00	367,247,100

扶桑薬品工業	4,200	2,348.00	9,861,600
日本ケミファ	1,600	2,865.00	4,584,000
ツムラ	36,800	3,025.00	111,320,000
日医工	31,200	1,307.00	40,778,400
キッセイ薬品工業	21,000	2,660.00	55,860,000
生化学工業	23,000	1,186.00	27,278,000
栄研化学	20,900	2,136.00	44,642,400
日水製薬	5,000	1,172.00	5,860,000
鳥居薬品	6,400	2,286.00	14,630,400
JCRファーマ	8,400	6,430.00	54,012,000
東和薬品	17,100	2,736.00	46,785,600
富士製薬工業	8,100	1,558.00	12,619,800
沢井製薬	24,400	6,010.00	146,644,000
ゼリア新薬工業	23,500	1,880.00	44,180,000
第一三共	339,900	5,522.00	1,876,927,800
キョーリン製薬ホールディングス	26,200	2,068.00	54,181,600
大幸薬品	5,300	1,776.00	9,412,800
ダイト	6,900	3,540.00	24,426,000
大塚ホールディングス	226,300	3,878.00	877,591,400
大正製薬ホールディングス	26,600	9,790.00	260,414,000
ペプチドリーム	59,500	5,850.00	348,075,000
日本コークス工業	100,900	98.00	9,888,200
ニチレキ	15,300	1,007.00	15,407,100
ユシロ化学工業	6,200	1,267.00	7,855,400
ビーピー・カストロール	4,300	1,420.00	6,106,000
富士石油	28,800	258.00	7,430,400
MORESCO	4,300	1,443.00	6,204,900
出光興産	137,100	3,300.00	452,430,000
JXTGホールディングス	1,997,800	523.20	1,045,248,960
コスモエネルギーホールディングス	34,400	2,295.00	78,948,000
横浜ゴム	68,800	1,924.00	132,371,200
TOYO TIRE	61,000	1,126.00	68,686,000
ブリヂストン	365,100	4,198.00	1,532,689,800
住友ゴム工業	106,700	1,262.00	134,655,400
藤倉コンポジット	10,400	435.00	4,524,000
オカモト	8,300	5,210.00	43,243,000
フコク	5,200	777.00	4,040,400
ニッタ	13,400	3,265.00	43,751,000
住友理工	23,000	890.00	20,470,000
三ツ星ベルト	15,600	1,897.00	29,593,200
バンドー化学	22,600	988.00	22,328,800
日東紡績	17,700	2,115.00	37,435,500

A G C	117,400	3,565.00	418,531,000
日本板硝子	53,000	833.00	44,149,000
石塚硝子	2,000	2,053.00	4,106,000
日本山村硝子	5,000	1,380.00	6,900,000
日本電気硝子	51,400	2,797.00	143,765,800
オハラ	4,700	1,327.00	6,236,900
住友大阪セメント	24,000	4,345.00	104,280,000
太平洋セメント	75,000	3,355.00	251,625,000
日本ヒューム	12,000	732.00	8,784,000
日本コンクリート工業	25,900	271.00	7,018,900
三谷セキサン	5,500	2,925.00	16,087,500
アジアパイルホールディングス	17,000	558.00	9,486,000
東海カーボン	107,900	1,145.00	123,545,500
日本カーボン	5,700	4,235.00	24,139,500
東洋炭素	7,000	2,002.00	14,014,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,100	4,790.00	34,009,000
T O T O	91,400	3,925.00	358,745,000
日本碍子	145,000	1,590.00	230,550,000
日本特殊陶業	100,200	1,890.00	189,378,000
M A R U W A	4,100	5,380.00	22,058,000
品川リフラクトリーズ	3,100	3,105.00	9,625,500
黒崎播磨	2,400	5,550.00	13,320,000
ヨータイ	10,500	495.00	5,197,500
イソライト工業	6,200	482.00	2,988,400
東京窯業	15,200	346.00	5,259,200
ニッカトー	5,400	727.00	3,925,800
フジインコーポレーテッド	10,600	2,351.00	24,920,600
クニミネ工業	5,400	832.00	4,492,800
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,020.00	2,346,000
ニチアス	32,500	1,913.00	62,172,500
ニチハ	16,500	3,200.00	52,800,000
日本製鉄	545,800	1,867.50	1,019,281,500
神戸製鋼所	215,000	761.00	163,615,000
中山製鋼所	16,500	484.00	7,986,000
合同製鐵	5,700	1,638.00	9,336,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	317,200	1,776.50	563,505,800
東京製鐵	63,000	921.00	58,023,000
共英製鋼	13,300	1,788.00	23,780,400
大和工業	25,000	3,055.00	76,375,000
東京鐵鋼	4,900	1,223.00	5,992,700
大阪製鐵	7,800	1,857.00	14,484,600
淀川製鋼所	15,900	2,084.00	33,135,600

丸一鋼管	41,600	2,959.00	123,094,400
モリ工業	3,500	2,105.00	7,367,500
大同特殊鋼	19,200	4,125.00	79,200,000
日本高周波鋼業	4,400	490.00	2,156,000
日本冶金工業	97,100	224.00	21,750,400
山陽特殊製鋼	14,800	1,592.00	23,561,600
愛知製鋼	6,600	3,305.00	21,813,000
日立金属	126,600	1,149.00	145,463,400
日本金属	2,700	1,052.00	2,840,400
大平洋金属	8,000	2,048.00	16,384,000
新日本電工	70,800	211.00	14,938,800
栗本鐵工所	6,000	1,431.00	8,586,000
虹技	1,800	1,331.00	2,395,800
三菱製鋼	8,800	1,515.00	13,332,000
日亜鋼業	17,300	315.00	5,449,500
日本精線	1,700	2,682.00	4,559,400
エンビプロ・ホールディングス	4,500	618.00	2,781,000
シンニッタン	18,400	354.00	6,513,600
新家工業	2,700	1,468.00	3,963,600
大紀アルミニウム工業所	19,600	611.00	11,975,600
日本軽金属ホールディングス	320,700	233.00	74,723,100
三井金属鉱業	31,800	2,608.00	82,934,400
東邦亜鉛	6,600	2,635.00	17,391,000
三菱マテリアル	77,600	2,673.00	207,424,800
住友金属鉱山	160,900	2,978.50	479,240,650
D O W Aホールディングス	27,500	3,455.00	95,012,500
古河機械金属	19,600	1,439.00	28,204,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	1,444.00	19,782,800
東邦チタニウム	21,300	925.00	19,702,500
U A C J	17,900	2,120.00	37,948,000
C Kサンエツ	2,300	2,716.00	6,246,800
古河電気工業	33,900	2,659.00	90,140,100
住友電気工業	439,300	1,387.00	609,309,100
フジクラ	142,300	422.00	60,050,600
昭和電線ホールディングス	13,700	708.00	9,699,600
東京特殊電線	1,600	1,794.00	2,870,400
タツタ電線	23,700	452.00	10,712,400
カナレ電気	2,000	1,886.00	3,772,000
平河ヒューテック	5,000	1,227.00	6,135,000
リョービ	14,500	2,498.00	36,221,000
アーレスティ	14,700	588.00	8,643,600
アサヒホールディングス	22,100	2,040.00	45,084,000

稲葉製作所	6,700	1,416.00	9,487,200
宮地エンジニアリンググループ	3,600	1,820.00	6,552,000
トーカロ	30,300	814.00	24,664,200
アルファC o	4,200	1,240.00	5,208,000
SUMCO	129,800	1,361.00	176,657,800
川田テクノロジーズ	2,600	6,880.00	17,888,000
RS Technologies	2,400	2,932.00	7,036,800
信和	6,200	1,092.00	6,770,400
東洋製罐グループホールディングス	74,800	2,174.00	162,615,200
ホッカンホールディングス	6,000	1,699.00	10,194,000
コロナ	6,600	978.00	6,454,800
横河ブリッジホールディングス	21,900	1,702.00	37,273,800
駒井ハルテック	2,200	1,719.00	3,781,800
高田機工	1,100	2,473.00	2,720,300
三和ホールディングス	121,300	1,291.00	156,598,300
文化シャッター	34,800	795.00	27,666,000
三協立山	16,400	1,152.00	18,892,800
アルインコ	9,400	974.00	9,155,600
東洋シャッター	2,900	629.00	1,824,100
LIXILグループ	173,300	1,368.00	237,074,400
日本フィルコン	9,100	491.00	4,468,100
ノーリツ	26,300	1,542.00	40,554,600
長府製作所	12,000	2,160.00	25,920,000
リンナイ	20,900	7,460.00	155,914,000
ダイニチ工業	6,400	625.00	4,000,000
日東精工	16,400	613.00	10,053,200
三洋工業	1,600	1,802.00	2,883,200
岡部	23,800	993.00	23,633,400
ジーテクト	13,100	1,439.00	18,850,900
東プレ	21,900	1,886.00	41,303,400
高周波熱錬	22,800	885.00	20,178,000
東京製綱	7,200	1,089.00	7,840,800
サンコール	6,700	564.00	3,778,800
モリテック スチール	9,200	360.00	3,312,000
パイオラックス	18,800	1,903.00	35,776,400
エイチワン	11,600	840.00	9,744,000
日本発條	117,000	896.00	104,832,000
中央発條	1,400	2,820.00	3,948,000
アドバネクス	1,500	1,592.00	2,388,000
立川ブラインド工業	5,200	1,233.00	6,411,600
三益半導体工業	10,500	1,576.00	16,548,000
日本ドライケミカル	3,200	1,054.00	3,372,800

日本製鋼所	35,700	1,896.00	67,687,200
三浦工業	50,900	2,729.00	138,906,100
タクマ	43,000	1,273.00	54,739,000
ツガミ	26,600	905.00	24,073,000
オークマ	15,000	6,050.00	90,750,000
東芝機械	13,300	2,480.00	32,984,000
アマダホールディングス	176,600	1,160.00	204,856,000
アイダエンジニアリング	31,900	816.00	26,030,400
滝澤鉄工所	3,700	1,479.00	5,472,300
F U J I	46,900	1,518.00	71,194,200
牧野フライス製作所	13,800	4,135.00	57,063,000
オーエスジー	57,900	2,101.00	121,647,900
ダイジェット工業	1,500	1,550.00	2,325,000
旭ダイヤモンド工業	31,000	748.00	23,188,000
D M G 森精機	74,400	1,491.00	110,930,400
ソディック	25,600	923.00	23,628,800
ディスコ	15,900	17,490.00	278,091,000
日東工器	6,400	2,185.00	13,984,000
日進工具	3,500	2,412.00	8,442,000
パンチ工業	8,200	567.00	4,649,400
富士ダイス	5,200	607.00	3,156,400
豊和工業	6,800	912.00	6,201,600
O K K	5,100	761.00	3,881,100
東洋機械金属	8,400	579.00	4,863,600
津田駒工業	2,600	1,797.00	4,672,200
島精機製作所	16,200	3,120.00	50,544,000
オプトラン	11,500	2,622.00	30,153,000
N C ホールディングス	3,800	500.00	1,900,000
イワキポンプ	5,000	917.00	4,585,000
フリュー	9,400	959.00	9,014,600
ヤマシンフィルタ	20,500	636.00	13,038,000
日阪製作所	14,600	900.00	13,140,000
やまびこ	22,800	971.00	22,138,800
平田機工	5,600	7,180.00	40,208,000
ペガサスミシン製造	11,000	587.00	6,457,000
マルマエ	4,800	852.00	4,089,600
タツモ	4,900	771.00	3,777,900
ナプテスコ	64,700	2,992.00	193,582,400
三井海洋開発	12,500	3,050.00	38,125,000
レオン自動機	11,600	1,642.00	19,047,200
S M C	34,800	41,270.00	1,436,196,000
新川	5,900	418.00	2,466,200

ホソカワミクロン	4,100	4,895.00	20,069,500
ユニオンツール	5,100	2,693.00	13,734,300
オイレス工業	16,500	1,710.00	28,215,000
日精エー・エス・ビー機械	4,000	3,525.00	14,100,000
サトーホールディングス	14,200	2,535.00	35,997,000
技研製作所	10,300	3,300.00	33,990,000
日本エアーテック	3,700	591.00	2,186,700
カワタ	3,200	1,294.00	4,140,800
日精樹脂工業	10,100	882.00	8,908,200
オカダアイヨン	4,000	1,262.00	5,048,000
ワイエイシイホールディングス	4,700	775.00	3,642,500
小松製作所	537,900	2,420.50	1,301,986,950
住友重機械工業	68,000	3,655.00	248,540,000
日立建機	47,700	2,593.00	123,686,100
日工	3,300	2,738.00	9,035,400
巴工業	5,000	2,327.00	11,635,000
井関農機	12,100	1,541.00	18,646,100
TOWA	10,200	806.00	8,221,200
丸山製作所	2,800	1,272.00	3,561,600
北川鉄工所	5,400	2,178.00	11,761,200
ローツェ	5,200	2,297.00	11,944,400
タカキタ	4,200	523.00	2,196,600
クボタ	636,400	1,550.50	986,738,200
荏原実業	3,600	2,008.00	7,228,800
三菱化工機	4,300	1,477.00	6,351,100
月島機械	23,700	1,299.00	30,786,300
帝国電機製作所	8,300	1,051.00	8,723,300
新東工業	28,400	951.00	27,008,400
澁谷工業	10,400	3,265.00	33,956,000
アイチ コーポレーション	20,900	692.00	14,462,800
小森コーポレーション	32,300	1,194.00	38,566,200
鶴見製作所	9,300	1,893.00	17,604,900
住友精密工業	2,000	2,887.00	5,774,000
酒井重工業	2,300	2,835.00	6,520,500
荏原製作所	52,700	3,145.00	165,741,500
石井鐵工所	1,900	1,994.00	3,788,600
西島製作所	12,400	939.00	11,643,600
北越工業	12,300	1,158.00	14,243,400
ダイキン工業	162,100	13,625.00	2,208,612,500
オルガノ	4,300	3,250.00	13,975,000
トーヨーカネツ	4,600	1,983.00	9,121,800
栗田工業	64,300	2,777.00	178,561,100

椿本チエイン	15,600	3,705.00	57,798,000
大同工業	5,900	827.00	4,879,300
木村化工機	10,600	362.00	3,837,200
アネスト岩田	18,500	882.00	16,317,000
ダイフク	65,400	6,340.00	414,636,000
サムコ	3,300	835.00	2,755,500
加藤製作所	6,100	2,631.00	16,049,100
油研工業	2,100	1,722.00	3,616,200
タダノ	57,500	1,154.00	66,355,000
フジテック	43,200	1,308.00	56,505,600
C K D	33,000	1,110.00	36,630,000
キトー	9,000	1,592.00	14,328,000
平和	33,100	2,112.00	69,907,200
理想科学工業	10,500	1,641.00	17,230,500
S A N K Y O	29,700	4,170.00	123,849,000
日本金銭機械	13,200	1,130.00	14,916,000
マースグループホールディングス	7,500	2,113.00	15,847,500
福島工業	7,300	3,600.00	26,280,000
オーイズミ	5,000	370.00	1,850,000
ダイコク電機	5,500	1,485.00	8,167,500
竹内製作所	19,900	1,942.00	38,645,800
アマノ	33,900	2,844.00	96,411,600
J U K I	16,600	970.00	16,102,000
サンデンホールディングス	14,600	644.00	9,402,400
蛇の目ミシン工業	10,800	425.00	4,590,000
マックス	18,100	1,547.00	28,000,700
グローリー	32,900	2,632.00	86,592,800
新晃工業	11,100	1,496.00	16,605,600
大和冷機工業	17,200	1,213.00	20,863,600
セガサミーホールディングス	117,800	1,353.00	159,383,400
日本ピストンリング	4,300	1,455.00	6,256,500
リケン	5,500	4,770.00	26,235,000
T P R	16,000	1,893.00	30,288,000
ツバキ・ナカシマ	18,000	1,908.00	34,344,000
ホシザキ	34,700	7,130.00	247,411,000
大豊工業	9,700	835.00	8,099,500
日本精工	243,900	998.00	243,412,200
N T N	255,300	328.00	83,738,400
ジェイテクト	113,900	1,273.00	144,994,700
不二越	11,000	4,930.00	54,230,000
日本トムソン	35,300	503.00	17,755,900
T H K	74,000	2,570.00	190,180,000

ユーシン精機	9,300	1,153.00	10,722,900
前澤給装工業	4,700	1,828.00	8,591,600
イーグル工業	14,800	1,131.00	16,738,800
前澤工業	7,900	352.00	2,780,800
日本ピラー工業	12,100	1,130.00	13,673,000
キット	48,100	812.00	39,057,200
マキタ	144,600	3,705.00	535,743,000
日立造船	94,800	333.00	31,568,400
三菱重工業	199,100	4,622.00	920,240,200
I H I	91,300	2,330.00	212,729,000
スター精密	20,300	1,666.00	33,819,800
日清紡ホールディングス	66,100	815.00	53,871,500
イビデン	72,900	1,819.00	132,605,100
コニカミノルタ	259,800	1,076.00	279,544,800
ブラザー工業	154,900	1,973.00	305,617,700
ミネベアミツミ	220,700	1,780.00	392,846,000
日立製作所	534,800	3,683.00	1,969,668,400
三菱電機	1,187,800	1,484.00	1,762,695,200
富士電機	77,100	3,705.00	285,655,500
東洋電機製造	4,900	1,406.00	6,889,400
安川電機	137,700	3,790.00	521,883,000
シンフォニアテクノロジー	16,600	1,480.00	24,568,000
明電舎	23,700	1,500.00	35,550,000
オリジン	3,300	1,900.00	6,270,000
山洋電気	5,800	4,420.00	25,636,000
デンヨー	11,200	1,388.00	15,545,600
東芝テック	14,900	2,868.00	42,733,200
芝浦メカトロニクス	2,200	3,005.00	6,611,000
マブチモーター	33,000	3,665.00	120,945,000
日本電産	143,000	14,900.00	2,130,700,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,700	1,338.00	8,964,600
トレックス・セミコンダクター	5,600	1,252.00	7,011,200
東光高岳	6,300	1,172.00	7,383,600
ダブル・スコープ	17,600	1,750.00	30,800,000
ダイヘン	13,000	2,887.00	37,531,000
ヤーマン	17,600	1,046.00	18,409,600
JVCケンウッド	92,400	234.00	21,621,600
ミマキエンジニアリング	11,300	581.00	6,565,300
第一精工	5,300	1,046.00	5,543,800
日新電機	28,000	987.00	27,636,000
大崎電気工業	23,800	686.00	16,326,800
オムロン	126,300	5,550.00	700,965,000

日東工業	19,100	2,081.00	39,747,100
I D E C	16,000	1,996.00	31,936,000
正興電機製作所	2,600	771.00	2,004,600
不二電機工業	1,600	1,282.00	2,051,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,900	2,036.00	87,344,400
サクサホールディングス	3,100	1,632.00	5,059,200
メルコホールディングス	5,000	3,155.00	15,775,000
テクノメディカ	1,800	2,055.00	3,699,000
日本電気	153,700	3,820.00	587,134,000
富士通	114,500	7,289.00	834,590,500
沖電気工業	51,600	1,315.00	67,854,000
岩崎通信機	5,600	790.00	4,424,000
電気興業	6,300	3,095.00	19,498,500
サンケン電気	14,000	2,373.00	33,222,000
ナカヨ	2,500	1,399.00	3,497,500
アイホン	6,800	1,570.00	10,676,000
ルネサスエレクトロニクス	123,700	564.00	69,766,800
セイコーエプソン	147,500	1,664.00	245,440,000
ワコム	86,900	406.00	35,281,400
アルバック	23,700	3,545.00	84,016,500
アクセル	5,600	527.00	2,951,200
E I Z O	10,900	4,115.00	44,853,500
日本信号	30,400	1,142.00	34,716,800
京三製作所	25,800	395.00	10,191,000
能美防災	15,900	1,991.00	31,656,900
ホーチキ	7,900	1,298.00	10,254,200
星和電機	7,100	524.00	3,720,400
エレコム	11,400	3,385.00	38,589,000
パナソニック	1,357,000	915.70	1,242,604,900
シャープ	117,900	1,071.00	126,270,900
アンリツ	76,500	1,714.00	131,121,000
富士通ゼネラル	36,400	1,508.00	54,891,200
ソニー	797,000	5,408.00	4,310,176,000
T D K	62,200	9,260.00	575,972,000
帝国通信工業	5,600	1,196.00	6,697,600
タムラ製作所	46,000	617.00	28,382,000
アルプスアルパイン	123,800	2,058.00	254,780,400
池上通信機	3,800	1,051.00	3,993,800
鈴木	6,900	659.00	4,547,100
日本トリム	2,300	5,250.00	12,075,000
ローランド ディー . ジー .	6,200	2,275.00	14,105,000
フォスター電機	13,600	1,572.00	21,379,200

SMK	3,400	2,640.00	8,976,000	
ヨコオ	8,700	1,659.00	14,433,300	
ホシデン	35,300	993.00	35,052,900	
ヒロセ電機	17,100	12,540.00	214,434,000	
日本航空電子工業	27,300	1,725.00	47,092,500	
TOA	12,900	1,170.00	15,093,000	
マクセルホールディングス	25,900	1,803.00	46,697,700	
古野電気	15,700	886.00	13,910,200	
ユニデンホールディングス	3,600	2,319.00	8,348,400	
スミダコーポレーション	10,400	1,260.00	13,104,000	
アイコム	6,600	2,040.00	13,464,000	
リオン	5,600	1,992.00	11,155,200	
本多通信工業	10,900	532.00	5,798,800	
横河電機	118,900	2,159.00	256,705,100	
新電元工業	4,200	4,100.00	17,220,000	
アズビル	76,700	2,570.00	197,119,000	
東亜ディーケーケー	6,400	855.00	5,472,000	
日本光電工業	52,500	3,180.00	166,950,000	
チノー	4,200	1,170.00	4,914,000	
共和電業	12,800	414.00	5,299,200	
日本電子材料	4,900	743.00	3,640,700	
堀場製作所	23,600	6,020.00	142,072,000	
アドバンテスト	81,000	2,980.00	241,380,000	
小野測器	6,100	590.00	3,599,000	
エスベック	10,700	2,061.00	22,052,700	
キーエンス	58,300	66,690.00	3,888,027,000	
日置電機	6,300	3,815.00	24,034,500	
シスメックス	92,600	7,197.00	666,442,200	
日本マイクロニクス	21,100	859.00	18,124,900	
メガチップス	9,600	1,483.00	14,236,800	
OBARA GROUP	6,200	3,385.00	20,987,000	
澤藤電機	1,700	1,656.00	2,815,200	
原田工業	5,300	816.00	4,324,800	
コーセル	15,500	1,103.00	17,096,500	
イリソ電子工業	10,900	5,560.00	60,604,000	
オブテックスグループ	21,100	1,670.00	35,237,000	
千代田インテグレ	5,200	1,974.00	10,264,800	
アイ・オー・データ機器	4,700	1,177.00	5,531,900	
レーザーテック	24,400	4,590.00	111,996,000	
スタンレー電気	84,100	2,751.00	231,359,100	
岩崎電気	4,900	1,308.00	6,409,200	
ウシオ電機	69,300	1,295.00	89,743,500	

岡谷電機産業	9,500	348.00	3,306,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	629.00	7,233,500
エノモト	3,700	918.00	3,396,600
日本セラミック	12,200	3,055.00	37,271,000
遠藤照明	6,500	729.00	4,738,500
古河電池	9,100	629.00	5,723,900
双信電機	6,700	513.00	3,437,100
山一電機	9,000	1,124.00	10,116,000
図研	8,000	1,625.00	13,000,000
日本電子	23,600	2,261.00	53,359,600
カシオ計算機	105,200	1,327.00	139,600,400
ファナック	112,900	19,150.00	2,162,035,000
日本シイエムケイ	27,000	658.00	17,766,000
エンプラス	5,500	3,005.00	16,527,500
大真空	4,700	981.00	4,610,700
ローム	56,800	7,550.00	428,840,000
浜松ホトニクス	85,300	4,160.00	354,848,000
三井ハイテック	13,500	1,156.00	15,606,000
新光電気工業	40,300	971.00	39,131,300
京セラ	181,100	6,899.00	1,249,408,900
太陽誘電	53,000	2,209.00	117,077,000
村田製作所	373,900	5,030.00	1,880,717,000
双葉電子工業	19,700	1,691.00	33,312,700
北陸電気工業	4,800	1,002.00	4,809,600
ニチコン	37,800	936.00	35,380,800
日本ケミコン	8,400	2,028.00	17,035,200
K O A	18,200	1,322.00	24,060,400
市光工業	18,400	650.00	11,960,000
小糸製作所	71,200	5,940.00	422,928,000
ミツバ	22,500	592.00	13,320,000
S C R E E Nホールディングス	20,600	4,920.00	101,352,000
キャノン電子	11,100	1,767.00	19,613,700
キャノン	639,400	3,051.00	1,950,809,400
リコー	357,200	1,048.00	374,345,600
象印マホービン	29,800	1,121.00	33,405,800
M U T O Hホールディングス	1,800	1,802.00	3,243,600
東京エレクトロン	79,200	16,705.00	1,323,036,000
トヨタ紡織	41,600	1,440.00	59,904,000
芦森工業	2,500	1,505.00	3,762,500
ユニプレス	23,100	1,597.00	36,890,700
豊田自動織機	96,100	5,850.00	562,185,000
モリタホールディングス	20,800	1,926.00	40,060,800

三櫻工業	15,200	494.00	7,508,800
デンソー	261,500	4,429.00	1,158,183,500
東海理化電機製作所	31,300	1,735.00	54,305,500
三井E & Sホールディングス	41,900	851.00	35,656,900
川崎重工業	92,400	2,482.00	229,336,800
名村造船所	35,800	323.00	11,563,400
日本車輛製造	4,300	2,307.00	9,920,100
三菱ロジスネクスト	14,200	1,304.00	18,516,800
近畿車輛	1,100	1,983.00	2,181,300
日産自動車	1,400,800	858.50	1,202,586,800
いすゞ自動車	375,400	1,443.00	541,702,200
トヨタ自動車	1,323,600	6,537.00	8,652,373,200
日野自動車	148,300	947.00	140,440,100
三菱自動車工業	439,600	507.00	222,877,200
エフテック	8,400	805.00	6,762,000
レシップホールディングス	4,300	815.00	3,504,500
G M B	2,400	832.00	1,996,800
ファルテック	2,200	777.00	1,709,400
武蔵精密工業	28,900	1,341.00	38,754,900
日産車体	23,300	967.00	22,531,100
新明和工業	49,800	1,247.00	62,100,600
極東開発工業	23,600	1,411.00	33,299,600
日信工業	21,900	1,467.00	32,127,300
トピー工業	9,800	2,412.00	23,637,600
ティラド	4,400	2,144.00	9,433,600
曙ブレーキ工業	65,100	125.00	8,137,500
タチエス	19,600	1,499.00	29,380,400
N O K	63,900	1,634.00	104,412,600
フタバ産業	33,200	606.00	20,119,200
K Y B	12,100	2,772.00	33,541,200
大同メタル工業	19,500	665.00	12,967,500
プレス工業	58,900	496.00	29,214,400
ミクニ	15,200	453.00	6,885,600
太平洋工業	24,900	1,558.00	38,794,200
ケーヒン	27,400	1,676.00	45,922,400
河西工業	14,700	785.00	11,539,500
アイシン精機	97,800	3,775.00	369,195,000
マツダ	372,800	1,263.00	470,846,400
今仙電機製作所	11,200	970.00	10,864,000
本田技研工業	1,002,000	2,832.00	2,837,664,000
スズキ	217,300	4,803.00	1,043,691,900
S U B A R U	368,700	2,453.00	904,421,100

安永	5,800	1,572.00	9,117,600
ヤマハ発動機	167,700	1,921.00	322,151,700
ショーワ	28,100	1,506.00	42,318,600
T B K	14,300	387.00	5,534,100
エクセディ	16,200	2,273.00	36,822,600
豊田合成	38,400	2,078.00	79,795,200
愛三工業	18,800	678.00	12,746,400
盟和産業	1,900	1,043.00	1,981,700
日本プラスト	9,400	704.00	6,617,600
ヨロズ	11,200	1,363.00	15,265,600
エフ・シー・シー	21,400	2,378.00	50,889,200
シマノ	47,900	15,750.00	754,425,000
テイ・エス テック	27,600	2,893.00	79,846,800
ジャムコ	6,000	2,214.00	13,284,000
テルモ	336,100	3,095.00	1,040,229,500
クリエートメディック	4,000	918.00	3,672,000
日機装	38,400	1,269.00	48,729,600
島津製作所	152,900	2,866.00	438,211,400
J M S	11,000	633.00	6,963,000
長野計器	9,400	739.00	6,946,600
ブイ・テクノロジー	2,800	13,810.00	38,668,000
東京計器	7,600	1,050.00	7,980,000
愛知時計電機	1,600	4,100.00	6,560,000
インターアクション	6,000	1,724.00	10,344,000
オーバル	11,700	262.00	3,065,400
東京精密	21,500	2,968.00	63,812,000
マニー	15,800	6,570.00	103,806,000
ニコン	207,000	1,456.00	301,392,000
トプコン	63,800	1,354.00	86,385,200
オリンパス	707,800	1,266.00	896,074,800
理研計器	10,500	1,905.00	20,002,500
タムロン	10,500	2,270.00	23,835,000
H O Y A	239,100	7,724.00	1,846,808,400
シード	5,100	1,067.00	5,441,700
ノーリツ鋼機	9,400	1,986.00	18,668,400
エー・アンド・デイ	10,900	849.00	9,254,100
朝日インテック	50,400	5,460.00	275,184,000
シチズン時計	130,100	584.00	75,978,400
リズム時計工業	4,100	1,217.00	4,989,700
大研医器	9,500	552.00	5,244,000
メニコン	16,300	3,115.00	50,774,500
シンシア	1,800	581.00	1,045,800

松風	5,800	1,286.00	7,458,800
セイコーホールディングス	18,300	2,327.00	42,584,100
ニプロ	82,200	1,307.00	107,435,400
中本パックス	3,300	1,513.00	4,992,900
スノーピーク	4,600	1,578.00	7,258,800
パラマウントベッドホールディングス	13,700	4,965.00	68,020,500
トランザクション	7,600	796.00	6,049,600
S H O - B I	3,500	340.00	1,190,000
ニホンフラッシュ	5,100	2,510.00	12,801,000
前田工織	13,100	1,996.00	26,147,600
永大産業	15,500	400.00	6,200,000
アートネイチャー	12,800	603.00	7,718,400
バンダイナムコホールディングス	122,800	5,100.00	626,280,000
アイフィスジャパン	2,700	602.00	1,625,400
共立印刷	19,700	202.00	3,979,400
S H O E I	5,700	4,570.00	26,049,000
フランスベッドホールディングス	16,900	901.00	15,226,900
パイロットコーポレーション	20,700	4,080.00	84,456,000
萩原工業	6,600	1,356.00	8,949,600
トッパン・フォームズ	25,600	903.00	23,116,800
フジシールインターナショナル	26,600	3,845.00	102,277,000
タカラトミー	49,700	1,171.00	58,198,700
廣済堂	10,600	759.00	8,045,400
エステールホールディングス	3,200	609.00	1,948,800
アーク	45,300	102.00	4,620,600
タカノ	4,700	758.00	3,562,600
プロネクサス	10,300	1,257.00	12,947,100
ホクシン	7,300	128.00	934,400
ウッドワン	4,000	1,029.00	4,116,000
大建工業	9,000	2,053.00	18,477,000
凸版印刷	167,600	1,711.00	286,763,600
大日本印刷	167,400	2,482.00	415,486,800
図書印刷	11,200	954.00	10,684,800
共同印刷	3,700	2,436.00	9,013,200
N I S S H A	24,400	1,096.00	26,742,400
光村印刷	1,000	1,970.00	1,970,000
宝印刷	5,800	1,669.00	9,680,200
アシックス	112,000	1,345.00	150,640,000
ツツミ	3,700	1,867.00	6,907,900
小松ウオール工業	3,600	1,757.00	6,325,200
ヤマハ	70,600	5,310.00	374,886,000
河合楽器製作所	3,700	2,774.00	10,263,800

クリナップ	11,100	567.00	6,293,700
ピジョン	71,800	4,450.00	319,510,000
兼松サステック	800	1,535.00	1,228,000
キングジム	9,900	862.00	8,533,800
リンテック	28,200	2,270.00	64,014,000
イトーキ	22,000	511.00	11,242,000
任天堂	68,000	37,000.00	2,516,000,000
三菱鉛筆	19,600	2,061.00	40,395,600
タカラスタANDARD	24,500	1,652.00	40,474,000
コクヨ	57,000	1,353.00	77,121,000
ナカバヤシ	11,700	485.00	5,674,500
グローブライド	5,800	2,895.00	16,791,000
オカムラ	41,500	1,081.00	44,861,500
美津濃	11,800	2,401.00	28,331,800
東京電力ホールディングス	948,200	585.00	554,697,000
中部電力	363,400	1,569.00	570,174,600
関西電力	484,600	1,265.50	613,261,300
中国電力	164,200	1,356.00	222,655,200
北陸電力	116,300	767.00	89,202,100
東北電力	278,200	1,152.00	320,486,400
四国電力	106,900	1,035.00	110,641,500
九州電力	244,800	1,053.00	257,774,400
北海道電力	111,200	598.00	66,497,600
沖縄電力	22,000	1,659.00	36,498,000
電源開発	94,500	2,290.00	216,405,000
エフオン	5,600	822.00	4,603,200
イーレックス	20,700	1,010.00	20,907,000
レノバ	19,500	941.00	18,349,500
東京瓦斯	233,000	2,685.00	625,605,000
大阪瓦斯	230,500	1,925.00	443,712,500
東邦瓦斯	58,800	4,360.00	256,368,000
北海道瓦斯	6,400	1,422.00	9,100,800
広島ガス	24,600	337.00	8,290,200
西部瓦斯	13,400	2,231.00	29,895,400
静岡ガス	36,700	840.00	30,828,000
メタウォーター	5,700	3,320.00	18,924,000
SBSホールディングス	11,700	1,712.00	20,030,400
東武鉄道	125,300	3,090.00	387,177,000
相鉄ホールディングス	40,700	2,949.00	120,024,300
東京急行電鉄	322,600	1,749.00	564,227,400
京浜急行電鉄	162,700	1,775.00	288,792,500
小田急電鉄	190,200	2,596.00	493,759,200

京王電鉄	66,400	6,940.00	460,816,000
京成電鉄	89,000	3,810.00	339,090,000
富士急行	16,200	4,010.00	64,962,000
新京成電鉄	3,000	2,020.00	6,060,000
東日本旅客鉄道	211,200	9,904.00	2,091,724,800
西日本旅客鉄道	106,500	8,274.00	881,181,000
東海旅客鉄道	106,400	22,140.00	2,355,696,000
西武ホールディングス	147,100	1,755.00	258,160,500
鴻池運輸	18,900	1,638.00	30,958,200
西日本鉄道	32,900	2,386.00	78,499,400
ハマキョウレックス	9,100	3,895.00	35,444,500
サカイ引越センター	6,200	6,080.00	37,696,000
近鉄グループホールディングス	112,500	5,040.00	567,000,000
阪急阪神ホールディングス	150,000	3,930.00	589,500,000
南海電気鉄道	50,200	2,753.00	138,200,600
京阪ホールディングス	50,100	4,720.00	236,472,000
神戸電鉄	2,900	3,975.00	11,527,500
名古屋鉄道	92,300	2,926.00	270,069,800
山陽電気鉄道	8,600	2,150.00	18,490,000
日本通運	43,400	5,560.00	241,304,000
ヤマトホールディングス	197,200	2,304.00	454,348,800
山九	31,300	5,210.00	163,073,000
丸運	6,400	277.00	1,772,800
丸全昭和運輸	9,100	2,897.00	26,362,700
センコーグループホールディングス	62,100	845.00	52,474,500
トナミホールディングス	2,700	5,700.00	15,390,000
ニッコンホールディングス	42,800	2,431.00	104,046,800
日本石油輸送	1,300	2,815.00	3,659,500
福山通運	14,400	3,930.00	56,592,000
セイノーホールディングス	84,200	1,383.00	116,448,600
エスライン	3,400	976.00	3,318,400
神奈川中央交通	2,800	3,840.00	10,752,000
日立物流	24,700	2,978.00	73,556,600
丸和運輸機関	5,900	4,125.00	24,337,500
C & F ロジホールディングス	11,400	1,269.00	14,466,600
九州旅客鉄道	94,400	3,465.00	327,096,000
S Gホールディングス	106,300	2,853.00	303,273,900
日本郵船	94,500	1,753.00	165,658,500
商船三井	67,000	2,578.00	172,726,000
川崎汽船	34,700	1,460.00	50,662,000
N S ユナイテッド海運	6,500	2,285.00	14,852,500
飯野海運	55,400	363.00	20,110,200

共栄タンカー	1,500	1,477.00	2,215,500
乾汽船	10,200	814.00	8,302,800
日本航空	205,900	3,607.00	742,681,300
A N Aホールディングス	205,600	3,702.00	761,131,200
パスコ	2,200	973.00	2,140,600
ランコム	3,100	6,320.00	19,592,000
日新	9,700	1,813.00	17,586,100
三菱倉庫	38,900	2,946.00	114,599,400
三井倉庫ホールディングス	13,800	1,610.00	22,218,000
住友倉庫	41,400	1,355.00	56,097,000
澁澤倉庫	6,200	1,683.00	10,434,600
東陽倉庫	20,300	310.00	6,293,000
日本トランスシティ	24,900	423.00	10,532,700
ケイヒン	2,200	1,263.00	2,778,600
中央倉庫	6,900	998.00	6,886,200
川西倉庫	2,300	1,170.00	2,691,000
安田倉庫	9,300	859.00	7,988,700
ファイズ	2,000	848.00	1,696,000
東洋埠頭	3,400	1,416.00	4,814,400
宇徳	9,700	523.00	5,073,100
上組	69,400	2,567.00	178,149,800
サンリツ	2,700	649.00	1,752,300
キムラユニティー	3,000	1,068.00	3,204,000
キューソー流通システム	2,800	1,998.00	5,594,400
近鉄エクスプレス	21,300	1,528.00	32,546,400
東海運	6,400	251.00	1,606,400
エーアイティー	7,300	1,031.00	7,526,300
内外トランスライン	3,600	1,289.00	4,640,400
日本コンセプト	4,100	1,092.00	4,477,200
N E C ネットエスアイ	12,900	2,708.00	34,933,200
クロスキャット	3,200	1,095.00	3,504,000
システナ	41,700	1,365.00	56,920,500
デジタルアーツ	6,300	9,100.00	57,330,000
日鉄ソリューションズ	17,500	3,190.00	55,825,000
キューブシステム	6,500	800.00	5,200,000
エイジア	2,500	1,191.00	2,977,500
コア	5,100	1,365.00	6,961,500
ソリトンシステムズ	6,800	953.00	6,480,400
ソフトクリエイイトホールディングス	5,200	1,490.00	7,748,000
T I S	38,900	4,985.00	193,916,500
ネオス	2,600	779.00	2,025,400
電算システム	4,500	4,130.00	18,585,000

グリー	80,900	486.00	39,317,400
コーエーテクモホールディングス	23,900	1,922.00	45,935,800
三菱総合研究所	5,100	3,005.00	15,325,500
電算	1,400	1,939.00	2,714,600
A G S	6,900	690.00	4,761,000
ファインデックス	10,100	861.00	8,696,100
ブレインパッド	2,300	6,170.00	14,191,000
K L a b	21,000	774.00	16,254,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	15,700	993.00	15,590,100
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,349.00	4,698,000
ネクソン	297,400	1,567.00	466,025,800
アイスタイル	30,200	770.00	23,254,000
エムアップ	4,100	2,588.00	10,610,800
エイチーム	8,100	1,587.00	12,854,700
テクノスジャパン	10,100	641.00	6,474,100
コロプラ	38,400	665.00	25,536,000
ブロードリーフ	58,000	596.00	34,568,000
クロス・マーケティンググループ	4,800	386.00	1,852,800
デジタルハーツホールディングス	5,500	1,232.00	6,776,000
システム情報	6,100	905.00	5,520,500
メディアドゥホールディングス	3,700	2,972.00	10,996,400
じげん	16,800	578.00	9,710,400
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	1,078.00	1,832,600
サイバーリンクス	2,000	1,038.00	2,076,000
フィックスターズ	12,500	1,508.00	18,850,000
C A R T A H O L D I N G S	5,800	1,198.00	6,948,400
オブティム	5,200	2,096.00	10,899,200
セレス	3,900	2,115.00	8,248,500
ティーガイア	11,800	1,750.00	20,650,000
セック	1,900	3,435.00	6,526,500
日本アジアグループ	12,300	349.00	4,292,700
豆蔵ホールディングス	8,200	1,101.00	9,028,200
テクマトリックス	8,300	1,722.00	14,292,600
プロシップ	3,500	1,151.00	4,028,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	281,400	343.00	96,520,200
G M O ペイメントゲートウェイ	19,200	8,000.00	153,600,000
ザッパラス	6,600	387.00	2,554,200
システムリサーチ	1,600	2,682.00	4,291,200
インターネットイニシアティブ	19,000	2,248.00	42,712,000
さくらインターネット	14,300	494.00	7,064,200
ヴィンクス	4,100	1,270.00	5,207,000
G M O クラウド	2,600	3,705.00	9,633,000

S R Aホールディングス	6,300	2,310.00	14,553,000
M i n o r iソリューションズ	2,400	1,488.00	3,571,200
朝日ネット	9,900	596.00	5,900,400
e B A S E	7,200	1,039.00	7,480,800
アバント	4,300	1,648.00	7,086,400
アドソル日進	4,200	1,684.00	7,072,800
フリービット	7,200	1,080.00	7,776,000
コムチュア	6,600	4,190.00	27,654,000
サイバーコム	2,200	2,149.00	4,727,800
アステリア	8,000	817.00	6,536,000
マークラインズ	5,400	1,754.00	9,471,600
メディカル・データ・ビジョン	10,600	1,010.00	10,706,000
ショーケース	2,800	653.00	1,828,400
モバイルファクトリー	3,400	1,470.00	4,998,000
テラスカイ	1,900	1,755.00	3,334,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,643.00	8,707,900
P C Iホールディングス	2,400	2,233.00	5,359,200
パイプドHD	2,000	1,173.00	2,346,000
アイビーシー	2,200	1,276.00	2,807,200
ネオジャパン	2,400	904.00	2,169,600
P R T I M E S	1,100	2,463.00	2,709,300
ランドコンピュータ	1,900	1,126.00	2,139,400
ダブルスタンダード	1,000	5,470.00	5,470,000
オープンドア	5,800	3,050.00	17,690,000
マイネット	4,000	932.00	3,728,000
アカツキ	4,100	5,190.00	21,279,000
ベネフィットジャパン	1,100	939.00	1,032,900
U b i c o mホールディングス	2,300	1,361.00	3,130,300
L I N E	35,500	3,665.00	130,107,500
カナミックネットワーク	2,500	2,024.00	5,060,000
ノムラシステムコーポレーション	1,500	747.00	1,120,500
チェンジ	2,100	3,790.00	7,959,000
シンクロ・フード	5,300	602.00	3,190,600
オークネット	6,300	1,291.00	8,133,300
エイトレッド	1,400	1,515.00	2,121,000
A O I T Y O H o l d i n g s	13,000	763.00	9,919,000
マクロミル	20,800	1,215.00	25,272,000
ビーグリー	3,100	1,031.00	3,196,100
オロ	1,600	6,630.00	10,608,000
ソルクシーズ	5,200	808.00	4,201,600
フェイス	4,800	836.00	4,012,800
プロトコーポレーション	5,300	2,127.00	11,273,100

ハイマックス	1,500	1,799.00	2,698,500
野村総合研究所	74,200	5,250.00	389,550,000
サイバネットシステム	10,000	667.00	6,670,000
C Eホールディングス	3,600	919.00	3,308,400
日本システム技術	2,000	1,372.00	2,744,000
インテージホールディングス	15,200	898.00	13,649,600
東邦システムサイエンス	3,700	904.00	3,344,800
ソースネクスト	45,800	532.00	24,365,600
インフォコム	12,800	2,177.00	27,865,600
F I G	10,900	305.00	3,324,500
アルテリア・ネットワークス	13,100	1,037.00	13,584,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,760.00	4,752,000
フォーカスシステムズ	8,100	901.00	7,298,100
クレスコ	3,600	3,400.00	12,240,000
フジ・メディア・ホールディングス	121,000	1,412.00	170,852,000
オービック	40,400	12,230.00	494,092,000
ジャストシステム	16,600	3,150.00	52,290,000
T D Cソフト	10,500	824.00	8,652,000
ヤフー	760,500	335.00	254,767,500
トレンドマイクロ	62,200	5,170.00	321,574,000
I Dホールディングス	4,600	1,146.00	5,271,600
日本オラクル	23,600	7,470.00	176,292,000
アルファシステムズ	3,700	2,726.00	10,086,200
フューチャー	15,900	1,997.00	31,752,300
C A C Holdings	8,500	1,544.00	13,124,000
ソフトバンク・テクノロジー	5,000	2,082.00	10,410,000
トーセ	3,400	812.00	2,760,800
オービックビジネスコンサルタント	11,900	4,345.00	51,705,500
伊藤忠テクノソリューションズ	53,200	2,705.00	143,906,000
アイティフォー	14,400	835.00	12,024,000
東計電算	1,800	3,020.00	5,436,000
エクスネット	2,400	905.00	2,172,000
大塚商会	63,100	4,175.00	263,442,500
サイボウズ	13,900	1,026.00	14,261,400
ソフトブレーン	9,600	431.00	4,137,600
電通国際情報サービス	7,300	3,665.00	26,754,500
デジタルガレージ	22,800	3,260.00	74,328,000
E Mシステムズ	9,700	1,526.00	14,802,200
ウェザーニューズ	4,000	3,345.00	13,380,000
C I J	9,400	934.00	8,779,600
東洋ビジネスエンジニアリング	1,300	2,059.00	2,676,700
日本エンタープライズ	13,100	164.00	2,148,400

WOWOW	5,600	2,842.00	15,915,200
スカラ	8,400	826.00	6,938,400
インテリジェント ウェイブ	4,600	726.00	3,339,600
I M A G I C A G R O U P	10,200	551.00	5,620,200
ネットワンシステムズ	41,300	2,821.00	116,507,300
システムソフト	29,500	98.00	2,891,000
アルゴグラフィックス	10,000	2,226.00	22,260,000
マーベラス	18,100	833.00	15,077,300
エイベックス	20,200	1,385.00	27,977,000
日本ユニシス	36,500	3,280.00	119,720,000
兼松エレクトロニクス	6,400	3,125.00	20,000,000
東京放送ホールディングス	77,400	2,040.00	157,896,000
日本テレビホールディングス	107,100	1,576.00	168,789,600
朝日放送グループホールディングス	11,900	733.00	8,722,700
テレビ朝日ホールディングス	32,100	1,765.00	56,656,500
スカパーJ S A Tホールディングス	89,500	428.00	38,306,000
テレビ東京ホールディングス	9,600	2,266.00	21,753,600
日本BS放送	4,200	1,081.00	4,540,200
ビジョン	3,600	5,310.00	19,116,000
スマートバリュー	3,600	797.00	2,869,200
ワイヤレスゲート	5,500	403.00	2,216,500
コネクシオ	8,400	1,378.00	11,575,200
クロップス	2,400	613.00	1,471,200
日本電信電話	797,200	4,745.00	3,782,714,000
K D D I	1,027,200	2,561.00	2,630,659,200
ソフトバンク	1,235,900	1,424.00	1,759,921,600
光通信	13,700	19,790.00	271,123,000
N T T ドコモ	738,000	2,412.50	1,780,425,000
エムティーアイ	11,500	661.00	7,601,500
G M O インターネット	42,600	1,718.00	73,186,800
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	518.00	1,502,200
カドカワ	34,200	1,358.00	46,443,600
学研ホールディングス	3,900	5,000.00	19,500,000
ゼンリン	23,300	2,232.00	52,005,600
昭文社	5,800	398.00	2,308,400
インプレスホールディングス	9,600	145.00	1,392,000
アイネット	6,800	1,258.00	8,554,400
松竹	7,700	13,150.00	101,255,000
東宝	76,700	4,510.00	345,917,000
東映	4,900	14,360.00	70,364,000
エヌ・ティ・ティ・データ	310,500	1,224.00	380,052,000
ピー・シー・エー	1,600	3,815.00	6,104,000

ビジネスブレイン太田昭和	2,100	1,961.00	4,118,100
D T S	13,100	4,480.00	58,688,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,300	3,665.00	199,009,500
シーイーシー	12,600	1,991.00	25,086,600
カブコン	50,000	2,150.00	107,500,000
アイ・エス・ビー	2,400	1,746.00	4,190,400
ジャステック	7,000	864.00	6,048,000
S C S K	30,800	4,920.00	151,536,000
日本システムウエア	3,900	2,196.00	8,564,400
アイネス	15,000	1,283.00	19,245,000
T K C	9,900	4,350.00	43,065,000
富士ソフト	17,400	4,870.00	84,738,000
N S D	19,200	3,035.00	58,272,000
コナミホールディングス	47,700	4,980.00	237,546,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	2,183.00	8,513,700
J B C Cホールディングス	9,400	1,327.00	12,473,800
ミロク情報サービス	11,600	2,833.00	32,862,800
ソフトバンクグループ	487,100	10,925.00	5,321,567,500
ハウスイ	1,000	803.00	803,000
高千穂交易	4,500	896.00	4,032,000
伊藤忠食品	2,900	4,410.00	12,789,000
エレマテック	5,500	1,946.00	10,703,000
J A L U X	3,300	2,772.00	9,147,600
あらた	8,600	4,245.00	36,507,000
トーメンデバイス	1,800	2,340.00	4,212,000
東京エレクトロン デバイス	4,300	1,843.00	7,924,900
フィールズ	10,300	740.00	7,622,000
双日	646,100	358.00	231,303,800
アルフレッサ ホールディングス	130,000	2,942.00	382,460,000
横浜冷凍	32,800	860.00	28,208,000
神栄	1,600	743.00	1,188,800
ラサ商事	6,300	797.00	5,021,100
ラクーンホールディングス	5,600	675.00	3,780,000
アルコニックス	12,500	1,240.00	15,500,000
神戸物産	17,700	4,355.00	77,083,500
あい ホールディングス	16,700	1,716.00	28,657,200
ディーブイエックス	4,600	890.00	4,094,000
ダイワボウホールディングス	10,700	5,270.00	56,389,000
マクニカ・富士エレホールディングス	32,400	1,488.00	48,211,200
ラクト・ジャパン	5,000	4,115.00	20,575,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,000	1,031.00	22,682,000
八洲電機	9,100	819.00	7,452,900

メディアスホールディングス	6,700	702.00	4,703,400
レスターホールディングス	12,800	1,704.00	21,811,200
ジューテックホールディングス	2,700	959.00	2,589,300
大光	5,000	688.00	3,440,000
OCHIホールディングス	3,400	1,234.00	4,195,600
TOKAIホールディングス	61,900	889.00	55,029,100
黒谷	2,700	436.00	1,177,200
Cominix	2,100	849.00	1,782,900
三洋貿易	5,900	2,170.00	12,803,000
ビューティガレージ	1,900	1,350.00	2,565,000
ウイン・パートナーズ	7,700	1,180.00	9,086,000
ミタチ産業	3,500	728.00	2,548,000
シップヘルスケアホールディングス	24,400	4,500.00	109,800,000
明治電機工業	3,700	1,717.00	6,352,900
デリカフーズホールディングス	2,100	1,402.00	2,944,200
スターティアホールディングス	2,300	616.00	1,416,800
コメダホールディングス	27,100	1,995.00	54,064,500
富士興産	4,600	674.00	3,100,400
協栄産業	1,400	1,515.00	2,121,000
小野建	10,600	1,452.00	15,391,200
南陽	2,400	1,960.00	4,704,000
佐島電機	8,700	927.00	8,064,900
エコトレーディング	2,700	537.00	1,449,900
伯東	8,100	1,153.00	9,339,300
コンドーテック	9,100	945.00	8,599,500
中山福	6,800	492.00	3,345,600
ナガイレーベン	16,900	2,382.00	40,255,800
三菱食品	12,900	2,798.00	36,094,200
松田産業	8,600	1,317.00	11,326,200
第一興商	17,400	5,330.00	92,742,000
メディバルホールディングス	126,200	2,423.00	305,782,600
SPK	2,500	2,382.00	5,955,000
萩原電気ホールディングス	4,300	2,897.00	12,457,100
アズワン	8,400	8,900.00	74,760,000
スズデン	4,100	1,434.00	5,879,400
尾家産業	3,800	1,222.00	4,643,600
シモジマ	7,200	1,155.00	8,316,000
ドウシシャ	11,000	1,748.00	19,228,000
小津産業	2,600	1,891.00	4,916,600
高速	7,000	1,115.00	7,805,000
たけびし	4,100	1,262.00	5,174,200
リックス	2,700	1,450.00	3,915,000

丸文	10,400	599.00	6,229,600
ハビネット	9,800	1,282.00	12,563,600
橋本総業ホールディングス	2,400	1,352.00	3,244,800
日本ライフライン	36,700	1,882.00	69,069,400
タカショー	5,700	456.00	2,599,200
エクセル	2,900	1,792.00	5,196,800
マルカ	3,800	1,985.00	7,543,000
I D O M	39,600	264.00	10,454,400
日本エム・ディ・エム	6,900	1,295.00	8,935,500
進和	6,900	2,168.00	14,959,200
エスケイジャパン	2,900	550.00	1,595,000
ダイトロン	5,400	1,491.00	8,051,400
シークス	14,900	1,586.00	23,631,400
田中商事	4,000	586.00	2,344,000
オーハシテクニカ	6,600	1,349.00	8,903,400
白銅	3,800	1,443.00	5,483,400
伊藤忠商事	818,200	1,955.00	1,599,581,000
丸紅	1,153,600	713.90	823,555,040
高島	1,900	1,656.00	3,146,400
長瀬産業	65,800	1,660.00	109,228,000
蝶理	7,500	1,572.00	11,790,000
豊田通商	130,600	3,310.00	432,286,000
三共生興	20,100	493.00	9,909,300
兼松	46,800	1,145.00	53,586,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,092.00	2,293,200
三井物産	963,800	1,657.00	1,597,016,600
日本紙パルプ商事	6,700	3,885.00	26,029,500
日立ハイテクノロジーズ	35,600	4,835.00	172,126,000
カメイ	15,300	1,094.00	16,738,200
東都水産	1,600	2,467.00	3,947,200
O U G ホールディングス	1,900	2,560.00	4,864,000
スターゼン	4,300	3,910.00	16,813,000
山善	45,700	1,068.00	48,807,600
椿本興業	2,600	3,005.00	7,813,000
住友商事	691,900	1,580.50	1,093,547,950
内田洋行	5,000	3,430.00	17,150,000
三菱商事	820,900	2,844.00	2,334,639,600
第一実業	5,300	3,310.00	17,543,000
キャノンマーケティングジャパン	33,400	2,254.00	75,283,600
西華産業	6,700	1,249.00	8,368,300
佐藤商事	10,500	856.00	8,988,000
菱洋エレクトロ	11,900	1,616.00	19,230,400

東京産業	11,700	490.00	5,733,000
ユアサ商事	12,000	2,953.00	35,436,000
神鋼商事	2,600	2,403.00	6,247,800
小林産業	7,000	319.00	2,233,000
阪和興業	20,300	2,916.00	59,194,800
正栄食品工業	8,200	3,055.00	25,051,000
カナデン	10,600	1,215.00	12,879,000
菱電商事	9,300	1,530.00	14,229,000
フルサト工業	6,500	1,489.00	9,678,500
岩谷産業	26,000	3,415.00	88,790,000
すてきナイスグループ	5,000	967.00	4,835,000
昭光通商	4,200	629.00	2,641,800
ニチモウ	1,800	1,722.00	3,099,600
極東貿易	3,600	1,465.00	5,274,000
イワキ	14,000	447.00	6,258,000
三愛石油	31,600	837.00	26,449,200
稲畑産業	28,100	1,392.00	39,115,200
G S Iクレオス	3,100	1,106.00	3,428,600
明和産業	10,800	428.00	4,622,400
クワザワ	4,200	580.00	2,436,000
ワキタ	25,000	1,094.00	27,350,000
東邦ホールディングス	34,600	2,603.00	90,063,800
サンゲツ	34,800	2,038.00	70,922,400
ミツウロコグループホールディングス	15,500	853.00	13,221,500
シナネンホールディングス	4,800	1,916.00	9,196,800
伊藤忠エネクス	26,000	862.00	22,412,000
サンリオ	36,100	2,501.00	90,286,100
サンワテクノス	7,200	844.00	6,076,800
リョーサン	12,900	2,784.00	35,913,600
新光商事	11,000	1,818.00	19,998,000
トーホー	5,300	2,108.00	11,172,400
三信電気	8,100	1,725.00	13,972,500
東陽テクニカ	13,600	900.00	12,240,000
モスフードサービス	15,400	2,609.00	40,178,600
加賀電子	11,700	1,888.00	22,089,600
ソーダニッカ	12,200	486.00	5,929,200
立花エレテック	8,700	1,594.00	13,867,800
フォーバル	5,200	933.00	4,851,600
P A L T A C	21,100	5,980.00	126,178,000
三谷産業	13,700	286.00	3,918,200
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,700	4,035.00	10,894,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,235.00	1,235,000

国際紙パルプ商事	27,400	284.00	7,781,600
ヤマタネ	5,900	1,527.00	9,009,300
丸紅建材リース	1,200	1,811.00	2,173,200
日鉄物産	8,300	4,350.00	36,105,000
泉州電業	3,900	2,357.00	9,192,300
トラスコ中山	24,300	2,751.00	66,849,300
オートバックスセブン	46,500	1,705.00	79,282,500
モリト	8,600	826.00	7,103,600
加藤産業	18,300	3,465.00	63,409,500
北恵	2,300	885.00	2,035,500
イノテック	7,000	936.00	6,552,000
イエローハット	22,200	1,405.00	31,191,000
J Kホールディングス	10,700	523.00	5,596,100
日伝	9,800	1,670.00	16,366,000
北沢産業	8,800	293.00	2,578,400
杉本商事	6,300	1,844.00	11,617,200
因幡電機産業	16,600	4,230.00	70,218,000
東テク	3,900	2,102.00	8,197,800
ミスミグループ本社	146,500	2,635.00	386,027,500
アルテック	8,600	216.00	1,857,600
タキヒヨー	3,600	1,768.00	6,364,800
蔵王産業	1,900	1,309.00	2,487,100
スズケン	53,400	6,570.00	350,838,000
ジェコス	8,100	913.00	7,395,300
ルネサスイーストン	10,800	393.00	4,244,400
ローソン	29,600	5,150.00	152,440,000
サンエー	8,900	4,300.00	38,270,000
カワチ薬品	9,100	1,844.00	16,780,400
エービーシー・マート	18,300	6,860.00	125,538,000
ハードオフコーポレーション	4,700	710.00	3,337,000
アスクル	12,300	2,877.00	35,387,100
ゲオホールディングス	17,900	1,458.00	26,098,200
アダストリア	16,200	2,870.00	46,494,000
ジーフット	7,200	635.00	4,572,000
くら寿司	6,900	4,555.00	31,429,500
キャンドウ	5,600	1,729.00	9,682,400
パルグループホールディングス	6,000	3,345.00	20,070,000
エディオン	49,700	982.00	48,805,400
サーラコーポレーション	24,000	584.00	14,016,000
ワッツ	5,300	674.00	3,572,200
ハローズ	4,400	2,198.00	9,671,200
フジオフードシステム	4,900	2,943.00	14,420,700

あみやき亭	2,500	3,370.00	8,425,000
ひらまつ	23,500	346.00	8,131,000
大黒天物産	2,800	3,725.00	10,430,000
ハニーズホールディングス	10,400	1,049.00	10,909,600
ファーマライズホールディングス	2,900	554.00	1,606,600
アルペン	9,100	1,642.00	14,942,200
ハブ	3,800	1,202.00	4,567,600
クオールホールディングス	17,300	1,691.00	29,254,300
ジinz	6,200	6,250.00	38,750,000
ビックカメラ	69,400	1,162.00	80,642,800
D C Mホールディングス	63,200	1,090.00	68,888,000
ペッパーフードサービス	9,300	1,975.00	18,367,500
Monotaro	73,900	2,298.00	169,822,200
東京一番フーズ	3,100	606.00	1,878,600
DDホールディングス	2,600	1,905.00	4,953,000
きちりホールディングス	3,200	738.00	2,361,600
アークランドサービスホールディングス	8,600	1,997.00	17,174,200
J.フロント リテイリング	149,700	1,260.00	188,622,000
ドトール・日レスホールディングス	20,600	2,081.00	42,868,600
マツモトキヨシホールディングス	48,400	3,465.00	167,706,000
ブロンコビリー	6,100	2,252.00	13,737,200
Z O Z O	126,400	2,200.00	278,080,000
トレジャー・ファクトリー	3,500	718.00	2,513,000
物語コーポレーション	2,900	8,550.00	24,795,000
ココカラファイン	13,200	4,640.00	61,248,000
三越伊勢丹ホールディングス	218,900	963.00	210,800,700
Hamee	3,700	785.00	2,904,500
ウエルシアホールディングス	30,900	4,115.00	127,153,500
クリエイティブSDホールディングス	17,300	2,468.00	42,696,400
丸善C H Iホールディングス	13,600	368.00	5,004,800
ティーライフ	1,700	871.00	1,480,700
エー・ピーカンパニー	2,300	452.00	1,039,600
チムニー	3,600	2,588.00	9,316,800
シュッピン	8,100	880.00	7,128,000
ネクステージ	18,300	1,177.00	21,539,100
ジョイフル本田	34,300	1,206.00	41,365,800
鳥貴族	3,900	1,793.00	6,992,700
キリン堂ホールディングス	4,700	1,683.00	7,910,100
ホットランド	6,200	1,506.00	9,337,200
すかいらーくホールディングス	109,100	1,829.00	199,543,900
S F Pホールディングス	5,000	1,772.00	8,860,000
綿半ホールディングス	4,400	2,257.00	9,930,800

ヨシックス	1,900	2,601.00	4,941,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,200	982.00	33,584,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	655.00	3,209,500
B E E N O S	4,100	1,687.00	6,916,700
あさひ	9,800	1,336.00	13,092,800
日本調剤	4,200	3,770.00	15,834,000
コスモス薬品	5,200	17,580.00	91,416,000
トーエル	5,800	709.00	4,112,200
オンリー	2,100	830.00	1,743,000
セブン&アイ・ホールディングス	490,300	3,698.00	1,813,129,400
薬王堂	5,100	2,524.00	12,872,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	31,500	1,329.00	41,863,500
ツルハホールディングス	25,400	9,070.00	230,378,000
サンマルクホールディングス	9,300	2,410.00	22,413,000
フェリシモ	2,700	941.00	2,540,700
トリドールホールディングス	14,500	2,423.00	35,133,500
T O K Y O B A S E	10,600	953.00	10,101,800
ウイルプラスホールディングス	1,900	864.00	1,641,600
ジャパンミート	5,900	1,630.00	9,617,000
サツドラホールディングス	1,800	1,892.00	3,405,600
デファクトスタンダード	900	378.00	340,200
アレンザホールディングス	6,400	813.00	5,203,200
パロックジャパンリミテッド	9,600	886.00	8,505,600
クスリのアオキホールディングス	11,600	7,360.00	85,376,000
力の源ホールディングス	4,500	773.00	3,478,500
スシローグローバルホールディングス	12,800	7,250.00	92,800,000
L I X I L ビバ	10,000	1,265.00	12,650,000
メディカルシステムネットワーク	12,600	513.00	6,463,800
はるやまホールディングス	5,600	798.00	4,468,800
ノジマ	20,800	1,809.00	37,627,200
カップ・クリエイト	16,500	1,361.00	22,456,500
ライトオン	8,800	766.00	6,740,800
良品計画	16,600	20,210.00	335,486,000
三城ホールディングス	14,600	370.00	5,402,000
アドヴァン	18,000	995.00	17,910,000
アルビス	4,500	2,248.00	10,116,000
コナカ	13,900	425.00	5,907,500
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,699.00	2,548,500
G - 7ホールディングス	3,500	2,429.00	8,501,500
イオン北海道	11,900	734.00	8,734,600
コジマ	20,200	503.00	10,160,600

ヒマラヤ	4,200	830.00	3,486,000
コーナン商事	15,400	2,342.00	36,066,800
エコス	4,400	1,410.00	6,204,000
ワタミ	15,500	1,605.00	24,877,500
マルシェ	3,200	768.00	2,457,600
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	70,100	6,860.00	480,886,000
西松屋チェーン	25,900	842.00	21,807,800
ゼンショーホールディングス	55,200	2,393.00	132,093,600
幸楽苑ホールディングス	7,400	3,200.00	23,680,000
ハークスレイ	2,500	1,010.00	2,525,000
サイゼリヤ	19,300	2,457.00	47,420,100
V Tホールディングス	52,900	434.00	22,958,600
魚力	3,300	1,474.00	4,864,200
フジ・コーポレーション	3,100	2,145.00	6,649,500
ユナイテッドアローズ	13,400	3,650.00	48,910,000
ハイデイ日高	16,900	1,976.00	33,394,400
京都きもの友禅	7,600	380.00	2,888,000
コロワイド	38,900	2,003.00	77,916,700
ピーシーデポコーポレーション	15,700	404.00	6,342,800
壱番屋	8,300	4,520.00	37,516,000
P L A N T	3,100	852.00	2,641,200
スギホールディングス	25,700	5,470.00	140,579,000
ヴィア・ホールディングス	14,300	615.00	8,794,500
スクロール	18,300	337.00	6,167,100
ヨンドシーホールディングス	13,000	2,368.00	30,784,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	130,900	2,783.00	364,294,700
木曽路	14,400	2,509.00	36,129,600
S R Sホールディングス	13,900	999.00	13,886,100
タカキュー	9,400	181.00	1,701,400
ケーヨー	21,800	475.00	10,355,000
上新電機	13,800	2,366.00	32,650,800
日本瓦斯	19,000	2,757.00	52,383,000
ロイヤルホールディングス	20,400	2,741.00	55,916,400
いなげや	13,200	1,308.00	17,265,600
島忠	24,700	2,585.00	63,849,500
チヨダ	12,300	1,653.00	20,331,900
ライフコーポレーション	8,900	2,114.00	18,814,600
リンガーハット	14,400	2,323.00	33,451,200
M r M a x H D	16,200	458.00	7,419,600
テンアライド	10,800	404.00	4,363,200
A O K Iホールディングス	23,500	1,047.00	24,604,500
オークワ	16,800	1,076.00	18,076,800

コメリ	18,100	2,184.00	39,530,400
青山商事	20,500	2,276.00	46,658,000
しまむら	13,600	8,040.00	109,344,000
はせがわ	6,400	387.00	2,476,800
高島屋	91,800	1,195.00	109,701,000
松屋	23,700	897.00	21,258,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	60,100	1,316.00	79,091,600
近鉄百貨店	4,500	3,150.00	14,175,000
パルコ	11,400	1,052.00	11,992,800
丸井グループ	99,000	2,136.00	211,464,000
アクシアル リテイリング	9,700	3,300.00	32,010,000
イオン	450,200	1,963.00	883,742,600
イズミ	23,800	4,800.00	114,240,000
平和堂	23,800	1,988.00	47,314,400
フジ	14,200	1,750.00	24,850,000
ヤオコー	13,300	5,140.00	68,362,000
ゼビオホールディングス	14,300	1,149.00	16,430,700
ケーズホールディングス	121,600	1,111.00	135,097,600
Olympicグループ	7,000	706.00	4,942,000
日産東京販売ホールディングス	17,400	263.00	4,576,200
Genky DrugStores	5,700	2,640.00	15,048,000
総合メディカルホールディングス	10,200	1,893.00	19,308,600
ブックオフグループホールディングス	6,100	861.00	5,252,100
アインホールディングス	15,700	8,870.00	139,259,000
元気寿司	3,300	3,135.00	10,345,500
ヤマダ電機	356,500	510.00	181,815,000
アークランドサカモト	20,000	1,376.00	27,520,000
ニトリホールディングス	50,600	12,910.00	653,246,000
グルメ杵屋	8,400	1,132.00	9,508,800
愛眼	9,300	255.00	2,371,500
ケーユーホールディングス	6,200	857.00	5,313,400
吉野家ホールディングス	40,900	1,721.00	70,388,900
松屋フーズホールディングス	5,600	3,550.00	19,880,000
サガミホールディングス	15,800	1,314.00	20,761,200
関西スーパーマーケット	9,000	1,007.00	9,063,000
王将フードサービス	8,600	7,010.00	60,286,000
プレナス	13,100	1,777.00	23,278,700
ミニストップ	8,700	1,704.00	14,824,800
アークス	22,000	2,166.00	47,652,000
バローホールディングス	25,300	2,420.00	61,226,000
ベルク	5,800	4,800.00	27,840,000
大庄	6,300	1,552.00	9,777,600

ファーストリテイリング	15,600	65,400.00	1,020,240,000
サンドラッグ	44,000	2,857.00	125,708,000
サクスパー ホールディングス	10,000	1,084.00	10,840,000
ヤマザワ	2,500	1,590.00	3,975,000
やまや	2,000	2,109.00	4,218,000
ペルーナ	28,900	841.00	24,304,900
島根銀行	3,800	752.00	2,857,600
じもとホールディングス	79,600	102.00	8,119,200
めぶきフィナンシャルグループ	612,100	260.00	159,146,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,500	1,453.00	23,974,500
九州フィナンシャルグループ	194,500	426.00	82,857,000
ゆうちょ銀行	332,600	1,212.00	403,111,200
富山第一銀行	30,700	348.00	10,683,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	737,100	407.00	299,999,700
西日本フィナンシャルホールディングス	74,700	844.00	63,046,800
関西みらいフィナンシャルグループ	56,200	705.00	39,621,000
三十三フィナンシャルグループ	10,800	1,425.00	15,390,000
第四北越フィナンシャルグループ	20,600	2,933.00	60,419,800
新生銀行	86,000	1,497.00	128,742,000
あおぞら銀行	65,400	2,593.00	169,582,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,064,300	523.50	4,221,661,050
りそなホールディングス	1,285,600	446.60	574,148,960
三井住友トラスト・ホールディングス	230,300	3,747.00	862,934,100
三井住友フィナンシャルグループ	825,700	3,880.00	3,203,716,000
千葉銀行	404,600	540.00	218,484,000
群馬銀行	236,500	404.00	95,546,000
武蔵野銀行	17,900	1,958.00	35,048,200
千葉興業銀行	35,500	271.00	9,620,500
筑波銀行	49,000	182.00	8,918,000
七十七銀行	37,400	1,490.00	55,726,000
青森銀行	9,400	2,744.00	25,793,600
秋田銀行	7,900	2,063.00	16,297,700
山形銀行	13,700	1,700.00	23,290,000
岩手銀行	8,500	2,929.00	24,896,500
東邦銀行	104,600	264.00	27,614,400
東北銀行	6,000	980.00	5,880,000
みちのく銀行	7,600	1,566.00	11,901,600
ふくおかフィナンシャルグループ	103,500	2,442.00	252,747,000
静岡銀行	296,000	797.00	235,912,000
十六銀行	16,100	2,141.00	34,470,100
八十二銀行	284,700	457.00	130,107,900
山梨中央銀行	14,800	1,233.00	18,248,400

大垣共立銀行	25,100	2,434.00	61,093,400	
福井銀行	10,600	1,506.00	15,963,600	
北國銀行	12,300	3,065.00	37,699,500	
清水銀行	5,400	1,616.00	8,726,400	
富山銀行	2,600	2,868.00	7,456,800	
滋賀銀行	23,800	2,541.00	60,475,800	
南都銀行	18,700	1,985.00	37,119,500	
百五銀行	108,300	328.00	35,522,400	
京都銀行	42,200	4,380.00	184,836,000	
紀陽銀行	42,100	1,431.00	60,245,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	78,800	1,118.00	88,098,400	
広島銀行	174,500	558.00	97,371,000	
山陰合同銀行	70,800	697.00	49,347,600	
中国銀行	101,700	1,040.00	105,768,000	
鳥取銀行	4,700	1,317.00	6,189,900	
伊予銀行	156,700	578.00	90,572,600	
百十四銀行	12,900	2,160.00	27,864,000	
四国銀行	17,700	976.00	17,275,200	
阿波銀行	18,300	2,687.00	49,172,100	
大分銀行	7,500	3,210.00	24,075,000	
宮崎銀行	8,200	2,516.00	20,631,200	
佐賀銀行	7,600	1,629.00	12,380,400	
沖縄銀行	11,000	3,195.00	35,145,000	
琉球銀行	27,800	1,127.00	31,330,600	
セブン銀行	398,700	304.00	121,204,800	
みずほフィナンシャルグループ	15,918,500	167.30	2,663,165,050	
高知銀行	4,300	728.00	3,130,400	
山口フィナンシャルグループ	147,400	788.00	116,151,200	
長野銀行	4,500	1,606.00	7,227,000	
名古屋銀行	9,700	3,475.00	33,707,500	
北洋銀行	180,200	249.00	44,869,800	
愛知銀行	4,500	3,350.00	15,075,000	
中京銀行	5,300	2,108.00	11,172,400	
大光銀行	4,600	1,491.00	6,858,600	
愛媛銀行	17,300	1,051.00	18,182,300	
トマト銀行	5,500	1,037.00	5,703,500	
京葉銀行	53,200	631.00	33,569,200	
栃木銀行	65,100	213.00	13,866,300	
北日本銀行	4,200	1,739.00	7,303,800	
東和銀行	20,700	691.00	14,303,700	
福島銀行	7,300	286.00	2,087,800	
大東銀行	5,700	596.00	3,397,200	

トモニホールディングス	92,800	373.00	34,614,400
フィデアホールディングス	114,100	122.00	13,920,200
池田泉州ホールディングス	127,700	265.00	33,840,500
F P G	37,100	913.00	33,872,300
マーキュリアインベストメント	4,700	678.00	3,186,600
S B I ホールディングス	139,600	2,494.00	348,162,400
ジャフコ	19,200	4,025.00	77,280,000
大和証券グループ本社	940,200	499.50	469,629,900
野村ホールディングス	2,061,600	382.10	787,737,360
岡三証券グループ	100,200	392.00	39,278,400
丸三証券	35,000	615.00	21,525,000
東洋証券	43,000	125.00	5,375,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	140,100	351.00	49,175,100
光世証券	3,000	678.00	2,034,000
水戸証券	34,700	204.00	7,078,800
いちよし証券	24,900	754.00	18,774,600
松井証券	57,500	1,025.00	58,937,500
だいこう証券ビジネス	5,100	440.00	2,244,000
マネックスグループ	108,400	327.00	35,446,800
カブドットコム証券	86,900	557.00	48,403,300
極東証券	15,900	998.00	15,868,200
岩井コスモホールディングス	12,200	1,178.00	14,371,600
藍澤証券	21,300	696.00	14,824,800
マネーパートナーズグループ	14,200	294.00	4,174,800
スパークス・グループ	46,800	257.00	12,027,600
かんぽ生命保険	44,300	2,091.00	92,631,300
S O M P O ホールディングス	206,500	4,233.00	874,114,500
アニコム ホールディングス	9,700	2,970.00	28,809,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	306,300	3,329.00	1,019,672,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	96,300	2,255.00	217,156,500
第一生命ホールディングス	662,800	1,533.50	1,016,403,800
東京海上ホールディングス	418,900	5,460.00	2,287,194,000
T & D ホールディングス	362,300	1,170.00	423,891,000
アドバンスクリエイト	2,700	1,726.00	4,660,200
全国保証	33,000	3,640.00	120,120,000
ジェイリース	3,200	333.00	1,065,600
イントラスト	3,300	480.00	1,584,000
日本モーゲージサービス	2,100	1,096.00	2,301,600
C a s a	5,300	1,031.00	5,464,300
アルヒ	10,600	1,517.00	16,080,200
プレミアグループ	6,700	1,874.00	12,555,800
クレディセゾン	82,100	1,340.00	110,014,000

芙蓉総合リース	13,400	5,500.00	73,700,000
興銀リース	22,000	2,457.00	54,054,000
東京センチュリー	23,600	4,595.00	108,442,000
日本証券金融	51,500	549.00	28,273,500
アイフル	178,900	260.00	46,514,000
リコーリース	9,200	3,165.00	29,118,000
イオンフィナンシャルサービス	74,800	2,164.00	161,867,200
アコム	235,500	380.00	89,490,000
ジャックス	12,900	1,704.00	21,981,600
オリエントコーポレーション	316,300	119.00	37,639,700
日立キャピタル	27,600	2,291.00	63,231,600
アプラスフィナンシャル	56,100	83.00	4,656,300
オリックス	781,600	1,585.00	1,238,836,000
三菱UFJリース	264,300	523.00	138,228,900
九州リースサービス	5,800	669.00	3,880,200
日本取引所グループ	316,500	1,782.00	564,003,000
イー・ギャランティ	11,000	1,157.00	12,727,000
アサックス	4,900	544.00	2,665,600
NECキャピタルソリューション	4,800	1,741.00	8,356,800
いちご	151,200	338.00	51,105,600
日本駐車場開発	133,000	168.00	22,344,000
ヒューリック	245,300	933.00	228,864,900
三栄建築設計	5,200	1,538.00	7,997,600
スター・マイカ	6,000	1,325.00	7,950,000
野村不動産ホールディングス	78,400	2,297.00	180,084,800
三重交通グループホールディングス	25,200	580.00	14,616,000
サムティ	16,800	1,428.00	23,990,400
ディア・ライフ	16,900	414.00	6,996,600
コーセーアールイー	4,500	730.00	3,285,000
エー・ディー・ワークス	115,000	34.00	3,910,000
日本商業開発	7,900	1,457.00	11,510,300
プレサンスコーポレーション	19,100	1,310.00	25,021,000
ユニゾホールディングス	18,100	1,829.00	33,104,900
日本管理センター	8,600	942.00	8,101,200
サンセイランディック	4,200	735.00	3,087,000
エストラスト	1,200	704.00	844,800
フージャースホールディングス	21,200	657.00	13,928,400
オープンハウス	17,200	3,685.00	63,382,000
東急不動産ホールディングス	316,400	597.00	188,890,800
飯田グループホールディングス	98,100	1,827.00	179,228,700
イーランド	2,800	643.00	1,800,400
ムゲンエステート	9,500	529.00	5,025,500

ファーストブラザーズ	3,900	1,121.00	4,371,900
ハウストゥ	6,500	1,269.00	8,248,500
シーアールイー	3,700	977.00	3,614,900
ケイアイスター不動産	3,600	1,552.00	5,587,200
グッドコムアセット	3,200	1,445.00	4,624,000
ジェイ・エス・ビー	700	3,395.00	2,376,500
テンポイノベーション	1,800	1,530.00	2,754,000
パーク24	68,800	2,173.00	149,502,400
パラカ	3,400	1,950.00	6,630,000
三井不動産	621,800	2,515.00	1,563,827,000
三菱地所	821,200	1,869.00	1,534,822,800
平和不動産	22,500	2,027.00	45,607,500
東京建物	128,700	1,190.00	153,153,000
ダイビル	35,300	956.00	33,746,800
京阪神ビルディング	21,700	1,024.00	22,220,800
住友不動産	263,500	3,979.00	1,048,466,500
テーオーシー	28,000	663.00	18,564,000
東京楽天地	1,800	4,995.00	8,991,000
スターツコーポレーション	16,200	2,322.00	37,616,400
フジ住宅	16,000	801.00	12,816,000
空港施設	15,200	537.00	8,162,400
明和地所	7,800	533.00	4,157,400
ゴールドクレスト	9,800	1,633.00	16,003,400
日本エスリード	5,100	1,545.00	7,879,500
日神不動産	19,100	413.00	7,888,300
日本エスコン	22,200	707.00	15,695,400
タカラレーベン	55,800	334.00	18,637,200
サンヨーハウジング名古屋	7,500	887.00	6,652,500
イオンモール	59,200	1,671.00	98,923,200
毎日コムネット	3,600	770.00	2,772,000
ファースト住建	5,000	1,165.00	5,825,000
カチタス	13,300	3,505.00	46,616,500
トーセイ	17,000	856.00	14,552,000
穴吹興産	1,500	2,920.00	4,380,000
サンフロンティア不動産	16,900	993.00	16,781,700
エフ・ジェー・ネクスト	11,200	963.00	10,785,600
インテリックス	4,500	725.00	3,262,500
ランドビジネス	4,900	771.00	3,777,900
グランディハウス	11,900	465.00	5,533,500
日本空港ビルデング	37,500	4,170.00	156,375,000
日本工営	7,700	2,339.00	18,010,300
LIFULL	39,800	587.00	23,362,600

ジェイエイシーリクルートメント	9,200	2,741.00	25,217,200
日本M&Aセンター	84,600	2,856.00	241,617,600
メンバーズ	3,900	1,715.00	6,688,500
中広	1,400	541.00	757,400
アイティメディア	2,500	483.00	1,207,500
タケエイ	12,000	737.00	8,844,000
E・Jホールディングス	1,600	1,186.00	1,897,600
トラスト・テック	6,300	3,735.00	23,530,500
コシダカホールディングス	27,400	1,476.00	40,442,400
アルトナー	2,900	823.00	2,386,700
パソナグループ	14,000	1,660.00	23,240,000
CDS	3,000	1,302.00	3,906,000
リンクアンドモチベーション	21,200	783.00	16,599,600
GCA	11,800	799.00	9,428,200
エス・エム・エス	41,800	2,436.00	101,824,800
サニーサイドアップ	1,300	2,047.00	2,661,100
パーソルホールディングス	113,500	2,004.00	227,454,000
リニカル	6,500	1,206.00	7,839,000
クックパッド	36,400	269.00	9,791,600
エスクリ	3,300	628.00	2,072,400
アイ・ケイ・ケイ	5,800	710.00	4,118,000
学情	4,700	1,105.00	5,193,500
スタジオアリス	5,800	2,062.00	11,959,600
シミックホールディングス	6,400	2,071.00	13,254,400
NJS	2,600	1,494.00	3,884,400
総合警備保障	45,200	4,810.00	217,412,000
カカクコム	85,000	2,175.00	184,875,000
アイロムグループ	4,300	1,798.00	7,731,400
セントケア・ホールディング	8,500	476.00	4,046,000
サイネックス	2,100	683.00	1,434,300
ルネサンス	6,400	2,163.00	13,843,200
ディップ	18,400	1,631.00	30,010,400
オプトホールディング	7,000	1,656.00	11,592,000
ツクイ	27,100	668.00	18,102,800
キャリアデザインセンター	3,000	1,518.00	4,554,000
ベネフィット・ワン	31,500	2,165.00	68,197,500
エムスリー	239,000	2,034.00	486,126,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,500	619.00	4,642,500
プラス	1,500	622.00	933,000
アウトソーシング	59,900	1,324.00	79,307,600
ウェルネット	10,900	994.00	10,834,600
ワールドホールディングス	3,200	1,771.00	5,667,200

ディー・エヌ・エー	61,300	1,766.00	108,255,800
博報堂DYホールディングス	157,900	1,760.00	277,904,000
ぐるなび	16,500	589.00	9,718,500
タカミヤ	12,000	679.00	8,148,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	1,384.00	10,656,800
ファンコミュニケーションズ	31,700	615.00	19,495,500
ライク	4,700	1,232.00	5,790,400
ビジネス・ブレークスルー	5,200	356.00	1,851,200
WDBホールディングス	5,200	3,305.00	17,186,000
ティア	6,800	662.00	4,501,600
CDG	1,200	1,307.00	1,568,400
バリューコマース	7,700	2,549.00	19,627,300
インフォマート	62,300	1,573.00	97,997,900
J Pホールディングス	33,000	293.00	9,669,000
エコナックホールディングス	21,700	128.00	2,777,600
E P Sホールディングス	17,200	1,840.00	31,648,000
レグス	3,000	1,293.00	3,879,000
プレステージ・インターナショナル	21,300	1,580.00	33,654,000
アミューズ	6,900	2,658.00	18,340,200
ドリームインキュベータ	3,500	1,605.00	5,617,500
クイック	7,100	1,662.00	11,800,200
T A C	6,700	214.00	1,433,800
ケネディクス	100,000	526.00	52,600,000
電通	138,300	4,455.00	616,126,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,376.00	6,192,000
ぴあ	3,300	4,805.00	15,856,500
イオンファンタジー	3,700	2,450.00	9,065,000
シーティーエス	13,100	670.00	8,777,000
ネクシィーズグループ	4,000	2,598.00	10,392,000
みらかホールディングス	31,800	2,748.00	87,386,400
アルプス技研	10,000	1,828.00	18,280,000
ダイオーズ	2,700	1,359.00	3,669,300
日本空調サービス	13,200	677.00	8,936,400
オリエンタルランド	134,100	12,400.00	1,662,840,000
ダスキン	29,200	2,681.00	78,285,200
明光ネットワークジャパン	13,500	1,024.00	13,824,000
ファルコホールディングス	6,400	1,334.00	8,537,600
ラウンドワン	35,300	1,659.00	58,562,700
リゾートトラスト	48,100	1,488.00	71,572,800
ビー・エム・エル	14,700	3,035.00	44,614,500
ワタベウェディング	2,100	646.00	1,356,600
りらいあコミュニケーションズ	20,600	1,164.00	23,978,400

リソー教育	58,100	433.00	25,157,300
早稲田アカデミー	3,500	714.00	2,499,000
ユー・エス・エス	138,700	2,031.00	281,699,700
東京個別指導学院	4,200	983.00	4,128,600
サイバーエージェント	65,300	4,535.00	296,135,500
楽天	529,100	1,146.00	606,348,600
クリーク・アンド・リバー社	6,800	1,217.00	8,275,600
テー・オー・ダブリュー	10,200	716.00	7,303,200
山田コンサルティンググループ	5,600	2,167.00	12,135,200
セントラルスポーツ	4,300	3,040.00	13,072,000
フルキャストホールディングス	11,400	2,385.00	27,189,000
エン・ジャパン	16,500	3,270.00	53,955,000
リソルホールディングス	1,300	3,990.00	5,187,000
テクノプロ・ホールディングス	22,800	6,140.00	139,992,000
アトラ	2,600	325.00	845,000
インターワークス	2,400	656.00	1,574,400
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	1,884.00	8,854,800
K e e P e r 技研	4,300	1,241.00	5,336,300
ファーストロジック	2,900	563.00	1,632,700
三機サービス	2,500	1,243.00	3,107,500
G u n o s y	8,000	1,663.00	13,304,000
デザインワン・ジャパン	2,700	328.00	885,600
イー・ガーディアン	5,800	1,877.00	10,886,600
リブセンス	6,700	269.00	1,802,300
ジャパンマテリアル	31,100	1,557.00	48,422,700
ベクトル	14,000	1,252.00	17,528,000
ウチヤマホールディングス	5,900	591.00	3,486,900
チャーム・ケア・コーポレーション	3,700	1,578.00	5,838,600
ライクキッズネクスト	2,900	823.00	2,386,700
キャリアリンク	4,600	418.00	1,922,800
I B J	7,800	943.00	7,355,400
アサンテ	4,600	2,124.00	9,770,400
N・フィールド	7,600	719.00	5,464,400
バリューHR	2,500	2,446.00	6,115,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,100	5,540.00	22,714,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,138.00	5,462,400
E R Iホールディングス	3,400	911.00	3,097,400
アピスト	1,800	3,040.00	5,472,000
シグマクシス	5,600	1,203.00	6,736,800
ウィルグループ	7,500	1,196.00	8,970,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	286.00	4,604,600
日本ビューホテル	3,700	1,119.00	4,140,300

リクルートホールディングス	813,100	3,286.00	2,671,846,600
エラン	8,000	1,854.00	14,832,000
土木管理総合試験所	5,200	445.00	2,314,000
日本郵政	930,400	1,216.00	1,131,366,400
ベルシステム24ホールディングス	19,200	1,536.00	29,491,200
鎌倉新書	8,400	1,435.00	12,054,000
ソネット・メディア・ネットワークス	1,600	899.00	1,438,400
一蔵	1,500	534.00	801,000
LITALICO	2,700	1,813.00	4,895,100
グローバルキッズCOMPANY	1,800	1,006.00	1,810,800
エボラブルアジア	4,900	1,969.00	9,648,100
アトラエ	3,000	3,360.00	10,080,000
ストライク	4,400	1,946.00	8,562,400
ソラスト	28,000	1,084.00	30,352,000
セラク	3,800	614.00	2,333,200
インソース	4,500	2,704.00	12,168,000
ベikalレント・コンサルティング	8,100	3,930.00	31,833,000
Orchestra Holdings	2,100	895.00	1,879,500
アイモバイル	3,700	822.00	3,041,400
キャリアインデックス	4,100	841.00	3,448,100
MS - Japan	4,700	1,668.00	7,839,600
船場	2,000	983.00	1,966,000
グレイステクノロジー	4,200	1,942.00	8,156,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,000	2,203.00	19,827,000
フルテック	1,700	1,183.00	2,011,100
グリーンズ	4,400	1,564.00	6,881,600
ツナググループ・ホールディングス	1,600	616.00	985,600
ソウルドアウト	1,200	3,200.00	3,840,000
MS&Consulting	2,000	1,110.00	2,220,000
日総工産	7,600	1,386.00	10,533,600
キュービーネットホールディングス	6,900	2,588.00	17,857,200
RPAホールディングス	2,300	5,630.00	12,949,000
スプリックス	3,800	2,577.00	9,792,600
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	905.00	4,253,500
リログループ	62,100	2,885.00	179,158,500
東祥	7,100	2,820.00	20,022,000
エイチ・アイ・エス	20,300	3,550.00	72,065,000
ラックランド	2,300	2,154.00	4,954,200
共立メンテナンス	17,400	5,520.00	96,048,000
イチネンホールディングス	12,000	1,151.00	13,812,000
建設技術研究所	8,000	1,483.00	11,864,000
スペース	7,500	1,216.00	9,120,000

長大	4,800	739.00	3,547,200	
燦ホールディングス	2,500	2,195.00	5,487,500	
スバル興業	800	5,470.00	4,376,000	
東京テアトル	4,600	1,290.00	5,934,000	
タナベ経営	2,300	1,193.00	2,743,900	
ナガワ	3,200	5,900.00	18,880,000	
よみうりランド	2,500	4,265.00	10,662,500	
東京都競馬	7,500	3,340.00	25,050,000	
カナモト	17,000	2,452.00	41,684,000	
東京ドーム	42,600	1,076.00	45,837,600	
西尾レントオール	11,600	2,819.00	32,700,400	
トランス・コスモス	12,700	2,513.00	31,915,100	
乃村工藝社	26,600	3,000.00	79,800,000	
藤田観光	4,600	2,706.00	12,447,600	
KNT-CTホールディングス	6,100	1,418.00	8,649,800	
日本管財	12,200	1,951.00	23,802,200	
トーカイ	11,000	2,450.00	26,950,000	
白洋舎	1,300	2,964.00	3,853,200	
セコム	120,500	9,316.00	1,122,578,000	
セントラル警備保障	5,500	5,420.00	29,810,000	
丹青社	21,500	1,221.00	26,251,500	
メイテック	14,100	5,270.00	74,307,000	
応用地質	12,400	1,163.00	14,421,200	
船井総研ホールディングス	23,500	2,654.00	62,369,000	
進学会ホールディングス	5,500	559.00	3,074,500	
オオバ	9,200	679.00	6,246,800	
いであ	2,400	1,263.00	3,031,200	
学究社	3,900	1,210.00	4,719,000	
ベネッセホールディングス	41,600	2,918.00	121,388,800	
イオンディライト	14,000	3,560.00	49,840,000	
ナック	7,400	935.00	6,919,000	
ニチイ学館	16,300	1,360.00	22,168,000	
ダイセキ	19,100	2,741.00	52,353,100	
ステップ	4,300	1,447.00	6,222,100	
合 計	138,041,600		264,183,767,920	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(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

	2019年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,690,676,231
コール・ローン	185,635,058
株式	334,664,160,830
投資信託受益証券	252,928,645
投資証券	8,773,064,368
派生商品評価勘定	38,748,222
未収入金	28,865,588
未収配当金	566,109,135
前払金	46,772,185
差入委託証拠金	3,498,953,547
流動資産合計	352,745,913,809
資産合計	352,745,913,809
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,633,532
未払解約金	221,479,123
未払利息	260
その他未払費用	2,902
流動負債合計	307,115,817
負債合計	307,115,817
純資産の部	
元本等	
元本	137,979,051,302
剰余金	
剰余金又は欠損金()	214,459,746,690
元本等合計	352,438,797,992
純資産合計	352,438,797,992
負債純資産合計	352,745,913,809

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2019年 5月10日現在
	<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)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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2019年 5月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(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)

	2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,979,051,302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 2.5543円 (1万口当たり純資産額) (25,543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

	2019年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

	2019年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2019年 5月10日現在
期首	2018年11月13日
期首元本額	137,716,718,181円
期中追加設定元本額	9,436,482,067円
期中一部解約元本額	9,174,148,946円
期末元本額	137,979,051,302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）	2,418,868,731円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,767,656円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,970,321,453円
世界経済インデックスファンド	7,334,692,718円
外国株式インデックス・オープン	870,899,589円
D C マイセレクション 2 5	1,068,800,299円
D C マイセレクション 5 0	4,799,785,862円
D C マイセレクション 7 5	5,044,763,793円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,260,877,531円
D C マイセレクション S 2 5	429,037,187円
D C マイセレクション S 5 0	1,927,136,687円
D C マイセレクション S 7 5	1,463,095,128円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	109,664,720円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	185,761,496円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	122,119,153円
D C 世界経済インデックスファンド	6,368,783,693円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,739,348,827円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	10,911,548円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,445,891円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	57,759,014円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	62,889,191円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	220,368,569円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	35,273,700円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	312,641,148円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	755,999,934円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	381,184,969円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,491,891,485円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,893,495,481円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	82,421,531円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	369,037,406円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	9,617,282円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	127,655,235円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,007,304,022円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,127,749,825円
外国株式ファンド・シリーズ 1	926,272,278円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,602,330,387円

区分	2019年 5月10日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,686,654,951円
分散投資コア戦略ファンドA	2,262,879,852円
分散投資コア戦略ファンドS	4,572,708,262円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	846,410,313円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	997,591,370円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,709,204,311円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	834,300,097円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,297,856円
SMT インデックスバランス・オープン	273,710,681円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,683,436,442円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,915,194,239円
SMT 世界経済インデックス・オープン	64,923,908円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	304,358,567円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	45,151,689円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,179,420円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	41,768,455円
グローバル経済コア	1,134,320,123円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,792,736円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	260,092円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	566,590,441円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	46,501,794円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	58,867円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	66,613円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,359円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	81,330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）	1,403,228,978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）	767,804,376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）	1,160,527,761円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,268,218,020
投資信託受益証券	1,800,538
投資証券	958,359,061
合計	10,228,377,619

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,600,613,436	-	8,553,841,251	46,772,185
合計		8,600,613,436	-	8,553,841,251	46,772,185

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	32,946,000	-	32,946,000	-
	アメリカドル 売建	32,946,000	-	32,946,000	-
	ユーロ 売建	76,930,625	-	77,043,750	113,125
	ユーロ 買建	76,930,625	-	77,043,750	113,125
合計		109,876,625	-	109,989,750	113,125

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	73.39	3,257,048.20
	APACHE CORP	34,273	31.06	1,064,519.38
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	22.61	1,003,884.00
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	25.94	930,701.26
	CHENIERE ENERGY INC	18,402	64.97	1,195,577.94
	CHEVRON CORP	161,747	121.19	19,602,118.93
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	67.46	512,628.54
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	110.92	1,938,992.52
	CONOCOPHILLIPS	96,852	61.54	5,960,272.08
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	42.03	321,403.41
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	31.25	1,183,156.25
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	108.24	1,459,832.88
	EOG RESOURCES INC	49,840	94.24	4,696,921.60
	EXXON MOBIL	358,711	76.77	27,538,243.47
	HALLIBURTON CO	76,620	25.99	1,991,353.80
	HELMERICH & PAYNE	8,315	58.44	485,928.60
	HESS CORP	22,081	63.26	1,396,844.06
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	43.56	614,631.60
	KINDER MORGAN INC	167,254	19.73	3,299,921.42
	MARATHON OIL CORP	74,537	15.27	1,138,179.99
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	52.96	3,056,851.20
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	25.11	761,109.21
	NOBLE ENERGY INC	38,291	24.34	932,002.94
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,462	56.33	3,631,144.46
	ONEOK INC	34,074	66.04	2,250,246.96
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	20.63	422,399.25
	PHILLIPS 66	38,115	85.75	3,268,361.25
	PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	153.40	2,217,397.00
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	23.83	235,678.70
	SCHLUMBERGER	119,098	40.27	4,796,076.46
	TARGA RESOURCES CORP	20,002	38.55	771,077.10
	TECHNIPFMC PLC	36,005	22.88	823,794.40
	VALERO ENERGY CORP	35,352	81.74	2,889,672.48
	WILLIAMS COS	105,155	26.96	2,834,978.80
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,003	204.44	3,884,973.32
	ALBEMARLE CORP	8,647	72.61	627,858.67
AVERY DENNISON CORP	7,457	105.54	787,011.78	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	25.98	457,403.88	
BALL CORP	27,142	62.37	1,692,846.54	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	103.60	1,145,090.80	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,052	41.15	866,289.80	
CHEMOURS CO/THE	15,493	27.18	421,099.74	

CROWN HOLDINGS INC	10,321	59.05	609,455.05
DOW INC	65,790	52.93	3,482,264.70
DOWDUPONT INC	193,235	30.99	5,988,352.65
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	75.72	897,887.76
ECOLAB INC	21,748	180.75	3,930,951.00
FMC CORP	12,118	79.71	965,925.78
FREEMONT-MCMORAN INC	112,473	11.28	1,268,695.44
INT'L PAPER CO	33,803	45.71	1,545,135.13
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,824	136.01	928,132.24
LINDE PLC	47,208	173.35	8,183,506.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28,777	81.98	2,359,138.46
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	216.94	1,082,313.66
MOSAIC CO/THE	31,911	23.65	754,695.15
NEWMONT GOLDCORP CORP	46,929	29.93	1,404,584.97
NUCOR CORP	27,868	56.56	1,576,214.08
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	97.94	870,686.60
PPG INDUSTRIES INC	19,958	112.88	2,252,859.04
SEALED AIR CORP	14,689	42.88	629,864.32
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,287	441.96	3,220,562.52
STEEL DYNAMICS INC	18,273	32.42	592,410.66
VULCAN MATERIALS CO	10,740	128.41	1,379,123.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	60.50	209,027.50
WESTROCK CO	21,244	37.15	789,214.60
3 M COMPANY	49,155	175.28	8,615,888.40
ACUITY BRANDS INC	3,505	143.20	501,916.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	49.77	563,894.10
ALLEGION PLC	7,435	100.10	744,243.50
AMETEK INC	19,001	85.45	1,623,635.45
ARCONIC INC	36,550	22.09	807,389.50
BOEING CO	45,639	354.13	16,162,139.07
CATERPILLAR	49,668	131.20	6,516,441.60
CUMMINS INC	12,585	165.34	2,080,803.90
DEERE&CO	26,347	155.48	4,096,431.56
DOVER CORP	12,008	96.24	1,155,649.92
EATON CORP	37,641	80.96	3,047,415.36
EMERSON ELECTRIC CO	53,427	66.80	3,568,923.60
FASTENAL CO	23,461	66.01	1,548,660.61
FLOWSERVE CORP	10,826	49.07	531,231.82
FLUOR CORP	11,267	29.91	336,995.97
FORTIVE CORP	25,813	82.26	2,123,377.38
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	54.02	691,996.20
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	172.05	3,616,663.05

GENERAL ELECTRIC CO	745,767	10.04	7,487,500.68
GRAINGER (WW) INC	3,976	273.44	1,087,197.44
HARRIS CORP	9,793	181.18	1,774,295.74
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	43.94	669,030.44
HONEYWELL INTL INC	62,478	170.39	10,645,626.42
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	207.38	730,392.36
IDEX CORP	6,916	152.91	1,057,525.56
ILLINOIS TOOL WORKS	25,828	151.56	3,914,491.68
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	121.54	2,469,935.88
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	78.63	945,604.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	64.52	1,296,852.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	37.65	771,825.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	80,399	39.59	3,182,996.41
L3 TECHNOLOGIES INC	6,974	234.39	1,634,635.86
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	270.00	778,950.00
LOCKHEED MARTIN CORP	22,009	339.36	7,468,974.24
MASCO CORP	24,547	37.83	928,613.01
MIDDLEBY CORP	4,364	135.24	590,187.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,287	295.00	4,214,665.00
OWENS CORNING	7,979	50.22	400,705.38
PACCAR INC	30,075	69.01	2,075,475.75
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	171.77	1,947,871.80
PENTAIR PLC	13,583	37.71	512,214.93
RAYTHEON COMPANY	24,615	179.99	4,430,453.85
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	169.00	1,776,359.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	352.44	3,073,276.80
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	48.69	673,285.32
SMITH (A.O.) CORP	12,146	50.47	613,008.62
SNAP-ON INC	4,900	167.70	821,730.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	84.19	714,015.39
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	142.52	1,886,109.68
TEXTRON	21,877	50.84	1,112,226.68
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	473.05	1,926,259.60
UNITED RENTALS INC	6,446	133.79	862,410.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,171	136.86	9,603,603.06
WABCO HOLDINGS INC	3,841	132.27	508,049.07
WABTEC CORP	11,163	71.54	798,601.02
XYLEM INC	16,060	79.08	1,270,024.80
CINTAS CORP	7,934	221.51	1,757,460.34
COPART INC	17,540	66.35	1,163,779.00
COSTAR GROUP INC	3,008	494.75	1,488,208.00
EQUIFAX INC	10,799	119.04	1,285,512.96

IHS MARKIT LTD	32,775	55.72	1,826,223.00
MANPOWER GROUP	5,123	92.22	472,443.06
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	24.27	667,522.08
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	82.67	1,526,170.87
ROBERT HALF INTL INC	9,566	57.45	549,566.70
ROLLINS INC	10,546	36.48	384,718.08
TRANSUNION	15,344	66.00	1,012,704.00
VERISK ANALYTICS INC	13,480	140.50	1,893,940.00
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	91.61	2,107,762.88
WASTE MANAGEMENT INC	36,731	105.22	3,864,835.82
AMERCO	602	386.28	232,540.56
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	33.95	336,784.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	82.68	946,520.64
CSX CORP	68,519	78.17	5,356,130.23
DELTA AIR LINES INC	15,095	56.59	854,226.05
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	74.27	1,025,148.81
FEDEX CORP	21,697	179.56	3,895,913.32
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	95.40	680,583.60
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	122.20	1,068,394.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	31.34	335,338.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	202.71	4,624,625.94
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	146.20	766,819.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	52.46	601,453.90
UNION PACIFIC CORP	62,195	175.63	10,923,307.85
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	84.12	504,972.36
UNITED PARCEL SERVICE B	59,561	100.75	6,000,770.75
XPO LOGISTICS INC	10,037	61.44	616,673.28
APTIV PLC	23,291	77.91	1,814,601.81
AUTOLIV INC	6,639	73.91	490,688.49
BORGWARNER INC	15,953	38.58	615,466.74
FORD MOTOR COMPANY	315,578	10.20	3,218,895.60
GENERAL MOTORS CO	106,331	37.58	3,995,918.98
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	17.17	371,335.59
HARLEY-DAVIDSON	14,677	35.95	527,638.15
LEAR CORP	5,287	138.78	733,729.86
TESLA INC	10,812	241.98	2,616,287.76
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	43.09	497,560.23
DR HORTON INC	28,998	43.62	1,264,892.76
GARMIN LTD	9,564	78.56	751,347.84
HANESBRANDS INC	31,136	17.52	545,502.72
HASBRO INC	10,617	100.46	1,066,583.82
LEGGETT & PLATT INC	10,594	38.14	404,055.16

LENNAR CORP-CL A	23,545	51.78	1,219,160.10
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	173.71	1,471,671.12
MATTEL INC	27,399	11.55	316,458.45
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	132.84	672,436.08
NEWELL BRANDS INC	37,563	15.36	576,967.68
NIKE B	107,381	82.98	8,910,475.38
NVR INC	264	3,307.48	873,174.72
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	89.87	421,580.17
PULTE GROUP INC	21,959	31.53	692,367.27
PVH CORP	7,252	120.65	874,953.80
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	125.68	575,363.04
TAPESTRY INC	25,989	33.36	866,993.04
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	22.12	352,814.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	19.61	319,309.63
VF CORP	28,754	94.04	2,704,026.16
WHIRLPOOL CORP	5,324	133.83	712,510.92
ARAMARK	19,980	31.35	626,373.00
BLOCK H & R INC	16,984	26.80	455,171.20
CARNIVAL CORPORATION	35,126	53.94	1,894,696.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,041	705.13	1,439,170.33
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	120.35	1,207,230.85
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	282.16	974,298.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	91.14	2,143,886.22
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	64.88	2,098,284.08
MARRIOTT INTL A	25,016	135.47	3,388,917.52
MCDONALD'S CORP	65,135	197.73	12,879,143.55
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	22.45	396,511.90
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	25.55	1,140,960.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	57.59	1,027,290.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	127.33	1,767,977.05
STARBUCKS CORP	104,538	77.90	8,143,510.20
VAIL RESORTS INC	3,574	225.96	807,581.04
WYNN RESORTS LTD	8,052	136.33	1,097,729.16
YUM BRANDS INC	27,323	100.74	2,752,519.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,388	46.64	2,863,136.32
ALPHABET INC-CL A	25,292	1,167.97	29,540,297.24
ALPHABET INC-CL C	26,644	1,162.38	30,970,452.72
ALTICE USA INC- A	31,657	24.55	777,179.35
CBS CORP-CL B	28,628	48.78	1,396,473.84
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	374.33	5,102,866.56
COMCAST CORP-CL A	383,994	42.92	16,481,022.48
DISCOVERY INC - A	12,804	28.45	364,273.80

DISCOVERY INC-C	23,672	26.94	637,723.68
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	34.77	633,439.86
ELECTRONIC ARTS INC	26,819	93.32	2,502,749.08
FACEBOOK INC-A	203,629	188.65	38,414,610.85
FOX CORP - CLASS A	30,270	38.50	1,165,395.00
FOX CORP- CLASS B	12,152	37.97	461,411.44
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	231.41	1,472,693.24
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.94	776,151.96
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	99.22	859,542.86
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.29	407,915.64
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	25.62	1,185,463.02
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	39.21	732,952.53
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	39.40	600,180.20
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.20	250,252.80
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	64.65	816,982.05
NETFLIX INC	36,840	362.75	13,363,710.00
NEWS CORP-CLASS A	33,479	11.43	382,664.97
OMNICOM GROUP	19,030	79.30	1,509,079.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.71	739,473.55
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	102.12	975,450.24
THE WALT DISNEY CO	152,138	133.59	20,324,115.42
TRIPADVISOR INC	10,393	48.83	507,490.19
TWITTER INC	61,378	38.79	2,380,852.62
VIACOM INC-CLASS B	31,895	28.50	909,007.50
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	34.27	341,397.74
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	159.89	989,079.54
AMAZON.COM	35,254	1,899.87	66,978,016.98
AUTOZONE INC	2,085	1,004.48	2,094,340.80
BEST BUY COMPANY INC	21,836	72.29	1,578,524.44
BOOKING HOLDINGS INC	3,901	1,736.03	6,772,253.03
BURLINGTON STORES INC	6,004	166.51	999,726.04
CARMAX INC	14,253	78.53	1,119,288.09
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	122.96	2,745,696.80
DOLLAR TREE INC	19,630	105.64	2,073,713.20
EBAY	78,686	37.62	2,960,167.32
EXPEDIA GROUP INC	11,152	119.30	1,330,433.60
GAP	21,891	24.98	546,837.18
GENUINE PARTS CO	12,722	98.52	1,253,371.44
GRUBHUB INC	8,261	68.39	564,969.79
HOME DEPOT	95,597	194.58	18,601,264.26
KOHL'S CORP	14,645	68.37	1,001,278.65
L BRANDS INC	19,499	24.25	472,850.75

LKQ CORP	24,693	27.42	677,082.06
LOWES COMPANIES	67,906	106.29	7,217,728.74
MACY'S INC	25,926	22.70	588,520.20
MERCADOLIBRE INC	3,727	542.64	2,022,419.28
NORDSTROM INC	10,094	39.80	401,741.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,012	367.39	2,576,138.68
QURATE RETAIL INC	35,071	16.60	582,178.60
ROSS STORES INC	31,827	97.01	3,087,537.27
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	75.11	3,142,301.96
TIFFANY & CO	9,326	104.92	978,483.92
TJX COMPANIES INC	106,813	53.84	5,750,811.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,304	102.48	1,158,433.92
ULTA BEAUTY INC	4,911	348.05	1,709,273.55
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	147.89	787,810.03
COSTCO WHOLESALE CORP	37,583	243.47	9,150,333.01
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	7.85	266,115.00
KROGER CO	68,147	25.36	1,728,207.92
SYSCO CORP	42,872	73.55	3,153,235.60
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	53.56	3,610,318.92
WALMART INC	122,729	99.54	12,216,444.66
ALTRIA GROUP INC	158,456	51.99	8,238,127.44
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	42.56	2,034,282.88
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	52.31	1,152,912.40
BUNGE LIMITED	11,767	53.17	625,651.39
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	38.96	548,245.12
COCA-COLA CO	342,026	47.40	16,212,032.40
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	53.70	916,981.20
CONAGRA BRANDS INC	39,943	29.23	1,167,533.89
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	201.89	2,830,094.02
GENERAL MILLS INC	50,246	51.41	2,583,146.86
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	125.50	1,571,385.50
HORMEL FOODS CORP	23,465	39.51	927,102.15
INGREDION INC	5,835	84.55	493,349.25
JM SMUCKER CO	9,442	125.96	1,189,314.32
KELLOGG CO	21,051	57.79	1,216,537.29
KRAFT HEINZ CO/THE	53,058	32.58	1,728,629.64
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	68.63	886,974.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	154.93	1,545,581.68
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	58.35	881,085.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	51.35	6,276,715.90
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	61.92	2,162,989.44
PEPSICO INC	119,352	126.05	15,044,319.60

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,107	83.93	11,171,670.51
TYSON FOODS INC	24,363	77.94	1,898,852.22
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	72.65	1,544,829.60
CLOROX COMPANY	10,995	146.96	1,615,825.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,032	70.85	5,032,617.20
COTY INC-CL A	30,534	11.57	353,278.38
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,908	165.33	3,126,059.64
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	126.40	3,719,067.20
PROCTER & GAMBLE CO	210,947	104.24	21,989,115.28
ABBOTT LABORATORIES	148,700	76.42	11,363,654.00
ABIOMED INC	3,502	261.94	917,313.88
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	323.25	2,024,838.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	79.18	1,017,225.46
ANTHEM INC	21,803	266.05	5,800,688.15
BAXTER INTERNATIONAL	44,084	76.00	3,350,384.00
BECTON DICKINSON & CO	22,592	229.80	5,191,641.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,205	37.07	4,307,719.35
CARDINAL HEALTH	25,252	50.14	1,266,135.28
CENTENE CORP	35,914	54.74	1,965,932.36
CERNER CORP	25,778	68.59	1,768,113.02
CIGNA CORP	32,709	155.86	5,098,024.74
CVS HEALTH CORP	111,050	55.35	6,146,617.50
DANAHER CORP	54,225	131.34	7,121,911.50
DAVITA INC	11,875	52.38	622,012.50
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	54.99	980,691.66
DEXCOM INC	7,827	117.21	917,402.67
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	181.34	3,234,924.26
HCA HEALTHCARE INC	22,986	124.60	2,864,055.60
HENRY SCHEIN INC	12,492	69.26	865,195.92
HOLOGIC INC	24,459	45.50	1,112,884.50
HUMANA INC	11,944	243.89	2,913,022.16
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	246.22	1,774,015.10
INTUITIVE SURGICAL INC	9,805	496.06	4,863,868.30
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	165.92	1,464,575.84
MCKESSON CORP	16,655	134.60	2,241,763.00
MEDTRONIC PLC	113,614	88.14	10,013,937.96
QUEST DIAGNOSTICS	12,284	98.74	1,212,922.16
RESMED INC	12,398	112.05	1,389,195.90
STRYKER CORP	29,041	188.01	5,459,998.41
TELEFLEX INC	3,697	301.34	1,114,053.98
THE COOPER COS INC	4,135	291.42	1,205,021.70
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,621	237.97	19,423,349.37

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	122.89	890,706.72
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	134.69	1,109,441.53
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,212	142.08	1,450,920.96
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	266.29	1,172,474.87
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	121.91	2,114,163.22
ABBVIE INC	127,283	77.91	9,916,618.53
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	77.00	2,108,799.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	131.77	2,509,954.96
ALKERMES PLC	12,547	26.83	336,636.01
ALLERGAN PLC	29,318	140.26	4,112,142.68
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	72.14	533,763.86
AMGEN	53,917	172.87	9,320,631.79
BEIGENE LTD-ADR	2,369	121.24	287,217.56
BIOGEN INC	17,262	228.47	3,943,849.14
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	83.38	1,350,088.96
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140,314	47.23	6,627,030.22
CELGENE CORP	59,466	95.47	5,677,219.02
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	23,667	32.96	780,064.32
GILEAD SCIENCES INC	111,360	66.13	7,364,236.80
ILLUMINA INC	12,711	317.37	4,034,090.07
INCYTE CORP	16,120	82.02	1,322,162.40
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	133.14	1,897,910.70
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	139.88	695,343.48
JOHNSON & JOHNSON	227,778	138.73	31,599,641.94
LILLY (ELI) & CO	75,567	115.80	8,750,658.60
MERCK & CO	220,538	78.33	17,274,741.54
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,243	741.67	1,663,565.81
MYLAN NV	42,644	22.76	970,577.44
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	35.45	478,823.15
PERRIGO CO PLC	11,333	52.62	596,342.46
PFIZER	490,485	40.64	19,933,310.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	324.17	2,243,580.57
SEATTLE GENETICS INC	9,601	67.86	651,523.86
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	14.47	1,167,584.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,582	269.00	9,302,558.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	96.68	313,919.96
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	169.91	3,675,832.94
WATERS CORP	6,513	216.78	1,411,888.14
ZOETIS INC	41,718	101.67	4,241,469.06
BANK OF AMERICA CORP	789,496	29.71	23,455,926.16
BB&T CORP	64,191	49.50	3,177,454.50
CIT GROUP INC	10,713	51.52	551,933.76

CITIGROUP	206,425	67.63	13,960,522.75
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	35.82	1,433,158.20
COMERICA INC	14,360	76.22	1,094,519.20
EAST WEST BANCORP INC	13,827	50.17	693,700.59
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	27.83	1,620,179.11
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	102.99	1,454,836.74
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	13.58	1,163,303.54
JPMORGAN CHASE & CO	281,755	112.52	31,703,072.60
KEY CORP	87,033	17.29	1,504,800.57
M & T BANK CORP	11,745	166.11	1,950,961.95
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	17.03	625,341.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,173	131.94	5,168,485.62
REGIONS FINL CORP	83,851	14.93	1,251,895.43
SIGNATURE BANK	4,354	127.75	556,223.50
SUNTRUST BANKS	38,353	63.40	2,431,580.20
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	250.15	1,098,158.50
US BANCORP	129,139	52.12	6,730,724.68
WELLS FARGO & CO	378,409	46.74	17,686,836.66
ZIONS BANCORPORATION	15,186	48.24	732,572.64
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	94.33	418,164.89
ALLY FINANCIAL INC	36,028	29.39	1,058,862.92
AMERICAN EXPRESS	61,108	117.26	7,165,524.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	142.83	1,692,535.50
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	22.04	500,175.76
BANK NEW YORK CO	84,617	47.78	4,043,000.26
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	109,623	208.56	22,862,972.88
BLACKROCK INC	9,909	464.22	4,599,955.98
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	90.20	3,564,704.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	103.60	981,092.00
CME GROUP INC	30,723	180.01	5,530,447.23
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	79.00	2,335,635.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	50.08	1,057,088.64
EATON VANCE CORP	10,061	39.01	392,479.61
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	33.73	879,341.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	201.63	5,671,851.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,543	80.80	4,003,074.40
INVESCO LTD	30,943	20.81	643,923.83
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	19.61	504,094.66
KKR & CO INC -A	44,859	23.92	1,073,027.28
MOODY'S CORP	15,058	188.88	2,844,155.04
MORGAN STANLEY	108,193	46.45	5,025,564.85
MSCI INC	7,907	221.88	1,754,405.16

NASDAQ INC	9,070	91.16	826,821.20
NORTHERN TRUST CORP	17,320	96.97	1,679,520.40
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	102.84	2,063,587.44
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,870	87.26	1,035,776.20
S&P GLOBAL INC	21,709	213.12	4,626,622.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	45.82	4,666,537.90
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	52.60	568,185.20
STATE STREET CORP	32,349	64.54	2,087,804.46
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	34.40	1,826,468.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	53.40	1,249,773.60
VOYA FINANCIAL INC	14,081	53.57	754,319.17
AFLAC	65,227	50.49	3,293,311.23
ALLEGHANY CORP	1,276	678.35	865,574.60
ALLSTATE CORP	30,108	94.39	2,841,894.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	101.90	714,624.70
AMERICAN INT'L GROUP	76,910	50.83	3,909,335.30
AON PLC	20,104	176.51	3,548,557.04
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	33.42	1,154,694.42
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	82.22	1,230,997.84
ASSURANT INC	4,769	95.62	456,011.78
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	44.79	597,812.13
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	39.71	413,619.36
CHUBB LTD	38,690	142.65	5,519,128.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	95.09	1,180,352.17
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	245.66	823,697.98
FNF GROUP	24,961	38.99	973,229.39
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	52.51	1,665,092.10
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	65.00	1,156,350.00
LOEWS CORP	22,051	50.53	1,114,237.03
MARKEL CORP	1,132	1,043.85	1,181,638.20
MARSH & MCLENNAN COS	42,543	93.94	3,996,489.42
METLIFE INC	71,520	47.48	3,395,769.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	55.89	1,294,132.95
PROGRESSIVE CORP	48,681	72.85	3,546,410.85
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,290	100.83	3,558,290.70
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	146.40	795,098.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	161.72	525,428.28
TORCHMARK CORP	8,473	87.14	738,337.22
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	141.83	3,127,493.33
UNUM GROUP	18,574	35.80	664,949.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	175.00	1,912,750.00
WR BERKLEY CORP	13,990	60.64	848,353.60

CBRE GROUP INC-A	26,855	48.61	1,305,421.55
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.96	686,952.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	136.41	501,033.93
WEYERHAEUSER CO	62,107	25.66	1,593,665.62
ACCENTURE PLC-CL A	53,858	174.46	9,396,066.68
ADOBE INC	41,223	275.79	11,368,891.17
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	76.15	1,079,654.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	147.91	594,006.56
ANSYS INC	6,865	190.51	1,307,851.15
AUTODESK INC	18,213	171.42	3,122,072.46
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	160.57	5,907,852.01
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	117.07	1,129,725.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	25,271	68.70	1,736,117.70
CDK GLOBAL INC	10,687	52.62	562,349.94
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	117.78	1,272,141.78
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	96.87	1,099,668.24
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	59.10	2,858,253.30
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	59.44	1,396,721.12
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,276	115.87	3,160,470.12
FIRST DATA CORP- CLASS A	47,683	25.16	1,199,704.28
FISERV INC	33,784	84.69	2,861,166.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	266.19	1,941,057.48
FORTINET INC	12,963	81.81	1,060,503.03
GARTNER INC	8,145	152.97	1,245,940.65
GLOBAL PAYMENTS INC	13,947	146.07	2,037,238.29
GODADDY INC - CLASS A	14,919	78.32	1,168,456.08
INTL BUSINESS MACHINES CORP	76,740	135.34	10,385,991.60
INTUIT INC	20,704	241.30	4,995,875.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,223	133.91	967,231.93
LEIDOS HOLDINGS	10,999	75.02	825,144.98
MASTERCARD INC-CLASS A	77,757	245.31	19,074,569.67
MICROSOFT CORP	618,610	125.50	77,635,555.00
ORACLE CORP	224,052	54.25	12,154,821.00
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	237.83	1,917,861.12
PAYCHEX INC	27,697	84.31	2,335,134.07
PAYPAL HOLDINGS INC	94,486	109.73	10,367,948.78
PTC INC	9,984	86.33	861,918.72
RED HAT INC	15,009	184.65	2,771,411.85
SABRE CORP	24,114	20.58	496,266.12
SALESFORCE.COM INC	64,577	156.31	10,094,030.87
SERVICENOW INC	14,979	270.49	4,051,669.71
SPLUNK INC	13,187	132.43	1,746,354.41

SQUARE INC - A	25,389	66.39	1,685,575.71
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20,656	58.30	1,204,244.80
SYMANTEC CORP	58,346	22.17	1,293,530.82
SYNOPSIS INC	12,264	118.90	1,458,189.60
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	6,719	122.99	826,369.81
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	100.14	1,423,790.52
VERISIGN INC	9,541	193.73	1,848,377.93
VISA INC-CLASS A SHARES	149,028	159.81	23,816,164.68
VMWARE INC-CLASS A	6,787	197.69	1,341,722.03
WESTERN UNION CO	38,757	19.20	744,134.40
WIX.COM LTD	2,661	141.17	375,653.37
WORKDAY INC-CLASS A	12,522	200.35	2,508,782.70
WORLDPAY INC-CLASS A	25,793	117.53	3,031,451.29
AMPHENOL CORPORATION	26,216	94.26	2,471,120.16
APPLE INC	402,575	200.72	80,804,854.00
ARISTA NETWORKS INC	4,324	267.43	1,156,367.32
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	70.82	472,086.12
CDW CORP/DE	12,482	105.39	1,315,477.98
CISCO SYSTEMS	380,632	52.92	20,143,045.44
COGNEX CORP	16,230	46.82	759,888.60
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	18.86	281,636.38
CORNING	66,228	30.63	2,028,563.64
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	67.09	931,880.10
F5 NETWORKS INC	5,350	146.83	785,540.50
FLEX LTD	40,465	10.40	420,836.00
FLIR SYSTEMS INC	11,686	51.80	605,334.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	15.22	1,974,581.92
HP INC	134,066	19.29	2,586,133.14
IPG PHOTONICS CORP	3,207	153.62	492,659.34
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	26.43	827,364.72
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	86.30	1,368,113.90
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	145.23	2,023,925.28
NETAPP INC	20,586	68.54	1,410,964.44
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	47.57	1,086,308.52
TE CONNECTIVITY LTD	28,434	90.89	2,584,366.26
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	42.13	868,804.86
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	46.42	1,094,444.34
XEROX CORP	16,718	32.17	537,818.06
AT&T INC	616,020	30.38	18,714,687.60
CENTURYLINK INC	83,301	10.86	904,648.86
SPRINT CORP	64,825	5.98	387,653.50
T-MOBILE US INC	28,273	74.25	2,099,270.25

VERIZON COMMUNICATIONS	349,784	56.48	19,755,800.32
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	32.91	503,160.99
AES CORP	52,646	16.12	848,653.52
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	46.28	891,167.68
AMEREN CORPORATION	21,002	71.90	1,510,043.80
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	82.87	3,432,641.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,134	106.28	1,714,721.52
ATMOS ENERGY CORP	9,385	100.70	945,069.50
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	29.25	1,251,666.00
CMS ENERGY CORP	24,527	54.40	1,334,268.80
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	84.00	2,309,496.00
DOMINION ENERGY INC	63,052	73.31	4,622,342.12
DTE ENERGY COMPANY	15,603	123.60	1,928,530.80
DUKE ENERGY CORP	59,862	86.83	5,197,817.46
EDISON INTL	28,962	59.84	1,733,086.08
ENERGY CORP	15,636	94.31	1,474,631.16
EVERGY INC	21,330	56.94	1,214,530.20
EVERSOURCE ENERGY	28,103	70.45	1,979,856.35
EXELON CORP	80,900	48.76	3,944,684.00
FIRSTENERGY CORP	43,246	41.36	1,788,654.56
NEXTERA ENERGY INC	40,931	188.61	7,719,995.91
NISOURCE INC	32,308	27.51	888,793.08
NRG ENERGY INC	26,737	36.68	980,713.16
OGE ENERGY CORP	15,686	40.65	637,635.90
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	92.57	871,639.12
PPL CORPORATION	59,613	30.26	1,803,889.38
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	44,554	58.29	2,597,052.66
SEMPRA ENERGY	23,257	126.21	2,935,265.97
SOUTHERN CO	88,512	52.36	4,634,488.32
UGI CORP	13,950	54.01	753,439.50
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.85	734,590.85
WEC ENERGY GROUP INC	27,947	77.47	2,165,054.09
XCEL ENERGY INC	44,934	56.06	2,519,000.04
ADVANCED MICRO DEVICES	78,474	27.21	2,135,277.54
ANALOG DEVICES	32,237	110.55	3,563,800.35
APPLIED MATERIALS	84,218	40.94	3,447,884.92
BROADCOM INC	35,411	304.06	10,767,068.66
INTEL CORP	386,406	46.62	18,014,247.72
KLA-TENCOR CORP	13,856	114.13	1,581,385.28
LAM RESEARCH CORP	12,864	198.63	2,555,176.32
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	23.40	1,280,845.80
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,692	57.10	1,409,913.20

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	89.38	1,854,098.72
	MICRON TECHNOLOGY	97,275	39.27	3,819,989.25
	NVIDIA CORP	49,534	170.19	8,430,191.46
	NXP SEMICONDUCTORS NV	29,778	100.33	2,987,626.74
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.15	761,315.40
	QORVO INC	10,609	75.15	797,266.35
	QUALCOMM	102,656	83.78	8,600,519.68
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	83.64	1,213,616.40
	TEXAS INSTRUMENTS	81,032	112.15	9,087,738.80
	XILINX INC	22,116	116.70	2,580,937.20
	アメリカドル 小計	25,728,020		2,084,584,242.70 (229,012,424,903)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	27,117	8.03	217,749.51
	CAMECO CORP	28,709	13.96	400,777.64
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	37.93	3,919,231.04
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.06	1,165,791.96
	ENBRIDGE	173,856	49.17	8,548,499.52
	ENCANA CORP	138,637	9.01	1,249,119.37
	HUSKY ENERGY INC	31,439	13.63	428,513.57
	IMPERIAL OIL	24,763	38.33	949,165.79
	INTER PIPELINE LTD	30,317	20.81	630,896.77
	KEYERA CORP	14,929	30.96	462,201.84
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	47.47	2,006,841.72
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	18.72	343,512.00
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	8.93	178,689.30
	SUNCOR ENERGY	134,430	43.57	5,857,115.10
	TC ENERGY CORP	76,314	63.02	4,809,308.28
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	20.14	402,095.10
	VERMILION ENERGY INC	10,067	31.64	318,519.88
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	54.78	1,175,524.02
	BARRICK GOLD CORP	149,092	16.63	2,479,399.96
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	56.27	739,331.53
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	12.47	709,543.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	98.11	1,644,127.38
	KINROSS GOLD CORP	107,615	4.14	445,526.10
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.46	402,089.78
	METHANEX CORP	7,099	66.57	472,580.43
	NEWMONT GOLDCORP CORP	22,529	40.12	903,863.48
	NUTRIEN LTD	51,428	68.05	3,499,675.40
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	29.26	1,336,509.02
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	1.87	132,770.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	61.31	265,288.37

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	27.00	994,626.00
BOMBARDIER B	151,366	2.15	325,436.90
CAE INC	25,999	31.20	811,168.80
FINNING INTERNATIONAL INC	19,764	23.14	457,338.96
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	27.48	404,313.24
WSP GLOBAL INC	9,471	69.58	658,992.18
THOMSON REUTERS CORP	16,142	85.17	1,374,814.14
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	124.98	7,645,526.52
CP RAILWAY LIMITED	11,825	295.57	3,495,115.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	64.57	1,806,539.46
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	50.52	892,132.68
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	90.18	1,926,695.70
STARS GROUP INC/THE	11,841	27.07	320,535.87
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.19	977,398.93
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	148.33	802,316.97
DOLLARAMA INC	26,700	40.56	1,082,952.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	81.04	2,930,244.32
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	31.07	357,273.93
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	68.37	1,067,802.66
METRO INC	19,179	48.53	930,756.87
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	100.71	693,186.93
SAPUTO INC	20,412	45.72	933,236.64
AURORA CANNABIS INC	53,000	11.25	596,250.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	63.05	1,034,020.00
CRONOS GROUP INC	15,900	19.05	302,895.00
BANK MONTREAL	55,382	104.55	5,790,188.10
BANK NOVA SCOTIA	106,056	72.06	7,642,395.36
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	111.16	4,222,968.40
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	63.49	1,792,195.72
ROYAL BANK OF CANADA	123,447	105.98	13,082,913.06
TORONTO-DOMINION BANK	154,324	74.64	11,518,743.36
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	73,316	62.35	4,571,252.60
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.12	375,660.52
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.97	284,114.45
ONEX CORP	6,603	76.51	505,195.53
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	626.39	1,443,828.95
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	32.13	764,308.44
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	51.41	423,104.30
INTACT FINANCIAL CORP	11,102	112.47	1,248,641.94
MANULIFE FINANCIAL CORP	172,987	24.25	4,194,934.75
POWER CORP OF CANADA	29,774	30.08	895,601.92
POWER FINANCIAL CORP	20,740	31.18	646,673.20

	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,941	53.85	2,904,722.85
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.98	261,515.70
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	11.91	469,254.00
	CGI INC - CL A	21,192	95.75	2,029,134.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,146.95	1,950,961.95
	OPEN TEXT CORP	24,643	54.18	1,335,157.74
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	350.20	2,571,168.40
	BCE INC	12,539	59.88	750,835.32
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	68.39	2,194,977.05
	TELUS CORP	16,454	48.88	804,271.52
	ALTAGAS INCOME LTD	31,487	18.66	587,547.42
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	45.17	236,735.97
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.46	376,413.04
	EMERA INC	4,086	50.44	206,097.84
	FORTIS INC	38,447	49.68	1,910,046.96
	HYDRO ONE LTD	32,299	21.72	701,534.28
	カナダドル 小計	3,533,963		157,608,921.45 (12,871,920,614)
ユーロ	ENAGAS	18,299	24.83	454,364.17
	ENI	216,297	14.32	3,098,238.22
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	13.85	552,157.95
	NESTE OIL OYJ	33,258	28.23	938,873.34
	OMV AG	12,139	43.35	526,225.65
	REPSOL SA	124,649	14.27	1,778,741.23
	SNAM SPA	205,372	4.46	916,369.86
	TENARIS SA	40,648	11.77	478,426.96
	TOTAL SA	203,962	46.60	9,505,649.01
	VOPAK	6,360	37.30	237,228.00
	AIR LIQUIDE	36,297	113.10	4,105,190.70
	AKZO NOBEL	19,742	73.68	1,454,590.56
	ARCELORMITTAL	53,985	16.68	900,901.68
	ARKEMA	5,335	80.40	428,934.00
	BASF SE	77,211	65.52	5,058,864.72
	COVESTRO AG	16,178	43.68	706,655.04
	CRH PLC	71,124	28.62	2,035,568.88
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	25.95	349,131.30
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	34.48	198,673.76
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,833	69.72	964,436.76
	IMERYS SA	3,000	40.78	122,340.00
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	98.14	1,495,064.76
	LANXESS	7,293	46.59	339,780.87
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	26.10	510,646.50

SOLVAY SA	6,906	91.82	634,108.92
STORA ENSO OYJ R	47,237	10.57	499,295.09
SYMRISE AG	11,581	83.76	970,024.56
THYSSEN KRUPP	33,044	11.23	371,249.34
UMICORE	17,605	30.26	532,727.30
UPM KYMMENE OYJ	43,990	23.96	1,054,000.40
VOESTALPINE AG	8,140	26.39	214,814.60
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,861	37.06	773,108.66
AIRBUS SE	48,982	116.80	5,721,097.60
ALSTOM	13,816	39.45	545,041.20
ANDRITZ AG	5,242	35.62	186,720.04
BOUYGUES ORD	16,815	32.58	547,832.70
BRENTAG AG	11,626	44.64	518,984.64
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.56	797,046.76
DASSAULT AVIATION SA	213	1,261.00	268,593.00
EIFFAGE	6,079	88.68	539,085.72
FERROVIAL SA	38,509	20.61	793,670.49
GEA GROUP AG	13,382	22.88	306,180.16
HOCHTIEF AG	1,354	116.20	157,334.80
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	44.74	528,513.62
KION GROUP AG	5,887	55.46	326,493.02
KONE OYJ-B	30,120	48.01	1,446,061.20
LEGRAND SA	21,794	60.00	1,307,640.00
LEONARDO SPA	35,425	10.02	354,958.50
METSO OYJ	9,561	30.92	295,626.12
MTU AERO ENGINES AG	4,753	200.00	950,600.00
OSRAM LICHT AG	7,440	29.03	215,983.20
PRYSMIAN SPA	25,673	16.37	420,395.37
REXEL SA	24,339	11.01	267,972.39
SAFRAN SA	28,935	122.40	3,541,644.00
SAINT-GOBAIN	40,731	33.96	1,383,428.41
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,763	71.28	3,404,546.64
SIEMENS	65,680	105.28	6,914,790.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	14.98	262,015.18
THALES SA	9,665	100.65	972,782.25
VINCI S.A.	43,091	85.22	3,672,215.02
WARTSILA OYJ	34,386	13.48	463,523.28
BUREAU VERITAS SA	19,558	21.26	415,803.08
EDENRED	18,941	40.68	770,519.88
RANDSTAD NV	9,588	48.61	466,072.68
SOCIETE BIC SA	2,424	75.15	182,163.60
TELEPERFORMANCE	4,523	165.00	746,295.00

WOLTERS KLUWER	22,886	60.96	1,395,130.56
ADP	2,382	169.50	403,749.00
AENA SME SA	5,610	165.10	926,211.00
ATLANTIA SPA	42,039	23.14	972,782.46
BOLLORE	61,805	4.11	254,512.99
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	18.85	438,677.20
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	28.83	2,450,146.38
FRAPORT AG	3,561	72.64	258,671.04
GETLINK	36,478	14.09	513,975.02
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	69.30	2,005,957.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	60.60	302,454.60
CONTINENTAL AG	9,928	134.44	1,334,720.32
DAIMLER AG	78,530	55.65	4,370,194.50
FAURECIA	5,945	39.82	236,729.90
FERRARI NV	9,947	124.95	1,242,877.65
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	13.08	1,261,022.83
MICHELIN	15,337	107.40	1,647,193.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	26.63	274,075.96
PEUGEOT SA	52,883	21.24	1,123,234.92
PIRELLI & C SPA	39,097	5.77	225,902.46
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	60.10	843,082.80
RENAULT SA	17,362	56.21	975,918.02
VALEO SA	19,350	28.59	553,216.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	151.50	2,423,848.50
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	155.05	402,199.70
ADIDAS AG	15,081	249.85	3,767,987.85
ESSILORLUXOTTICA	25,039	106.00	2,654,134.00
HERMES INTERNATIONAL	2,600	607.80	1,580,280.00
HUGO BOSS AG	4,852	59.58	289,082.16
KERING	6,332	501.60	3,176,131.20
LVMH	23,422	331.85	7,772,590.70
MONCLER SPA	15,736	35.53	559,100.08
PUMA AG	772	552.00	426,144.00
SEB SA	2,075	155.80	323,285.00
ACCOR	17,931	35.96	644,798.76
PADDY POWER PLC	7,143	69.78	498,438.54
SODEXO	8,135	100.30	815,940.50
AXEL SPRINGER SE	3,827	47.26	180,864.02
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	15.96	191,196.84
JC DECAUX SA	4,674	27.94	130,591.56
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	14.69	281,761.93
PUBLICIS GROUPE	17,601	51.22	901,523.22

RTL GROUP	3,513	46.16	162,160.08
SES	31,369	15.21	477,122.49
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	46.50	232,407.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	81.84	558,967.20
VIVENDI	94,307	24.88	2,346,358.16
DELIVERY HERO SE	8,671	41.58	360,540.18
INDITEX	93,820	25.15	2,359,573.00
ZALANDO SE	9,155	39.12	358,143.60
CARREFOUR	53,759	17.50	940,782.50
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	33.63	123,993.81
COLRUYT SA	4,160	65.00	270,400.00
JERONIMO MARTINS	20,234	13.75	278,217.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	20.93	2,056,037.62
METRO AG	13,712	13.95	191,282.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	64,009	74.19	4,748,827.71
DANONE (GROUPE)	52,307	69.46	3,633,244.22
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	9.12	388,049.75
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	89.40	956,669.40
HEINEKEN NV	22,649	95.16	2,155,278.84
KERRY GROUP PLC-A	13,146	101.10	1,329,060.60
PERNOD-RICARD	18,484	154.40	2,853,929.60
REMY COINTREAU	1,575	118.30	186,322.50
BEIERSDORF AG	9,190	98.28	903,193.20
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	82.05	707,106.90
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	87.26	1,373,123.36
LOREAL	21,190	235.80	4,996,602.00
UNILEVER NV-CVA	131,771	53.06	6,991,769.26
BIOMERIEUX	3,246	70.95	230,303.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	72.60	1,306,509.60
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	50.52	1,856,458.44
KONINKLIJKE PHILIPS	80,612	36.78	2,964,909.36
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	161.90	525,527.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	36.30	453,750.00
BAYER	78,314	57.07	4,469,379.98
EUROFINS SCIENTIFIC	971	395.80	384,321.80
GRIFOLS SA	27,685	23.47	649,766.95
IPSEN	2,722	100.00	272,200.00
MERCK KGAA	10,480	96.64	1,012,787.20
ORION OYJ-CLASS B	7,975	29.31	233,747.25
QIAGEN N.V.	21,801	31.95	696,541.95
RECORDATI SPA	7,493	35.37	265,027.41
SANOFI	96,647	73.38	7,091,956.86

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	120.50	361,982.00
UCB (GROUPE)	10,465	69.08	722,922.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	19.32	641,377.42
AIB GROUP PLC	70,200	3.98	279,957.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	5.09	2,832,921.12
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.03	456,692.79
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	4.14	5,667,056.90
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	5.31	446,040.00
BANKIA SA	110,053	2.31	254,992.80
BANKINTER SA	58,881	6.77	398,742.13
BNP PARIBAS	94,302	45.42	4,283,196.84
CAIXABANK	286,347	2.76	790,890.41
COMMERZBANK AG	80,494	7.47	602,014.62
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	11.56	1,073,625.21
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	33.12	912,787.20
ING GROEP NV-CVA	332,029	10.43	3,463,062.47
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.16	2,785,267.77
KBC GROEP NV	22,703	59.20	1,344,017.60
MEDIOBANCA	53,990	8.99	485,478.08
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	22.75	284,147.50
SOCIETE GENERALE	63,719	26.28	1,674,853.91
UNICREDIT SPA	177,131	11.12	1,970,759.50
AMUNDI SA	4,764	60.20	286,792.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.86	1,105,530.16
DEUTSCHE BOERSE	15,674	117.30	1,838,560.20
EURAZEO SA	3,357	64.55	216,694.35
EXOR NV	10,345	55.76	576,837.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	81.52	509,255.44
NATIXIS	69,996	4.97	348,020.11
WENDEL	2,023	118.90	240,534.70
AEGON	166,267	4.26	709,461.28
AGEAS	16,065	45.33	728,226.45
ALLIANZ SE-REG	35,781	198.82	7,113,978.42
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	16.85	1,713,293.89
AXA	165,661	22.11	3,662,764.71
CNP ASSURANCES	11,830	19.80	234,234.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	126.60	595,779.60
MAPFRE SA	90,939	2.60	236,623.27
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	207.50	2,627,987.50
NN GROUP NV	27,631	37.18	1,027,320.58
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.00	414,683.28
SAMPO OYJ-A SHS	39,991	39.26	1,570,046.66

SCOR SE	13,354	34.97	466,989.38
AROUNDTOWN SA	59,250	7.46	442,242.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	41.60	1,206,774.40
VONOVIA SE	43,942	47.66	2,094,275.72
ADYEN NV	734	660.20	484,586.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	65.94	2,407,469.40
ATOS SE	7,634	67.24	513,310.16
CAPGEMINI SA	13,238	102.30	1,354,247.40
DASSAULT SYSTEMES SA	11,783	135.15	1,592,472.45
SAP SE	84,279	110.08	9,277,432.32
WIRECARD AG	9,864	135.25	1,334,106.00
WORLDLINE SA	3,052	50.80	155,041.60
INGENICO GROUP	4,681	72.10	337,500.10
NOKIA OYJ	489,813	4.36	2,137,543.93
1&1 DRILLISCH AG	3,773	31.22	117,793.06
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	14.84	4,148,462.31
ELISA A	11,722	37.93	444,615.46
ILIAD SA	2,053	101.20	207,763.60
KPN (KON.)	261,596	2.69	705,786.00
ORANGE	176,815	13.88	2,455,076.27
PROXIMUS	13,141	24.71	324,714.11
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.46	397,459.74
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.43	205,219.16
TELEFONICA	410,000	7.11	2,918,790.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.87	192,597.09
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.84	321,919.92
E.ON SE	183,255	9.41	1,725,345.82
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	12.19	606,281.84
ENDESA	24,774	21.80	540,073.20
ENEL	681,211	5.51	3,759,603.50
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.22	760,583.51
ENGIE	162,096	12.99	2,106,437.52
FORTUM OYJ	38,328	18.26	700,060.92
IBERDROLA SA	520,818	7.88	4,104,045.84
INNOGY SE	11,000	39.86	438,460.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	32,230	25.59	824,765.70
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	18.65	739,136.80
RWE STAMM	42,828	21.79	933,222.12
SUEZ	28,043	12.30	344,928.90
TERNA SPA	130,230	5.40	704,023.38
UNIPER SE	14,751	25.55	376,888.05
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	20.67	945,487.14

	VERBUND AG	7,463	43.46	324,341.98	
	ASML HOLDING NV	35,211	174.06	6,128,826.66	
	INFINEON TECHNOLOGIES	99,840	18.53	1,850,833.92	
	STMICROELECTRONICS	57,598	14.78	851,298.44	
	ユーロ 小計	16,438,627		319,778,944.08 (39,419,150,436)	
イギリスポンド	BP PLC	1,694,881	5.25	8,906,599.65	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	380,747	24.16	9,200,751.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,895	24.22	7,772,076.90	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	4.41	238,518.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	18.98	1,659,737.13	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.37	300,114.72	
	BHP GROUP PLC	179,682	17.33	3,114,967.15	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	50.65	506,449.35	
	FRESNILLO PLC	17,743	7.27	129,027.09	
	GLENCORE PLC	941,686	2.80	2,643,312.60	
	JOHNSON MATTHEY PLC	18,160	31.34	569,134.40	
	MONDI PLC	34,071	16.38	558,082.98	
	RIO TINTO PLC REG	97,151	43.71	4,246,470.21	
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	20.05	842,521.05	
	BAE SYSTEMS PLC	282,016	4.70	1,326,039.23	
	BUNZL PLC	27,712	21.90	606,892.80	
	DCC PLC	9,127	65.98	602,199.46	
	FERGUSON PLC	19,208	53.60	1,029,548.80	
	MEGGITT PLC	66,268	5.32	353,075.90	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.83	750,184.53	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	9.13	1,361,790.45	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	14.96	555,704.16	
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	15.97	296,911.35	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	5.17	101,930.96	
	EXPERIAN PLC	81,220	21.75	1,766,535.00	
	G4S PLC	132,555	2.08	276,774.84	
	INTERTEK GROUP PLC	14,722	50.24	739,633.28	
	RELX PLC	171,324	17.30	2,964,761.82	
	EASYJET PLC	11,633	10.35	120,459.71	
	ROYAL MAIL PLC	75,133	2.41	181,746.72	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.00	578,814.00		
BURBERRY GROUP PLC	35,328	18.99	671,055.36		
PERSIMMON PLC	26,389	21.12	557,335.68		
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.78	483,013.86		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	36.97	391,845.03		
CARNIVAL PLC	13,721	39.58	543,077.18		

COMPASS GROUP PLC	136,301	17.04	2,323,250.54
GVC HOLDINGS PLC	42,500	5.99	254,830.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.95	785,206.95
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.62	236,240.64
TUI AG-DI	37,945	8.25	313,349.81
WHITBREAD PLC	14,664	45.10	661,346.40
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.80	464,378.04
INFORMA PLC	100,899	7.50	756,742.50
ITV PLC	295,435	1.18	350,829.06
PEARSON	66,305	8.04	533,622.64
WPP PLC	113,065	9.59	1,085,197.87
KINGFISHER PLC	170,994	2.44	417,567.34
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.72	368,456.41
NEXT PLC	11,202	56.74	635,601.48
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.11	355,920.62
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.10	312,393.51
TESCO	856,393	2.40	2,060,481.55
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	25.04	722,278.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	197,242	28.85	5,691,417.91
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.43	492,642.80
DIAGEO	204,601	32.40	6,630,095.40
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	22.27	1,854,282.37
RECKITT BENCKISER PLC	56,295	61.55	3,464,957.25
UNILEVER PLC	93,214	46.11	4,298,097.54
CONVATEC GROUP PLC	112,565	1.44	162,543.86
NMC HEALTH PLC	9,509	26.73	254,175.57
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	16.03	1,138,562.81
ASTRAZENECA	108,675	58.26	6,331,405.50
GLAXOSMITHKLINE	425,464	15.18	6,459,394.44
BARCLAYS	1,471,691	1.56	2,308,494.50
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,693,900	6.51	11,042,534.10
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.60	3,634,357.26
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.32	918,406.72
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.79	1,586,995.12
3I GROUP PLC	79,251	10.50	832,531.75
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	22.75	614,727.75
INVESTEC PLC	54,280	4.74	257,667.16
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	50.76	1,334,784.96
SCHRODERS PLC	8,614	30.58	263,416.12
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	10.96	490,683.75
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.65	514,299.07
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.43	332,089.65

	AVIVA PIC	348,023	4.13	1,437,683.01
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.12	355,131.94
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.70	1,325,977.88
	PRUDENTIAL	217,306	16.10	3,499,713.13
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.46	472,843.63
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	17.71	514,799.28
	SAGE GROUP PLC	89,321	7.20	643,825.76
	BT GROUP PLC	730,298	2.10	1,539,103.03
	VODAFONE GROUP PLC	2,309,362	1.38	3,198,466.37
	CENTRICA PLC	440,558	0.94	415,005.63
	NATIONAL GRID PLC	283,108	8.25	2,335,641.00
	SEVERN TRENT PLC	18,112	19.54	353,999.04
	SSE PLC	93,277	11.16	1,040,971.32
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.93	467,115.48
	イギリスポンド 小計	25,279,389		148,093,626.62 (21,152,212,690)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.41	337,782.17
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	586.00	393,792.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,581.00	2,098,353.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	50.26	2,027,186.84
	SIKA AG-BR	10,500	152.00	1,596,000.00
	ABB LTD	153,407	19.13	2,934,675.91
	GEBERIT AG-REG	3,021	451.00	1,362,471.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	204.80	302,899.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	210.00	791,280.00
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	56.00	740,544.00
	SGS SA	437	2,554.00	1,116,098.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	135.20	685,058.40
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	70.68	3,162,505.92
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	285.90	709,889.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	55.05	216,786.90
	DUFREY AG-REG	2,548	93.98	239,461.04
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,840.00	294,400.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	76,000.00	608,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	6,670.00	693,680.00
	NESTLE SA - REGISTERED	259,428	96.93	25,146,356.04
	ALCON INC	37,545	60.98	2,289,494.10
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	205.80	1,050,403.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	816.60	636,131.40
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	308.50	2,007,409.50
	NOVARTIS	184,125	81.69	15,041,171.25
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,430	260.00	15,451,800.00

	VIFOR PHARMA AG	3,601	128.50	462,728.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	224,271	12.39	2,778,717.69	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	45.62	966,094.74	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	77.00	261,569.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	743.00	1,107,813.00	
	UBS GROUP AG	334,926	12.14	4,067,676.27	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	163.80	635,052.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	449.10	1,324,395.90	
	SWISS RE LTD	26,239	90.22	2,367,282.58	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,661	313.80	3,973,021.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	82.20	515,969.40	
	TEMENOS AG - REG	5,252	162.90	855,550.80	
	SWISSCOM	2,064	470.40	970,905.60	
	スイスフラン 小計	1,505,205		102,220,407.45 (11,051,048,249)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	273.40	3,879,819.40	
	BOLIDEN AB	26,315	235.50	6,197,182.50	
	ALFA LAVAL AB	25,639	209.00	5,358,551.00	
	ASSA ABLOY AB-B	88,864	197.95	17,590,628.80	
	ATLAS COPCO A	59,675	277.20	16,541,910.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	254.00	9,280,652.00	
	EPIROC AB-A	53,833	93.34	5,024,772.22	
	EPIROC AB-B	29,972	89.71	2,688,788.12	
	SANDVIK AB	100,730	162.30	16,348,479.00	
	SKANSKA B	28,530	159.20	4,541,976.00	
	SKF AB-B	28,335	161.15	4,566,185.25	
	VOLVO B	136,906	140.00	19,166,840.00	
	SECURITAS B	22,844	162.10	3,703,012.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	224.50	4,079,165.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	85.60	3,313,747.20	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	158.74	11,740,727.88	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	362.10	2,074,833.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	482.20	7,304,847.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	54,928	278.00	15,269,984.00	
	NORDEA BANK ABP	250,593	72.95	18,280,759.35	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	88.30	12,248,093.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	100.60	13,720,431.60	
	SWEDBANK AB-A	80,216	143.50	11,510,996.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	202.90	2,595,496.80	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	426.80	17,258,938.40	
	KINNEVIK AB - B	18,104	262.20	4,746,868.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	310.40	2,259,712.00	

	ERICSSON (LM) B	268,755	87.80	23,596,689.00	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	479.30	10,306,867.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	542.50	3,360,245.00	
	TELE2 AB-B SHS	38,012	124.75	4,741,997.00	
	TELIA CO AB	235,437	40.21	9,466,921.77	
	スウェーデンクローナ 小計	2,113,444		292,766,117.49 (3,331,678,417)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	252.50	2,603,527.50	
	EQUINOR ASA	100,907	181.10	18,274,257.70	
	NORSK HYDRO	106,150	32.52	3,451,998.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	359.50	4,842,465.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	210.20	1,465,304.20	
	MOWI ASA	40,968	191.80	7,857,662.40	
	ORKLA	69,804	74.16	5,176,664.64	
	DNB ASA	80,217	152.90	12,265,179.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	166.50	3,092,571.00	
	TELENOR ASA	60,821	171.15	10,409,514.15	
	ノルウェークローネ 小計	508,193		69,439,143.89 (869,378,081)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	702.00	6,373,458.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	320.20	5,663,377.40	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	562.60	9,969,272.00	
	ISS A/S	14,253	214.60	3,058,693.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,640.00	2,284,360.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	8,162.00	4,146,296.00	
	DSV A/S	16,873	600.00	10,123,800.00	
	PANDORA A/S	8,431	272.10	2,294,075.10	
	CARLSBERG AS-B	9,692	875.40	8,484,376.80	
	COLOPLAST-B	9,476	723.60	6,856,833.60	
	DEMANT A/S	7,420	222.80	1,653,176.00	
	GENMAB A/S	4,888	1,088.00	5,318,144.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	274.00	1,334,654.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	155,978	322.35	50,279,508.30	
	DANSKE BANK A/S	59,378	108.60	6,448,450.80	
	TRYG A/S	9,828	202.40	1,989,187.20	
ORSTED A/S	15,908	513.60	8,170,348.80		
	デンマーククローネ 小計	362,289		134,448,011.80 (2,219,736,674)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	25.73	530,784.17	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.57	899,172.17	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.44	1,232,026.80	
	SANTOS	156,437	6.96	1,088,801.52	

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	22.68	290,598.84
WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	35.43	2,961,593.70
WORLEYPARSONS LTD	34,596	13.73	475,003.08
ALUMINA LIMITED	170,458	2.20	375,007.60
AMCOR	105,214	16.03	1,686,580.42
BHP GROUP LTD	253,437	36.98	9,372,100.26
BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	13.23	652,609.44
BORAL LIMITED	81,732	4.81	393,130.92
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	7.46	1,004,682.96
INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.27	492,458.73
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	18.53	692,336.39
NEWCREST MINING LIMITED	70,314	25.13	1,766,990.82
ORICA LTD	29,211	19.70	575,456.70
RIO TINTO LTD	32,522	95.35	3,100,972.70
SOUTH32 LTD	408,172	3.28	1,338,804.16
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	45.35	418,127.00
BRAMBLES LTD	129,297	12.19	1,576,130.43
SEEK LTD	26,358	19.92	525,051.36
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.89	779,891.43
TRANSURBAN GROUP	238,575	13.44	3,206,448.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	25.74	1,357,836.48
CROWN RESORTS LTD	30,328	13.41	406,698.48
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	40.72	224,896.56
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	39.44	128,692.72
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.63	772,496.98
REA GROUP LTD	3,593	81.14	291,536.02
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.98	179,748.74
WESFARMERS LTD	100,277	36.25	3,635,041.25
COLES GROUP LTD	93,277	12.71	1,185,550.67
WOOLWORTHS GROUP LTD	113,612	32.84	3,731,018.08
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.82	406,866.60
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	15.07	879,711.25
COCHLEAR LIMITED	4,811	193.72	931,986.92
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	63.17	773,706.16
SONIC HEALTHCARE LTD	32,669	26.23	856,907.87
CSL LIMITED	38,043	197.16	7,500,557.88
AUST AND NZ BANKING GROUP	248,111	27.65	6,860,269.15
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	8.98	319,688.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.52	446,405.68
COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,029	75.17	11,352,849.93
NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	25.91	6,160,387.51
WESTPAC BANKING	288,399	27.06	7,804,076.94

	AMP LTD	244,230	2.21	539,748.30
	ASX LTD	15,814	75.26	1,190,161.64
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	8.12	357,832.16
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	124.37	3,335,230.29
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.96	1,666,465.80
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.93	628,520.16
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.84	1,452,114.12
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.58	1,397,667.18
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	17.85	792,111.60
	TELSTRA CORP	342,339	3.38	1,157,105.82
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.05	190,423.75
	AGL ENERGY LTD	51,344	22.48	1,154,213.12
	AUSNET SERVICES	120,230	1.82	218,818.60
	オーストラリアドル 小計	6,049,222		105,722,102.01 (8,127,915,202)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.06	387,818.64
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	8.25	700,837.50
	A2 MILK CO LTD	66,854	16.07	1,074,343.78
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.99	727,672.92
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	11.86	430,719.62
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.64	530,161.60
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.28	473,128.32
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,324,682.38 (313,323,238)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	79.55	18,614,381.80
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	16.36	2,666,680.00
	MTR CORP	142,000	46.10	6,546,200.00
	MINTH GROUP LTD	46,000	24.40	1,122,400.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	52.00	6,188,000.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	24.30	1,664,550.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	53.45	10,583,100.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	13.98	939,456.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	40.40	8,193,120.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	10.36	1,015,280.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.10	1,201,200.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	19.70	2,773,760.00
	WH GROUP LTD	699,000	7.63	5,333,370.00
	BANK EAST ASIA	109,160	24.00	2,619,840.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	32.70	10,137,000.00
	HANG SENG BANK	68,000	202.00	13,736,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	103,000	248.00	25,544,000.00
AIA GROUP LTD	1,035,400	77.65	80,398,810.00	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	61.70	13,326,953.20	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	21.45	1,737,450.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.10	2,958,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	46.80	5,327,899.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	43.00	2,537,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	31.70	2,044,650.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	12.52	6,153,580.00	
	SINO LAND CO	315,400	13.00	4,100,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	128,500	132.80	17,064,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	96.25	3,898,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	31.25	3,006,250.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	22.35	2,033,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	57.80	5,491,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	54.35	3,532,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.73	1,688,610.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	62.50	3,125,000.00	
	CLP HOLDINGS	148,000	87.40	12,935,200.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	815,913	18.60	15,175,981.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	55.20	6,127,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	86.50	2,050,050.00	
	香港ドル 小計	7,471,909		313,591,997.00 (4,390,287,958)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.55	735,565.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.55	272,850.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	4.00	436,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.52	303,848.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.56	426,240.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.57	414,696.81	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.24	268,288.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.95	403,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.39	303,769.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	34.66	343,134.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.28	117,320.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.51	626,886.00	
	DBS GROUP	156,300	26.60	4,157,580.00	
	OCBC BANK	264,200	11.31	2,988,102.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	119,800	25.48	3,052,504.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.38	459,774.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.40	636,140.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	8.69	271,128.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.14	339,150.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.45	422,765.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.14	2,095,771.02	
	シンガポールドル 小計	3,510,376		19,075,260.83 (1,536,893,765)	
イスラエルシ ケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	19.45	1,317,854.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	493.60	720,656.00	
	BANK HAPOLIM BM	84,067	26.84	2,256,358.28	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.45	3,439,014.75	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	78.17	640,994.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	200.00	864,600.00	
	NICE LTD	4,894	476.10	2,330,033.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	2.58	400,274.93	
	イスラエルシケル 小計	465,961		11,969,785.56 (368,190,603)	
	合 計	93,532,864		334,664,160,830 (334,664,160,830)	

(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	899,292.84	
		LENLEASE GROUP	44,009	562,435.02	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	686,530.40	
		オーストラリアドル 小計	223,440	2,148,258.26 (165,158,095)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,686,825.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,582,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,269,325.00 (87,770,550)	
		投資信託受益証券合計	818,940	252,928,645 (252,928,645)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	804,924.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,381,811.20	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,095	7,141,529.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	112,760	1,079,113.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,329,352.49	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,778,523.30	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	5,542	110,452.06	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	877,481.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,765	4,311,902.95	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,027	2,002,375.20	
		DUKE REALTY CORP	29,929	911,338.05	

EQUINIX INC		6,911	3,293,713.49
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		31,274	2,339,920.68
ESSEX PROPERTY TRUST		5,691	1,593,992.19
EXTRA SPACE STORAGE INC		10,092	1,047,448.68
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6,029	778,042.45
HCP INC		41,014	1,230,420.00
HOST HOTELS AND RESORTS INC		67,709	1,287,148.09
INVITATION HOMES INC		24,000	592,320.00
IRON MOUNTAIN INC		24,669	763,998.93
KIMCO REALTY CORP		35,407	637,680.07
LIBERTY PROPERTY TRUST		11,822	568,401.76
MACERICH CO/THE		10,128	411,095.52
MID-AMERICA APARTMENT COMM		10,237	1,122,487.05
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		14,182	742,994.98
PROLOGIS INC		53,238	3,973,684.32
PUBLIC STORAGE		13,613	3,034,201.57
REALTY INCOME CORP		24,440	1,646,278.40
REGENCY CENTERS CORP		14,271	933,037.98
SBA COMMUNICATIONS CORP		9,366	1,941,665.46
SIMON PROPERTY GROUP		25,938	4,507,246.26
SL GREEN REALTY CORP		8,067	678,434.70
UDR INC		24,799	1,083,964.29
VENTAS INC		30,413	1,876,177.97
VEREIT INC		77,798	639,499.56
VORNADO REALTY TRUST		15,390	1,019,741.40
WELLTOWER INC		31,753	2,415,768.24
WP CAREY INC		13,017	1,015,456.17
アメリカドル 小計		968,571	63,903,623.86 (7,020,452,117)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	217,937.75
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	400,571.40
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	187,850.16
カナダドル 小計		30,576	806,359.31 (65,855,364)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	343,488.00
	GECINA SA	4,459	591,709.30
	ICADE	2,845	211,952.50
	KLEPIERRE	17,225	532,597.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,040	1,765,064.00
ユーロ 小計		40,147	3,444,810.80 (424,641,827)
	BRITISH LAND CO PLC	79,414	463,777.76

イギリスポンド	HAMMERSON PLC	61,184	181,349.37	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	534,444.40	
	SEGRO PLC	102,202	694,155.98	
イギリスポンド 小計		301,350	1,873,727.51	(267,624,500)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,183,652.20	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,838,952.81	
	GPT GROUP	136,015	775,285.50	
	MIRVAC GROUP	306,089	872,353.65	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,795,786.47	
	STOCKLAND	207,412	788,165.60	
	VICINITY CENTERS	291,115	727,787.50	
オーストラリアドル 小計		1,661,655	7,981,983.73	(613,654,909)
香港ドル	LINK REIT	179,500	16,612,725.00	
香港ドル 小計		179,500	16,612,725.00	(232,578,150)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	576,700.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	459,270.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	492,738.00	
	SUNTEC REIT	173,000	311,400.00	
シンガポールドル 小計		813,800	1,840,108.00	(148,257,501)
投資証券合計		3,995,599	8,773,064,368	(8,773,064,368)
合計			9,025,993,013	(9,025,993,013)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 598銘柄	97.0%			66.6%
	投資証券 38銘柄			3.0%	2.0%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 238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 92銘柄	98.8%			6.2%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39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 59銘柄	91.3%			2.4%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.9%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	93.2%			1.3%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.2%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.8%	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

	2019年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	857,451,022
コール・ローン	25,404,478
株式	51,414,716,669
投資信託受益証券	118,913,809
投資証券	178,113,983
派生商品評価勘定	8,240
未収入金	1,920,657
未収配当金	78,086,843

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
前払金	60,530,114
差入委託証拠金	304,422,207
流動資産合計	53,039,568,022
資産合計	53,039,568,022
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,538,354
未払解約金	22,216,961
未払利息	35
その他未払費用	216
流動負債合計	82,755,566
負債合計	82,755,566
純資産の部	
元本等	
元本	19,276,223,190
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,680,589,266
元本等合計	52,956,812,456
純資産合計	52,956,812,456
負債純資産合計	53,039,568,022

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

		2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		19,276,223,190口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7473円 (27,473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

		2019年 5月10日現在

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

	2019年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	18,612,081,328円
期中追加設定元本額	1,321,163,736円
期中一部解約元本額	657,021,874円
期末元本額	19,276,223,190円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,104,640,266円
世界経済インデックスファンド	3,184,663,805円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,954,644,895円
DC 世界経済インデックスファンド	2,774,498,556円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	186,938,448円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	373,612,150円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	426,649,554円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	365,133,477円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,644,332円
SMT インデックスバランス・オープン	119,249,895円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,742,646円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	188,732,490円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	27,116,623円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,041,247円
グローバル経済コア	496,942,911円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	13,846,508円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	26,252円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	29,706円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,160円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	36,269円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,836,142,910	
投資信託受益証券	1,582,352	
投資証券	4,961,804	
合計	2,832,763,458	

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,298,476,538	-	1,237,946,424	60,530,114
合計		1,298,476,538	-	1,237,946,424	60,530,114

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	15,374,800	-	15,374,800	-
	アメリカドル	15,374,800	-	15,374,800	-
合計		15,374,800	-	15,374,800	-

(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	516,164	4.92	2,543,140.02	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	1.15	120,016.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	45,064	80.26	3,616,836.64	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	183.00	1,576,911.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	103,060	6.32	651,339.20	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	3.60	577,447.20	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	24,530	65.40	1,604,262.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.08	255,304.40	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	21.28	1,415,056.16	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	25.00	387,725.00	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	11.91	221,764.20	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	38.30	272,849.20	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	15.16	384,306.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	35.43	191,392.86	
	51JOB INC-ADR	1,655	84.28	139,483.40	
	DP WORLD PLC	21,152	17.80	376,505.60	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	18.98	568,488.96	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	37.64	411,555.76		

	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	14,110	88.15	1,243,796.50
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	34,236	36.20	1,239,343.20
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	44.71	1,489,111.26
	58.COM INC-ADR	9,450	65.40	618,030.00
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	105.39	558,356.22
	BAIDU INC - SPON ADR	24,875	158.70	3,947,662.50
	IQIYI INC-ADR	11,977	21.51	257,625.27
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	32.29	419,673.13
	NETEASE INC-ADR	7,445	261.67	1,948,133.15
	SINA CORP	5,725	57.00	326,325.00
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	16.61	150,702.53
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	61.79	324,335.71
	YY INC-ADR	4,344	73.72	320,239.68
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	118,228	179.04	21,167,541.12
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	42.79	150,107.32
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	40.63	1,546,824.73
	JD.COM INC-ADR	68,369	27.51	1,880,831.19
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	23.13	410,002.38
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	8.58	310,930.62
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,845	14.01	558,427.67
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	25.61	93,297.23
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	161,330	4.20	677,586.00
	CREDICORP LTD	6,431	225.23	1,448,454.13
	SBERBANK-SPONSORED ADR	252,453	13.85	3,496,474.05
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.08	222,801.11
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	47.98	96,967.58
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.46	66,497.76
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	35.87	158,007.35
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	7.78	310,064.12
	アメリカドル 小計	2,402,446		60,752,532.11 (6,674,273,177)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,571,661	8.69	13,657,734.09
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	295,492	51.23	15,138,055.16
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	206.82	2,998,890.00
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	43.02	4,166,573.04
	ALFA S.A.B. -A	242,900	18.71	4,544,659.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	68.87	2,582,625.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	315.79	7,359,485.95
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	185.59	5,768,137.20
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	189.45	3,216,861.00
	ALSEA SAB DE CV	34,300	42.99	1,474,557.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	209,790	35.62	7,472,719.80

	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	81.09	2,546,226.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	119.29	1,300,261.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	53.59	25,111,202.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	107.58	3,622,756.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	186.62	33,431,106.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	188.69	4,898,392.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	41.61	5,509,164.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	33.53	6,095,754.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	30.30	5,141,910.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	218,200	110.99	24,218,018.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	27.19	6,865,475.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	13.52	41,071,596.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	78.41	2,956,057.00	
	メキシコペソ 小計	7,354,155		231,148,216.94 (1,322,167,800)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	44.25	814,200.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,100	29.36	8,165,016.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	341,340	26.83	9,158,152.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	21.80	1,648,080.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	40.53	599,844.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	71,700	14.25	1,021,725.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	14.24	1,238,880.00	
	SUZANO SA	50,679	44.16	2,237,984.64	
	VALE SA	288,278	48.54	13,993,014.12	
	EMBRAER SA	69,700	19.21	1,338,937.00	
	WEG SA	66,872	18.55	1,240,475.60	
	CCR SA	101,100	12.12	1,225,332.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	36.32	2,142,952.64	
	RUMO SA	97,700	17.35	1,695,095.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	9.61	1,327,948.24	
	B2W CIA DIGITAL	23,600	36.15	853,140.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	15.75	1,003,527.00	
	LOJAS RENNER S.A.	66,407	41.10	2,729,327.70	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,100	185.90	1,319,890.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	27,700	24.49	678,373.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	20.56	853,240.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	83.99	1,243,052.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	68.34	1,441,974.00	
	AMBEV SA	438,500	17.49	7,669,365.00	
	BRF SA	52,500	30.73	1,613,325.00	
	JBS SA	69,100	20.80	1,437,280.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	41.45	261,135.00	

	NATURA COSMETICOS SA	20,700	51.00	1,055,700.00	
	HYPERA SA	35,300	28.83	1,017,699.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	30.37	3,533,913.94	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	365,953	34.87	12,760,781.11	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	51.03	4,138,533.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	442,781	32.56	14,416,949.36	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	410,067	11.49	4,711,669.83	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	33.90	6,458,051.70	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	27.62	1,555,006.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,200	99.50	716,400.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	52.14	380,622.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	12.25	699,021.75	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	24.21	1,099,134.00	
	CIELO SA	99,269	7.69	763,378.61	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	45.50	2,202,200.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	10.93	796,797.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	33.90	600,030.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	32.55	784,455.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	13.89	916,628.88	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	47.80	1,247,580.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	42.35	709,362.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13,000	80.60	1,047,800.00	
	ブラジルリアル 小計	4,811,018		130,562,978.82	(3,632,262,070)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	8,050.00	360,076,500.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	2,160.10	293,697,996.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	23,553.00	232,161,921.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,754	6,620.00	157,251,480.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	4,708.00	333,500,596.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,245.00	171,795,060.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	9,060.00	84,466,380.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,400.10	36,510,321.20	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	98.50	230,025,080.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	4,984	44,155.00	220,068,520.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	48.50	304,571,318.50	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.68	95,151,955.23	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,811.30	126,363,237.60	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	394.00	64,319,712.00	
	COLBUN SA	475,888	134.20	63,864,169.60	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	113.51	245,474,569.31	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	64.48	165,151,205.44	
		31,198,454		3,184,450,022.38	

チリペソ 小計				(510,785,783)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,040.00	1,486,496,160.00
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	7,860.00	251,606,460.00
	GRUPO ARGOS SA	17,723	17,820.00	315,823,860.00
	BANCOLOMBIA SA	20,302	38,500.00	781,627,000.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	39,900.00	1,527,292,200.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,255.00	381,153,540.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	35,000.00	728,700,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	32,580.00	409,237,380.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	15,780.00	797,063,580.00
コロンビアペソ 小計		984,893		6,679,000,180.00 (223,746,506)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	20.40	183,600.00
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	18.20	79,315.60
	OPAP SA	17,668	8.82	155,920.10
	JUMBO SA	8,599	15.32	131,736.68
	ALPHA BANK AE	129,138	1.21	157,160.94
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	11.32	229,716.76
ユーロ 小計		189,056		937,450.08 (115,559,471)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	117.10	1,358,711.30
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	7.39	862,819.45
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	52,814	4.57	241,359.98
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	18.80	447,646.80
	KOC HOLDING AS	62,460	15.31	956,262.60
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	5.80	250,374.40
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	24.44	240,391.84
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	12.46	774,899.86
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	51.35	167,298.30
	ARCELIK AS	15,358	16.34	250,949.72
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,412	78.50	1,680,842.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	18.54	208,204.20
	AKBANK T.A.S.	341,944	5.66	1,935,403.04
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	7.58	1,819,139.36
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	5.40	283,127.40
	TURKIYE IS BANKASI-C	219,434	5.07	1,112,530.38
	HACI OMER SABANCI HOLDING	146,764	7.11	1,043,492.04
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	11.43	1,086,947.28	
トルコリラ 小計		1,529,557		14,720,399.95 (262,759,139)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	861.50	6,429,374.50
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	72.60	4,991,104.80

	CEZ AS	13,737	522.00	7,170,714.00	
	チェココルナ 小計	89,948		18,591,193.30 (89,051,815)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,056.00	100,456,832.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,815.00	88,260,070.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	12,450.00	243,385,050.00	
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		432,101,952.00 (164,371,582)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	74.54	824,188.78	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	87.68	2,315,979.52	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	5.51	807,198.47	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	47.20	196,871.20	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	92.64	1,216,548.48	
	CCC SA	3,138	187.00	586,806.00	
	LPP SA	124	7,905.00	980,220.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	214.30	1,436,667.20	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	26.00	611,052.00	
	DINO POLSKA SA	4,430	123.50	547,105.00	
	ALIOR BANK SA	8,830	52.25	461,367.50	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	55.40	111,354.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	9.07	299,629.27	
	BANK PEKAO SA	15,510	104.70	1,623,897.00	
	M BANK SA	2,316	410.00	949,560.00	
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	37.27	2,851,341.35	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	4,247	370.00	1,571,390.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	40.33	2,054,853.83	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	4.66	259,811.54	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	8.70	552,415.20	
	ポーランドズロチ 小計	551,709		20,258,256.34 (581,614,539)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.23	316,540.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.60	1,459,200.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,377,400	5.76	13,693,824.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	17.06	5,868,640.00	
	CNOOC LTD-R	1,626,000	13.34	21,690,840.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.84	2,022,720.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	4.64	9,168,640.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	7.78	1,104,760.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.69	914,600.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	4.85	281,300.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	45.45	4,999,500.00	
	BBMG CORPORATION - H	131,000	2.49	326,190.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.66	574,490.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	2.62	880,320.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.52	2,151,600.00
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	214,000	4.50	963,000.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	7.28	1,528,800.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.91	311,236.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.86	818,380.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.81	964,460.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	3.42	998,640.00
MMG LIMITED	168,000	2.91	488,880.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.27	937,830.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.42	680,580.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	7.07	639,835.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.84	2,070,360.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.26	528,240.00
BOC AVIATION LTD	32,500	63.55	2,065,375.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	395,000	7.24	2,859,800.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	25.35	4,043,325.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	191,500	9.39	1,798,185.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	5.99	1,797,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	7.67	1,303,900.00
CITIC LTD	502,000	11.00	5,522,000.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	6.67	3,408,703.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.08	3,191,040.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	0.77	429,275.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	17.30	605,500.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	2.04	291,720.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.84	477,120.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	17.12	650,560.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	7.28	520,520.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	14.74	626,450.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	143,800	12.14	1,745,732.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	8.08	253,841.28
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	39.85	2,482,655.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	7.20	2,772,532.80
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	13.96	1,898,560.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.19	1,114,200.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.92	934,560.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.57	709,560.00
CAR INC	42,000	6.09	255,780.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	4.77	314,820.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	14.90	1,453,450.30

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.74	1,010,240.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.33	372,380.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	3.16	462,940.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	7.08	738,755.52
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.62	722,160.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	118,500	16.08	1,905,480.00
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.99	328,900.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	8.29	729,520.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.96	580,320.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	7.69	1,922,500.00
BYD CO LTD-H	74,500	48.85	3,639,325.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	2.73	682,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.84	1,819,440.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	25.30	688,160.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	494,000	13.50	6,669,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	410,250	5.80	2,379,450.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.75	1,955,666.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	11.06	1,017,520.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	52.10	5,783,100.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	20.50	2,378,000.00
HENGTECH NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.19	327,888.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	99.75	6,982,500.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	1.58	186,440.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.63	2,363,500.00
CHINA LITERATURE LTD	41,000	34.00	1,394,000.00
TENCENT HOLDINGS LTD	521,100	375.60	195,725,160.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.74	439,528.92
MEITUAN DIANPING-CLASS B	33,500	57.30	1,919,550.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	18.98	797,160.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	6.51	1,269,450.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.38	245,140.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	28.80	7,401,600.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	34.40	4,884,800.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.54	667,570.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	12.88	1,906,240.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	47.55	1,331,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.07	645,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.23	3,488,800.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	35.60	1,210,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	68.20	4,535,300.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	8.00	2,288,000.00

SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	292,000	7.06	2,061,520.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.50	1,990,200.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	30.10	2,997,960.00
3SBIO INC	119,000	13.48	1,604,120.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	6.39	639,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	13.52	6,111,040.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	10.58	1,666,350.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	4.11	682,260.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	64,000	17.74	1,135,360.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.74	549,310.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	24.30	1,348,650.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.83	587,430.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	7.03	4,070,370.00
SSY GROUP LTD	114,000	6.70	763,800.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	10.26	379,620.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	39,000	75.15	2,930,850.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.43	8,293,740.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	3.51	26,002,782.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	6.20	5,874,345.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.74	4,508,688.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,580,620	6.44	55,259,192.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.60	802,800.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	354,423	36.20	12,830,112.60
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.59	3,082,326.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	4.16	628,160.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,450,515	5.50	35,477,832.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	4.66	3,401,800.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.92	1,597,440.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.10	1,848,000.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	13.22	819,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.45	1,461,825.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.45	1,344,150.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	14.96	1,974,720.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	15.12	3,008,880.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.95	1,120,950.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.47	839,042.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	14.98	886,816.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	8.84	2,446,912.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	12.88	2,045,344.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	725,000	19.32	14,007,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	29.00	7,853,200.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.52	363,280.00

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	20.75	2,942,848.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	37.35	2,502,450.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.00	2,076,000.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.08	4,955,367.04
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	463,000	86.70	40,142,100.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	24.40	261,080.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.86	1,542,120.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	22.85	5,438,300.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.69	2,710,820.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	28.20	10,745,328.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	32.30	7,852,485.30
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	28.55	3,448,840.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.91	1,355,160.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	770,285	11.68	8,996,928.80
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	8.66	1,108,480.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	6.00	336,000.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	14.44	993,472.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	3.50	245,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.02	471,120.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	8.44	751,160.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	11.50	1,081,000.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	27.20	3,359,200.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.98	1,001,280.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	22.40	2,968,000.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.81	379,195.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	225,091	3.28	738,298.48
SOHO CHINA LTD	113,000	2.60	293,800.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	36.15	7,627,650.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.74	1,005,720.00
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.72	387,199.92
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	8.56	2,071,520.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	17.70	1,168,200.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	18.08	1,428,320.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	80,000	45.90	3,672,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	12.76	1,084,600.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	5.34	1,260,240.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.50	1,507,500.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.41	511,290.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	19.50	411,450.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	6.41	3,704,980.00
MEITU INC	143,000	2.37	338,910.00
SUNNY OPTICAL TECH	61,100	86.10	5,260,710.00

	XIAOMI CORP-CLASS B	323,200	10.46	3,380,672.00	
	ZTE CORP-H	97,708	22.25	2,174,003.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	136,000	5.99	814,640.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	561,500	72.75	40,849,125.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	4.05	5,491,800.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	3,672,000	1.95	7,160,400.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	8.83	4,485,640.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	39.70	1,548,300.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.28	1,746,240.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.04	2,737,680.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	24.20	4,167,240.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.00	1,265,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.91	315,150.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	35.80	3,078,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.58	1,855,732.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	1.88	259,440.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	72.65	5,456,015.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	15.28	3,392,160.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.08	566,720.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.73	1,750,100.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.02	618,120.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.86	269,560.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	16.74	753,300.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	8.03	2,127,950.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	151,725	4.09	620,555.25	
	香港ドル 小計	83,214,974		860,137,936.05 (12,041,931,104)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.13	1,294,780.84	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	24.24	608,424.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.90	1,869,890.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.46	643,578.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.28	456,576.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.86	376,652.00	
	IJM CORP BHD	198,100	2.07	410,067.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.21	369,613.66	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	2.65	171,720.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	7.20	385,876.80	
	MISC BHD	125,040	6.74	842,769.60	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.65	255,500.00	
	GENTING BHD	205,300	6.76	1,387,828.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.14	703,674.00	

	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	33.50	365,150.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	33.86	287,810.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.28	143,920.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.35	781,434.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.64	1,350,272.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	145.00	1,000,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.62	980,901.60	
	QL RESOURCES BHD	83,200	6.68	555,776.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	280,146	4.99	1,397,928.54	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	158,600	4.88	773,968.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.48	1,256,564.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.76	468,384.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.71	261,926.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.43	576,786.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.13	2,213,954.10	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	19.62	1,202,549.04	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	19.00	283,727.00	
	MALAYAN BANKING BHD	352,318	8.97	3,160,292.46	
	PUBLIC BANK BERHAD	256,420	22.28	5,713,037.60	
	RHB BANK BHD	53,119	5.75	305,434.25	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.30	199,972.50	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.05	175,608.30	
	SP SETIA BHD	185,105	2.10	388,720.50	
	AXIATA GROUP BERHAD	281,687	4.48	1,261,957.76	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.79	1,493,043.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.36	1,435,944.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	2.77	195,429.04	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.30	1,306,150.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	11.94	3,516,031.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.12	282,648.80	
	マレーシアリングット 小計	6,686,621		43,112,769.89 (1,140,332,763)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	15.80	1,872,300.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	5.30	3,035,840.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	128.00	15,961,600.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	47.50	45,657,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	66.50	7,986,650.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	47.25	9,752,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	66.50	14,958,111.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	27,200	458.00	12,457,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	67.75	29,003,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	11.00	8,987,000.00	

	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	11.70	4,299,750.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	36.25	5,865,612.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	16.10	3,729,323.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	57.75	2,009,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	51.50	3,491,700.00	
	CP ALL PCL-NVDR	491,700	75.75	37,246,275.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	27.25	9,284,075.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.60	4,464,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	24.70	11,255,790.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	169.00	4,326,400.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	211.00	3,418,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	186.50	23,573,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,200	187.50	3,787,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	18.90	4,673,025.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	182,300	127.50	23,243,250.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	1.97	2,632,905.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	48.25	4,332,850.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	74.25	9,808,425.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	132,300	10.70	1,415,610.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	189.00	20,015,100.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	5.00	3,038,545.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	293.00	6,797,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	54.25	10,063,375.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	90.50	2,678,800.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	105.00	5,502,000.00	
	タイパーツ 小計	9,305,538		360,625,687.00 (1,251,371,133)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.20	12,182,528.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	13.58	8,020,348.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	10.52	3,634,134.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	60.70	13,982,852.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	940.00	21,436,700.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	131.00	8,284,440.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	302.00	18,425,020.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	160.10	10,147,138.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	82.50	4,937,212.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	134.00	23,278,614.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	142,732	72.60	10,362,343.20	
	SECURITY BANK CORP	30,810	170.00	5,237,700.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	889.00	19,886,930.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,350	845.00	5,365,750.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.20	9,893,940.00	

	AYALA LAND INC	637,000	46.80	29,811,600.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.42	3,457,960.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	23.05	2,143,650.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	38.65	34,303,807.50	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,999.00	3,578,210.00	
	PLDT INC	6,225	1,290.00	8,030,250.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	34.50	3,087,750.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	373.00	10,858,030.00	
	フィリピンペソ 小計	6,788,488		270,346,907.20 (567,728,505)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,280.00	1,842,304,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	3,110.00	1,391,103,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	26,100.00	3,364,290,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	6,250.00	1,526,250,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	19,525.00	3,709,750,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	7,775.00	674,092,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	10,900.00	2,557,140,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,550.00	685,425,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	7,150.00	12,306,580,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,685.00	898,105,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	550,200	5,000.00	2,751,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	84,050.00	2,588,740,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,550.00	3,258,545,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,675.00	1,557,675,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,625.00	2,842,787,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	43,050.00	5,105,730,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	3,154,000	1,460.00	4,604,840,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	915,000	28,150.00	25,757,250,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,500.00	13,635,720,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,575.00	6,947,465,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	2,350.00	2,102,310,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	4,120.00	20,130,732,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,265.00	864,501,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	650.00	1,046,760,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	3,800.00	17,263,780,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	3,750.00	500,250,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	2,040.00	1,614,660,000.00		
	インドネシアルピア 小計	27,596,096		141,527,785,000.00 (1,075,611,166)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	49,700.00	210,081,900.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	87,200.00	296,567,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,130	169,000.00	1,035,970,000.00	

HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	20,950.00	224,290,700.00
HYUNDAI STEEL CO	7,242	43,250.00	313,216,500.00
KOREA ZINC CO LTD	783	424,500.00	332,383,500.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	91,000.00	95,641,000.00
LG CHEM LTD	4,436	343,000.00	1,521,548,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	195,000.00	93,405,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	261,000.00	365,400,000.00
OCI COMPANY LTD	1,127	89,300.00	100,641,100.00
POSCO	7,270	245,000.00	1,781,150,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,159	53,000.00	61,427,000.00
CJ CORP	1,230	113,000.00	138,990,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,753	96,300.00	168,813,900.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,820.00	39,861,400.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	31,950.00	137,640,600.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	38,400.00	259,584,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	28,100.00	79,382,500.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	43,750.00	96,293,750.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	48,100.00	306,878,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	115,500.00	383,229,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	302,000.00	244,620,000.00
KCC CORP	870	288,000.00	250,560,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	30,800.00	159,420,800.00
LG CORP	8,323	71,900.00	598,423,700.00
LOTTE CORP	2,370	46,850.00	111,034,500.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	17,350.00	103,891,800.00
SAMSUNG C&T CORP	7,702	97,500.00	750,945,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	16,550.00	306,439,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	8,020.00	297,951,020.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	246,500.00	682,558,500.00
S-1 CORPORATION	960	93,000.00	89,280,000.00
CJ LOGISTICS	862	155,500.00	134,041,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	153,000.00	222,615,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	32,600.00	179,430,400.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,380.00	130,243,680.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	37,600.00	265,681,600.00
HANON SYSTEMS	19,000	11,600.00	220,400,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,621	219,500.00	1,453,309,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	131,000.00	1,726,056,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	81,900.00	236,854,800.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	75,000.00	225,225,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	21,570	43,100.00	929,667,000.00
FILA KOREA LTD	3,555	76,500.00	271,957,500.00

HLB INC	2,398	76,100.00	182,487,800.00
LG ELECTRONICS INC	9,197	73,300.00	674,140,100.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,607	77,000.00	277,739,000.00
KANGWON LAND INC	13,208	32,450.00	428,599,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	25,600.00	129,792,000.00
KAKAO CORP	4,122	126,500.00	521,433,000.00
NAVER CORP	13,644	119,000.00	1,623,636,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	490,000.00	808,500,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	123,500.00	304,427,500.00
PEARL ABYSS CORP	338	167,800.00	56,716,400.00
CJ ENM CO LTD	830	210,000.00	174,300,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	104,500.00	318,829,500.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	95,100.00	116,212,200.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	170,000.00	175,780,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	307,000.00	162,710,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	207,000.00	113,643,000.00
EMART	1,661	162,000.00	269,082,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,800.00	46,933,800.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	306,000.00	237,150,000.00
KT&G CORP	10,696	98,300.00	1,051,416,800.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	96,200.00	191,726,600.00
OTTOGI CORPORATION	68	698,000.00	47,464,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	202,000.00	580,346,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	111,000.00	78,810,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,309,000.00	1,212,134,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	734,000.00	99,090,000.00
PACIFIC CORP	2,115	72,500.00	153,337,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,731	74,100.00	276,467,100.00
CELLTRION INC	7,739	210,000.00	1,625,190,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	56,600.00	62,939,200.00
HANMI PHARM CO LTD	481	414,500.00	199,374,500.00
HANMI SCIENCE CO LTD	628	70,100.00	44,022,800.00
HELIXMITH CO LTD	1,015	228,100.00	231,521,500.00
MEDY-TOX INC	326	516,000.00	168,216,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	299,500.00	468,118,500.00
SILLAJEN INC	5,667	57,800.00	327,552,600.00
YUHAN CORPORATION	630	230,500.00	145,215,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	6,930.00	160,886,880.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	8,690.00	106,678,440.00
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	36,500.00	965,096,500.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,900.00	393,787,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	46,100.00	1,759,129,900.00

	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	36,776	44,450.00	1,634,693,200.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	45,214	13,850.00	626,213,900.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	65,100.00	299,590,200.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,250.00	225,417,000.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	13,100.00	148,003,800.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	35,900.00	68,174,100.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	33,950.00	196,095,200.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	67,300.00	283,265,700.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	3,680.00	110,020,960.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	36,300.00	156,743,400.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	34,200.00	135,945,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	292,500.00	909,090,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	79,700.00	591,134,900.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	201,500.00	628,881,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	26,755	17,950.00	480,252,250.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	111,500.00	157,772,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,095	100,000.00	609,500,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	435,416	42,450.00	18,483,409,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	75,158	34,700.00	2,607,982,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,427	222,000.00	1,204,794,000.00	
	KT CORP	3,800	28,000.00	106,400,000.00	
	LG UPLUS CORP	17,329	15,450.00	267,733,050.00	
	SK TELECOM	1,647	263,500.00	433,984,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	27,050.00	661,832,350.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	40,800.00	58,425,600.00	
	SK HYNIX INC	53,572	76,000.00	4,071,472,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,374,238		69,760,461,280.00 (6,508,651,037)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	107.00	11,688,680.00	
	ASIA CEMENT CORP	261,176	41.85	10,930,215.60	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.70	27,670,446.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	106.00	33,290,466.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	108.50	42,187,404.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	76.80	35,923,353.60	
	TAIWAN CEMENT	465,721	42.50	19,793,142.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	381.50	4,578,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	385,028	32.55	12,532,661.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,619	258.00	5,319,702.00	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.26	1,205,679.78	
	EVA AIRWAYS CORP	159,403	14.90	2,375,104.70	
	EVERGREEN MARINE	132,968	12.60	1,675,396.80	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	36.55	6,469,350.00	

CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	39.95	7,073,586.95
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	387.50	4,625,587.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	252.50	8,311,290.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	37.20	1,488,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	219.50	5,589,348.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	241.50	3,864,000.00
POU CHEN	273,780	36.20	9,910,836.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	70.00	1,547,560.00
TATUNG CO LTD	210,000	22.05	4,630,500.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	430.00	11,180,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	290.50	13,230,532.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	52.90	1,891,492.40
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	76.50	34,149,217.50
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	150.00	1,950,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	412,224	18.05	7,440,643.20
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.50	11,939,410.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,628,237	20.85	33,948,741.45
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	913,614	25.00	22,840,350.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	994,153	21.70	21,573,120.10
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	549,972	20.05	11,026,938.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	29.90	26,979,936.10
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.75	13,593,445.75
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	945,114	13.85	13,089,828.90
TAIWAN BUSINESS BANK	199,639	12.35	2,465,541.65
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	747,205	19.95	14,906,739.75
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	306,000	50.30	15,391,800.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	128,177	129.50	16,598,921.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	17.55	13,551,285.15
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	43.50	31,839,868.50
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163,157	24.95	4,070,767.15
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	44.60	28,949,057.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,142,638	8.81	10,066,640.78
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	48.00	2,021,760.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	39.90	1,334,256.00
ACER INC	255,803	19.60	5,013,738.80
ADVANTECH CO LTD	28,402	251.50	7,143,103.00
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	223.00	14,069,516.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	10.35	9,781,681.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	240.00	13,848,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	70.90	2,041,352.80
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	9.12	7,068,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.35	8,354,556.00

	DELTA ELECTRONICS INC	186,903	151.00	28,222,353.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	66.10	6,137,385.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,247,248	84.30	105,143,006.40	
	INVENTEC CO LTD	349,511	23.45	8,196,032.95	
	LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	4,410.00	39,866,400.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	251,452	43.40	10,913,016.80	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	75,000	79.20	5,940,000.00	
	PEGATRON CORP	159,474	52.00	8,292,648.00	
	QUANTA COMPUTER INC	242,270	58.80	14,245,476.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	37.15	4,758,915.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	174.00	4,698,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	24.55	5,958,162.25	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	40.15	5,769,233.80	
	YAGEO CORPORATION	22,764	286.00	6,510,504.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	108.00	2,367,576.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	110.00	39,304,650.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	75.30	11,822,100.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	114.00	17,350,800.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	69.40	20,356,061.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	342.50	6,165,000.00	
	MEDIATEK INC	147,804	300.00	44,341,200.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	64.20	6,612,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	217.50	11,537,287.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	291.50	3,381,108.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	76.50	3,654,405.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,944	225.50	7,428,872.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,248,389	256.50	576,711,778.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	13.15	12,847,550.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	63.70	5,669,300.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	200.00	6,400,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	15.35	3,131,400.00	
	新台湾ドル 小計	29,905,042		1,729,763,375.01 (6,140,659,981)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	368.05	24,335,466.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	242.30	10,158,185.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	276.70	16,442,897.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	150.60	29,181,009.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	169.40	17,416,691.60	
	PETRONET LNG LTD	49,423	237.35	11,730,549.05	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,198	1,256.45	319,387,077.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	213.95	7,955,730.75	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,354.20	33,800,832.00	

GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	869.00	23,760,198.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	198.15	24,046,889.55
JSW STEEL LTD	80,284	285.45	22,917,067.80
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,159.50	9,401,226.00
SHREE CEMENT LTD	901	19,318.90	17,406,328.90
TATA STEEL LTD	25,839	519.15	13,414,316.85
ULTRATECH CEMENT LTD	9,993	4,478.40	44,752,651.20
UNITED PHOSPHORUS LTD	39,586	948.90	37,563,155.40
VEDANTA LTD	110,508	157.15	17,366,332.20
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	84.85	12,184,714.55
HAVELLS INDIA LTD	23,476	741.70	17,412,149.20
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,356.45	60,478,679.70
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	363.90	22,753,211.40
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	32,547	473.90	15,424,023.30
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,536.80	12,847,648.00
BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,982.90	28,233,148.50
BHARAT FORGE LTD	13,392	460.55	6,167,685.60
BOSCH LTD	431	17,160.85	7,396,326.35
EICHER MOTORS LTD	1,381	20,360.90	28,118,402.90
HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,537.75	8,245,149.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	625.45	39,370,826.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	6,624.95	62,930,400.05
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	129.05	9,915,814.85
TATA MOTORS LTD	147,050	186.35	27,402,767.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	21,486.85	12,913,596.85
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,104.45	30,724,694.55
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	357.90	17,646,975.30
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,251.60	13,800,141.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,478	2,672.40	14,639,407.20
ITC LTD	316,525	299.85	94,910,021.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	10,362.20	24,817,469.00
UNITED SPIRITS LTD	37,523	525.80	19,729,593.40
DABUR INDIA LTD	58,111	367.30	21,344,170.30
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	641.10	17,909,769.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,703.75	101,696,837.50
MARICO LTD	42,465	355.65	15,102,677.25
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	756.65	15,387,234.40
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	290.55	3,052,518.30
CIPLA LTD	31,308	557.75	17,462,037.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,625.55	14,724,231.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,900.60	30,235,854.40
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	610.30	9,786,770.80

	LUPIN LTD	16,340	865.00	14,134,100.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,181.65	14,619,236.65	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	439.35	36,444,082.50	
	AXIS BANK LTD	162,301	731.00	118,642,031.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	150,186	1,914.60	287,546,115.60	
	ICICI BANK LTD	230,892	381.40	88,062,208.80	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	681.60	18,347,308.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	476.10	13,316,993.10	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	299.30	50,111,200.40	
	YES BANK LTD	152,956	170.30	26,048,406.80	
	BAJAJ FINANCE LTD	17,670	2,971.35	52,503,754.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	379.40	10,596,262.60	
	REC LTD	48,168	136.65	6,582,157.20	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,033.05	12,538,127.85	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	7,467.30	23,648,939.10	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,136.60	52,100,607.40	
	INFOSYS LTD	308,929	721.05	222,753,255.45	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	81,948	2,172.55	178,036,127.40	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	809.65	38,907,730.75	
	WIPRO LTD	118,712	291.05	34,551,127.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	124,727	315.45	39,345,132.15	
	BHARTI AIRTEL LTD-RIGHT	35,370	89.25	3,156,772.50	
	BHARTI INFRATEL LTD	45,240	267.10	12,083,604.00	
	IDEA CELLULAR LTD	467,944	14.30	6,691,599.20	
	GAIL INDIA LTD	87,384	340.40	29,745,513.60	
	NTPC LTD	260,019	127.70	33,204,426.30	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,781	187.90	31,338,149.90	
	TATA POWER CO LTD	93,250	64.40	6,005,300.00	
	インドルピー 小計	5,647,538		2,976,861,824.10 (4,703,441,682)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	136.97	9,998,810.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	124.73	8,294,545.00	
	MCB BANK LTD	53,300	176.82	9,424,506.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		27,717,861.00 (21,619,931)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	15,948	113.01	1,802,283.48	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	47.20	962,832.80	
	MASRAF AL RAYAN	40,654	35.50	1,443,217.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	11,423	159.00	1,816,257.00	
	QATAR NATIONAL BANK	41,282	182.50	7,533,965.00	
	QATAR INSURANCE CO	18,964	36.61	694,272.04	
	BARWA REAL ESTATE CO	20,749	33.85	702,353.65	

	EZDAN HOLDING GROUP	67,796	9.60	650,841.60
	OOREDOO QSC	7,280	63.90	465,192.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	161.71	611,587.22
	カタールリアル 小計	248,277		16,682,801.79 (501,651,849)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	160.72	3,156,219.36
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,431	714.06	4,592,119.86
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	168.74	8,167,353.48
	GOLD FIELDS LTD	64,581	54.05	3,490,603.05
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	429.00	2,304,588.00
	MONDI LTD	9,893	306.04	3,027,653.72
	SAPPI LIMITED	49,985	61.10	3,054,083.50
	SASOL LTD	52,957	435.41	23,058,007.37
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	211.54	5,860,081.08
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	125.50	5,086,389.50
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	210.59	4,485,356.41
	NASPERS LTD-N SHS	39,791	3,410.00	135,687,310.00
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	187.20	4,498,790.40
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	73.66	3,489,053.22
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	46.80	3,916,411.20
	BID CORP LTD	33,071	293.38	9,702,369.98
	CLICKS GROUP LTD	20,499	197.67	4,052,037.33
	PICK N PAY STORES LTD	15,477	70.08	1,084,628.16
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	172.06	7,706,911.52
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	192.97	2,819,870.61
	TIGER BRANDS LTD	13,023	255.03	3,321,255.69
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	25.87	4,049,767.41
	NETCARE LTD	99,170	23.18	2,298,760.60
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	42,615	102.07	4,349,713.05
	ABSA GROUP LTD	61,049	161.60	9,865,518.40
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,339.55	4,316,030.10
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	265.50	10,098,823.50
	STANDARD BANK GROUP LTD	109,999	195.61	21,516,904.39
	FIRSTRAND LTD	312,664	67.01	20,951,614.64
	INVESTEC LTD	28,883	88.18	2,546,902.94
	PSG GROUP LTD	18,494	255.02	4,716,339.88
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	228.01	2,655,632.47
REMGRO LTD	46,153	189.18	8,731,224.54	
RMB HOLDINGS LTD	74,398	82.16	6,112,539.68	
DISCOVERY LIMITED	34,996	145.14	5,079,319.44	
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	100.89	628,141.14	
MMI HOLDINGS LTD	68,078	17.90	1,218,596.20	

	OLD MUTUAL LTD	407,000	22.66	9,222,620.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	34.00	1,373,872.00	
	SANLAM LTD	172,493	74.85	12,911,101.05	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	120.71	3,731,628.94	
	MTN GROUP LTD	164,317	100.42	16,500,713.14	
	TELKOM SA LTD	11,353	82.98	942,071.94	
	VODACOM GROUP	63,550	112.35	7,139,842.50	
	南アフリカランド 小計	2,685,347		403,518,771.39 (3,094,988,976)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	8.65	1,596,271.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.13	659,656.44	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	223,903	15.60	3,492,886.80	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	1.68	1,070,600.16	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	1.07	193,893.63	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	3.57	109,045.65	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.61	289,225.23	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	4.50	1,352,799.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	15.86	2,668,778.06	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	2,034,583		11,433,155.97 (342,537,352)	
香港・オフショア 人民元	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	37.72	1,110,476.80	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.62	236,196.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.19	253,171.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	30.39	325,173.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	18.82	444,152.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.18	278,120.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	23.24	264,936.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	15.09	256,530.00	
	LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	16,640	23.07	383,884.80	
	SUZHOUGOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	10.10	228,260.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.64	213,981.04	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	23.50	244,400.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	8.79	227,661.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	6.11	244,400.00	
	COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	98,400	2.82	277,488.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	8.10	496,530.00	
	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.21	203,193.00	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	67.54	359,245.26	
	SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	38.62	320,546.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.85	852,305.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	25.55	1,088,430.00		
HEILAN HOME CO LTD -A	21,400	9.19	196,666.00		

MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	50.75	1,045,450.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	73.65	1,090,020.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	15.43	262,310.00	
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	21,060	10.25	215,865.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	12.99	220,830.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,300	87.79	377,497.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	858.81	2,061,144.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	67.70	297,880.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,800	91.81	348,878.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	27.53	280,806.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	14,160	62.50	885,000.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	22.82	159,740.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.59	1,269,424.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.90	861,810.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	6.12	1,176,264.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	5.38	171,622.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	7.82	1,442,790.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.12	1,132,016.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.20	269,080.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	23,800	76.66	1,824,508.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	21,100	12.51	263,961.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	16.40	1,128,320.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.88	1,157,404.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.79	868,500.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	113,300	4.58	518,914.00	
香港・オフショア人民元 小計	2,630,730		27,835,777.90 (447,599,308)	
合 計	227,489,107		51,414,716,669 (51,414,716,669)	

(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	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	5,165,257.00	
		メキシコペソ 小計	43,300	5,165,257.00 (29,545,270)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,748,019.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	908,048.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	556,317.58	
	ブラジルリアル 小計	111,562	3,212,384.58 (89,368,539)		

投資信託受益証券合計			154,862	118,913,809 (118,913,809)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,083,164.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	8,083,164.00 (46,235,698)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	950,410.26	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	891,472.39	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,104,731.76	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	1,558,993.23	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,392,172.40	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	1,296,259.76	
	南アフリカランド 小計	1,024,432	17,194,039.80 (131,878,285)		
投資証券合計			1,332,832	178,113,983 (178,113,983)	
合計				297,027,792 (297,027,792)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 47銘柄	100.0%			12.9%
メキシコペソ	株式 24銘柄	94.6%			2.6%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 1銘柄			3.3%	0.1%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	97.6%			7.0%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.4%		0.2%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			1.0%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 6銘柄	100.0%			0.2%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3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 20銘柄	100.0%			1.1%

香港ドル	株式	206銘柄	100.0%			23.3%
マレーシアリングギット	株式	44銘柄	100.0%			2.2%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%			2.4%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアルピア	株式	27銘柄	100.0%			2.1%
韓国ウォン	株式	113銘柄	100.0%			12.6%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			11.9%
インドルピー	株式	79銘柄	100.0%			9.1%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	10銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式	44銘柄	95.9%			6.0%
	投資証券	6銘柄			4.1%	0.3%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.7%
香港・オフショア人民元	株式	47銘柄	100.0%			0.9%

(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

	2019年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	657,623,925
国債証券	380,860,450,450
地方債証券	25,049,058,155
特殊債券	31,361,320,334
社債券	18,403,417,770
未収利息	880,507,024
前払費用	19,382,242
流動資産合計	457,231,759,900
資産合計	457,231,759,900
負債の部	
流動負債	
未払解約金	286,696,737
未払利息	921

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	9,581
流動負債合計	286,707,239
負債合計	286,707,239
純資産の部	
元本等	
元本	323,053,631,511
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	133,891,421,150
元本等合計	456,945,052,661
純資産合計	456,945,052,661
負債純資産合計	457,231,759,900

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	323,053,631,511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 101,786,000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 1.4145円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,145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

	2019年 5月10日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

	2019年 5月10日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	2019年 5月10日現在

（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	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	304,499,496,806円
期中追加設定元本額	29,848,197,988円
期中一部解約元本額	11,294,063,283円
期末元本額	323,053,631,511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）	3,866,767,270円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,467,694円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,227,616,070円
世界経済インデックスファンド	1,793,300,974円
D C マイセレクション 2 5	19,961,401,293円
D C マイセレクション 5 0	21,901,914,586円
D C マイセレクション 7 5	5,875,489,338円
D C 日本債券インデックス・オープン	453,982,842円
D C 日本債券インデックス・オープン S	82,954,528,613円
D C 日本債券インデックス・オープン P	38,149,061,713円
D C マイセレクション S 2 5	8,054,337,976円
D C マイセレクション S 5 0	8,857,804,672円
D C マイセレクション S 7 5	1,703,751,011円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,167,504,827円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,247,669,879円

区分	2019年 5月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	417,863,777円
DC世界経済インデックスファンド	1,577,752,622円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	85,697,047円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	5,291,192円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	50,535,901円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,941,064円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	866,233円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	221,917,542円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	325,447,416円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	63,958,719円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	165,424,346円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,540,962,527円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	976,191,133円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,679,847,614円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	848,238,970円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	112,844,319円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,305,428,983円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	29,254,801円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,493,842,056円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,836,703,647円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	167,761,272円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,524,281,333円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,108,598,082円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	58,245,051円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	758,217,399円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	51,740,715円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,426,721円
SMT インデックスバランス・オープン	65,012,149円
SMT 世界経済インデックス・オープン	8,857,511円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	9,506,347円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,521,002円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,982,091円
グローバル経済コア	236,695,104円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,515,461円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	402,972円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,089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)	76,014,981,002円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,549,442,300
地方債証券		29,205,916
特殊債券		26,168,027
社債券		11,774,560
合計		3,616,590,803

(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389回利付国債(2年)	2,780,000,000	2,787,756,200	
	第390回利付国債(2年)	3,320,000,000	3,329,993,200	
	第391回利付国債(2年)	2,850,000,000	2,859,205,500	
	第392回利付国債(2年)	560,000,000	561,937,600	
	第393回利付国債(2年)	740,000,000	742,723,200	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,043,983,200	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,262,400	
	第396回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,018,582,700	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,366,106,400	
	第398回利付国債(2年)	2,360,000,000	2,371,068,400	
	第399回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,195,842,900	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,955,713,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,622,996,000	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,972,609,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,803,517,600	

第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,618,999,900	
第129回利付国債（5年）	3,340,000,000	3,360,908,400	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,369,424,800	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,582,048,600	
第132回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,839,648,000	
第133回利付国債（5年）	4,740,000,000	4,783,181,400	
第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	3,201,034,300	
第135回利付国債（5年）	5,790,000,000	5,850,563,400	
第136回利付国債（5年）	5,900,000,000	5,965,785,000	
第137回利付国債（5年）	3,430,000,000	3,470,611,200	
第138回利付国債（5年）	9,060,000,000	9,173,521,800	
第139回利付国債（5年）	1,140,000,000	1,155,048,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	601,488,000	
第2回利付国債（40年）	470,000,000	686,453,800	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	809,649,500	
第4回利付国債（40年）	850,000,000	1,262,641,000	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,279,330,500	
第6回利付国債（40年）	640,000,000	905,958,400	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	980,798,400	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	1,017,344,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,028,861,900	
第10回利付国債（40年）	1,760,000,000	1,956,046,400	
第11回利付国債（40年）	1,620,000,000	1,744,059,600	
第308回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,514,138,000	
第309回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,484,275,500	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,432,320,300	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,094,158,800	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,893,705,700	
第313回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,386,612,000	
第314回利付国債（10年）	470,000,000	480,998,000	
第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	3,230,494,800	
第316回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,201,239,000	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	916,628,800	
第318回利付国債（10年）	1,960,000,000	2,013,998,000	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,766,601,000	
第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,709,293,600	
第321回利付国債（10年）	2,470,000,000	2,552,448,600	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	772,882,500	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,002,223,400	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,318,528,000	
第325回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,405,864,800	
第326回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,712,074,200	

第327回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,324,800,000	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,852,684,500	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,340,180,000	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,501,300,800	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,426,630,200	
第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,552,588,200	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,417,771,100	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,900,595,600	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,751,080,200	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	529,334,100	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,469,874,200	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,531,781,000	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,025,488,700	
第340回利付国債(10年)	3,770,000,000	3,906,813,300	
第341回利付国債(10年)	3,530,000,000	3,639,606,500	
第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,963,427,600	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,208,842,000	
第344回利付国債(10年)	2,420,000,000	2,464,987,800	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,017,303,200	
第346回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,975,626,000	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,312,744,100	
第348回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,364,870,400	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,268,550,400	
第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,010,368,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,725,479,600	
第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	3,954,107,200	
第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	4,785,077,400	
第354回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,430,938,500	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	141,970,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	201,702,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	150,495,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	146,505,700	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,956,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	245,415,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	231,636,600	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	61,386,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	281,877,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	181,488,000	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	109,721,700	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	242,920,700	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	367,464,800	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	398,355,000	

第15回利付国債(30年)	340,000,000	458,007,200
第16回利付国債(30年)	370,000,000	499,762,700
第17回利付国債(30年)	570,000,000	763,230,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	457,725,300
第19回利付国債(30年)	380,000,000	505,286,000
第20回利付国債(30年)	480,000,000	655,368,000
第21回利付国債(30年)	320,000,000	427,315,200
第22回利付国債(30年)	400,000,000	548,640,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	591,116,700
第24回利付国債(30年)	380,000,000	523,529,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	470,991,500
第26回利付国債(30年)	430,000,000	587,487,500
第27回利付国債(30年)	600,000,000	834,006,000
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,577,796,400
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,936,060,000
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,492,853,100
第31回利付国債(30年)	910,000,000	1,234,587,900
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,853,193,200
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,217,526,200
第34回利付国債(30年)	1,265,000,000	1,738,287,100
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,261,118,600
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,256,979,200
第37回利付国債(30年)	1,550,000,000	2,055,408,500
第38回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,386,151,400
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,252,728,600
第40回利付国債(30年)	720,000,000	944,762,400
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,200,816,000
第42回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,408,716,000
第43回利付国債(30年)	960,000,000	1,241,875,200
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,438,881,900
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,374,648,000
第46回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,375,429,000
第47回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,709,960,600
第48回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,658,029,500
第49回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,425,222,400
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,154,187,600
第51回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,047,486,000
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,543,711,400
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,149,948,800
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,434,551,300
第55回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,077,900,000
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,357,246,800
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,248,647,200

第58回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,441,357,600	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	178,185,500	
第60回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,444,130,900	
第61回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,435,102,400	
第62回利付国債(30年)	240,000,000	237,837,600	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	174,477,800	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	92,898,900	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	135,574,400	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	145,894,000	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	228,441,400	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	104,577,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,899,300	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,740,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	212,376,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,692,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	160,131,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	255,460,800	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	320,907,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,528,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	369,866,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	250,886,400	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	332,825,600	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	216,238,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	348,992,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	241,082,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	360,092,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,130,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	211,977,300	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	433,204,200	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	452,812,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	224,346,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	707,105,700	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	404,096,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	225,628,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	147,355,000	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	302,856,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	327,001,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	191,586,600	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	305,947,800	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	250,648,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	444,093,000	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	687,072,000	

第83回利付国債(20年)	290,000,000	333,752,300
第84回利付国債(20年)	470,000,000	537,774,000
第85回利付国債(20年)	290,000,000	335,289,300
第86回利付国債(20年)	210,000,000	245,704,200
第87回利付国債(20年)	550,000,000	639,699,500
第88回利付国債(20年)	420,000,000	493,886,400
第89回利付国債(20年)	350,000,000	409,059,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	739,569,600
第91回利付国債(20年)	450,000,000	531,607,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,031,131,200
第93回利付国債(20年)	410,000,000	479,277,700
第94回利付国債(20年)	610,000,000	717,909,000
第95回利付国債(20年)	610,000,000	730,804,400
第96回利付国債(20年)	320,000,000	378,134,400
第97回利付国債(20年)	400,000,000	477,924,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	522,007,200
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,369,604,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	578,083,200
第101回利付国債(20年)	715,000,000	873,858,700
第102回利付国債(20年)	410,000,000	503,246,300
第103回利付国債(20年)	400,000,000	487,304,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	431,971,200
第105回利付国債(20年)	680,000,000	818,964,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	461,236,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	314,256,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	784,971,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	620,391,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,152,217,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,190,432,500
第112回利付国債(20年)	790,000,000	961,509,000
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,770,841,500
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,151,791,400
第115回利付国債(20年)	700,000,000	865,158,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,314,495,400
第117回利付国債(20年)	780,000,000	958,791,600
第118回利付国債(20年)	690,000,000	843,235,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	635,931,100
第120回利付国債(20年)	790,000,000	930,351,400
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,821,570,000
第122回利付国債(20年)	230,000,000	276,699,200
第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,588,262,400
第124回利付国債(20年)	540,000,000	663,795,000
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,030,141,400

第126回利付国債(20年)	730,000,000	899,834,500	
第127回利付国債(20年)	670,000,000	817,962,800	
第128回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,579,024,500	
第129回利付国債(20年)	320,000,000	387,840,000	
第130回利付国債(20年)	1,045,000,000	1,269,570,500	
第131回利付国債(20年)	640,000,000	769,676,800	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,012,342,800	
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,315,094,400	
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,220,350,000	
第135回利付国債(20年)	590,000,000	712,495,800	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	681,081,600	
第137回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,234,281,600	
第138回利付国債(20年)	320,000,000	378,924,800	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	610,526,100	
第140回利付国債(20年)	1,750,000,000	2,121,840,000	
第141回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,955,763,600	
第142回利付国債(20年)	520,000,000	638,653,600	
第143回利付国債(20年)	720,000,000	866,368,800	
第144回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,748,785,500	
第145回利付国債(20年)	2,475,000,000	3,017,346,750	
第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,564,646,000	
第147回利付国債(20年)	1,690,000,000	2,043,142,400	
第148回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,236,763,100	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,041,929,400	
第150回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,379,980,700	
第151回利付国債(20年)	1,765,000,000	2,038,257,300	
第152回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,495,707,200	
第153回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,144,046,300	
第154回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,942,987,200	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,427,948,000	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,009,156,800	
第157回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,089,258,700	
第158回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,296,167,900	
第159回利付国債(20年)	1,870,000,000	1,972,045,900	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	2,089,230,000	
第161回利付国債(20年)	1,710,000,000	1,799,621,100	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,155,103,500	
第163回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,764,134,400	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,835,322,400	
第165回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,070,804,800	
第166回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,448,903,200	
第167回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,042,874,300	

	第168回利付国債（20年）	440,000,000	442,846,800
	国債証券合計	348,160,000,000	380,860,450,450
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,952,000
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,585,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	134,393,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	132,480,000
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	128,551,000
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	127,735,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,176,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,202,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	238,728,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	237,966,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	102,211,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	102,486,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,379,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	205,384,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	102,745,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,413,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,556,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,975,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,243,000
	第764回東京都公募公債	150,000,000	152,106,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,410,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,213,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,960,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,941,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,289,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,382,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,475,000
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	138,092,000
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,779,000
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	115,871,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,890,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,088,000
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,586,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,131,000
	第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	238,762,000
	第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,002,000
	第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,640,000
	第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,785,000
	第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,196,000
	第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,484,000

第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,760,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,642,120	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,138,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,026,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,648,960	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,510,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,581,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	119,224,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,469,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,252,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,505,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,139,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	210,038,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,413,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,395,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,496,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	121,312,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	104,298,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,783,420	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,497,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,601,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,212,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,373,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,373,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,641,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,695,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,460,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,549,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,460,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,281,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,346,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,568,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,508,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,864,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	103,736,000	

平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	120,899,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,842,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,877,949	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,162,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	119,232,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	107,560,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,152,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	197,408,120	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,079,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,118,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,168,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,903,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,405,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,703,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,213,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,260,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,455,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,695,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	121,463,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,992,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,006,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	133,063,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,870,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,227,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	118,935,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,836,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,585,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,375,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,189,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,404,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,692,800	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,264,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,107,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,284,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	365,526,560	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,388,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,634,500	

第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,873,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,076,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,674,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,660,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,569,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,022,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,499,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,012,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,974,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,114,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,573,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,101,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,911,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,714,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,594,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,426,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,543,216	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,044,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,480,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,347,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,852,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,286,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,090,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,150,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,115,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,632,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,266,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,757,250	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,304,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,667,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,470,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,543,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,359,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	242,130,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,613,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	136,571,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,985,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,851,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,651,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,532,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	103,456,560	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,769,000	

	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,727,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,155,000	
	平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	202,308,000	
	平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	141,368,400	
	平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	241,410,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,126,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,360,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,723,000	
	平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,114,000	
	平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,178,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,065,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,914,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,329,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,854,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,327,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,808,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,986,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,448,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,994,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,690,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,483,350	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,668,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,724,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,965,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,469,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,779,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,477,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,078,350	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,376,600	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	205,346,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,576,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	118,965,000	
	地方債証券合計	23,736,220,000	25,049,058,155	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,035,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,765,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,264,000	

第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,990,000	
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,956,000	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,270,000	
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	103,504,000	
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	207,306,000	
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,332,000	
第14回道路債券	100,000,000	106,748,000	
第17回道路債券	100,000,000	105,412,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	466,596,000	
第21回道路債券	100,000,000	133,714,000	
第28回道路債券	200,000,000	271,220,000	
第33回道路債券	200,000,000	275,266,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,198,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	155,702,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,895,000	
第42回道路債券	100,000,000	112,586,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,205,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,639,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,988,000	
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	147,259,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,738,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,607,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,700,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,946,000	
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	133,649,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,155,000	
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	204,078,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,505,000	
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	102,148,000	

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	102,655,000	
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	102,546,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,384,000	
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	307,755,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,969,000	
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	308,771,820	
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	205,788,000	
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	102,953,000	
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	102,803,000	
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	308,514,000	
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	119,142,000	
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	103,291,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,879,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,540,000	
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	204,696,000	
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	307,986,000	
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	207,730,000	
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	153,541,120	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,684,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,402,000	
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	234,666,000	
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	105,654,660	
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	103,571,000	
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	103,409,000	
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	103,234,000	
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	102,912,000	
	300,000,000	306,333,000	

第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	204,924,000	
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	101,296,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,082,000	
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	107,405,530	
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	319,147,360	
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	207,539,950	
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	101,464,000	
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	304,317,000	
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	101,498,000	
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	529,157,200	
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	202,442,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,027,480	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,164,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	313,683,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,313,100	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,982,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,623,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	135,696,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,346,400	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	240,802,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,792,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,991,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,495,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,499,750	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,630,040	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,749,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,730,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,567,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,090,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,773,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,264,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,337,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,635,000	

第5 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,781,000	
第5 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,792,000	
第5 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,532,000	
第6 5 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,016,000	
F 7 7 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,632,000	
第7 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,803,000	
第8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,446,000	
第8 7 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,545,000	
第8 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,183,000	
第9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,990,000	
第9 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,235,000	
第9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,594,320	
第9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,558,000	
第9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,489,000	
第1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,929,400	
第1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,873,520	
第1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,874,000	
F 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,160,000	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,516,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	214,046,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,456,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,850,000	
第7 回阪神高速道路債券	100,000,000	112,353,000	
第1 9 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,922,000	
第1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,713,000	
第4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,561,960	
第4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,560,000	
第4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,026,500	
第5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,386,570	
第4 3 回都市再生債券	100,000,000	101,725,000	
第1 2 7 回都市再生債券	400,000,000	400,144,000	
第5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,076,000	
第3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	106,177,000	
第3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,894,800	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,814,000	15,475,000	
第1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,066,000	15,807,699	
第2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,463,000	16,363,255	
第2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	265,404,000	266,701,825	
	185,444,000	186,148,687	

第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,482,000	16,320,040	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,492,000	17,422,478	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,424,000	13,831,284	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,590,000	28,833,481	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,024,000	16,841,224	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,026,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,591,000	15,285,823	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,888,000	17,873,245	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,537,000	15,256,872	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,736,000	17,700,495	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,753,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,977,000	16,333,446	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,309,000	16,668,124	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,271,000	23,971,836	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,714,000	24,523,397	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,224,000	27,390,489	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,514,000	30,676,216	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,415,000	32,820,522	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,451,000	33,855,114	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,230,000	71,240,299	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,977,000	15,602,739	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,307,000	35,535,571	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,914,000	15,527,114	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,731,000	15,517,930	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,338,000	38,906,006	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,712,000	14,367,707	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,051,000	38,672,989	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,783,000	36,204,903	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,600,000	16,562,676	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,824,000	72,171,518	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,757,000	39,174,140	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,365,000	16,155,375	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,027,000	50,985,943	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,768,000	48,573,120	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,757,000	48,597,136	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,386,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,606,000	103,381,347	

第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,107,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,152,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,597,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,882,000	109,994,997	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,957,000	55,469,280	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,949,000	55,889,787	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,018,000	57,093,244	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,725,000	50,242,016	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,631,000	49,777,729	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,575,000	56,748,247	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,617,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,226,000	51,456,430	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,541,000	57,945,925	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,825,000	59,325,868	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,540,000	59,909,497	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,689,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,736,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,224,000	126,202,669	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,043,000	64,319,357	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,514,000	132,371,990	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,253,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,316,000	74,750,879	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,075,000	78,411,263	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,379,000	78,108,473	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,754,000	160,871,425	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,132,000	78,983,143	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,675,000	83,786,634	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,530,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,297,000	90,052,452	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,511,000	90,067,758	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,331,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,642,000	90,602,962	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,096,000	91,483,478	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,660,000	91,915,641	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,041,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,516,000	93,674,300	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,010,000	94,294,468	

第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,137,000	94,182,928	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,337,000	94,417,842	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,884,000	95,027,507	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,850,000	190,721,503	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,339,000	95,453,143	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,122,000	192,888,275	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,185,000	96,327,220	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,334,000	193,302,826	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,292,000	97,426,319	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,182,000	195,982,067	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,520,000	196,311,529	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	132,111,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,784,000	99,278,139	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,357,000	100,086,116	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,745,000	99,546,809	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,858,000	199,482,414	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,876,000	100,084,740	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,323,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,561,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,396,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,000,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,912,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,058,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,792,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,838,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,965,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,928,000	
第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,279,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,098,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,228,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,239,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,502,000	

	第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,262,000	
	第350回信金中金債(5年)	100,000,000	100,164,000	
	第218号商工債(3年)	300,000,000	300,396,000	
	第221号商工債(3年)	200,000,000	200,190,000	
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	102,858,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,952,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,866,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,677,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,174,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,850,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,632,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,924,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,891,000	
	特殊債券合計	29,686,092,000	31,361,320,334	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,859,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,351,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,806,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,382,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,641,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,010,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,512,000	
	第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,248,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,698,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,426,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,796,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA/B円貨社債	100,000,000	100,211,000	
	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	100,454,000	
	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	105,594,000	
	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	300,000,000	300,588,000	
	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	200,334,000	

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	100,278,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,715,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,692,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,635,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
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	100,191,000	
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	100,232,000	
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	102,438,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,353,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,800,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,275,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,040,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,810,000	
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	99,927,000	
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	99,599,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,788,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,118,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,064,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,546,000	
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	100,949,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,349,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,875,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,181,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,750,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,729,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,528,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,961,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,244,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,511,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,988,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,734,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,380,000	

第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,415,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,328,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,811,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,475,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,296,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,242,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,164,000	
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	100,227,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,880,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,240,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,984,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
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	100,456,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	120,435,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,451,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,094,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,457,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,904,000	
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	123,841,000	
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	101,824,000	
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	103,094,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,554,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,742,000	
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	102,141,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	102,071,000	
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	306,837,000	
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	101,828,000	
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	102,430,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,359,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,858,000	
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	100,455,000	

第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,900,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,769,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,673,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,083,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,136,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,107,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,849,000	
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	199,966,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,092,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,180,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,058,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,732,000	
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	102,398,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	103,968,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,852,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,009,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	104,088,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,543,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,111,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,730,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,606,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,808,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,866,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,233,480	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,682,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,338,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,692,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,307,200	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,020,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	128,535,000	

第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,039,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,200,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,772,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,067,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,884,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,764,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,170,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,083,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,040,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,727,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,038,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,354,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,171,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,501,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,714,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,040,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,608,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,477,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,756,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,919,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,084,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,260,500	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,002,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,742,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,918,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,290,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,731,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,848,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,645,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,223,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,069,590	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,478,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,268,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,543,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,388,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,278,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,254,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,276,000	
	100,000,000	101,171,000	

	第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債			
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,978,000	
	社債券合計	17,966,000,000	18,403,417,770	
	合計		455,674,246,709	

(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

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	306,122,334
コール・ローン	4,924,737,659
国債証券	302,824,274,311
派生商品評価勘定	19,723,623
未収入金	9,373,355
未収利息	2,030,330,019
前払費用	412,975,142
差入委託証拠金	179,511,086
流動資産合計	310,707,047,529
資産合計	310,707,047,529
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,439,934
前受金	19,535,622
未払金	147,252,587
未払解約金	114,006,878
未払利息	6,901
その他未払費用	15,476
流動負債合計	350,257,398
負債合計	350,257,398
純資産の部	
元本等	
元本	113,477,031,083
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	196,879,759,048
元本等合計	310,356,790,131
純資産合計	310,356,790,131
負債純資産合計	310,707,047,529

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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)

	2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	113,477,031,083口

	2019年 5月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,7350円 (27,350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

	2019年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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

	2019年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2019年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</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	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	92,247,899,512円
期中追加設定元本額	28,092,966,747円
期中一部解約元本額	6,863,835,176円
期末元本額	113,477,031,083円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,825,325,012円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	742,517,031円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	504,744,342円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,976,750,703円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,888,509円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,158,857,132円

区分	2019年 5月10日現在
世界経済インデックスファンド	6,392,905,637円
DCマイセレクション25	1,640,795,415円
DCマイセレクション50	1,256,312,643円
DCマイセレクション75	804,647,897円
DC外国債券インデックス・オープン	1,832,203,738円
DCマイセレクションS25	662,649,520円
DCマイセレクションS50	510,095,641円
DCマイセレクションS75	233,163,341円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	50,034,654円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	64,239,995円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	30,660,652円
DC世界経済インデックスファンド	5,553,889,987円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	607,332,785円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	43,091,299円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,882,570円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,887,912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）	60,635,960円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	128,261,435円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	195,905,821円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	162,521,822円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	480,279,915円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,267,727,009円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	627,481,608円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,230,142,124円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	898,061,330円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	91,227,184円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	648,275,491円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	38,253,498円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	245,008,472円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	303,040,162円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,022,324,576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）	784,125,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	843,201,395円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,484,843円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,410,439,035円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,742,576,502円
分散投資コア戦略ファンドA	1,207,277,596円
分散投資コア戦略ファンドS	3,000,534,200円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,940,895円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,543,007,885円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,105,938,791円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	235,551,162円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	110,182,598円

区分	2019年 5月10日現在
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,055,580,923円
SMT インデックスバランス・オープン	234,372,941円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	24,300,042,049円
SMT 世界経済インデックス・オープン	55,573,667円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	85,819,753円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	115,622,824円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,064,887円
グローバル経済コア	992,410,068円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,935,384円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	51,407円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	162,512,504円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	13,044,147円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	904,300,034円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,027,314,995円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,347,996円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	18,174,655,552円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,258,146,215
合計	5,258,146,215

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	債券先物取引 買建	3,757,782,832	-	19,535,622
			3,777,318,454	
合計		3,757,782,832	-	19,535,622

(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

(2019年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,094,428,633	-	5,025,176,700	69,251,933
	アメリカドル	2,546,810,365	-	2,516,845,200	29,965,165
	カナダドル	196,700,912	-	193,486,800	3,214,112
	ユーロ	2,004,165,475	-	1,973,552,700	30,612,775
	イギリスポンド	346,751,881	-	341,292,000	5,459,881
合計		5,094,428,633	-	5,025,176,700	69,251,933

(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	6,366,574.56	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,952,547.60	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,574,612.74	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,878,350.40	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,729,134.49	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,434,157.40	

T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,368,349.75	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,763,483.70	
T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,827,960.10	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	990,435.36	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,337,095.33	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,534,027.01	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,562,704.30	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,829,403.60	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,411,173.42	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,947,552.72	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,708,297.28	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,917,141.20	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,414,398.57	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,590,645.81	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,890,180.96	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,129,088.35	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,894,897.70	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,440,206.28	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,736,238.96	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,418,385.56	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,881,966.30	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,880,772.80	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,975,314.53	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,956,759.25	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,453,072.57	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,426,641.90	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,761,858.74	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	11,902,372.30	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,017,672.25	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,420,085.71	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,468,075.30	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,425,566.17	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,048,153.87	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,747,299.16	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,169,124.87	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,416,609.99	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,903,169.56	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,993,786.62	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,966,902.04	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,126,470.51	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	11,887,542.72	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,476,169.70	

T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,729,820.08
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,903,394.09
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,955,677.52
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,479,783.26
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,352,273.23
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,991,229.74
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,044,387.44
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,355,379.85
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,874,554.28
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,480,371.75
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,094,119.62
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,766,389.58
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,082,962.39
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,482,755.04
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,272,879.79
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,939,062.08
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,612,323.67
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,488,482.83
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,299,981.90
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,998,514.88
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,868,671.43
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,048,425.86
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,499,026.09
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,999,946.69
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,452,433.12
T 2.25% 08/15/46	6,700,000.00	5,918,364.26
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,290,854.35
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,129,726.69
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,377,434.02
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	14,466,260.87
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,497,712.07
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,383,761.28
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,520,427.56
T 2.375% 04/30/20	3,960,000.00	3,960,285.35
T 2.375% 05/15/27	6,950,000.00	6,944,178.40
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,561,333.75
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,011,976.24
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,103,288.80
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,056,392.95
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,892,412.05
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	15,379,873.57
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,089,554.40
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,932,639.67

T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	14,902,385.11	
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,968,791.76	
T 2.5% 06/30/20	6,500,000.00	6,510,763.48	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,597,272.90	
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,030,253.00	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,419,583.95	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,377,164.56	
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,653,703.66	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,293,397.60	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,376,431.96	
T 2.625% 07/31/20	12,700,000.00	12,742,742.10	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,519,781.79	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,049,356.01	
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,687,744.86	
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	16,991,530.39	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,066,649.14	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,668,785.40	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,745,291.78	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	10,759,960.15	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,121,531.20	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,120,991.86	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,964,054.54	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	9,716,555.38	
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,162,625.31	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,047,161.47	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,143,868.30	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	8,832,613.29	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	14,772,732.68	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	11,581,767.18	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	9,762,583.30	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	16,497,750.96	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,945,309.22	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,873,591.48	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,432,511.28	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,102,780.60	
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,290,716.69	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,478,957.65	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,485,286.70	
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	11,897,253.84	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,265,230.06	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,980,057.64	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,780,317.93	

T 2% 05/31/24	8,000,000.00	7,899,892.24
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,364,260.93
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,178,394.10
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,979,401.91
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,068,972.79
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,762,396.54
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,977,625.85
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,618,465.76
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,386,678.08
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,958,265.89
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,473,653.46
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,984,002.80
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,187,896.78
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,478,864.88
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,256,323.75
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,388,934.68
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	4,934,388.15
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,302,434.86
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	15,227,809.19
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,431,965.84
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,145,051.67
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	9,142,474.65
T 3.5% 02/15/39	2,200,000.00	2,474,672.61
T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,713,557.07
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,354,699.37
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	8,549,257.42
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,277,959.02
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,322,342.04
T 3.75% 11/15/43	6,000,000.00	6,971,272.08
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,725,590.01
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,561,341.40
T 3% 02/15/49	4,650,000.00	4,771,266.64
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	2,013,674.18
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,599,373.01
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	7,956,860.36
T 3% 08/15/48	6,350,000.00	6,509,634.61
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	15,595,789.65
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,398,330.70
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,219,289.46
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,117,337.52
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	5,410,683.12
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,256,164.35
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,400,136.14

	T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,354,634.76
	T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,408,402.59
	T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,314,169.82
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,276,448.56
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,179,339.65
	T 4.625% 02/15/40	1,700,000.00	2,215,746.64
	T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	3,916,270.31
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,476,458.59
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,552,697.32
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,608,224.16
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,069,136.11
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,503,319.16
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,086,047.54
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,861,892.24
	T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,588,928.67
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,917,210.35
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,937,171.25
	アメリカドル 小計	1,289,070,000.00	1,299,773,073.94 (142,793,069,903)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,009,480.00
	CAN 0.75% 03/01/21	4,590,000.00	4,521,999.15
	CAN 0.75% 09/01/20	4,200,000.00	4,150,398.00
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,599,853.15
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,393,760.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,280,783.50
	CAN 1.75% 03/01/23	1,900,000.00	1,912,872.50
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,708,734.50
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,872,652.45
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,472,535.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,373,795.50
	CAN 2.25% 06/01/25	2,850,000.00	2,956,789.50
	CAN 2.25% 06/01/29	1,120,000.00	1,178,223.20
	CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,198,648.60
	CAN 2.75% 06/01/22	2,210,000.00	2,287,725.70
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,398,295.25
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	782,387.30
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,199,802.30
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,148,897.85
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,121,341.25
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	407,080.00
	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,201,791.65
	CAN 3.5% 06/01/20	5,210,000.00	5,307,895.90

	CAN 3.5% 12/01/45	2,490,000.00	3,295,303.35
	CAN 4.0% 06/01/41	2,330,000.00	3,189,432.15
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	2,977,674.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,381,480.00
	CAN 5% 06/01/37	2,010,000.00	2,960,498.85
	CAN 8.0% 06/01/27	910,000.00	1,343,801.55
	カナダドル 小計	66,930,000.00	72,633,932.15 (5,932,013,238)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	19,353,679.50
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	42,452,314.20
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,070,000.00	22,060,346.50
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,895,045.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	55,880,000.00	54,332,403.40
	MBONO 7.25% 12/09/21	25,330,000.00	24,922,946.90
	MBONO 7.5% 06/03/27	42,070,000.00	40,523,296.45
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	21,101,520.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	32,690,000.00	30,095,721.60
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,630,000.00	8,156,213.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	21,000,000.00	21,430,815.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	24,084,805.05
	MBONO 8% 06/11/20	33,750,000.00	33,766,200.00
	MBONO 8% 11/07/47	13,560,000.00	12,741,654.00
	MBONO 8% 12/07/23	33,800,000.00	33,909,850.00
	メキシコペソ 小計	440,380,000.00	433,826,810.60 (2,481,489,356)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,000,000.00	2,044,080.00
	BGB 0.5% 10/22/24	1,570,000.00	1,625,389.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,211,100.50
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,212,113.45
	BGB 0.8% 06/22/28	3,160,000.00	3,296,085.40
	BGB 0.9% 06/22/29	950,000.00	993,476.75
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	903,103.75
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	848,628.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,750,000.00	1,825,740.00
	BGB 1.7% 06/22/50	670,000.00	702,039.40
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,246,751.00
	BGB 1% 06/22/26	1,730,000.00	1,844,802.80
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,553,958.25
	BGB 2.15% 06/22/66	570,000.00	643,316.25
	BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,951,232.80
	BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	930,752.00
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,448,994.60
	BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,454,712.00

BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,914,092.50
BGB 3% 06/22/34	1,450,000.00	1,891,633.75
BGB 4.25% 03/28/41	2,730,000.00	4,320,265.95
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,619,192.50
BGB 4.25% 09/28/22	2,270,000.00	2,633,517.80
BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,167,610.60
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,502,736.50
BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,230,209.50
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,294,899.20
BGB 5% 03/28/35	2,780,000.00	4,460,093.00
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,994,632.00
BTPS 0.05% 04/15/21	2,190,000.00	2,167,344.45
BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,388,568.30
BTPS 0.35% 06/15/20	3,480,000.00	3,488,404.20
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,550,033.30
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,394,694.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,252,998.50
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,557,393.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,011,300.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,151,364.10
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,442,110.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,967,260.00
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,454,364.50
BTPS 1.25% 12/01/26	4,200,000.00	3,945,900.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,920,967.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,231,632.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,057,911.75
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,272,154.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	2,832,841.35
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,482,586.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,723,381.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,011,240.00
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,575,142.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	3,135,264.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,576,487.50
BTPS 2.2% 06/01/27	3,700,000.00	3,674,266.50
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,370,703.25
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,790,436.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,358,662.50
BTPS 2.45% 10/01/23	3,000,000.00	3,109,065.00
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,023,219.00
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,609,632.00
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	2,645,775.00

BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	774,594.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,950,000.00	3,017,953.25	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,540,000.00	2,425,636.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,604,517.75	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,141,873.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,400,000.00	2,336,628.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,945,188.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	2,520,082.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,930,000.00	4,209,501.60	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,018,918.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,288,697.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	2,790,000.00	2,972,270.70	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,354,346.75	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,320,000.00	1,378,337.40	
BTPS 3% 08/01/29	1,620,000.00	1,668,421.80	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	3,890,979.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	3,600,000.00	4,138,614.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,356,982.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,756,353.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,299,970.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,159,451.80	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,896,308.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,200,000.00	4,664,541.00	
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,613,180.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,400,000.00	4,206,463.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,500,687.25	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,866,378.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,938,813.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,350,000.00	4,375,100.00	
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,317,684.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,092,205.50	
BTPS 5% 08/01/34	3,690,000.00	4,545,489.60	
BTPS 5% 09/01/40	3,520,000.00	4,334,158.40	
BTPS 6.5% 11/01/27	4,170,000.00	5,479,400.85	
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	6,330,024.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,880,851.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,055,352.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,190,000.00	4,356,238.25	
DBR 0.25% 02/15/29	910,000.00	936,503.75	
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,295,636.80	
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	3,995,399.05	
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,596,673.00	

DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,459,643.65
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	4,924,815.00
DBR 0% 08/15/26	3,160,000.00	3,229,188.20
DBR 1.25% 08/15/48	2,120,000.00	2,489,102.60
DBR 1.5% 02/15/23	920,000.00	993,006.60
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,197,357.50
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,520,763.30
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,998,996.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,829,874.75
DBR 1.75% 07/04/22	3,650,000.00	3,925,648.00
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,450,000.00
DBR 1% 08/15/25	3,910,000.00	4,254,236.40
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,595,775.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,081,566.50
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,054,077.00
DBR 2.5% 07/04/44	4,430,000.00	6,484,789.05
DBR 2.5% 08/15/46	4,190,000.00	6,236,563.60
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,533,442.00
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,273,326.75
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	11,044,431.50
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,190,069.00
DBR 3% 07/04/20	7,190,000.00	7,489,966.80
DBR 4.0% 01/04/37	3,360,000.00	5,488,341.60
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,232,893.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,703,071.75
DBR 4.75% 07/04/34	3,380,000.00	5,676,963.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,510,000.00	4,721,284.90
DBR 5.5% 01/04/31	2,930,000.00	4,809,126.20
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,712,779.60
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,636,080.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,095,162.50
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,010,932.00
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,064,250.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,928,327.50
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,159,295.65
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,510,852.80
FRTR 0.5% 05/25/29	2,600,000.00	2,640,196.00
FRTR 0.75% 05/25/28	5,000,000.00	5,236,375.00
FRTR 0.75% 11/25/28	6,510,000.00	6,796,602.75
FRTR 0% 02/25/21	3,500,000.00	3,536,120.00
FRTR 0% 03/25/23	3,900,000.00	3,959,338.50
FRTR 0% 03/25/24	8,040,000.00	8,144,600.40
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,147,314.00

FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,631,585.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,229,028.00	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,820,000.00	5,098,644.20	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,520,000.00	7,265,105.60	
FRTR 1.5% 05/25/50	1,200,000.00	1,233,648.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,989,192.30	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	1,964,076.30	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,420,000.00	2,743,868.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,662,482.05	
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,127,303.75	
FRTR 1% 11/25/25	6,930,000.00	7,427,816.55	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,497,094.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,279,215.60	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,460,000.00	6,683,558.70	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,696,122.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,111,600.00	
FRTR 2% 05/25/48	4,040,000.00	4,696,984.80	
FRTR 3.25% 05/25/45	4,170,000.00	6,061,095.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,869,140.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,084,750.05	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,470,000.00	7,019,529.45	
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,406,761.60	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,545,937.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	5,690,000.00	9,547,820.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,808,985.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,300,000.00	3,952,032.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,850,000.00	3,269,431.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,980,000.00	6,152,920.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,129,290.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5,410,000.00	9,037,783.70	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,651,602.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,355,385.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	1,570,000.00	1,622,626.40	
IRISH 0.9% 05/15/28	1,060,000.00	1,110,063.80	
IRISH 0% 10/18/22	630,000.00	637,156.80	
IRISH 1.1% 05/15/29	490,000.00	518,050.05	
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	547,450.80	
IRISH 1.35% 03/18/31	730,000.00	783,085.60	
IRISH 1.7% 05/15/37	940,000.00	1,026,893.60	
IRISH 1% 05/15/26	1,880,000.00	1,994,351.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,480,000.00	1,761,873.40	
IRISH 2% 02/18/45	1,260,000.00	1,437,930.90	

IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,726,426.80
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,500,902.10
IRISH 5.4% 03/13/25	1,980,000.00	2,606,600.70
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	248,218.30
NETHER 0.25% 07/15/25	1,880,000.00	1,940,630.00
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	960,478.50
NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,747,711.90
NETHER 0.75% 07/15/27	3,630,000.00	3,869,489.25
NETHER 0.75% 07/15/28	1,490,000.00	1,586,909.60
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,554,180.00
NETHER 0% 01/15/24	2,650,000.00	2,698,746.75
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,131,720.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,809,972.70
NETHER 2.5% 01/15/33	2,010,000.00	2,596,317.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,230,000.00	3,419,783.05
NETHER 2% 07/15/24	2,750,000.00	3,089,240.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,224,075.75
NETHER 3.5% 07/15/20	2,060,000.00	2,159,745.20
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,676,692.80
NETHER 3.75% 01/15/42	2,550,000.00	4,285,020.00
NETHER 4% 01/15/37	2,470,000.00	3,962,806.25
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,690,882.20
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	259,799.00
OBL 0.25% 10/16/20	2,250,000.00	2,278,586.25
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,968,092.00
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,830,561.40
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,562,975.90
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,640,664.00
OBL 0% 10/13/23	2,930,000.00	2,999,250.55
RAGB 0.5% 02/20/29	780,000.00	797,635.80
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,175,799.50
RAGB 0.75% 02/20/28	1,430,000.00	1,504,831.90
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,499,911.25
RAGB 0% 07/15/23	910,000.00	924,978.60
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,117,638.50
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,861,531.65
RAGB 1.5% 02/20/47	970,000.00	1,077,645.75
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	672,694.40
RAGB 1.65% 10/21/24	1,090,000.00	1,204,809.70
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,534,624.00
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	661,800.00
RAGB 2.4% 05/23/34	1,320,000.00	1,653,689.40
RAGB 3.15% 06/20/44	980,000.00	1,464,717.80

RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,706,685.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,379,101.20	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,235,800.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	640,000.00	1,201,673.60	
RAGB 3.9% 07/15/20	3,000,000.00	3,158,415.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,040,000.00	3,212,112.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,844,955.20	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	196,093.95	
RFGB 0.375% 09/15/20	1,330,000.00	1,347,223.50	
RFGB 0.5% 04/15/26	950,000.00	988,978.50	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,087,133.25	
RFGB 0.5% 09/15/28	350,000.00	360,260.25	
RFGB 0.5% 09/15/29	430,000.00	439,444.95	
RFGB 0.75% 04/15/31	760,000.00	790,400.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	320,014.50	
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	862,414.25	
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	772,289.20	
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	615,437.55	
RFGB 1.375% 04/15/47	350,000.00	392,864.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	699,702.25	
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	824,577.60	
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,287,066.20	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	891,144.00	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	669,387.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	863,100.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,425,393.30	
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,622,518.00	
SPGB 0.05% 10/31/21	1,700,000.00	1,713,447.00	
SPGB 0.35% 07/30/23	2,280,000.00	2,317,779.60	
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,343,222.00	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,912,928.00	
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,251,964.00	
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,055,755.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,360,915.25	
SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	6,550,097.40	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,100,000.00	3,244,305.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,660,000.00	2,776,481.40	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,750,657.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,243,004.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,210,000.00	3,462,033.15	
SPGB 1.85% 07/30/35	1,210,000.00	1,248,653.45	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,244,277.25	

	SPGB 1.95% 07/30/30	3,270,000.00	3,552,740.55
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,749,546.25
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,750,000.00	3,065,012.50
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,670,000.00	1,863,502.90
	SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,018,948.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,550,000.00	2,974,447.50
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,560,000.00	1,967,355.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,919,155.85
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,900,000.00	4,046,500.50
	SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,087,207.50
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,550,000.00	4,495,418.25
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,430,000.00	5,183,398.85
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,733,993.00
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,252,925.50
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,700,000.00	4,154,476.50
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,127,020.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,493,604.60
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,408,636.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,800,000.00	3,378,396.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,480,000.00	3,878,233.80
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,500,000.00	5,399,205.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,050,000.00	4,725,195.75
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,800,416.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,549,437.75
	ユーロ 小計	820,520,000.00	941,283,750.70 (116,032,047,948)
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,100,000.00	5,059,480.50
	UKT 0.75% 07/22/23	3,930,000.00	3,920,312.55
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	4,985,774.50
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,160,466.40
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,699,528.00
	UKT 1.5% 07/22/47	3,070,000.00	2,961,352.70
	UKT 1.625% 10/22/28	4,650,000.00	4,858,436.25
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,241,724.00
	UKT 1.75% 01/22/49	910,000.00	929,437.60
	UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,658,688.45
	UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,509,973.00
	UKT 1.75% 09/07/37	3,720,000.00	3,823,378.80
	UKT 1% 04/22/24	2,820,000.00	2,839,204.20
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,653,512.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,650,000.00	3,480,973.75
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,417,514.00
	UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,425,618.00

	UKT 2% 09/07/25	1,170,000.00	1,249,911.00
	UKT 3.25% 01/22/44	3,520,000.00	4,650,272.00
	UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	4,649,013.60
	UKT 3.5% 07/22/68	2,610,000.00	4,355,724.60
	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,076,226.40
	UKT 3.75% 09/07/20	3,470,000.00	3,607,915.15
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,033,334.50
	UKT 4.25% 03/07/36	3,180,000.00	4,473,703.50
	UKT 4.25% 06/07/32	2,500,000.00	3,372,962.50
	UKT 4.25% 09/07/39	2,190,000.00	3,202,765.50
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	848,193.20
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,518,117.50
	UKT 4.25% 12/07/46	2,470,000.00	3,882,148.40
	UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,529,960.70
	UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	4,755,626.20
	UKT 4.5% 09/07/34	2,930,000.00	4,159,633.10
	UKT 4.5% 12/07/42	2,800,000.00	4,373,698.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,210,000.00	3,050,496.15
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,923,796.00
	UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,105,373.25
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,128,746.75
	UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,083,687.50
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,806,393.75
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	851,558.70
	イギリスポンド 小計	113,040,000.00	139,314,633.15 (19,898,309,052)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	7,952,582.40
	SGB 0.75% 11/12/29	4,940,000.00	5,217,578.60
	SGB 1.5% 11/13/23	12,450,000.00	13,531,842.75
	SGB 1% 11/12/26	8,660,000.00	9,355,138.20
	SGB 2.5% 05/12/25	9,430,000.00	10,985,619.95
	SGB 3.5% 03/30/39	7,150,000.00	10,890,022.00
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,764,387.85
	SGB 5% 12/01/20	14,100,000.00	15,338,473.50
	スウェーデンクローナ 小計	81,810,000.00	93,035,645.25 (1,058,745,642)
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,260,000.00	5,254,266.60
	NGB 1.75% 02/17/27	5,460,000.00	5,539,470.30
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,896,048.00
	NGB 1.75% 09/06/29	3,170,000.00	3,194,393.15
	NGB 2% 04/26/28	5,730,000.00	5,909,578.20
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,762,358.40

	NGB 3.75% 05/25/21	11,700,000.00	12,271,135.50
	NGB 3% 03/14/24	7,000,000.00	7,518,805.00
ノルウェークローネ 小計		57,560,000.00	59,346,055.15 (743,012,610)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,530,378.00
	DGB 0.5% 11/15/27	14,090,000.00	14,874,742.55
	DGB 1.5% 11/15/23	9,700,000.00	10,583,912.50
	DGB 1.75% 11/15/25	9,410,000.00	10,699,734.60
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,687,449.50
	DGB 4.5% 11/15/39	20,360,000.00	36,939,860.60
デンマーククローネ 小計		73,660,000.00	94,316,077.75 (1,557,158,443)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,106,528.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,770,759.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,680,000.00	5,767,756.00
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,890,000.00	1,910,515.95
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,450,000.00	6,388,725.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,340,000.00	4,257,952.30
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,800,000.00	4,770,480.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,940,000.00	1,913,014.60
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,603,755.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,501,628.00
	POLGB 4% 10/25/23	3,380,000.00	3,644,468.10
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,520,000.00	5,810,848.80
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	753,312.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,037,904.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,261,981.25
	ポーランドズロチ 小計		61,950,000.00
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	5,100,000.00	5,130,778.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,057,092.70
	ACGB 2.25% 11/21/22	770,000.00	795,471.60
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,250,000.00	3,490,353.75
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,744,941.85
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	871,368.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,030,000.00	1,137,974.90
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,246,138.75
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,324,728.75
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,570,000.00	2,818,364.80
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,770,102.40
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,560,000.00	5,025,986.40
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,659,982.40
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,220,000.00	1,438,129.90

	ACGB 3.75% 04/21/37	1,920,000.00	2,403,705.60
	ACGB 3% 03/21/47	2,130,000.00	2,416,623.45
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,230,000.00	4,986,768.15
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,772,462.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,749,321.50
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,645,280.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,273,678.50
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,068,631.40
	オーストラリアドル 小計	71,700,000.00	79,827,885.30 (6,137,167,821)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	246,011.25
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	776,080.50
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	853,897.25
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,600,478.10
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	678,503.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	643,066.20
	SIGB 2.625% 05/01/28	590,000.00	613,157.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,010,000.00	1,034,982.35
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	637,186.40
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,540,000.00	1,588,887.30
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	296,853.20
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	710,062.65
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	410,672.40
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,344.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,141,833.00
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,088,446.80
	SIGB 3.375% 09/01/33	730,000.00	815,778.65
SIGB 3.5% 03/01/27	780,000.00	858,694.20	
SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,102,820.25	
	シンガポールドル 小計	14,970,000.00	15,417,755.00 (1,242,208,520)
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,496,400.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,689,632.00
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,341,524.00
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,706,745.25
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,156,629.75
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,288,820.00
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,110,785.50
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,183,241.80
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	2,901,107.30
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	760,466.25
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,085.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,132,621.60

	MGS 3.9% 11/30/26	1,080,000.00	1,084,935.60	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,727,783.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,081,990.25	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,935,178.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,000,000.00	999,770.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,064,814.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,587,401.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,033,220.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,403,262.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,275,276.80	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,390,000.00	2,500,489.70	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,340,000.00	1,371,175.10	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,860,000.00	1,970,474.70	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	860,560.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,633,080.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,522,260.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	661,290.00	
	マレーシアリングット 小計	52,220,000.00	52,992,020.10 (1,401,638,931)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	31,700,000.00	35,126,770.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,988,398.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,790,553.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,719,902.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	14,100,000.00	14,134,263.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,704,054.35	
	SAGB 8.25% 03/31/32	18,470,000.00	16,922,306.35	
	SAGB 8.5% 01/31/37	24,700,000.00	22,194,185.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,469,152.60	
	SAGB 8.75% 02/28/48	35,250,000.00	31,822,642.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	13,050,000.00	12,270,915.00	
	SAGB 8% 01/31/30	17,400,000.00	16,054,632.00	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,618,200.50	
	南アフリカランド 小計	242,710,000.00	224,815,974.30 (1,724,338,522)	
	合計		302,824,274,311 (302,824,274,311)	

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 193銘柄	100.0%	47.2%
カナダドル	国債証券 29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 297銘柄	100.0%	38.3%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19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 13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

項目	2019年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	478,259,022
コール・ローン	672,699,435
国債証券	45,326,845,993
未収入金	602,859,011
未収利息	902,609,736
前払費用	60,274,896
流動資産合計	48,043,548,093
資産合計	48,043,548,093
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	142,376
未払金	622,074,370
未払解約金	20,424,273

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
未払利息	942
その他未払費用	2,864
流動負債合計	642,644,825
負債合計	642,644,825
純資産の部	
元本等	
元本	28,933,282,533
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,467,620,735
元本等合計	47,400,903,268
純資産合計	47,400,903,268
負債純資産合計	48,043,548,093

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2019年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,933,282,533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) 1.6383円 (16,383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

2019年 5月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

2019年 5月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2019年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</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	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	27,958,931,928円
期中追加設定元本額	2,110,309,120円
期中一部解約元本額	1,135,958,515円
期末元本額	28,933,282,533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	4,161,496,645円
世界経済インデックスファンド	5,320,258,738円
DC 新興国債券インデックス・オープン	4,037,998,361円
DC 世界経済インデックスファンド	4,631,736,978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）	1,864,567,461円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円

区分	2019年 5月10日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	492,238,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	99,209,167円
分散投資コア戦略ファンドA	137,662,484円
分散投資コア戦略ファンドS	437,457,270円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	202,663,239円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,133,884,074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）	200,984,192円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,610,397円
SMT インデックスバランス・オープン	202,309,462円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,433,184,908円
SMT 世界経済インデックス・オープン	67,089,466円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	103,005,964円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	136,817,747円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,750,707円
グローバル経済コア	814,491,123円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	14,922,265円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	1,546,263円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	22,339円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,809円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	25,278円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,454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）	128,128,556円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	605,945,156
合計	605,945,156

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	33,740,528	-	33,598,152	142,376
	マレーシアリンギット	33,740,528	-	33,598,152	142,376
	合計	33,740,528	-	33,598,152	142,376

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,200,000.00	35,624,472.00			
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	89,899,661.25			
		MBONO 5.75% 03/05/26	47,200,000.00	41,533,640.00			
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	78,061,620.00			
		MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	89,160,368.50			
		MBONO 7.25% 12/09/21	40,600,000.00	39,947,558.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	77,800,000.00	74,939,683.00			
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	47,766,168.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	56,619,360.00			
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	22,682,400.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	30,500,000.00	31,125,707.50			
		MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	31,417,134.75			
		MBONO 8% 06/11/20	76,100,000.00	76,136,528.00			
		MBONO 8% 11/07/47	28,500,000.00	26,780,025.00			
		MBONO 8% 12/07/23	63,700,000.00	63,907,025.00			
			メキシコペソ 小計		817,500,000.00	805,601,351.00 (4,608,039,727)	
			ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000.00	14,698,175.52	
				BLTN 0% 07/01/20	37,550,000.00	34,924,902.03	
		BLTN 0% 07/01/21		12,900,000.00	11,090,598.27		
	BLTN 0% 07/01/22	13,250,000.00		10,445,432.12			

	BNTNF 10% 01/01/21	23,800,000.00	24,871,876.98	
	BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000.00	30,405,065.99	
	BNTNF 10% 01/01/25	17,950,000.00	19,162,591.56	
	BNTNF 10% 01/01/27	15,700,000.00	16,798,314.66	
	BNTNF 10% 01/01/29	3,800,000.00	4,087,414.31	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,577,625.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	508,500.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,961,750.00	
ブラジルレアル 小計		175,200,000.00	170,532,246.44	(4,744,207,095)
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	9,530,000,000.00	9,759,911,250.00	
チリペソ 小計		9,530,000,000.00	9,759,911,250.00	(1,565,489,764)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	22,739,948,000.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	9,600,000,000.00	10,020,048,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	52,850,000,000.00	65,300,931,500.00	
コロンビアペソ 小計		86,100,000,000.00	98,060,927,500.00	(3,285,041,071)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,550,000.00	5,894,821.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	5,800,000.00	6,116,332.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,250,000.00	7,611,521.25	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,350,000.00	7,979,343.75	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	5,900,000.00	6,554,811.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,350,000.00	8,264,964.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	7,821,872.50	
ペルーヌエボソル 小計		45,700,000.00	50,243,667.25	(1,665,577,569)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	16,900,000.00	14,345,480.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	18,450,000.00	18,217,068.75	
ウルグアイペソ 小計		35,350,000.00	32,562,549.25	(101,920,779)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,402,040.00	
ドミニカペソ 小計		20,400,000.00	20,402,040.00	(44,272,426)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,194,010.25	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	6,078,039.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	6,170,580.00	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,300,000.00	5,845,876.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	7,533,492.50	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	5,898,013.50	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	6,958,752.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	11,050,000.00	8,019,095.50	

	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	3,529,604.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	3,690,891.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	3,221,970.50	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	6,050,000.00	3,710,132.25	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	3,388,672.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	7,979,578.25	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	7,000,000.00	5,949,440.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,124,855.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	4,327,488.75	
	トルコリラ 小計	127,800,000.00	86,620,491.00 (1,546,175,764)	
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	32,200,000.00	28,552,384.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	22,400,000.00	21,227,696.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	53,900,000.00	48,432,653.50	
	CZGB 1% 06/26/26	34,800,000.00	32,884,782.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	47,200,000.00	49,014,840.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	48,800,000.00	51,501,080.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	35,000,000.00	37,553,425.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	36,500,000.00	37,555,032.50	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	39,891,645.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	38,000,000.00	41,795,440.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	38,800,000.00	46,484,728.00	
	チェココルナ 小計	425,500,000.00	434,893,706.00 (2,083,140,851)	
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	297,000,000.00	295,760,025.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	596,000,000.00	601,992,780.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	354,150,665.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	340,000,000.00	341,254,600.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	361,000,000.00	374,636,775.00	
	HGB 3% 06/26/24	466,000,000.00	488,207,230.00	
	HGB 3% 10/27/27	591,000,000.00	598,585,485.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	597,000,000.00	703,839,120.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	496,000,000.00	586,090,960.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	268,000,000.00	350,497,100.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	263,079,480.00	
HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	558,146,655.00		
	ハンガリーフォリント 小計	5,065,500,000.00	5,516,240,875.00 (2,098,378,028)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,664,912.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000.00	14,180,600.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,476,767.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,500,000.00	6,570,557.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	14,950,000.00	14,807,975.00	

	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000.00	12,901,399.25	
	POLGB 2.75% 04/25/28	8,950,000.00	8,894,957.50	
	POLGB 2% 04/25/21	10,650,000.00	10,721,035.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,253,720.00	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,674,625.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,579,368.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,468,382.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,846,231.25	
ポーランドズロチ 小計		145,500,000.00	149,040,531.00	(4,278,953,645)
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	151,600,000.00	144,262,560.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	71,200,000.00	66,049,392.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	167,900,430.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	159,702,940.50	
	RFLB 7.25% 05/10/34	60,500,000.00	55,696,300.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	171,509,884.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	123,033,825.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	48,350,000.00	48,479,336.25	
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	62,393,750.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	168,128,259.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	161,708,625.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	147,086,730.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	95,174,838.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	104,636,848.00	
	RFLB 7% 12/15/21	151,000,000.00	149,381,280.00	
RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	179,191,760.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	127,471,333.50		
ロシアルーブル 小計		2,169,400,000.00	2,131,808,091.25	(3,581,437,593)
マレーシアリンギット	MGS 3.62% 11/30/21	6,900,000.00	6,942,952.50	
	MGS 3.659% 10/15/20	10,800,000.00	10,862,262.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,161,850.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	8,650,000.00	8,712,020.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,713,620.75	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,300,000.00	2,326,657.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	11,550,000.00	11,572,926.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,086,788.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,315,248.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,689,788.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,153,757.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	6,000,000.00	6,144,780.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	8,500,000.00	9,004,857.50	

マレーシアリングット 小計		106,450,000.00	107,687,509.25 (2,848,334,619)
タイバーツ	THA1GB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	99,654,636.50
	THA1GB 2.125% 12/17/26	98,000,000.00	96,552,540.00
	THA1GB 2.4% 12/17/23	25,800,000.00	26,197,449.00
	THA1GB 2.55% 06/26/20	23,150,000.00	23,354,298.75
	THA1GB 2.875% 12/17/28	47,000,000.00	48,746,520.00
	THA1GB 2% 12/17/22	89,500,000.00	89,681,685.00
	THA1GB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	187,193,419.50
	THA1GB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,352,060.00
	THA1GB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	150,299,087.50
	THA1GB 3.65% 12/17/21	102,100,000.00	106,731,766.50
	THA1GB 3.775% 06/25/32	44,000,000.00	48,775,980.00
	THA1GB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	97,760,270.00
	THA1GB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	114,503,025.00
	タイバーツ 小計		1,110,250,000.00
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	24,212,375.00
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	19,978,200.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	22,436,400.00
フィリピンペソ 小計		65,000,000.00	66,626,975.00 (139,916,647)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,475,884,000.00
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,349,779,500.00
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,656,897,500.00
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,560,580,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	35,300,000,000.00	33,215,888,000.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	29,700,000,000.00	26,186,341,500.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	24,497,315,000.00
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	21,139,092,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	27,100,000,000.00	25,060,725,000.00
	INDOGB 7% 05/15/22	33,700,000,000.00	33,548,350,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	44,300,000,000.00	41,834,926,500.00
	INDOGB 8.125% 05/15/24	17,000,000,000.00	17,416,585,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/29	23,600,000,000.00	23,945,150,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,300,280,000.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	18,654,394,500.00
	INDOGB 8.25% 07/15/21	35,000,000,000.00	35,878,850,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000.00	49,743,846,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	32,110,000,000.00
	INDOGB 8.375% 04/15/39	10,000,000,000.00	9,787,750,000.00
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	46,089,450,000.00
INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	33,677,566,500.00	

	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,342,837,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	34,566,512,500.00	
	インドネシアルピア 小計	605,800,000,000.00	600,039,000,500.00 (4,560,296,403)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000.00	96,349,295.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	25,154,030.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	36,700,000.00	25,916,255.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	16,600,000.00	16,630,876.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	34,900,000.00	34,984,807.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,078,351.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	36,900,000.00	33,807,964.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	42,052,140.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000.00	48,235,065.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	75,450,000.00	68,113,996.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	31,250,000.00	29,384,375.00	
	SAGB 8% 01/31/30	48,100,000.00	44,380,908.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	32,534,950.00	
	南アフリカランド 小計	578,650,000.00	532,623,013.50 (4,085,218,513)	
合計			45,326,845,993 (45,326,845,993)	

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 15銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	3.5%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.2%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	3.7%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
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 17銘柄	100.0%	3.4%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	4.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.4%
ロシアルーブル	国債証券 17銘柄	100.0%	7.9%

マレーシアリングット	国債証券	13銘柄	100.0%	6.3%
タイバーツ	国債証券	13銘柄	100.0%	9.0%
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	23銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	9.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 5月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,701,153,229
投資証券	109,119,225,700
派生商品評価勘定	60,467,920
未収入金	75,882,204
未収配当金	1,033,775,226
差入委託証拠金	52,244,500
流動資産合計	112,042,748,779
資産合計	112,042,748,779
負債の部	
流動負債	
前受金	60,467,920
未払金	199,425,091
未払解約金	96,864,552
未払利息	2,383
その他未払費用	11,678
流動負債合計	356,771,624
負債合計	356,771,624
純資産の部	
元本等	
元本	61,170,885,363
剰余金	
剰余金又は欠損金()	50,515,091,792
元本等合計	111,685,977,155
純資産合計	111,685,977,155
負債純資産合計	112,042,748,779

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,170,885,363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 1.8258円 (1万口当たり純資産額) (18,258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

	2019年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2019年 5月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、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

	2019年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	61,232,689,286円
期中追加設定元本額	5,690,752,249円
期中一部解約元本額	5,752,556,172円
期末元本額	61,170,885,363円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,642,643,398円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,604,878円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,445,312,835円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	29,082,074,438円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,508,123,722円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,323,070,836円
分散投資コア戦略ファンド A	2,165,530,068円
分散投資コア戦略ファンド S	3,457,444,033円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,198,292,826円
S M T インデックスバランス・オープン	32,162,823円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	643,517,264円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,644,544円
グローバル経済コア	341,082,450円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	3,925,129円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	322,760,342円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	27,207,684円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	1,145,312,969円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	1,081,310,588円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	698,589,870円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	1,044,274,666円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		5,665,365,027
合計		5,665,365,027

(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

（2019年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	2,496,120,080	-	2,556,588,000	60,467,920
	合計	2,496,120,080	-	2,556,588,000	60,467,920

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,195	121,770,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,150	126,960,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,867	2,215,791,000	
	MCUBS MidCity投資法人	13,113	1,307,366,100	

森ヒルズリート投資法人	13,346	1,987,219,400	
産業ファンド投資法人	13,557	1,761,054,300	
アドバンス・レジデンス投資法人	11,341	3,515,710,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,193	1,301,933,000	
アクティブア・プロパティーズ投資法人	6,113	2,821,149,500	
G L P 投資法人	28,834	3,529,281,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,826	1,438,630,600	
日本プロロジスリート投資法人	15,609	3,730,551,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,771	947,485,000	
O n e リート投資法人	1,696	467,756,800	
イオンリート投資法人	11,945	1,607,797,000	
ヒューリックリート投資法人	9,407	1,700,785,600	
日本リート投資法人	3,756	1,566,252,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	68,978	1,141,585,900	
日本ヘルスケア投資法人	533	90,716,600	
積水ハウス・リート投資法人	30,023	2,473,895,200	
トーセイ・リート投資法人	2,240	260,064,000	
ケネディクス商業リート投資法人	4,265	1,151,976,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,437	276,112,100	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,329	233,365,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	36,206	5,901,578,000	
いちごホテルリート投資法人	2,035	257,427,500	
ラサールロジポート投資法人	8,779	1,059,625,300	
スターアジア不動産投資法人	3,612	391,902,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,001	112,912,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,824	1,009,580,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,878	162,822,600	
さくら総合リート投資法人	2,518	217,807,000	
投資法人みらい	12,536	609,876,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,730	369,915,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,231	317,844,200	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,165	133,975,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,073	127,472,400	
タカラレーベン不動産投資法人	1,741	161,913,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,800	178,380,000	
日本ビルファンド投資法人	11,268	8,056,620,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,636	7,156,140,000	
日本リテールファンド投資法人	21,993	4,636,124,400	
オリックス不動産投資法人	23,185	4,523,393,500	
日本プライムリアルティ投資法人	7,366	3,296,285,000	
プレミア投資法人	11,063	1,530,012,900	

東急リアル・エステート投資法人	7,802	1,403,579,800
グローバル・ワン不動産投資法人	8,049	1,037,516,100
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,664	4,588,723,200
森トラスト総合リート投資法人	8,317	1,397,256,000
インヴィンシブル投資法人	40,145	2,195,931,500
フロンティア不動産投資法人	3,958	1,818,701,000
平和不動産リート投資法人	7,246	915,169,800
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,603	1,869,577,700
福岡リート投資法人	6,018	1,030,883,400
ケネディクス・オフィス投資法人	3,600	2,696,400,000
いちごオフィスリート投資法人	9,654	982,777,200
大和証券オフィス投資法人	2,686	2,038,674,000
阪急阪神リート投資法人	5,236	779,640,400
スタートアップリート投資法人	1,833	319,308,600
大和ハウスリート投資法人	15,613	3,954,772,900
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,456	3,326,092,800
日本賃貸住宅投資法人	13,088	1,126,876,800
ジャパンエクセレント投資法人	10,420	1,650,528,000
合計	641,552	109,119,225,700

(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

項目	2019年 5月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	341,980,757
コール・ローン	31,818,839
投資証券	75,409,728,991
派生商品評価勘定	1,400
未収入金	5,054,618
未収配当金	126,560,415
流動資産合計	75,915,145,020
資産合計	75,915,145,020
負債の部	

	2019年 5月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	810
未払金	163,408,888
未払解約金	29,318,311
未払利息	44
その他未払費用	545
流動負債合計	192,728,598
負債合計	192,728,598
純資産の部	
元本等	
元本	40,519,425,507
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,202,990,915
元本等合計	75,722,416,422
純資産合計	75,722,416,422
負債純資産合計	75,915,145,020

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

	2019年 5月10日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,519,425,507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 1.8688円 (1万口当たり純資産額) (18,688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

	2019年 5月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

2019年 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年11月13日
期首元本額	41,278,052,911円
期中追加設定元本額	2,064,652,250円
期中一部解約元本額	2,823,279,654円

区分	2019年 5月10日現在
期末元本額	40,519,425,507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）	148,794,905円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,605,026,105円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,443,335円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,729,381,931円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,049,906,580円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,165,062,650円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,617,344,702円
分散投資コア戦略ファンドA	919,276,552円
分散投資コア戦略ファンドS	2,056,372,932円
コア投資戦略ファンド（切替型）	749,327,983円
SMT インデックスバランス・オープン	184,793,300円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	540,404,709円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,577,322円
グローバル経済コア	335,952,258円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,899,350円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	245,867,054円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,714,653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）	533,267,483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）	606,011,703円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 5月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	3,636,145,976	
合計	3,636,145,976	

(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

（2019年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	52,838,500	-	52,839,600	1,100

	カナダドル	9,798,300	-	9,798,000	300
	オーストラリアドル	43,040,200	-	43,041,600	1,400
	売建	37,341,690	-	37,342,200	510
	アメリカドル	37,341,690	-	37,342,200	510
	合計	90,180,190	-	90,181,800	590

(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	1,322,392.90	
		AGREE REALTY CORP	21,490	1,419,414.50	
		ALEXANDER'S INC	2,050	785,068.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	9,143,552.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,370	1,013,584.70	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	80,740	3,707,580.80	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	31,600	319,476.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	143,410	3,390,212.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	106,080	3,260,899.20	
		APARTMENT INVEST & MGMT	88,060	4,351,044.60	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,993	2,014,625.34	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	253,625.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,020	15,886,370.60	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	98,460.00	
		BOSTON PROPERTIES	88,840	11,626,490.80	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	189,225.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	101,518	1,509,572.66	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	169,340	3,053,200.20	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	59,700	1,189,821.00	

BRT APARTMENTS CORP	5,000	70,850.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	55,700	5,561,645.00	
CARETRUST REIT INC	57,290	1,386,418.00	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	124,800.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	161,045.00	
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	475,529.80	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	34,960	1,070,824.80	
CITY OFFICE REIT INC	20,000	236,600.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	95,192.00	
COLONY CAPITAL INC	282,000	1,426,920.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,160	1,563,385.20	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	352,304.00	
CORECIVIC INC	68,050	1,469,199.50	
CORESITE REALTY CORP	20,530	2,321,327.10	
CORPORATE OFFICE PPTYS	60,130	1,659,588.00	
COUSINS PROPERTIES INC	235,500	2,185,440.00	
CUBESMART	109,640	3,561,107.20	
CYRUSONE INC	63,060	3,811,977.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	1,289,076.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	119,170	14,014,392.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	94,950	3,858,768.00	
DUKE REALTY CORP	202,820	6,175,869.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	33,000	591,360.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,750	2,431,432.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	82,810	1,271,961.60	
EPR PROPERTIES	42,030	3,234,628.80	
EQUITY COMMONWEALTH	72,400	2,312,456.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,970	5,897,738.70	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	212,070	15,867,077.40	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28,500	579,975.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	37,970	10,635,017.30	
EXTRA SPACE STORAGE INC	72,480	7,522,699.20	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	122,930.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,270	5,583,993.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,790	2,440,839.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	37,890	1,085,548.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	410,494.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	297,000.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	114,470	4,536,446.10	
GEO GROUP INC/THE	69,850	1,436,116.00	
GETTY REALTY CORP	19,000	613,510.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	325,200.00	

GLADSTONE LAND CORP	5,000	62,100.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	98,040.00	
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	972,087.00	
HCP INC	273,990	8,219,700.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	74,700	2,293,290.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	114,830	3,130,265.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	333,081.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61,520	2,727,181.60	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	92,450	2,394,455.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	421,170	8,006,441.70	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	86,070	2,965,972.20	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	527,500.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	733,910.00	
INFREAREIT INC	23,000	484,840.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,500	437,800.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	381,998.31	
INVITATION HOMES INC	195,990	4,837,033.20	
IRON MOUNTAIN INC	162,310	5,026,740.70	
JBG SMITH PROPERTIES	68,500	2,824,940.00	
KILROY REALTY CORPORATION	57,310	4,385,361.20	
KIMCO REALTY CORP	236,050	4,251,260.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	807,867.40	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	125,366	1,143,337.92	
LIBERTY PROPERTY TRUST	82,810	3,981,504.80	
LIFE STORAGE INC	27,070	2,574,898.40	
LTC PROPERTIES INC	23,290	1,053,872.50	
MACERICH CO/THE	59,540	2,416,728.60	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	1,257,743.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	740,080	625,367.60	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	18,500	202,760.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	219,700	3,866,720.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,170	7,145,890.50	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	773,112.40	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	93,550	4,901,084.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	933,422.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,730	1,873,297.50	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	248,400.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	537,550.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	522,557.70	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	760,233.90	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	117,626	4,299,230.30	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	230,880.00	

PARAMOUNT GROUP INC	121,410	1,738,591.20	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	118,330	3,630,364.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,590	2,271,550.70	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	231,143.10	
PHYSICIANS REALTY TRUST	104,360	1,865,956.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,810	1,401,632.70	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	365,240.00	
PROLOGIS INC	363,000	27,094,320.00	
PS BUSINESS PARKS INC	11,900	1,842,953.00	
PUBLIC STORAGE	86,390	19,255,467.10	
QTS REALTY TRUST INC	33,510	1,471,759.20	
REALTY INCOME CORP	175,060	11,792,041.60	
REGENCY CENTERS CORP	96,960	6,339,244.80	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,140	1,076,064.00	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	114,000	1,422,720.00	
RETAIL VALUE	8,630	281,424.30	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	60,880	2,289,696.80	
RLJ LODGING TRUST	99,770	1,838,761.10	
RPT REALTY	51,580	645,781.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,830	2,414,224.20	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	104,520	2,014,100.40	
SAFEHOLD INC	4,700	127,793.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	362,604.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	143,800	1,190,664.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	15,700	711,367.00	
SIMON PROPERTY GROUP	177,980	30,927,584.60	
SITE CENTERS CORP	84,059	1,144,883.58	
SL GREEN REALTY CORP	48,540	4,082,214.00	
SPIRIT MTA REIT	23,901	164,916.90	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	47,730	1,991,295.60	
STAG INDUSTRIAL INC	74,630	2,176,957.10	
STORE CAPITAL CORP	111,080	3,684,523.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	812,482.70	
SUN COMMUNITIES INC	48,910	5,969,954.60	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	137,090	1,942,565.30	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	1,002,438.90	
TAUBMAN CENTERS INC	34,900	1,744,651.00	
TERRENO REALTY CORP	34,490	1,551,015.30	
TIER REIT INC	31,300	862,628.00	
UDR INC	157,830	6,898,749.30	
UMH PROPERTIES INC	20,000	266,000.00	

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	655,571.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	1,230,158.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	378,180.00	
	VENTAS INC	205,190	12,658,171.10	
	VEREIT INC	567,620	4,665,836.40	
	VICI PROPERTIES INC	205,000	4,524,350.00	
	VORNADO REALTY TRUST	99,150	6,569,679.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	494,675.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	1,296,583.20	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,570	1,919,213.10	
	WELLTOWER INC	222,630	16,937,690.40	
	WHITESTONE REIT	22,610	285,790.40	
	WP CAREY INC	97,520	7,607,535.20	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	1,544,734.80	
	アメリカドル 小計	13,155,728	499,520,248.51 (54,877,294,501)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	28,790	1,398,906.10	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	463,721.40	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	546,652.80	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	43,270	2,092,537.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	83,590	1,120,941.90	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	611,620.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	319,914.21	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	31,000	431,520.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	59,940	837,961.20	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	388,024.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	435,494.80	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,600	766,710.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	83,630	1,927,671.50	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	26,000	356,720.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	478,635.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	88,320.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	141,309.90	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	445,750.30	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	33,000	379,500.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	88,380	2,285,506.80	
	SLATE OFFICE REI	17,000	102,170.00	

	SLATE RETAIL REIT	10,300	126,278.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,810	1,294,701.60
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,000	243,800.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	99,300.00
	カナダドル 小計	830,540	17,383,666.71 (1,419,724,060)
ユーロ	AEDIFICA	13,866	1,139,785.20
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	95,240	1,330,502.80
	ALTAREA	2,000	370,400.00
	BEFIMMO S.C.A.	11,960	605,176.00
	COFINIMMO	12,400	1,413,600.00
	COVIVIO(FP)	36,260	3,480,960.00
	EUROCOMMERCIAL	21,040	531,470.40
	GECINA SA	31,170	4,136,259.00
	GREEN REIT PLC	377,170	646,469.38
	HAMBORNER REIT AG	44,000	397,804.00
	HIBERNIA REIT PLC	402,550	558,739.40
	ICADE	25,220	1,878,890.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	220,986.60
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	151,460	1,460,831.70
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	348,920.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	225,021	358,683.47
	KLEPIERRE	118,660	3,668,967.20
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	325,671.84
	MERCIALYS	34,020	391,230.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,470	2,548,213.50
	MONTEA	5,900	447,810.00
	NSI NV	11,700	415,935.00
	RETAIL ESTATES	4,200	349,020.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	79,310	11,626,846.00
	VASTNED RETAIL	8,500	259,675.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	10,350	1,391,040.00
	WERELDHAVE NV	24,970	559,328.00
	ユーロ 小計	2,052,919	40,863,214.49 (5,037,208,450)
イギリスポンド	ASSURA PLC	1,400,150	844,290.45
	BIG YELLOW GROUP PLC	85,070	883,026.60
	BRITISH LAND CO PLC	546,190	3,189,749.60
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	62,350.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	368,000	321,264.00
	DERWENT LONDON PLC	62,900	2,044,250.00

	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	360,000	331,200.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	153,000	1,152,090.00	
	HAMMERSON PLC	431,120	1,277,839.68	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	243,811.50	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	502,021.12	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	428,830	3,914,360.24	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	418,110	848,763.30	
	LXI REIT PLC	195,817	260,044.97	
	NEWRIVER REIT PL	173,000	403,955.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	320,000	297,600.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	653,700	861,576.60	
	RDI REIT PLC	154,400	191,147.20	
	REGIONAL REIT LTD	170,000	183,940.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	793,600.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	145,000.00	
	SEGRE PLC	631,010	4,285,819.92	
	SHAFTESBURY PLC	132,430	1,158,762.50	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	212,121.70	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	996,780	1,462,276.26	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	434,000	387,996.00	
	UNITE GROUP PLC	146,020	1,376,968.60	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,420	703,198.20	
	イギリスポンド 小計	10,005,773	28,339,023.44 (4,047,662,717)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	204,440	742,117.20	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	213,750.00	
	ARENA REIT	141,000	384,930.00	
	BWP TRUST	298,560	1,062,873.60	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	130,800	483,960.00	
	CHARTER HALL GROUP	271,600	2,737,728.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	119,700	536,256.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	856,091.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	987,623	1,165,395.14	
	DEXUS	622,590	7,832,182.20	
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	381,045.00	
	GOODMAN GROUP	919,750	12,057,922.50	
	GPT GROUP	1,012,900	5,773,530.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	142,860	598,583.40	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	252,720.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	124,000	375,720.00	
	MIRVAC GROUP	2,094,360	5,968,926.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	319,199	549,022.28	
	RURAL FUNDS GROUP	189,816	419,493.36	

	SCENTRE GROUP	3,056,490	11,278,448.10	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	514,230	1,270,148.10	
	STOCKLAND	1,381,680	5,250,384.00	
	VICINITY CENTERS	1,890,120	4,725,300.00	
	VIVA ENERGY REIT	290,000	707,600.00	
	オーストラリアドル 小計	15,343,598	65,624,125.88 (5,045,182,797)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	655,875.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	630,000	1,089,900.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,197,300.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	615,000	971,700.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	228,000	467,400.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	397,415.20	
	ニュージーランドドル 小計	2,935,460	4,779,590.20 (346,281,309)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,133,000	7,500,460.00	
	FORTUNE REIT	758,000	7,761,920.00	
	LINK REIT	1,204,500	111,476,475.00	
	PROSPERITY REIT	782,000	2,604,060.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	3,669,720.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	740,000	3,848,000.00	
	香港ドル 小計	5,253,500	136,860,635.00 (1,916,048,890)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	340,000	472,600.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	400,200.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,436,566	4,194,772.72	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	822,290.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	711,000	529,695.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,554,528	2,938,057.92	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,573,900	3,871,794.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	287,460	425,440.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	724,114.00	
	ESR REIT	1,130,579	593,553.97	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	309,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	331,240.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	355,800	853,920.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	529,200.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	326,600.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	977,820	1,114,714.80	
	KEPPEL DC REIT	519,460	794,773.80	

	KEPPEL REIT	1,074,800	1,322,004.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	200,340.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,135,830	2,180,793.60	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	714,860	1,486,908.80	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,387,152	2,039,113.44	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,251,800	1,664,894.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	680,000	476,000.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	712,500.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	196,201.40	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	192,720.00	
	SPH REIT	322,300	335,192.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	536,788.00	
	SUNTEC REIT	1,339,800	2,411,640.00	
	シンガポールドル 小計	22,725,995	32,987,662.25 (2,657,815,947)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	110,075,000.00	
	韓国ウォン 小計	17,500	110,075,000.00 (10,269,997)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	104,000	1,698,320.00	
	イスラエルシェケル 小計	104,000	1,698,320.00 (52,240,323)	
	合計	72,425,013	75,409,728,991 (75,409,728,991)	

(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%	72.8%
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%	6.7%
イギリスポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 24銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.5%

シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
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】

(2019年 5月31日現在)

資産総額	24,452,468円
負債総額	76,274円
純資産総額（ - ）	24,376,194円
発行済口数	23,499,030口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0373円
（1万口当たり純資産額）	（10,373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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	269,614,960,598円
負債総額	1,399,006,075円
純資産総額（ - ）	268,215,954,523円
発行済口数	192,800,544,058口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3912円
（1万口当たり純資産額）	（13,912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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	344,391,027,920円
負債総額	543,891,192円
純資産総額（ - ）	343,847,136,728円
発行済口数	138,416,919,859口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4841円
（1万口当たり純資産額）	（24,841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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	51,997,002,820円
負債総額	363,367,150円
純資産総額（ - ）	51,633,635,670円
発行済口数	19,499,293,444口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6480円
（1万口当たり純資産額）	（26,480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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	472,911,074,460円
負債総額	9,541,550,367円
純資産総額（ - ）	463,369,524,093円
発行済口数	325,838,234,156口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4221円
（1万口当たり純資産額）	（14,221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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	312,292,418,838円
負債総額	138,744,639円
純資産総額（ - ）	312,153,674,199円
発行済口数	113,915,596,028口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7402円
（1万口当たり純資産額）	（27,402円）

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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	47,652,308,267円
負債総額	10,642,992円
純資産総額（ - ）	47,641,665,275円
発行済口数	29,192,756,111口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6320円
（1万口当たり純資産額）	（16,320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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	113,701,856,176円
負債総額	726,746,891円
純資産総額（ - ）	112,975,109,285円
発行済口数	60,822,140,685口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8575円
（1万口当たり純資産額）	（18,575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

(2019年 5月31日現在)

資産総額	75,772,747,310円
負債総額	162,747,250円
純資産総額（ - ）	75,610,000,060円
発行済口数	40,717,282,049口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8570円
（1万口当たり純資産額）	（18,570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（2019年 5月31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年間に於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 8月 9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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。

2019年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	521	12,071,956
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	91	390,117
単位型公社債投資信託	0	0
合計	612	12,462,072

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
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	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411
負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240
営業利益	5,516,262	8,554,888

(単位:千円)

前事業年度

当事業年度

（自 2017年4月1日
至 2018年3月31日）（自 2018年4月1日
至 2019年3月31日）

営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本	
	利益剰余金	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		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
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) 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. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 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、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。

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

5．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。

6．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計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)

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、当事業年度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、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期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)

「『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）を当事業年度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。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017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
----	-----------	----------------	------------	-----------------	-----	-------

2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日
----------------------	------	--------	-----------	--------	------------	------------

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
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

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

2019年6月27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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28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、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しているほか、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ております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため有価証券及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの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極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、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極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の

「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

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

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

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、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、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。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

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（2018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) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

（*）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（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-

(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

(*1) 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。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

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、及び(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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(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	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019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、「(4)有価証券及び投資有価証券 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(2018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	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度(2019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	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（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

当事業年度（2019年3月31日）

（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	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

（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。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018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

当事業年度(2019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
1,538,203	46,789	34,437

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
	香港ドル	560	-	4	4
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
--------------	------------------	---------	--------------	------------------------	------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式		
	米ドル			
	英ポンド	2,575,513	-	50,256
	カナダドル	40,963	-	566
	スイスフラン	34,448	-	132
	香港ドル	566,113	-	2,528
	人民元	1,725,146	-	9,137
	ユーロ	262,583	-	6,080
	買建			
	ユーロ	6,313	-	86
	合計	8,643,951	-	82,081

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(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15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	"
有価証券評価差額	-	"	173,602	"
繰延ヘッジ損益	-	"	58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

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

企業結合日

2018年10月1日

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

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）

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)実施した会計処理の概要

「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しております。

（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]

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

[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。

(持分法損益等)

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

重要性が乏しいため、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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(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 2017年4月1日 至 2018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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	-	-

(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

運用受託報酬

各運用受託案件について、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。

投信販売代行手数料等

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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

(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（2018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（2019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 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日	当事業年度 (自 2018年4月1日
--	-----------------------	-----------------------

	至 2018年3月31日)	至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は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。

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年 8月 9日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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（2019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） （2019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	11,944	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(2019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

2019年6月5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 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

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2019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7月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2018年11月13日から2019年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2019年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。