

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年11月20日提出
【計算期間】	第1期(自 2017年11月30日至 2018年8月20日)
【ファンド名】	グローバル経済コア
【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3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0522
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり (部分 ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回	(日本を 含む)	ファンド・ オブ・ファ ンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	年4回	日本			その他 ( )	ロング・ ショート型/絶 対収益追求型
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)	北米				その他 ( )
不動産投信	年12回 (毎月)	欧州				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信、その他 資産(商品)) 資産配分変更 型))	日々	アジア				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型	その他 ( )	オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) 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。

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## 〔投資対象資産による属性区分〕

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## 〔決算頻度による属性区分〕

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## 〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

# 1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界\*の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。  
※REITは新興国を含みません。  
※コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。
- 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。

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。詳しくは後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)マザーファンドの概要」をご覧ください。

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、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。  
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的な指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



## ? ファミリーファンド方式とは

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

## ? DR(預託証券)とは

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

## 2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

### 基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) <sup>*1, *2</sup>	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 <sup>*2</sup>
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 <sup>*3</sup>
		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	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	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	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0%~20.0%）の通り。 <sup>*4</sup>

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャルペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンド受益証券へ資金を配分し、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。



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更する場合があります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

#### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### 主な投資制限

- 株式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。

- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### （2）【ファンドの沿革】

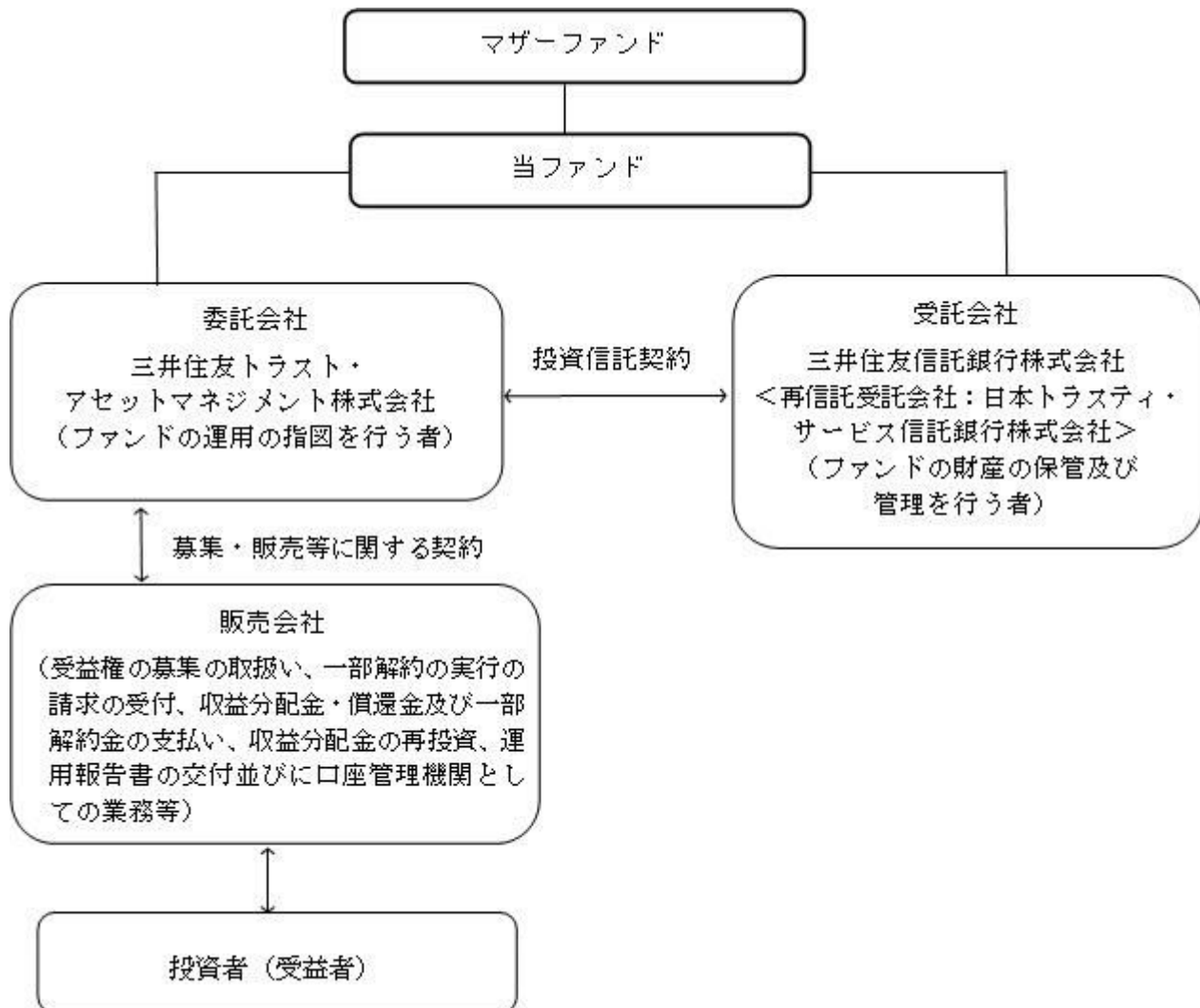
2017年11月30日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始



## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2018年10月1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」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「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」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

#### 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、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 （変動幅） <sup>1 2</sup>	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 <sup>2</sup>
< 株式 > 37.5% (35.0 ~ 40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 <sup>3</sup>
	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	
< 債券 > 37.5% (35.0 ~ 40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	5%
	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	
< REIT > 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
< 金 > 15.0% (10.0 ~ 20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0 ~ 20.0%）の通り。 <sup>4</sup>

1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

- 2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。
  - 3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。
  - 4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。
- ハ。「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、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。
- ニ. 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。)
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証券
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. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第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）<sup>1</sup>と連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行うことができます。

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「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<sup>2</sup>と連動する投資成果を

目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

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

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

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

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

## 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

※2 「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。

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）<sup>3</sup> に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

とします。

## (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「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）<sup>4</sup>と連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

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

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

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

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

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

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

## 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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



## 「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）<sup>5</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

※5 「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。

## 「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）<sup>6</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

## 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

※6 「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)」とは、新興国の現地通貨建て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。

## 「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）<sup>7</sup>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、並びに東証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。

※7 「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。

### 「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)<sup>8</sup>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。

※8 「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「SPDJII」)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SPDJIIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJII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、SPDJII、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。

## 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、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。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

< 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2018年9月28日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

## (2)投資態度

主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）<sup>9</sup>（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。

投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。

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

## 3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、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（上場投資信託証券を除きます。）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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

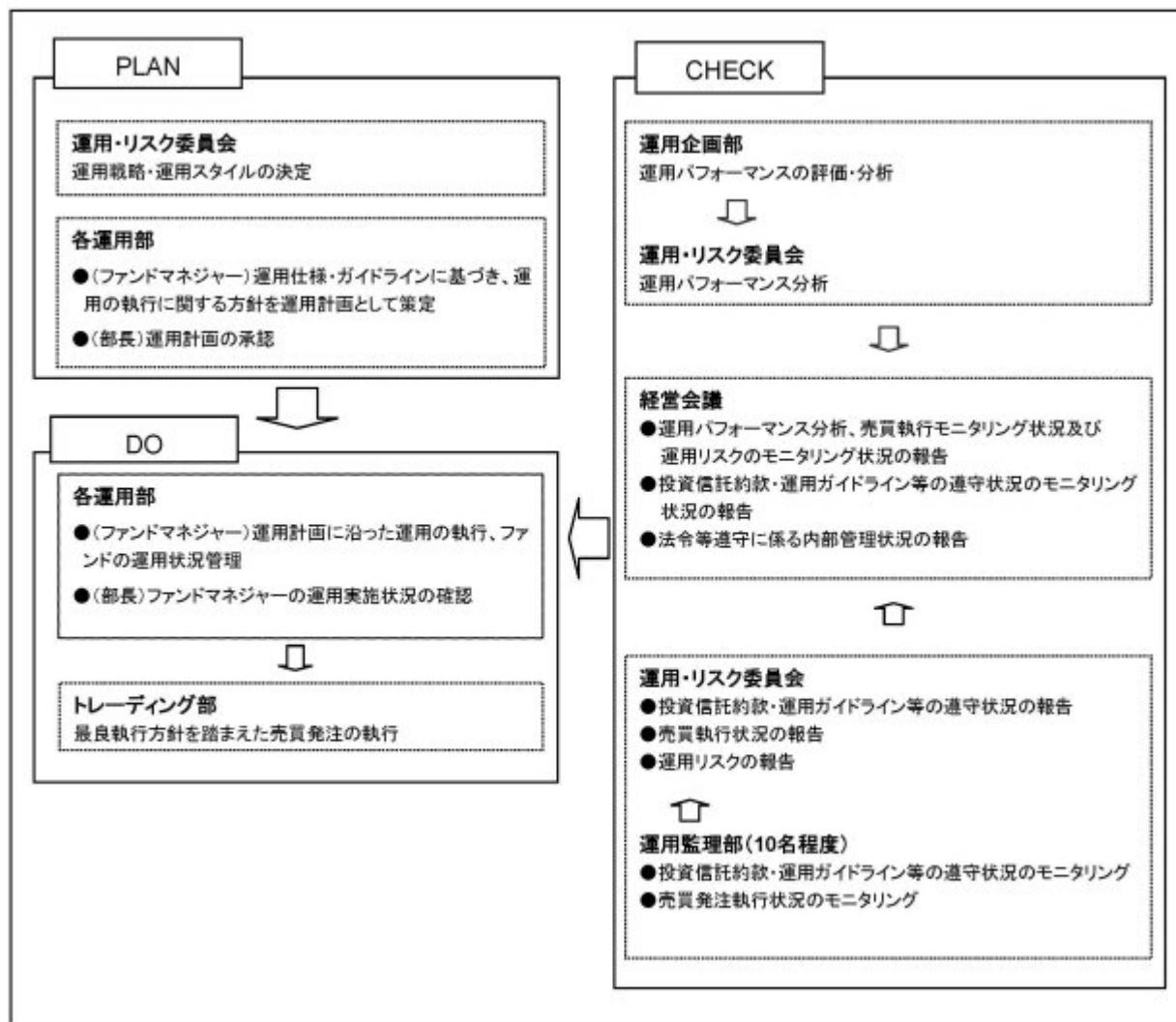
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、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。

※9 金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)とはLBMA金価格(円ヘッジベース)です(2018年9月28日現在)。LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

## (3)【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

## <約款に定める投資制限>

### イ．株式への投資割合

株式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には制限を設けません。

## 二．投資する株式等の範囲

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

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

## ホ．信用取引の指図範囲

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

（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効率的な運用に資するため、並びに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有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに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効率的な運用に資するため、並びに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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (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。
- (二) 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。
- フ．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。
- フ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲
- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに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)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、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にする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (二) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の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。
- (二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- コ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、

原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

なお、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」における外貨建資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

##### 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。

##### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価

格が下落した場合は、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。

#### 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>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

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

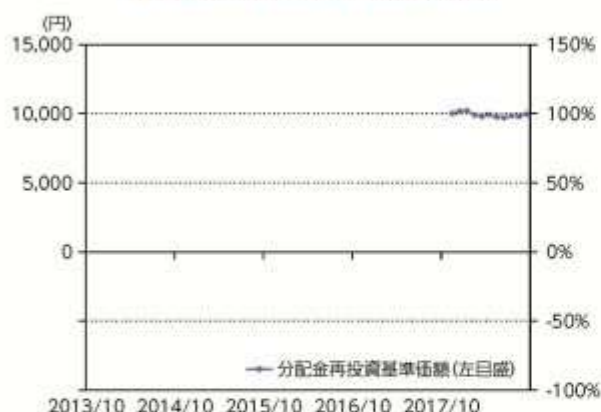
### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・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



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

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

### 当ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



\*2013年10月～2018年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの指数

日本株・・・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

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

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

日本国債・・・ NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （ 2 ）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

## （ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.918%（税抜 0.85%）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 0.432% （税抜 0.4%）	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 0.432% （税抜 0.4%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （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ず（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）」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。

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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、2018年 9月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2018年 9月28日現在の状況について記載してあります。

## 【グローバル経済コア】

## (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	13,319,220,629	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		122,213,566	0.91
合計(純資産総額)		13,441,434,195	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,287,442,681	2.5426	3,273,451,761	2.6710	3,438,759,400	25.58
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	1,183,151,823	2.6789	3,169,545,419	2.7552	3,259,819,902	24.25
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	956,137,277	1.5613	1,492,817,131	1.6288	1,557,356,396	11.59
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	523,147,715	2.7270	1,426,623,819	2.8744	1,503,735,791	11.19
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,462,555,415	0.8937	1,307,085,775	0.8915	1,303,868,152	9.70
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	401,229,953	1.6468	660,745,487	1.6773	672,983,000	5.01
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	370,021,965	1.8099	669,702,755	1.7963	664,670,455	4.94
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	314,696,150	1.5225	479,124,889	1.6488	518,871,012	3.86
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	289,076,276	1.3849	400,341,735	1.3808	399,156,521	2.97

(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	99.09
合計	99.09

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



## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
	2017年11月末日	386,431,667		10,000	
	12月末日	5,683,657,185		10,180	
	2018年 1月末日	10,247,532,926		10,213	
	2月末日	12,270,333,150		9,901	
	3月末日	13,425,095,835		9,781	
	4月末日	14,012,661,709		9,916	
	5月末日	13,722,454,062		9,768	
	6月末日	13,581,474,010		9,699	
	7月末日	13,856,061,471		9,857	
	8月末日	13,685,739,522		9,779	
	9月末日	13,441,434,195		9,953	

## 【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11月30日～2018年 8月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## （４）【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

（参考）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	228,305,025,190	98.13
新株予約権証券	日本	1,726,400	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,352,722,390	1.87
合計(純資産総額)		232,659,473,980	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	4,107,550,000	1.77

(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	1,070,400	6,984.54	7,476,251,616	7,095.00	7,594,488,000	3.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	391,100	7,832.58	3,063,322,038	11,470.00	4,485,917,000	1.93

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,047,800	681.34	4,120,608,052	709.10	4,288,494,980	1.84
日本	株式	ソニー	電気機器	590,100	5,227.51	3,084,753,651	6,966.00	4,110,636,600	1.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	620,000	5,123.00	3,176,260,000	5,132.00	3,181,840,000	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	650,200	4,533.55	2,947,714,210	4,586.00	2,981,817,200	1.28
日本	株式	キーエンス	電気機器	43,200	65,956.80	2,849,333,760	65,980.00	2,850,336,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	792,300	3,512.34	2,782,826,982	3,439.00	2,724,719,700	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	649,100	2,998.38	1,946,248,458	3,792.00	2,461,387,200	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	761,400	2,951.31	2,247,127,434	3,139.00	2,390,034,600	1.03
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,800,000	193.17	2,279,406,000	198.20	2,338,760,000	1.01
日本	株式	任天堂	その他製品	54,200	41,878.38	2,269,808,196	41,460.00	2,247,132,000	0.97
日本	株式	三菱商事	卸売業	608,500	3,040.51	1,850,150,335	3,501.00	2,130,358,500	0.92
日本	株式	花王	化学	216,500	8,427.42	1,824,536,430	9,174.00	1,986,171,000	0.85
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	620,400	2,819.25	1,749,062,700	3,055.00	1,895,322,000	0.81
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	78,800	22,591.78	1,780,232,264	23,660.00	1,864,408,000	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	327,200	5,276.06	1,726,326,832	5,637.00	1,844,426,400	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	363,500	4,871.83	1,770,910,205	5,060.00	1,839,310,000	0.79
日本	株式	ダイキン工業	機械	120,200	12,744.59	1,531,899,718	15,125.00	1,818,025,000	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	83,700	23,535.78	1,969,944,786	21,420.00	1,792,854,000	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	106,000	17,036.62	1,805,881,720	16,345.00	1,732,570,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	865,900	1,687.98	1,461,621,882	1,982.00	1,716,213,800	0.74
日本	株式	キヤノン	電気機器	474,100	3,740.23	1,773,243,043	3,610.00	1,711,501,000	0.74
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	156,600	10,712.01	1,677,500,766	10,555.00	1,652,913,000	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	422,900	4,042.45	1,709,552,105	3,860.00	1,632,394,000	0.70
日本	株式	村田製作所	電気機器	92,400	16,341.32	1,509,937,968	17,465.00	1,613,766,000	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	324,400	4,480.37	1,453,432,028	4,861.00	1,576,908,400	0.68
日本	株式	資生堂	化学	175,000	8,319.66	1,455,940,500	8,799.00	1,539,825,000	0.66
日本	株式	信越化学工業	化学	152,000	10,979.58	1,668,896,160	10,065.00	1,529,880,000	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	510,300	2,944.79	1,502,726,337	2,966.00	1,513,549,800	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。

#### 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	0.33
		建設業	2.78
		食料品	3.94
		繊維製品	0.60
		パルプ・紙	0.29

化学	7.39
医薬品	5.03
石油・石炭製品	0.87
ゴム製品	0.72
ガラス・土石製品	0.95
鉄鋼	1.06
非鉄金属	0.80
金属製品	0.59
機械	5.13
電気機器	13.01
輸送用機器	8.31
精密機器	1.75
その他製品	2.10
電気・ガス業	1.71
陸運業	4.21
海運業	0.20
空運業	0.55
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.91
卸売業	4.82
小売業	4.83
銀行業	6.63
証券、商品先物取引業	0.91
保険業	2.36
その他金融業	1.16
不動産業	2.25
サービス業	4.65
小計	98.13
新株予約権証券	0.00
合計	98.13

(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	226	円	4,050,674,660	4,107,550,000	1.77

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	342,794,870,850	82.90
地方債証券	日本	23,134,011,442	5.59
特殊債証券	日本	29,472,089,606	7.13
社債券	日本	14,832,621,070	3.59
	フランス	1,096,864,000	0.27
	オーストラリア	600,667,000	0.15
	オランダ	200,750,000	0.05
	アメリカ	106,960,000	0.03
	イギリス	100,428,000	0.02
	スウェーデン	100,180,000	0.02
	小計		17,038,470,070
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,050,781,551	0.25
合計(純資産総額)		413,490,223,519	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	150,090,000	0.04

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	8,360,000,000	101.04	8,447,373,200	100.80	8,427,381,600	0.100	2023/3/20	2.04
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	100.86	5,951,004,000	100.82	5,948,852,000	0.100	2023/6/20	1.44
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.84	5,586,591,400	100.67	5,577,561,200	0.100	2022/3/20	1.35
日本	国債証券	第390回利付国債(2年)	5,290,000,000	100.40	5,311,373,600	100.38	5,310,366,500	0.100	2020/7/1	1.28
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	4,820,000,000	100.66	4,852,163,100	99.90	4,815,469,200	0.100	2028/3/20	1.16
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.65	4,811,342,700	100.50	4,804,186,800	0.100	2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.73	4,774,886,400	0.100	2022/9/20	1.15
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	4,220,000,000	103.49	4,367,486,200	103.10	4,351,157,600	0.500	2024/9/20	1.05
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	100.87	4,035,056,800	100.70	4,028,320,000	0.100	2022/6/20	0.97
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	102.91	3,921,023,400	1.200	2020/12/20	0.95
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	103.26	3,861,924,000	102.65	3,839,184,800	0.400	2025/6/20	0.93
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.42	3,625,306,400	0.100	2020/9/20	0.88
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	3,540,000,000	102.25	3,619,995,000	101.96	3,609,384,000	0.300	2024/12/20	0.87
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.85	3,562,192,200	103.37	3,545,728,200	0.600	2023/12/20	0.86
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.37	3,533,164,800	100.27	3,529,644,800	0.100	2019/12/20	0.85
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	100.88	3,429,920,000	100.25	3,408,568,000	0.100	2027/3/20	0.82
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	100.76	3,224,448,000	100.58	3,218,560,000	0.100	2021/9/20	0.78
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	100.00	3,210,000,000	0.100	2027/12/20	0.78
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	100.76	3,194,155,400	0.100	2022/12/20	0.77
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	102.65	3,213,009,500	102.01	3,193,163,400	0.300	2025/12/20	0.77
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	3,060,000,000	104.08	3,185,081,200	103.54	3,168,385,200	1.200	2021/6/20	0.77
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	100.46	3,164,521,500	0.100	2026/6/20	0.77
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	103.33	3,172,507,300	102.71	3,153,381,200	0.400	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.32	3,150,142,200	0.100	2020/3/20	0.76
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,050,000,000	100.78	3,073,842,400	100.39	3,062,078,000	0.100	2026/9/20	0.74
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	2,920,000,000	104.04	3,037,968,000	103.53	3,023,222,000	1.000	2021/12/20	0.73
日本	国債証券	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	100.44	3,003,283,500	100.32	2,999,568,000	0.100	2020/3/15	0.73
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.61	2,978,233,600	100.46	2,973,823,200	0.100	2020/12/20	0.72
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	101.05	2,940,793,600	100.52	2,925,161,100	0.100	2026/3/20	0.71
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	103.60	2,890,663,200	0.600	2024/6/20	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	82.90
地方債証券	5.59
特殊債券	7.13
社債券	4.12
合計	99.75

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		150,190,324	150,090,000	0.04

(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	222,240,609,194	60.83
	イギリス	22,400,238,873	6.13
	フランス	13,388,177,373	3.66
	カナダ	12,911,161,421	3.53
	ドイツ	12,613,440,194	3.45
	スイス	12,009,318,935	3.29
	オーストラリア	7,952,397,914	2.18
	オランダ	6,227,696,875	1.70
	アイルランド	5,097,544,201	1.40
	スペイン	3,959,133,829	1.08
	スウェーデン	3,611,140,915	0.99
	香港	3,132,908,262	0.86
	イタリア	2,552,856,841	0.70

	デンマーク	2,197,420,340	0.60
	シンガポール	1,589,071,093	0.43
	ジャージー	1,586,985,370	0.43
	フィンランド	1,451,391,640	0.40
	バミューダ	1,440,428,289	0.39
	ベルギー	1,359,423,374	0.37
	ノルウェー	1,038,547,477	0.28
	ケイマン	834,770,169	0.23
	キュラソー	780,747,237	0.21
	イスラエル	727,337,115	0.20
	ルクセンブルク	480,831,691	0.13
	オーストリア	310,069,812	0.08
	ニュージーランド	299,726,467	0.08
	パナマ	254,275,421	0.07
	ポルトガル	207,223,721	0.06
	リベリア	203,927,223	0.06
	英ヴァージン諸島	91,089,343	0.02
	パプアニューギニア	87,964,636	0.02
	マン島	59,653,361	0.02
	モーリシャス	8,521,391	0.00
	小計	343,106,029,997	93.91
投資信託受益証券	オーストラリア	194,170,084	0.05
	香港	66,857,978	0.02
	小計	261,028,062	0.07
投資証券	アメリカ	6,009,298,400	1.64
	オーストラリア	575,715,658	0.16
	フランス	461,890,778	0.13
	イギリス	269,887,578	0.07
	香港	199,783,141	0.05
	シンガポール	142,208,747	0.04
	カナダ	64,410,929	0.02
	小計	7,723,195,231	2.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,251,823,962	3.90
合計(純資産総額)		365,342,077,252	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	9,484,133,029	2.60



買建	カナダ	620,274,438	0.17
買建	ドイツ	2,497,249,914	0.68
買建	イギリス	1,149,536,052	0.31
買建	オーストラリア	618,491,597	0.17

(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		651,907,300	0.18

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	398,252	21,415.89	8,528,922,976	25,547.57	10,174,371,445	2.78
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	591,521	11,171.39	6,608,112,758	12,993.54	7,685,953,963	2.10
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	33,277	182,905.00	6,086,529,862	228,614.13	7,607,592,690	2.08
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	193,825	21,015.32	4,073,295,767	19,175.15	3,716,625,154	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	12,567.65	3,480,888,873	13,006.03	3,602,307,914	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,480	122,178.10	3,113,098,080	135,675.26	3,457,005,747	0.95
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	217,581	13,792.72	3,001,034,045	15,697.64	3,415,509,384	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	342,921	8,942.94	3,066,725,231	9,740.89	3,340,358,792	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,157	123,144.51	2,974,802,010	137,119.87	3,312,404,825	0.91
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	787,725	3,425.27	2,698,171,756	3,400.28	2,678,490,132	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	103,404	22,044.07	2,279,445,408	24,610.61	2,544,836,447	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,964	14,909.02	2,176,181,533	17,037.77	2,486,901,265	0.68

アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	483,121	4,052.53	1,957,862,593	4,985.72	2,408,707,481	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	252,246	8,921.77	2,250,481,344	9,441.71	2,381,634,287	0.65
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,518	27,814.34	2,183,926,507	30,056.30	2,359,960,603	0.65
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	378,753	6,233.63	2,361,008,318	5,998.76	2,272,051,149	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	587,152	3,615.73	2,122,986,133	3,795.50	2,228,540,935	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	94,571	21,220.13	2,006,809,694	23,490.81	2,221,550,225	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	154,681	13,881.62	2,147,223,396	13,908.91	2,151,445,330	0.59
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	390,187	4,913.03	1,917,003,636	5,488.83	2,141,673,272	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	334,367	5,509.09	1,842,058,873	6,086.21	2,035,029,886	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	378,881	6,295.97	2,385,424,609	5,210.59	1,974,194,156	0.54
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	8,439.38	1,711,558,259	9,410.41	1,908,487,651	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	21,711.17	1,631,095,587	25,247.74	1,896,787,466	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	40,895.42	1,850,027,068	41,724.48	1,887,532,130	0.52
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	180,510	8,802.49	1,588,938,821	9,806.64	1,770,197,236	0.48
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	218,364	6,710.85	1,465,408,333	8,031.67	1,753,827,675	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	208,262	7,772.73	1,618,764,462	8,284.93	1,725,436,404	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	328,376	4,816.34	1,581,572,884	5,225.35	1,715,881,403	0.47
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,634,371	1,088.18	1,778,496,776	1,012.97	1,655,576,310	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.77
		素材	4.37
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	1.03
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	1.20
		耐久消費財・アパレル	1.77

	消費者サービス	1.72
	メディア	1.93
	小売	4.95
	食品・生活必需品小売り	1.46
	食品・飲料・タバコ	4.45
	家庭用品・パーソナル用品	1.78
	ヘルスケア機器・サービス	4.79
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.04
	銀行	8.33
	各種金融	4.21
	保険	3.65
	不動産	0.56
	ソフトウェア・サービス	11.57
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.54
	電気通信サービス	2.23
	公益事業	2.81
	半導体・半導体製造装置	2.80
	小計	93.91
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.11
合計		96.10

(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	572	アメリカドル	82,895,796.5	9,414,475,608	83,509,140	9,484,133,029	2.60
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	37	カナダドル	7,034,604.5	613,065,782	7,117,320	620,274,438	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	67	スイスフラン	5,962,169	692,923,280	6,094,990	708,359,737	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	394	ユーロ	13,166,033	1,739,759,600	13,537,840	1,788,890,177	0.49
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	49	オーストラリアドル	7,548,168	617,666,587	7,558,250	618,491,597	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	103	イギリスポンド	7,486,666.25	1,111,994,538	7,739,420	1,149,536,052	0.31

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,160,000.00	583,796,800	585,842,300	0.16
	ユーロ	買建	500,000.00	66,305,000	66,065,000	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。

## 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	115,416,153,265	43.74
	フランス	26,918,585,563	10.20
	イタリア	24,088,365,075	9.13
	ドイツ	18,137,625,138	6.87
	イギリス	17,129,586,245	6.49
	スペイン	15,289,995,868	5.79
	ベルギー	6,611,286,772	2.51
	オーストラリア	5,443,178,434	2.06
	オランダ	5,375,086,665	2.04
	カナダ	5,321,797,930	2.02
	オーストリア	3,934,687,239	1.49
	メキシコ	2,236,393,272	0.85
	アイルランド	2,076,516,830	0.79
	ポーランド	1,629,738,804	0.62
	デンマーク	1,578,860,917	0.60
	フィンランド	1,562,153,020	0.59
	南アフリカ	1,446,148,639	0.55
	マレーシア	1,239,679,019	0.47
	シンガポール	1,042,289,514	0.39
	スウェーデン	990,366,385	0.38
ノルウェー	615,614,036	0.23	
	小計	258,084,108,630	97.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,811,096,760	2.20

合計(純資産総額)	263,895,205,390	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,132,202,422	0.43
	買建	ドイツ	1,432,258,192	0.54

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		3,553,586,400	1.35

(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	10,823.35	1,894,086,809	10,769.93	1,884,737,886	1.750	2023/5/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/24	15,750,000	11,003.45	1,733,044,413	10,879.72	1,713,556,387	2.125	2024/2/29	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.125% 09/30/21	15,300,000	10,792.95	1,651,321,463	10,781.86	1,649,624,970	1.125	2021/9/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,111.27	1,668,361,195	9,939.76	1,640,060,657	2.500	2046/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,951.48	1,604,392,240	10,894.77	1,596,084,867	1.875	2022/10/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,326.33	1,580,023,886	11,302.06	1,576,638,756	2.500	2020/5/31	0.60
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	14,241.19	1,566,530,932	14,041.26	1,544,538,872	3.500	2020/4/25	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	11,165.49	1,395,687,255	11,121.38	1,390,173,233	1.875	2020/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,049.45	1,381,181,782	10,984.84	1,373,105,649	2.375	2024/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	10,177.06	1,343,372,691	10,142.07	1,338,753,276	1.500	2026/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,697.89	1,315,840,628	10,643.15	1,309,107,963	2.000	2025/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,723.39	1,302,892,478	10,653.69	1,294,424,363	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,828.63	1,299,436,789	10,755.85	1,290,702,779	2.125	2025/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,855.53	1,297,236,306	10,786.42	1,288,977,217	2.375	2027/5/15	0.49

アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,665.03	1,294,819,011	11,553.04	1,282,387,565	3.625	2021/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,375.18	1,251,270,869	11,304.54	1,243,500,147	2.625	2020/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,952.02	1,226,626,678	10,907.01	1,221,585,551	1.750	2022/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,911.32	1,189,334,248	10,723.27	1,168,837,331	2.875	2045/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	11,243.18	1,169,290,986	11,078.07	1,152,120,063	2.750	2028/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	10,650,000	10,718.95	1,141,568,214	10,634.13	1,132,534,845	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,821.36	1,136,242,971	10,771.14	1,130,970,351	2.000	2024/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,563.47	1,138,053,520	9,405.12	1,119,210,171	2.250	2046/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	11,110.11	1,111,011,518	11,085.00	1,108,500,905	1.500	2020/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,945.22	1,110,939,962	10,885.53	1,104,881,956	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,902.23	1,106,576,707	10,850.26	1,101,302,101	1.750	2022/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,832.34	1,083,234,896	10,806.07	1,080,607,193	1.250	2021/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	11,137.96	1,071,472,039	11,137.04	1,071,383,959	1.250	2020/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,851.24	1,063,422,462	10,832.35	1,061,570,799	1.125	2021/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,962.58	1,046,927,205	10,917.95	1,042,664,286	1.750	2022/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,943.52	1,045,106,562	10,895.71	1,040,540,760	1.750	2022/5/31	0.39

(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	97.80
合計	97.80

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	41	アメリカ ドル	4,627,382.79	525,531,863	4,609,297.08	523,477,869	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカ ドル	2,985,146.89	339,023,133	2,968,750	337,160,938	0.13
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	17	アメリカ ドル	2,412,661.75	274,005,995	2,391,156.25	271,563,615	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,124,871	280,780,454	2,122,585	280,478,382	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	22	ユーロ	2,882,338	380,872,143	2,868,140	378,996,019	0.14
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	37	ユーロ	5,898,198	779,387,884	5,848,220	772,783,791	0.29

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	15,770,000.00	1,762,399,481	1,788,318,000	0.68
	カナダドル	買建	1,720,000.00	147,537,558	149,726,000	0.06
	ユーロ	買建	10,420,000.00	1,361,606,432	1,376,586,200	0.52
	イギリスポンド	買建	1,610,000.00	235,720,492	238,956,200	0.09

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

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

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	7,935,322,563	15.18
	韓国	7,550,611,533	14.44
	台湾	6,146,925,775	11.76
	中国	5,472,258,570	10.47
	インド	4,405,999,326	8.43
	ブラジル	3,054,590,619	5.84
	南アフリカ	2,948,105,255	5.64
	香港	1,891,420,537	3.62
	ロシア	1,820,192,734	3.48
	メキシコ	1,533,869,975	2.93
	タイ	1,232,044,155	2.36
	マレーシア	1,221,297,895	2.34
	インドネシア	982,899,955	1.88
	ポーランド	613,949,553	1.17
	チリ	546,025,885	1.04
	バミューダ	504,732,735	0.97
	フィリピン	484,433,963	0.93
	カタール	466,125,324	0.89
	アラブ首長国連邦	336,854,956	0.64
	トルコ	294,090,880	0.56
コロンビア	225,644,723	0.43	

	アメリカ	158,752,044	0.30
	ギリシャ	156,076,890	0.30
	ハンガリー	150,918,273	0.29
	チェコ	92,226,091	0.18
	エジプト	67,059,428	0.13
	ルクセンブルク	36,684,398	0.07
	パキスタン	34,734,362	0.07
	マン島	32,743,787	0.06
	ペルー	25,610,898	0.05
	シンガポール	7,638,784	0.01
	小計	50,429,841,866	96.44
投資信託受益証券	ブラジル	71,860,321	0.14
投資証券	南アフリカ	145,452,508	0.28
	メキシコ	45,897,815	0.09
	トルコ	4,614,132	0.01
	小計	195,964,455	0.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,591,329,100	3.04
合計(純資産総額)		52,288,995,742	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,601,974,127	3.06

(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		247,514,400	0.47

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄



## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	492,400	5,705.89	2,809,584,931	4,728.06	2,328,097,729	4.45
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,146,389	895.99	1,923,151,336	983.14	2,110,222,345	4.04
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	414,971	5,672.30	2,353,841,372	4,859.25	2,016,447,832	3.86
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	99,804	21,119.25	2,107,786,173	18,888.96	1,885,194,003	3.61
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	38,108	28,511.37	1,086,511,375	24,756.28	943,412,532	1.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,422,620	103.10	868,396,739	98.65	830,964,740	1.59
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	24,165	27,421.28	662,635,417	26,174.47	632,506,258	1.21
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	528,000	1,153.93	609,276,817	1,104.28	583,059,840	1.12
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	446,500	1,086.42	485,087,388	1,145.69	511,550,808	0.98
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	250,229	1,459.12	365,116,043	1,980.92	495,684,882	0.95
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,981,515	92.12	551,018,358	82.82	495,395,054	0.95
ブラジル	株式	VALE SA	素材	267,478	987.53	264,144,582	1,682.09	449,923,246	0.86
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	1,395,311	389.67	543,723,605	291.97	407,398,720	0.78
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	51,320	8,451.54	433,733,512	7,672.50	393,752,700	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	140,211	2,763.55	387,481,091	2,731.81	383,031,214	0.73
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	56.33	417,324,040	50.70	375,667,600	0.72
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	271,721	1,191.76	323,828,681	1,258.74	342,026,852	0.65
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	296,602	768.56	227,957,969	1,145.18	339,663,865	0.65
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,538,000	163.07	250,815,157	217.07	333,866,272	0.64
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	225,496	1,828.86	412,401,306	1,436.09	323,833,148	0.62
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	37,814	6,551.15	247,725,225	8,501.85	321,488,964	0.61
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	76,736	4,615.86	354,202,795	3,928.32	301,443,564	0.58
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	81,948	2,231.57	182,873,494	3,458.38	283,407,570	0.54
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	487,161	508.42	247,684,348	557.85	271,765,609	0.52
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,812,440	100.47	282,570,023	92.41	259,903,205	0.50
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,175,400	87.29	189,898,758	111.73	243,069,842	0.46
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	273,361	861.60	235,529,884	826.34	225,889,566	0.43
南アフリカ	株式	SASOL LTD	素材	48,270	3,496.67	168,784,570	4,441.05	214,369,715	0.41

ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	406,600	581.90	236,602,794	522.61	212,495,015	0.41
韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,864	19,080.62	130,969,439	30,792.29	211,358,347	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.88
		素材	7.45
		資本財	3.55
		商業・専門サービス	0.15
		運輸	1.50
		自動車・自動車部品	2.62
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	1.12
		メディア	2.18
		小売	1.74
		食品・生活必需品小売り	1.67
		食品・飲料・タバコ	3.38
		家庭用品・パーソナル用品	1.20
		ヘルスケア機器・サービス	0.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.30
		銀行	16.30
		各種金融	2.49
		保険	3.57
		不動産	2.39
		ソフトウェア・サービス	12.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.80		
電気通信サービス	4.43		
公益事業	2.38		
半導体・半導体製造装置	5.74		
		小計	96.44
投資信託受益証券			0.14
投資証券			0.37
合計			96.96

(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	267	アメリカドル	13,781,524	1,565,167,680	14,105,610	1,601,974,127	3.06

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,180,000.00	246,170,400	247,514,400	0.47

(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	4,737,936,578	10.20
	メキシコ	4,582,653,934	9.87
	ポーランド	4,366,856,754	9.40
	インドネシア	4,185,411,435	9.01
	南アフリカ	4,020,310,924	8.65
	タイ	3,854,755,114	8.30
	ロシア	3,500,044,035	7.53
	コロンビア	3,372,393,172	7.26
	マレーシア	2,640,720,379	5.68
	チェコ	2,181,171,685	4.70
	ハンガリー	2,141,956,749	4.61
	トルコ	1,906,308,394	4.10
	ペルー	1,417,889,916	3.05
	チリ	1,236,687,260	2.66
	フィリピン	131,698,822	0.28

	ウルグアイ	103,939,391	0.22
	ドミニカ共和国	45,969,488	0.10
	小計	44,426,704,030	95.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,025,463,042	4.36
合計(純資産総額)		46,452,167,072	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		13,204,476	0.03
	売建		13,192,468	0.03

(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	39,600,000,000	4.79	1,898,717,774	4.70	1,861,497,792	9.850	2027/6/28	4.01
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	6,970,000,000	18.06	1,259,339,239	17.74	1,236,687,260	5.500	2020/8/5	2.66
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,367.19	888,881,129	2,440.25	916,317,093	0.000	2020/7/1	1.97
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.62	857,878,353	3.59	849,662,434	4.375	2023/3/21	1.83
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000	2,855.08	738,040,674	2,764.42	714,603,225	10.000	2023/1/1	1.54
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	76,250,000	877.90	669,399,977	873.69	666,195,305	10.500	2026/12/21	1.43
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	16,600,000,000	4.02	668,859,944	3.98	661,232,946	7.750	2021/4/14	1.42
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	161,500,000	368.48	595,105,804	358.68	579,279,343	3.400	2036/6/17	1.25
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/20	21,600,000	2,461.05	531,587,855	2,501.38	540,299,943	0.000	2020/4/1	1.16
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	140,900,000	381.29	537,239,442	373.40	526,126,701	3.650	2031/6/20	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	699.32	540,925,657	670.10	518,326,047	10.000	2024/12/5	1.12
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	88,000,000	590.89	519,989,080	586.21	515,866,736	6.500	2021/6/10	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000	614.96	522,720,846	606.47	515,507,507	8.000	2020/6/11	1.11
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	18,550,000	2,383.91	442,216,371	2,561.68	475,192,983	0.000	2020/1/1	1.02

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	63,300,000	724.63	458,692,234	717.40	454,114,934	8.750	2044/1/31	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	75,600,000	587.14	443,880,914	580.40	438,785,983	6.500	2022/6/9	0.94
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000	2,924.47	425,511,355	2,964.48	431,332,400	2.500	2026/7/25	0.93
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	2,898.29	428,948,233	2,863.37	423,780,226	10.000	2021/1/1	0.91
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	55,200,000,000	0.83	458,620,708	0.76	423,438,317	8.375	2024/3/15	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000	728.14	427,054,876	716.11	420,003,664	8.750	2048/2/28	0.90
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	15,450,000	2,788.94	430,892,092	2,686.23	415,023,588	10.000	2025/1/1	0.89
ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000	3,082.74	411,546,259	3,096.56	413,391,157	1.500	2020/4/25	0.89
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000	3,050.15	407,196,259	3,088.03	412,252,839	1.750	2021/7/25	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	432.29	410,684,546	412.90	392,258,909	4.875	2029/6/22	0.84
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	14,900,000	2,748.84	409,578,274	2,621.36	390,583,434	10.000	2027/1/1	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 2% 12/17/22	112,000,000	352.48	394,788,010	347.52	389,230,078	2.000	2022/12/17	0.84
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000	2,906.41	382,194,084	2,930.42	385,350,674	2.500	2027/7/25	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	110,000,000	343.46	377,812,607	337.63	371,403,104	2.125	2026/12/17	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000	376.96	380,730,501	367.68	371,358,088	3.650	2021/12/17	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	62,700,000	610.00	382,472,163	588.50	368,992,246	7.500	2027/6/3	0.79

(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	95.64
合計	95.64

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	116,298.01	13,115,768	13,204,476	0.03
	ロシアルーブル	売建	7,670,040.00	13,115,768	13,192,468	0.03

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

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

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	105,241,341,670	97.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,624,669,941	2.43
合計(純資産総額)		107,866,011,611	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	2,615,160,000	2.42

(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	11,825	550,465.42	6,509,253,603	657,000	7,769,025,000	7.20
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,211	529,277.03	6,463,001,854	596,000	7,277,756,000	6.75
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,194	140,478.82	5,084,490,584	155,200	5,617,308,800	5.21
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,933	161,788.46	4,357,448,829	178,300	4,802,153,900	4.45
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,079	200,219.09	4,620,856,466	206,100	4,756,581,900	4.41
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	24,331	156,565.21	3,809,388,150	177,400	4,316,319,400	4.00
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,289	258,422.82	3,951,026,541	259,900	3,973,611,100	3.68
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,380	231,764.9	3,796,309,091	224,900	3,683,862,000	3.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,901	267,119.51	3,178,989,374	290,200	3,453,670,200	3.20
日本	投資証券	G L P 投資法人	30,258	112,764.09	3,412,016,058	110,500	3,343,509,000	3.10
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,730	365,721.11	2,827,024,188	405,000	3,130,650,000	2.90
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,358	76,046.81	2,688,863,146	82,700	2,924,106,600	2.71
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,852	454,362.83	2,658,931,329	492,000	2,879,184,000	2.67

日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,778	609,205.93	2,301,580,041	725,000	2,739,050,000	2.54
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,507	65,344.69	2,058,815,174	71,900	2,265,353,300	2.10
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,058	446,360.69	1,811,331,698	506,000	2,053,348,000	1.90
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	42,733	47,461.26	2,028,162,172	47,500	2,029,817,500	1.88
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,005	133,052.51	1,863,400,450	144,400	2,022,322,000	1.87
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,819	570,989.25	1,609,618,703	685,000	1,931,015,000	1.79
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,154	440,823.66	1,831,181,518	442,500	1,838,145,000	1.70
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,057	206,580.51	1,664,419,199	223,500	1,800,739,500	1.67
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,935	132,701.69	1,451,092,996	150,600	1,646,811,000	1.53
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,227	116,996.29	1,664,506,265	114,600	1,630,414,200	1.51
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,535	114,687.45	1,437,607,203	122,100	1,530,523,500	1.42
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,807	159,827.44	1,407,600,345	165,200	1,454,916,400	1.35
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,942	326,915.62	1,288,701,394	367,500	1,448,685,000	1.34
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,727	159,708	1,393,771,801	162,000	1,413,774,000	1.31
日本	投資証券	プレミア投資法人	11,610	101,801.41	1,181,914,453	119,400	1,386,234,000	1.29
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	8,187	134,587.9	1,101,871,173	156,900	1,284,540,300	1.19
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,244	148,760.19	1,077,618,823	173,900	1,259,731,600	1.17

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	97.57
合計	97.57

(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	1,480円		2,564,692,000	2,615,160,000	2.42

(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	50,503,574,206	71.10
	オーストラリア	4,885,454,510	6.88
	イギリス	3,779,662,747	5.32
	フランス	3,576,478,260	5.03
	シンガポール	2,550,319,805	3.59
	香港	1,537,679,242	2.16
	カナダ	1,337,183,843	1.88
	ベルギー	561,347,898	0.79
	スペイン	559,324,987	0.79
	ニュージーランド	301,873,101	0.42
	オランダ	273,834,912	0.39
	ドイツ	202,972,326	0.29
	アイルランド	189,559,246	0.27
	ガーンジー	92,564,193	0.13
	イタリア	84,697,684	0.12
	イスラエル	38,765,282	0.05
	マン島	37,954,168	0.05
	小計	70,513,246,410	99.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		521,518,902	0.73
合計(純資産総額)		71,034,765,312	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		245,494,200	0.35

(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	172,630	18,438.62	3,183,059,125	19,928.12	3,440,192,719	4.84
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	351,741	7,383.39	2,597,042,232	7,547.86	2,654,892,598	3.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	83,180	23,834.58	1,982,560,574	22,656.07	1,884,532,676	2.65
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	76,900	26,255.50	2,019,048,186	23,283.06	1,790,467,929	2.52
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,830	20,956.42	1,610,082,010	20,184.79	1,550,797,884	2.18
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	204,500	7,799.02	1,594,900,949	7,376.37	1,508,467,972	2.12
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	206,760	7,563.12	1,563,752,381	7,160.58	1,480,523,278	2.08
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	114,500	13,669.21	1,565,125,646	12,674.41	1,451,220,174	2.04
香港	投資証券	LINK REIT	1,183,500	1,011.07	1,196,610,844	1,112.99	1,317,233,133	1.85
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	198,090	7,136.51	1,413,672,817	6,128.23	1,213,942,507	1.71
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	85,970	14,284.81	1,228,065,340	13,710.17	1,178,663,349	1.66
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	162,940	6,348.04	1,034,349,950	6,373.54	1,038,505,976	1.46
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	37,110	28,778.23	1,067,960,315	27,471.44	1,019,465,409	1.44
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	408,980	2,283.49	933,902,835	2,405.41	983,765,645	1.38
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,986,590	336.45	1,004,848,066	327.32	977,570,639	1.38
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	59,540	14,292.86	850,997,225	13,938.44	829,895,081	1.17
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	95,600	8,468.22	809,562,023	8,171.36	781,182,159	1.10
アメリカ	投資証券	HCP INC	259,660	3,012.16	782,138,786	2,913.07	756,407,886	1.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	886,000	721.77	639,492,684	851.03	754,014,352	1.06
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	62,930	11,802.58	742,736,799	11,233.20	706,905,824	1.00
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	95,610	7,427.29	710,123,849	7,207.15	689,075,822	0.97
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	69,750	9,804.65	683,874,415	9,713.64	677,526,537	0.95
アメリカ	投資証券	UDR INC	148,130	4,476.95	663,171,519	4,529.17	670,906,189	0.94
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,640	4,452.20	719,653,841	3,871.60	625,805,634	0.88
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	197,760	3,247.53	642,233,466	3,147.02	622,355,605	0.88
フランス	投資証券	GECINA SA	30,220	18,635.59	563,167,784	19,384.93	585,812,826	0.82
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	40,580	14,743.79	598,303,239	14,106.52	572,442,975	0.81
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	416,870	1,405.06	585,729,617	1,318.05	549,457,679	0.77
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	49,030	11,223.04	550,265,688	10,945.87	536,676,330	0.76
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	51,470	10,548.46	542,929,301	10,389.38	534,741,574	0.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.27
合計	99.27

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,620,000.00	183,479,200	183,924,200	0.26
	カナダドル	買建	150,000.00	13,063,200	13,068,000	0.02
	ユーロ	買建	100,000.00	13,261,000	13,213,000	0.02
	イギリスポンド	買建	70,000.00	10,391,080	10,395,000	0.01
	シンガポールドル	買建	300,000.00	24,882,600	24,894,000	0.04

(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。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	16,611,393,277	102.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		433,594,937	2.68
合計(純資産総額)		16,177,798,340	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		62,447,000	0.39
	売建		16,761,175,719	103.61

(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	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	12,875,500	1,366.71	17,597,196,777	1,290.15	16,611,393,277	102.68

(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。

#### □ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	102.68
合計	102.68

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの


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	550,000.00	62,420,325	62,447,000	0.39
	アメリカドル	売建	147,675,557.00	16,354,868,231	16,761,175,719	103.61

(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11月30日  
 作成基準日：2018年9月28日

**基準価額・純資産の推移**


基準価額	9,953円
純資産総額	134.41億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**分配の推移(1万口当たり、税引前)**

設定来分配金合計額:0円

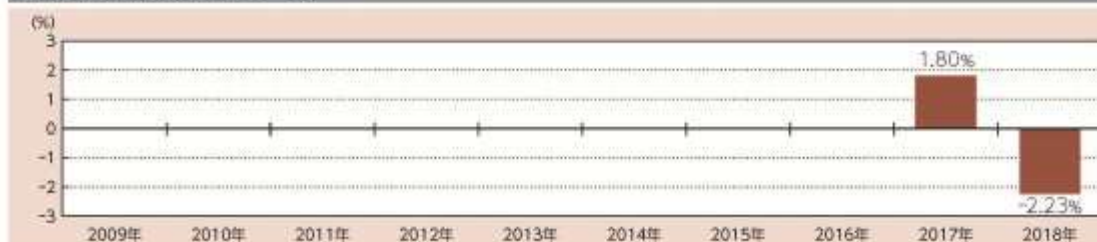
決算期	2018年8月				
分配金	0円	-	-	-	-

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	25.6%	APPLE INC.	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP.	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
外国債券インデックス マザーファンド	24.3%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.2%
		T 2.125% 02/29/24	アメリカ	国債	-	2.125%	2024/02/29	0.2%
新興国債券インデックス マザーファンド	11.6%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	11.2%	TENCENT HOLDINGS LTD.	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC.	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.5%
ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	9.7%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	10.0%
		-	-	-	-	-	-	-
J-REITインデックス マザーファンド	5.0%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.4%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.9%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%
		PROLOGIS INC.	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%
国内株式インデックス マザーファンド	3.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.1%
国内債券インデックス マザーファンド	3.0%	第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.1%
		第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**


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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口座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】

2017年11月30日（設定日）から2027年 8月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4) 【計算期間】



原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8月20日までとします。

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

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れ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場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

## < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金(解約)手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2017年11月30日から2018年8月20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】

## 【グローバル経済コア】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

		第1期 ( 2018年 8月20日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		212,814,175
親投資信託受益証券		13,507,669,384
未収入金		28,091,481
流動資産合計		13,748,575,040
資産合計		13,748,575,040
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		76,129,192
未払受託者報酬		1,697,234
未払委託者報酬		27,155,654
未払利息		543
その他未払費用		169,720
流動負債合計		105,152,343
負債合計		105,152,343
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		14,165,027,817
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		521,605,120
( 分配準備積立金 )		138,554,922
元本等合計		13,643,422,697
純資産合計		13,643,422,697
負債純資産合計		13,748,575,040

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日
営業収益	
受取利息	29
有価証券売買等損益	577,316,250
営業収益合計	577,316,221
営業費用	
支払利息	87,056
受託者報酬	4,440,238
委託者報酬	71,043,695
その他費用	449,273
営業費用合計	76,020,262
営業利益又は営業損失（ ）	653,336,483
経常利益又は経常損失（ ）	653,336,483
当期純利益又は当期純損失（ ）	653,336,483
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（ ）	52,375,515
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	109,660,076
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	109,660,076
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,304,228
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,304,228
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	521,605,120

## (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8月21日から翌年8月20日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2017年11月30日から2018年8月20日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年 8月20日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		14,165,027,817口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	521,605,120円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9632円 (9,632円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	138,554,922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	20,165,811円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	158,720,733円
当ファンドの期末残存口数	F	14,165,027,817口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	112円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2018年 8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第1期
	自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	386,432,484円
期中追加設定元本額	16,923,630,441円
期中一部解約元本額	3,145,035,108円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年 8月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	530,020,874
合計	530,020,874

## （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	435,153,156	716,653,732	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	416,806,502	754,461,449	
	新興国株式インデックス マザーファンド	535,754,745	1,460,145,982	
	国内株式インデックス マザーファンド	330,776,352	503,640,073	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,282,438,959	3,257,523,199	
	国内債券インデックス マザーファンド	305,026,963	422,462,343	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,112,847,235	2,977,645,346	
	新興国債券インデックス マザーファンド	958,468,838	1,494,732,152	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,148,825,230	1,920,405,108	
合計		7,526,097,980	13,507,669,384	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,496,937,778
株式	210,178,197,380
派生商品評価勘定	689,060
未収配当金	273,658,712
前払金	47,593,700
差入委託証拠金	60,028,600
流動資産合計	214,057,105,230

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産合計	214,057,105,230
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,317,320
未払金	1,501,978,000
未払解約金	64,533,087
未払利息	8,931
その他未払費用	252
流動負債合計	1,614,837,590
負債合計	1,614,837,590
純資産の部	
元本等	
元本	139,526,478,825
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,915,788,815
元本等合計	212,442,267,640
純資産合計	212,442,267,640
負債純資産合計	214,057,105,230

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 8月20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）

	2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		139,526,478,825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)	1.5226円 (15,226円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 8月20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

2018年 8月20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>「(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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	117,090,707,859円
期中追加設定元本額	31,325,995,160円
期中一部解約元本額	8,890,224,194円
期末元本額	139,526,478,825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）	648,004,879円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,583,443,198円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,705,078円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,513,991,403円
世界経済インデックスファンド	1,778,327,580円

区分	2018年 8月20日現在
日本株式インデックス・オープン	5,891,836,288円
DCマイセレクション25	5,654,354,801円
DCマイセレクション50	16,890,034,600円
DCマイセレクション75	16,084,766,353円
DC日本株式インデックス・オープン	5,249,705,680円
DCマイセレクションS25	2,246,009,817円
DCマイセレクションS50	6,725,372,457円
DCマイセレクションS75	4,584,857,728円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,501,645,835円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	374,185,450円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	562,844,798円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	355,375,555円
DC世界経済インデックスファンド	1,427,774,436円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	448,676,838円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	23,535,709円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	51,480,485円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,621,993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)	350,218,593円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,604,013円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	126,688,249円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	456,497,823円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	71,701,884円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	646,041,237円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,883,681,374円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	754,432,955円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,350,125,443円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	656,964,867円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	58,475,463円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	836,181,357円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	537,631,429円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	483,871,126円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	620,926,607円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	57,000,234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)	940,458,824円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,553,486,368円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	175,844,006円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	196,534,690円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,908,127円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,651,775円
SMT インデックスバランス・オープン	73,492,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン	4,396,225円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	44,332,255円

区分	2018年 8月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	6,636,362円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	897,780円
グローバル経済コア	330,776,352円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,135,367円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	42,889,489円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	150,691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)	31,542,297,520円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,373,358,965
合計	8,373,358,965

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2018年 8月20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	2,275,128,260	-	2,227,500,000	47,628,260
	合計	2,275,128,260	-	2,227,500,000	47,628,260

## (注)1.時価の算定方法

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

## 2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,800	3,255.00	12,369,000	



日本水産	109,800	600.00	65,880,000
マルハニチロ	18,500	3,850.00	71,225,000
カネコ種苗	3,300	1,490.00	4,917,000
サカタのタネ	14,400	3,560.00	51,264,000
ホクト	9,900	1,905.00	18,859,500
ホクリヨウ	1,600	774.00	1,238,400
住石ホールディングス	24,900	136.00	3,386,400
日鉄鉱業	2,700	5,100.00	13,770,000
三井松島産業	4,900	1,797.00	8,805,300
国際石油開発帝石	474,200	1,202.50	570,225,500
石油資源開発	15,400	2,340.00	36,036,000
K&Oエナジーグループ	5,700	1,722.00	9,815,400
ヒノキヤグループ	2,500	2,692.00	6,730,000
ショーボンドホールディングス	9,200	7,460.00	68,632,000
ミライト・ホールディングス	30,000	1,637.00	49,110,000
タマホーム	7,300	1,017.00	7,424,100
サンヨーホームズ	1,500	948.00	1,422,000
日本アクア	2,800	356.00	996,800
ファーストコーポレーション	3,200	1,074.00	3,436,800
ベステラ	1,800	1,256.00	2,260,800
TATERU	14,000	1,720.00	24,080,000
ダイセキ環境ソリューション	2,200	906.00	1,993,200
第一カッター興業	1,300	2,049.00	2,663,700
安藤・間	78,600	782.00	61,465,200
東急建設	37,500	990.00	37,125,000
コムシスホールディングス	34,300	2,917.00	100,053,100
ミサワホーム	8,100	855.00	6,925,500
ピーアールホールディングス	9,700	415.00	4,025,500
高松コンストラクショングループ	6,300	2,944.00	18,547,200
東建コーポレーション	3,600	7,740.00	27,864,000
ソネック	1,200	853.00	1,023,600
ヤマウラ	4,500	872.00	3,924,000
大成建設	97,100	5,130.00	498,123,000
大林組	292,500	1,029.00	300,982,500
清水建設	298,400	981.00	292,730,400
飛島建設	88,400	194.00	17,149,600
長谷工コーポレーション	113,800	1,437.00	163,530,600
松井建設	10,800	852.00	9,201,600
銭高組	1,400	5,140.00	7,196,000
鹿島建設	429,000	808.00	346,632,000
不動テトラ	74,100	210.00	15,561,000
大末建設	3,200	1,293.00	4,137,600

鉄建建設	5,900	2,768.00	16,331,200
西松建設	22,600	2,701.00	61,042,600
三井住友建設	68,700	723.00	49,670,100
大豊建設	35,000	568.00	19,880,000
前田建設工業	69,600	1,260.00	87,696,000
佐田建設	6,200	422.00	2,616,400
ナカノフドー建設	7,400	685.00	5,069,000
奥村組	16,100	3,335.00	53,693,500
東鉄工業	11,700	2,941.00	34,409,700
イチケン	1,800	2,161.00	3,889,800
富士ピー・エス	2,600	589.00	1,531,400
浅沼組	35,000	320.00	11,200,000
戸田建設	113,400	771.00	87,431,400
熊谷組	15,300	3,155.00	48,271,500
青木あすなろ建設	6,500	908.00	5,902,000
北野建設	20,000	408.00	8,160,000
植木組	1,200	2,573.00	3,087,600
三井ホーム	12,000	980.00	11,760,000
矢作建設工業	13,200	833.00	10,995,600
ピーエス三菱	11,700	500.00	5,850,000
日本ハウスホールディングス	18,600	574.00	10,676,400
大東建託	34,700	16,710.00	579,837,000
新日本建設	11,600	1,142.00	13,247,200
N I P P O	22,600	1,995.00	45,087,000
東亜道路工業	2,000	3,550.00	7,100,000
前田道路	30,500	2,050.00	62,525,000
日本道路	2,600	6,130.00	15,938,000
東亜建設工業	7,300	2,850.00	20,805,000
若築建設	5,300	1,566.00	8,299,800
東洋建設	30,400	412.00	12,524,800
五洋建設	115,900	645.00	74,755,500
世紀東急工業	13,100	688.00	9,012,800
福田組	3,200	5,710.00	18,272,000
住友林業	62,400	1,750.00	109,200,000
日本基礎技術	10,600	388.00	4,112,800
日成ビルド工業	14,500	1,009.00	14,630,500
巴コーポレーション	12,200	459.00	5,599,800
大和ハウス工業	288,100	3,467.00	998,842,700
ライト工業	18,700	1,340.00	25,058,000
積水ハウス	317,300	1,826.50	579,548,450
日特建設	8,200	668.00	5,477,600
北陸電気工事	5,300	959.00	5,082,700

ユアテック	13,600	870.00	11,832,000
西部電気工業	1,600	3,730.00	5,968,000
四電工	1,500	2,604.00	3,906,000
中電工	12,600	2,577.00	32,470,200
関電工	38,800	1,107.00	42,951,600
きんでん	64,800	1,745.00	113,076,000
東京エネシス	11,000	1,033.00	11,363,000
トーエネック	2,700	3,030.00	8,181,000
住友電設	7,700	1,772.00	13,644,400
日本電設工業	15,000	2,083.00	31,245,000
協和エクシオ	35,000	2,917.00	102,095,000
新日本空調	7,600	1,577.00	11,985,200
N D S	1,500	5,990.00	8,985,000
九電工	19,200	4,030.00	77,376,000
三機工業	20,600	1,180.00	24,308,000
日揮	84,000	2,128.00	178,752,000
中外炉工業	3,000	2,829.00	8,487,000
ヤマト	8,100	637.00	5,159,700
太平電業	6,600	2,655.00	17,523,000
高砂熱学工業	26,900	1,878.00	50,518,200
三晃金属工業	1,100	3,520.00	3,872,000
朝日工業社	2,000	3,220.00	6,440,000
明星工業	17,700	843.00	14,921,100
大気社	12,300	3,465.00	42,619,500
ダイダン	6,500	2,700.00	17,550,000
日比谷総合設備	10,900	1,828.00	19,925,200
東芝プラントシステム	21,100	2,415.00	50,956,500
O S J Bホールディングス	42,700	289.00	12,340,300
東洋エンジニアリング	10,100	844.00	8,524,400
千代田化工建設	63,400	812.00	51,480,800
新興プランテック	18,700	1,038.00	19,410,600
日本製粉	29,000	1,865.00	54,085,000
日清製粉グループ本社	106,900	2,167.00	231,652,300
日東富士製粉	600	5,300.00	3,180,000
昭和産業	8,000	2,871.00	22,968,000
鳥越製粉	7,600	945.00	7,182,000
中部飼料	10,700	1,414.00	15,129,800
フィード・ワン	58,300	194.00	11,310,200
東洋精糖	1,500	1,231.00	1,846,500
日本甜菜製糖	5,000	1,984.00	9,920,000
三井製糖	6,900	2,954.00	20,382,600
塩水港精糖	10,100	262.00	2,646,200

日新製糖	4,100	2,139.00	8,769,900
森永製菓	20,500	4,505.00	92,352,500
中村屋	2,300	4,620.00	10,626,000
江崎グリコ	24,400	5,780.00	141,032,000
名糖産業	4,200	1,665.00	6,993,000
井村屋グループ	3,400	3,270.00	11,118,000
不二家	5,400	2,300.00	12,420,000
山崎製パン	71,400	2,132.00	152,224,800
第一屋製パン	1,500	1,108.00	1,662,000
モロゾフ	1,500	5,630.00	8,445,000
亀田製菓	5,400	4,855.00	26,217,000
寿スピリッツ	8,400	4,515.00	37,926,000
カルビー	39,800	3,540.00	140,892,000
森永乳業	17,500	2,983.00	52,202,500
六甲バター	6,400	2,485.00	15,904,000
ヤクルト本社	50,800	7,960.00	404,368,000
明治ホールディングス	57,800	7,540.00	435,812,000
雪印メグミルク	21,000	2,682.00	56,322,000
プリマハム	61,000	551.00	33,611,000
日本ハム	37,800	4,030.00	152,334,000
林兼産業	3,100	676.00	2,095,600
丸大食品	47,000	431.00	20,257,000
S Foods	6,100	4,170.00	25,437,000
伊藤ハム米久ホールディングス	56,100	818.00	45,889,800
サッポロホールディングス	31,900	2,366.00	75,475,400
アサヒグループホールディングス	183,000	4,927.00	901,641,000
キリンホールディングス	395,200	2,541.50	1,004,400,800
宝ホールディングス	65,300	1,113.00	72,678,900
オエノンホールディングス	24,800	411.00	10,192,800
養命酒製造	2,700	2,391.00	6,455,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	66,900	3,215.00	215,083,500
サントリー食品インターナショナル	58,500	4,395.00	257,107,500
ダイドーグループホールディングス	4,500	5,510.00	24,795,000
伊藤園	28,900	4,675.00	135,107,500
キーコーヒー	8,600	2,074.00	17,836,400
ユニカフェ	2,600	1,129.00	2,935,400
ジャパンフーズ	1,200	1,449.00	1,738,800
日清オイリオグループ	10,300	3,035.00	31,260,500
不二製油グループ本社	23,700	3,295.00	78,091,500
かどや製油	1,000	6,070.00	6,070,000
J - オイルミルズ	4,500	3,765.00	16,942,500
キッコーマン	62,900	5,280.00	332,112,000

味の素	200,900	1,930.50	387,837,450
キューピー	48,600	2,693.00	130,879,800
ハウス食品グループ本社	33,300	3,275.00	109,057,500
カゴメ	35,000	3,010.00	105,350,000
焼津水産化学工業	4,100	1,141.00	4,678,100
アリアケジャパン	8,000	9,520.00	76,160,000
ピエトロ	1,100	1,632.00	1,795,200
エバラ食品工業	1,900	2,075.00	3,942,500
ニチレイ	41,600	2,764.00	114,982,400
東洋水産	47,900	3,970.00	190,163,000
イトアンド	2,700	1,635.00	4,414,500
大冷	1,000	1,954.00	1,954,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	790.00	1,343,000
日清食品ホールディングス	34,300	6,960.00	238,728,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,493.00	13,437,000
一正蒲鉾	3,300	1,018.00	3,359,400
フジッコ	9,500	2,325.00	22,087,500
ロック・フィールド	9,400	1,787.00	16,797,800
日本たばこ産業	504,400	3,058.00	1,542,455,200
ケンコーマヨネーズ	5,800	2,872.00	16,657,600
わらべや日洋ホールディングス	5,700	2,080.00	11,856,000
なとり	4,900	1,711.00	8,383,900
イフジ産業	1,500	763.00	1,144,500
ピクルスコーポレーション	1,700	2,048.00	3,481,600
北の達人コーポレーション	26,500	533.00	14,124,500
ユーグレナ	34,700	809.00	28,072,300
ミヨシ油脂	3,300	1,284.00	4,237,200
理研ビタミン	3,300	3,735.00	12,325,500
片倉工業	10,500	1,264.00	13,272,000
ゲンゼ	6,800	5,300.00	36,040,000
東洋紡	33,700	1,870.00	63,019,000
ユニチカ	26,700	679.00	18,129,300
富士紡ホールディングス	5,100	3,020.00	15,402,000
倉敷紡績	92,000	313.00	28,796,000
シキボウ	4,500	1,284.00	5,778,000
日本毛織	28,100	921.00	25,880,100
トーア紡コーポレーション	3,800	540.00	2,052,000
ガイドーリミテッド	10,400	398.00	4,139,200
帝国繊維	9,600	2,297.00	22,051,200
帝人	74,900	2,162.00	161,933,800
東レ	661,400	802.60	530,839,640
サカイオーベックス	2,300	2,345.00	5,393,500

住江織物	2,300	2,715.00	6,244,500
日本フェルト	4,800	504.00	2,419,200
イチカワ	6,000	351.00	2,106,000
日東製網	1,000	1,734.00	1,734,000
アツギ	6,200	1,164.00	7,216,800
ダイニック	3,400	936.00	3,182,400
セーレン	21,000	1,796.00	37,716,000
ソトー	3,400	999.00	3,396,600
東海染工	1,300	1,385.00	1,800,500
小松精練	14,000	846.00	11,844,000
ワコールホールディングス	24,900	3,270.00	81,423,000
ホギメディカル	11,500	3,795.00	43,642,500
レナウン	24,200	120.00	2,904,000
クラウドシアホールディングス	2,300	589.00	1,354,700
T S Iホールディングス	31,500	748.00	23,562,000
マツオカコーポレーション	2,200	3,590.00	7,898,000
三陽商会	5,200	1,922.00	9,994,400
ナイガイ	3,400	497.00	1,689,800
オンワードホールディングス	53,000	728.00	38,584,000
ルックホールディングス	3,100	1,211.00	3,754,100
ゴールドウイン	5,200	6,830.00	35,516,000
デサント	20,800	1,901.00	39,540,800
キング	4,600	462.00	2,125,200
ヤマトインターナショナル	5,600	549.00	3,074,400
特種東海製紙	5,000	4,440.00	22,200,000
王子ホールディングス	384,000	723.00	277,632,000
日本製紙	40,800	1,969.00	80,335,200
三菱製紙	13,000	591.00	7,683,000
北越コーポレーション	50,800	620.00	31,496,000
中越パルプ工業	3,600	1,495.00	5,382,000
巴川製紙所	14,000	249.00	3,486,000
大王製紙	36,400	1,498.00	54,527,200
阿波製紙	2,200	605.00	1,331,000
レンゴー	87,900	892.00	78,406,800
トーモク	5,200	1,897.00	9,864,400
ザ・パック	6,500	3,045.00	19,792,500
クラレ	143,800	1,523.00	219,007,400
旭化成	568,600	1,574.00	894,976,400
共和レザー	5,200	974.00	5,064,800
昭和電工	56,600	4,845.00	274,227,000
住友化学	671,000	612.00	410,652,000
住友精化	3,800	5,450.00	20,710,000

日産化学	52,700	4,720.00	248,744,000
ラサ工業	3,200	2,502.00	8,006,400
クレハ	7,900	7,380.00	58,302,000
多木化学	1,300	4,490.00	5,837,000
テイカ	6,900	2,655.00	18,319,500
石原産業	16,400	1,671.00	27,404,400
片倉コープアグリ	2,100	1,120.00	2,352,000
日東エフシー	5,300	750.00	3,975,000
日本曹達	63,000	610.00	38,430,000
東ソー	131,800	1,670.00	220,106,000
トクヤマ	26,500	3,225.00	85,462,500
セントラル硝子	18,600	2,651.00	49,308,600
東亜合成	53,500	1,209.00	64,681,500
大阪ソーダ	9,000	2,983.00	26,847,000
関東電化工業	21,700	1,076.00	23,349,200
デンカ	33,500	3,565.00	119,427,500
信越化学工業	150,200	10,380.00	1,559,076,000
日本カーバイド工業	2,900	1,731.00	5,019,900
堺化学工業	6,200	2,763.00	17,130,600
第一稀元素化学工業	7,000	1,311.00	9,177,000
エア・ウォーター	75,200	1,909.00	143,556,800
大陽日酸	70,200	1,520.00	106,704,000
日本化学工業	3,400	4,375.00	14,875,000
東邦アセチレン	1,300	1,550.00	2,015,000
日本パーカラライジング	46,600	1,385.00	64,541,000
高压ガス工業	13,500	786.00	10,611,000
チタン工業	1,000	2,632.00	2,632,000
四国化成工業	13,100	1,386.00	18,156,600
戸田工業	1,800	2,765.00	4,977,000
ステラ ケミファ	4,600	3,690.00	16,974,000
保土谷化学工業	3,000	3,185.00	9,555,000
日本触媒	14,300	8,020.00	114,686,000
大日精化工業	7,000	3,235.00	22,645,000
カネカ	123,000	983.00	120,909,000
三菱瓦斯化学	75,100	2,272.00	170,627,200
三井化学	82,900	2,809.00	232,866,100
J S R	91,700	2,099.00	192,478,300
東京応化工業	14,600	3,505.00	51,173,000
大阪有機化学工業	7,900	1,301.00	10,277,900
三菱ケミカルホールディングス	610,600	949.30	579,642,580
K Hネオケム	13,600	3,920.00	53,312,000
ダイセル	122,900	1,252.00	153,870,800

住友ベークライト	74,000	1,023.00	75,702,000
積水化学工業	186,300	1,847.00	344,096,100
日本ゼオン	76,900	1,180.00	90,742,000
アイカ工業	25,600	4,010.00	102,656,000
宇部興産	45,900	2,695.00	123,700,500
積水樹脂	14,100	2,074.00	29,243,400
タキロンシーアイ	18,400	618.00	11,371,200
旭有機材	5,400	2,460.00	13,284,000
日立化成	45,000	2,219.00	99,855,000
ニチバン	4,500	2,694.00	12,123,000
リケンテクノス	19,600	545.00	10,682,000
大倉工業	4,400	2,166.00	9,530,400
積水化成成品工業	11,400	980.00	11,172,000
群栄化学工業	2,200	3,305.00	7,271,000
タイガースポリマー	4,500	761.00	3,424,500
ミライアル	3,000	950.00	2,850,000
ダイキアクシス	3,000	1,043.00	3,129,000
ダイキョーニシカワ	18,000	1,477.00	26,586,000
竹本容器	1,500	3,090.00	4,635,000
森六ホールディングス	4,600	2,930.00	13,478,000
日本化薬	59,200	1,266.00	74,947,200
カーリットホールディングス	8,500	915.00	7,777,500
日本精化	7,500	1,276.00	9,570,000
扶桑化学工業	8,700	2,644.00	23,002,800
トリケミカル研究所	2,100	4,050.00	8,505,000
A D E K A	39,200	1,716.00	67,267,200
日油	35,200	3,460.00	121,792,000
ハリマ化成グループ	7,000	871.00	6,097,000
花王	214,000	8,107.00	1,734,898,000
第一工業製薬	17,000	691.00	11,747,000
石原ケミカル	2,200	2,192.00	4,822,400
日華化学	2,800	1,138.00	3,186,400
ニイタカ	1,400	1,718.00	2,405,200
三洋化成工業	5,700	5,190.00	29,583,000
有機合成薬品工業	5,900	267.00	1,575,300
大日本塗料	10,400	1,230.00	12,792,000
日本ペイントホールディングス	70,300	4,240.00	298,072,000
関西ペイント	95,800	2,175.00	208,365,000
神東塗料	6,600	214.00	1,412,400
中国塗料	26,100	1,007.00	26,282,700
日本特殊塗料	5,700	2,172.00	12,380,400
藤倉化成	11,500	672.00	7,728,000



太陽ホールディングス	7,000	4,270.00	29,890,000
D I C	38,600	3,650.00	140,890,000
サカタインクス	18,600	1,349.00	25,091,400
東洋インキＳＣホールディングス	18,000	2,756.00	49,608,000
T & K T O K A	6,000	1,113.00	6,678,000
富士フイルムホールディングス	180,800	4,597.00	831,137,600
資生堂	173,000	7,310.00	1,264,630,000
ライオン	121,300	2,164.00	262,493,200
高砂香料工業	5,500	3,790.00	20,845,000
マンダム	17,000	3,260.00	55,420,000
ミルボン	10,700	5,040.00	53,928,000
ファンケル	21,100	5,070.00	106,977,000
コーセー	14,700	18,090.00	265,923,000
コタ	4,200	1,356.00	5,695,200
シーズ・ホールディングス	10,500	4,560.00	47,880,000
シーボン	1,100	2,706.00	2,976,600
ポーラ・オルビスホールディングス	37,200	3,715.00	138,198,000
ノエビアホールディングス	5,500	5,910.00	32,505,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	955.00	1,814,500
エステー	6,200	1,971.00	12,220,200
アグロ カネショウ	3,500	2,782.00	9,737,000
コニシ	14,300	1,711.00	24,467,300
長谷川香料	10,400	2,098.00	21,819,200
星光P M C	5,800	1,029.00	5,968,200
小林製薬	24,400	7,260.00	177,144,000
荒川化学工業	7,800	1,644.00	12,823,200
メック	6,000	1,752.00	10,512,000
日本高純度化学	2,400	2,394.00	5,745,600
タカラバイオ	22,800	2,544.00	58,003,200
J C U	10,500	2,523.00	26,491,500
新田ゼラチン	5,900	807.00	4,761,300
O A T アグリオ	1,300	2,583.00	3,357,900
デクセリアルズ	22,300	1,056.00	23,548,800
アース製薬	6,600	4,990.00	32,934,000
北興化学工業	8,700	554.00	4,819,800
大成ラミック	2,700	3,180.00	8,586,000
クミアイ化学工業	38,700	865.00	33,475,500
日本農薬	20,800	670.00	13,936,000
アキレス	6,600	2,277.00	15,028,200
有沢製作所	14,500	989.00	14,340,500
日東電工	65,700	8,392.00	551,354,400
レック	5,200	5,360.00	27,872,000

きもと	14,700	302.00	4,439,400	
藤森工業	7,300	3,380.00	24,674,000	
前澤化成工業	6,000	1,198.00	7,188,000	
ウェブロックホールディングス	2,200	982.00	2,160,400	
J S P	5,100	2,677.00	13,652,700	
エフピコ	7,200	6,160.00	44,352,000	
天馬	6,800	1,755.00	11,934,000	
信越ポリマー	17,900	893.00	15,984,700	
東リ	21,800	321.00	6,997,800	
ニフコ	32,000	2,975.00	95,200,000	
日本バルカー工業	7,100	3,185.00	22,613,500	
ユニ・チャーム	184,600	3,366.00	621,363,600	
協和発酵キリン	109,000	1,941.00	211,569,000	
武田薬品工業	320,700	4,536.00	1,454,695,200	
アステラス製薬	856,000	1,887.50	1,615,700,000	
大日本住友製薬	64,500	2,176.00	140,352,000	
塩野義製薬	122,600	6,149.00	753,867,400	
田辺三菱製薬	106,200	1,919.00	203,797,800	
わかもと製薬	10,200	287.00	2,927,400	
あすか製薬	9,900	1,352.00	13,384,800	
日本新薬	22,800	6,160.00	140,448,000	
バイオフェルミン製薬	1,500	2,737.00	4,105,500	
中外製薬	90,700	6,000.00	544,200,000	
科研製薬	15,700	5,350.00	83,995,000	
エーザイ	104,200	9,608.00	1,001,153,600	
ロート製薬	47,800	3,180.00	152,004,000	
小野薬品工業	205,600	2,839.00	583,698,400	
久光製薬	25,700	7,930.00	203,801,000	
持田製薬	6,000	8,130.00	48,780,000	
参天製薬	165,000	1,654.00	272,910,000	
扶桑薬品工業	3,100	2,791.00	8,652,100	
日本ケミファ	1,200	4,625.00	5,550,000	
ツムラ	31,100	3,640.00	113,204,000	
日医工	23,000	1,588.00	36,524,000	
キッセイ薬品工業	15,400	3,155.00	48,587,000	
生化学工業	16,900	1,482.00	25,045,800	
栄研化学	14,100	2,194.00	30,935,400	
日水製薬	3,700	1,322.00	4,891,400	
鳥居薬品	5,300	2,631.00	13,944,300	
J C R ファーマ	6,100	5,190.00	31,659,000	
東和薬品	4,200	7,370.00	30,954,000	
富士製薬工業	5,900	1,782.00	10,513,800	

沢井製薬	17,500	5,730.00	100,275,000
ゼリア新薬工業	18,700	2,307.00	43,140,900
第一三共	249,100	4,214.00	1,049,707,400
キョーリン製薬ホールディングス	24,300	2,158.00	52,439,400
大幸薬品	4,600	1,841.00	8,468,600
ダイト	5,100	3,080.00	15,708,000
大塚ホールディングス	165,800	4,849.00	803,964,200
大正製薬ホールディングス	19,500	11,480.00	223,860,000
ペプチドリーム	39,800	3,810.00	151,638,000
日本コークス工業	73,400	115.00	8,441,000
昭和シェル石油	81,500	2,033.00	165,689,500
ニチレキ	11,100	1,193.00	13,242,300
ユシロ化学工業	4,900	1,449.00	7,100,100
ビーピー・カストロール	3,600	1,492.00	5,371,200
富士石油	21,100	413.00	8,714,300
MORESCO	3,100	1,604.00	4,972,400
出光興産	73,100	5,210.00	380,851,000
JXTGホールディングス	1,389,100	754.70	1,048,353,770
コスモエネルギーホールディングス	25,200	3,595.00	90,594,000
横浜ゴム	50,400	2,331.00	117,482,400
東洋ゴム工業	44,700	1,791.00	80,057,700
ブリヂストン	267,500	4,131.00	1,105,042,500
住友ゴム工業	78,200	1,684.00	131,688,800
藤倉ゴム工業	7,500	596.00	4,470,000
オカモト	30,000	1,215.00	36,450,000
フコク	3,700	933.00	3,452,100
ニッタ	9,000	3,850.00	34,650,000
住友理工	16,900	1,130.00	19,097,000
三ツ星ベルト	21,000	1,312.00	27,552,000
バンドー化学	16,600	1,200.00	19,920,000
日東紡績	13,000	2,369.00	30,797,000
A G C	87,800	4,280.00	375,784,000
日本板硝子	43,000	1,133.00	48,719,000
石塚硝子	1,200	2,334.00	2,800,800
日本山村硝子	36,000	182.00	6,552,000
日本電気硝子	37,700	3,500.00	131,950,000
オハラ	3,500	2,460.00	8,610,000
住友大阪セメント	165,000	474.00	78,210,000
太平洋セメント	55,000	3,385.00	186,175,000
日本ヒューム	8,800	902.00	7,937,600
日本コンクリート工業	18,500	339.00	6,271,500
三谷セキサン	4,600	2,710.00	12,466,000

アジアパイルホールディングス	11,200	823.00	9,217,600
東海カーボン	79,000	1,783.00	140,857,000
日本カーボン	4,400	5,750.00	25,300,000
東洋炭素	5,500	2,651.00	14,580,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,800	6,440.00	30,912,000
TOTO	67,000	4,585.00	307,195,000
日本碍子	106,200	1,789.00	189,991,800
日本特殊陶業	73,400	2,978.00	218,585,200
MARUWA	3,000	7,190.00	21,570,000
品川リフラクトリーズ	2,300	4,920.00	11,316,000
黒崎播磨	1,700	8,460.00	14,382,000
ヨータイ	7,000	918.00	6,426,000
イソライト工業	4,400	598.00	2,631,200
東京窯業	10,900	457.00	4,981,300
ニッカトー	4,000	1,495.00	5,980,000
フジインコーポレーテッド	7,800	2,761.00	21,535,800
クニミネ工業	2,300	1,034.00	2,378,200
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,164.00	2,095,200
ニチアス	48,000	1,427.00	68,496,000
ニチハ	13,100	3,095.00	40,544,500
新日鐵住金	385,200	2,216.50	853,795,800
神戸製鋼所	157,500	941.00	148,207,500
中山製鋼所	11,900	653.00	7,770,700
合同製鐵	4,600	2,461.00	11,320,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	232,500	2,453.50	570,438,750
日新製鋼	23,700	1,544.00	36,592,800
東京製鐵	46,000	909.00	41,814,000
共英製鋼	9,700	2,114.00	20,505,800
大和工業	18,300	3,225.00	59,017,500
東京鐵鋼	3,500	1,711.00	5,988,500
大阪製鐵	5,700	1,914.00	10,909,800
淀川製鋼所	12,600	2,582.00	32,533,200
丸一鋼管	30,500	3,335.00	101,717,500
モリ工業	2,800	2,937.00	8,223,600
大同特殊鋼	15,300	5,090.00	77,877,000
日本高周波鋼業	3,100	766.00	2,374,600
日本冶金工業	71,200	350.00	24,920,000
山陽特殊製鋼	9,900	2,398.00	23,740,200
愛知製鋼	4,800	3,970.00	19,056,000
日立金属	92,700	1,216.00	112,723,200
日本金属	2,200	1,681.00	3,698,200
大平洋金属	5,300	3,875.00	20,537,500

新日本電工	51,200	255.00	13,056,000
栗本鐵工所	4,300	1,794.00	7,714,200
虹技	1,300	1,832.00	2,381,600
日本鑄鉄管	9,000	152.00	1,368,000
三菱製鋼	6,400	2,095.00	13,408,000
日亜鋼業	12,400	329.00	4,079,600
日本精線	1,400	4,220.00	5,908,000
エンビプロ・ホールディングス	1,800	712.00	1,281,600
シンニッタン	13,400	441.00	5,909,400
新家工業	2,000	1,887.00	3,774,000
大紀アルミニウム工業所	14,300	703.00	10,052,900
日本軽金属ホールディングス	252,100	231.00	58,235,100
三井金属鉱業	23,300	3,100.00	72,230,000
東邦亜鉛	4,800	3,545.00	17,016,000
三菱マテリアル	56,900	2,967.00	168,822,300
住友金属鉱山	110,100	3,623.00	398,892,300
D O W Aホールディングス	21,800	3,330.00	72,594,000
古河機械金属	14,300	1,815.00	25,954,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,100	1,506.00	13,704,600
東邦チタニウム	15,600	1,040.00	16,224,000
U A C J	13,100	2,349.00	30,771,900
C Kサンエツ	1,700	3,050.00	5,185,000
古河電気工業	28,700	3,465.00	99,445,500
住友電気工業	321,900	1,753.50	564,451,650
フジクラ	104,200	641.00	66,792,200
昭和電線ホールディングス	10,800	740.00	7,992,000
東京特殊電線	1,200	2,125.00	2,550,000
タツタ電線	17,400	565.00	9,831,000
カナレ電気	1,500	2,038.00	3,057,000
平河ヒューテック	4,400	1,315.00	5,786,000
リョービ	10,600	3,985.00	42,241,000
アーレスティ	10,700	832.00	8,902,400
アサヒホールディングス	14,800	2,020.00	29,896,000
稲葉製作所	4,900	1,253.00	6,139,700
宮地エンジニアリンググループ	2,400	2,765.00	6,636,000
トーカロ	23,900	1,221.00	29,181,900
アルファC o	3,000	1,415.00	4,245,000
S U M C O	95,100	1,897.00	180,404,700
川田テクノロジーズ	1,700	5,590.00	9,503,000
R S Technologies	1,700	5,060.00	8,602,000
東洋製罐グループホールディングス	54,800	2,022.00	110,805,600
ホッカンホールディングス	22,000	430.00	9,460,000

コロナ	4,800	1,186.00	5,692,800
横河ブリッジホールディングス	16,000	2,065.00	33,040,000
駒井ハルテック	1,900	2,375.00	4,512,500
高田機工	800	2,915.00	2,332,000
三和ホールディングス	82,600	1,232.00	101,763,200
文化シャッター	25,400	858.00	21,793,200
三協立山	12,000	1,346.00	16,152,000
アルインコ	6,300	1,030.00	6,489,000
東洋シャッター	2,200	615.00	1,353,000
LIXILグループ	126,900	2,001.00	253,926,900
日本フィルコン	6,500	565.00	3,672,500
ノーリツ	19,200	1,573.00	30,201,600
長府製作所	9,500	2,402.00	22,819,000
リンナイ	15,300	8,300.00	126,990,000
ダイニチ工業	4,600	742.00	3,413,200
日東精工	11,900	592.00	7,044,800
三洋工業	1,100	2,025.00	2,227,500
岡部	17,500	987.00	17,272,500
ジーテクト	9,500	1,835.00	17,432,500
東プレ	16,100	2,641.00	42,520,100
高周波熱錬	16,500	1,012.00	16,698,000
東京製綱	6,200	1,429.00	8,859,800
サンコール	4,800	772.00	3,705,600
モリテック スチール	6,500	509.00	3,308,500
パイオラックス	12,700	2,393.00	30,391,100
エイチワン	8,500	1,300.00	11,050,000
日本発條	85,800	1,131.00	97,039,800
中央発條	1,000	3,900.00	3,900,000
アドバネクス	1,400	1,807.00	2,529,800
立川ブラインド工業	3,700	1,085.00	4,014,500
三益半導体工業	6,700	1,739.00	11,651,300
日本ドライケミカル	1,200	2,362.00	2,834,400
日本製鋼所	28,200	2,654.00	74,842,800
三浦工業	37,300	2,972.00	110,855,600
タクマ	29,300	1,333.00	39,056,900
ツガミ	23,000	1,065.00	24,495,000
オークマ	10,100	6,310.00	63,731,000
東芝機械	49,000	482.00	23,618,000
アマダホールディングス	133,000	1,172.00	155,876,000
アイダエンジニアリング	22,000	977.00	21,494,000
滝澤鉄工所	2,700	1,737.00	4,689,900
F U J I	25,800	1,695.00	43,731,000

牧野フライス製作所	44,000	941.00	41,404,000
オーエスジー	42,500	2,360.00	100,300,000
ダイジェット工業	1,200	1,863.00	2,235,600
旭ダイヤモンド工業	25,900	776.00	20,098,400
D M G 森精機	54,600	1,708.00	93,256,800
ソディック	18,800	1,014.00	19,063,200
ディスコ	11,700	17,690.00	206,973,000
日東工器	5,300	2,262.00	11,988,600
日進工具	2,300	2,732.00	6,283,600
パンチ工業	7,200	864.00	6,220,800
富士ダイス	4,200	801.00	3,364,200
豊和工業	4,900	917.00	4,493,300
O K K	3,400	1,072.00	3,644,800
東洋機械金属	6,600	702.00	4,633,200
島精機製作所	10,900	5,140.00	56,026,000
オプトラン	8,400	2,721.00	22,856,400
N C ホールディングス	2,700	677.00	1,827,900
フリー	6,000	952.00	5,712,000
ヤマシンフィルタ	13,000	1,015.00	13,195,000
日阪製作所	12,300	1,093.00	13,443,900
やまびこ	16,700	1,225.00	20,457,500
平田機工	3,200	7,210.00	23,072,000
ペガサスミシン製造	8,100	1,009.00	8,172,900
ナプテスコ	47,400	2,822.00	133,762,800
三井海洋開発	9,100	3,210.00	29,211,000
レオン自動機	7,700	1,860.00	14,322,000
S M C	27,300	37,390.00	1,020,747,000
新川	5,900	561.00	3,309,900
ホソカワミクロン	3,000	6,310.00	18,930,000
ユニオンツール	3,900	3,620.00	14,118,000
オイレス工業	11,100	2,287.00	25,385,700
日精エー・エス・ビー機械	2,500	4,535.00	11,337,500
サトーホールディングス	11,300	3,315.00	37,459,500
技研製作所	5,900	2,455.00	14,484,500
日本エアーテック	2,900	721.00	2,090,900
カワタ	1,800	1,980.00	3,564,000
日精樹脂工業	7,400	1,100.00	8,140,000
オカダアイヨン	2,900	1,727.00	5,008,300
ワイエイシイホールディングス	2,800	804.00	2,251,200
小松製作所	420,300	3,032.00	1,274,349,600
住友重機械工業	49,900	3,495.00	174,400,500
日立建機	40,800	3,310.00	135,048,000

日工	2,500	2,413.00	6,032,500
巴工業	3,700	2,344.00	8,672,800
井関農機	8,800	1,895.00	16,676,000
TOWA	6,800	962.00	6,541,600
丸山製作所	2,000	1,730.00	3,460,000
北川鉄工所	4,300	2,533.00	10,891,900
ローツェ	4,300	1,989.00	8,552,700
タカキタ	3,000	609.00	1,827,000
クボタ	467,000	1,664.00	777,088,000
荏原実業	2,600	2,272.00	5,907,200
三菱化工機	3,100	1,855.00	5,750,500
月島機械	17,400	1,490.00	25,926,000
帝国電機製作所	6,100	1,579.00	9,631,900
新東工業	20,800	975.00	20,280,000
澁谷工業	7,700	3,885.00	29,914,500
アイチ コーポレーション	15,400	611.00	9,409,400
小森コーポレーション	22,100	1,298.00	28,685,800
鶴見製作所	7,500	1,846.00	13,845,000
住友精密工業	14,000	367.00	5,138,000
酒井重工業	1,700	3,150.00	5,355,000
荏原製作所	38,600	3,615.00	139,539,000
石井鐵工所	1,500	1,676.00	2,514,000
西島製作所	9,000	1,037.00	9,333,000
北越工業	9,800	1,094.00	10,721,200
ダイキン工業	118,800	13,380.00	1,589,544,000
オルガノ	3,200	2,932.00	9,382,400
トーヨーカネツ	3,600	3,205.00	11,538,000
栗田工業	47,200	3,045.00	143,724,000
椿本チエイン	52,000	971.00	50,492,000
大同工業	3,900	1,091.00	4,254,900
木村化工機	7,600	436.00	3,313,600
アネスト岩田	14,700	1,050.00	15,435,000
ダイフク	44,300	5,300.00	234,790,000
サムコ	2,300	1,167.00	2,684,100
加藤製作所	4,200	3,190.00	13,398,000
油研工業	1,800	2,283.00	4,109,400
タダノ	42,200	1,248.00	52,665,600
フジテック	26,800	1,439.00	38,565,200
C K D	24,200	1,608.00	38,913,600
キトー	6,600	2,188.00	14,440,800
平和	27,000	2,673.00	72,171,000
理想科学工業	8,600	2,472.00	21,259,200



SANKYO	21,800	4,220.00	91,996,000
日本金銭機械	8,000	1,314.00	10,512,000
マースエンジニアリング	5,500	2,397.00	13,183,500
福島工業	5,400	5,050.00	27,270,000
オーイズミ	3,500	497.00	1,739,500
ダイコク電機	4,000	1,906.00	7,624,000
竹内製作所	14,600	2,603.00	38,003,800
アマノ	26,900	2,188.00	58,857,200
JUKI	12,600	1,278.00	16,102,800
サンデンホールディングス	10,600	1,405.00	14,893,000
蛇の目ミシン工業	7,800	647.00	5,046,600
マックス	13,400	1,546.00	20,716,400
グローリー	26,000	2,895.00	75,270,000
新晃工業	8,800	1,572.00	13,833,600
大和冷機工業	13,700	1,150.00	15,755,000
セガサミーホールディングス	86,300	1,803.00	155,598,900
日本ピストンリング	3,200	2,267.00	7,254,400
リケン	4,000	5,660.00	22,640,000
T P R	9,800	2,662.00	26,087,600
ツバキ・ナカシマ	13,100	2,340.00	30,654,000
ホシザキ	25,400	9,970.00	253,238,000
大豊工業	7,100	1,183.00	8,399,300
日本精工	178,800	1,219.00	217,957,200
NTN	201,400	429.00	86,400,600
ジェイテクト	92,800	1,460.00	135,488,000
不二越	8,100	4,995.00	40,459,500
日本トムソン	27,800	733.00	20,377,400
THK	54,300	2,860.00	155,298,000
ユーシン精機	7,700	1,128.00	8,685,600
前澤給装工業	3,400	1,916.00	6,514,400
イーグル工業	10,800	1,505.00	16,254,000
前澤工業	6,200	427.00	2,647,400
日本ピラー工業	8,800	1,555.00	13,684,000
キッツ	35,200	981.00	34,531,200
マキタ	113,500	4,995.00	566,932,500
日立造船	69,300	501.00	34,719,300
三菱重工業	145,900	4,185.00	610,591,500
I H I	66,900	3,790.00	253,551,000
スター精密	13,900	1,928.00	26,799,200
日清紡ホールディングス	53,400	1,194.00	63,759,600
イビデン	53,600	1,533.00	82,168,800
コニカミノルタ	204,100	1,061.00	216,550,100

ブラザー工業	106,500	2,198.00	234,087,000
ミネベアミツミ	161,800	1,929.00	312,112,200
日立製作所	2,090,000	728.00	1,521,520,000
三菱電機	870,600	1,475.50	1,284,570,300
富士電機	263,000	857.00	225,391,000
東洋電機製造	3,700	1,560.00	5,772,000
安川電機	101,000	3,510.00	354,510,000
シンフォニアテクノロジー	57,000	363.00	20,691,000
明電舎	75,000	378.00	28,350,000
オリジン電気	2,800	1,608.00	4,502,400
山洋電気	4,300	5,660.00	24,338,000
デンヨー	8,300	1,656.00	13,744,800
東芝テック	63,000	653.00	41,139,000
芝浦メカトロニクス	14,000	428.00	5,992,000
マブチモーター	24,200	4,740.00	114,708,000
日本電産	104,800	15,000.00	1,572,000,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,800	2,085.00	7,923,000
トレックス・セミコンダクター	2,700	1,612.00	4,352,400
東光高岳	4,600	1,661.00	7,640,600
ダブル・スコープ	13,100	810.00	10,611,000
ダイヘン	48,000	603.00	28,944,000
ヤーマン	12,900	1,596.00	20,588,400
JVCケンウッド	66,100	300.00	19,830,000
ミマキエンジニアリング	8,100	958.00	7,759,800
第一精工	4,200	1,351.00	5,674,200
日新電機	20,800	927.00	19,281,600
大崎電気工業	19,100	766.00	14,630,600
オムロン	92,600	4,860.00	450,036,000
日東工業	14,200	1,813.00	25,744,600
I D E C	11,000	2,127.00	23,397,000
不二電機工業	1,200	1,351.00	1,621,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	157,000	499.00	78,343,000
サクサホールディングス	2,400	2,154.00	5,169,600
メルコホールディングス	4,300	4,110.00	17,673,000
テクノメディカ	1,800	2,040.00	3,672,000
日本電気	112,800	2,945.00	332,196,000
富士通	896,000	774.80	694,220,800
沖電気工業	35,600	1,342.00	47,775,200
岩崎通信機	3,700	754.00	2,789,800
電気興業	5,100	3,230.00	16,473,000
サンケン電気	52,000	605.00	31,460,000
ナカヨ	1,900	1,660.00	3,154,000

アイホン	5,200	1,525.00	7,930,000
ルネサスエレクトロニクス	90,600	813.00	73,657,800
セイコーエプソン	129,800	1,920.00	249,216,000
ワコム	68,400	488.00	33,379,200
アルバック	20,100	3,850.00	77,385,000
アクセル	4,200	678.00	2,847,600
E I Z O	8,100	4,670.00	37,827,000
日本信号	24,300	1,101.00	26,754,300
京三製作所	20,800	596.00	12,396,800
能美防災	11,700	2,204.00	25,786,800
ホーチキ	6,600	1,552.00	10,243,200
星和電機	3,600	449.00	1,616,400
エレコム	7,800	2,633.00	20,537,400
パナソニック	994,600	1,360.50	1,353,153,300
シャープ	80,800	2,789.00	225,351,200
アンリツ	63,700	1,532.00	97,588,400
富士通ゼネラル	26,800	1,621.00	43,442,800
ソニー	583,100	6,000.00	3,498,600,000
T D K	45,600	11,060.00	504,336,000
帝国通信工業	4,200	1,295.00	5,439,000
タムラ製作所	34,100	730.00	24,893,000
アルプス電気	75,100	3,190.00	239,569,000
池上通信機	28,000	133.00	3,724,000
日本電波工業	7,800	477.00	3,720,600
鈴木	4,800	737.00	3,537,600
日本トリム	1,900	5,750.00	10,925,000
ローランド ディー . ジー .	4,600	2,483.00	11,421,800
フォスター電機	10,400	1,201.00	12,490,400
クラリオン	47,000	314.00	14,758,000
S M K	24,000	302.00	7,248,000
ヨコオ	5,900	1,475.00	8,702,500
ホシデン	22,400	994.00	22,265,600
ヒロセ電機	14,200	12,150.00	172,530,000
日本航空電子工業	23,000	1,889.00	43,447,000
T O A	9,700	1,188.00	11,523,600
マクセルホールディングス	17,500	1,769.00	30,957,500
古野電気	10,700	1,251.00	13,385,700
ユニデンホールディングス	25,000	278.00	6,950,000
アルパイン	20,900	2,360.00	49,324,000
スミダコーポレーション	9,000	1,273.00	11,457,000
アイコム	5,000	2,416.00	12,080,000
リオン	3,800	2,277.00	8,652,600

本多通信工業	7,300	764.00	5,577,200
横河電機	87,300	2,133.00	186,210,900
新電元工業	3,200	4,820.00	15,424,000
アズビル	26,200	4,610.00	120,782,000
東亜ディーケーケー	4,500	1,192.00	5,364,000
日本光電工業	36,100	3,175.00	114,617,500
チノー	3,300	1,440.00	4,752,000
共和電業	10,100	403.00	4,070,300
日本電子材料	3,800	818.00	3,108,400
堀場製作所	17,300	6,750.00	116,775,000
アドバンテスト	48,700	2,425.00	118,097,500
小野測器	4,600	813.00	3,739,800
エスペック	7,900	1,997.00	15,776,300
キーエンス	42,700	59,930.00	2,559,011,000
日置電機	4,700	3,845.00	18,071,500
シスメックス	67,800	8,950.00	606,810,000
日本マイクロニクス	14,600	775.00	11,315,000
メガチップス	7,100	1,853.00	13,156,300
O B A R A G R O U P	5,200	5,250.00	27,300,000
澤藤電機	1,100	2,032.00	2,235,200
コーセル	12,400	1,261.00	15,636,400
イリソ電子工業	7,400	5,980.00	44,252,000
新日本無線	5,200	774.00	4,024,800
オブテックスグループ	15,500	2,211.00	34,270,500
千代田インテグレ	4,100	2,193.00	8,991,300
アイ・オー・データ機器	4,000	1,161.00	4,644,000
レーザーテック	18,000	3,410.00	61,380,000
スタンレー電気	66,500	3,740.00	248,710,000
岩崎電気	3,700	1,520.00	5,624,000
ウシオ電機	53,100	1,417.00	75,242,700
岡谷電機産業	7,000	474.00	3,318,000
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	708.00	5,664,000
日本セラミック	9,000	2,942.00	26,478,000
遠藤照明	4,800	824.00	3,955,200
古河電池	6,700	835.00	5,594,500
双信電機	4,700	443.00	2,082,100
山一電機	6,600	1,354.00	8,936,400
図研	5,900	1,603.00	9,457,700
日本電子	32,000	996.00	31,872,000
カシオ計算機	70,200	1,732.00	121,586,400
ファナック	82,700	21,745.00	1,798,311,500
日本シイエムケイ	15,800	710.00	11,218,000

エンプラス	4,100	3,015.00	12,361,500
大真空	3,400	1,186.00	4,032,400
ローム	39,100	9,170.00	358,547,000
浜松ホトニクス	62,500	4,185.00	261,562,500
三井ハイテック	11,800	1,481.00	17,475,800
新光電気工業	33,200	991.00	32,901,200
京セラ	142,900	6,771.00	967,575,900
太陽誘電	39,200	2,960.00	116,032,000
村田製作所	91,300	17,845.00	1,629,248,500
ユーシン	13,100	725.00	9,497,500
双葉電子工業	14,400	1,947.00	28,036,800
北陸電気工業	3,800	1,222.00	4,643,600
ニチコン	27,700	1,225.00	33,932,500
日本ケミコン	7,100	3,430.00	24,353,000
K O A	12,200	2,081.00	25,388,200
市光工業	13,300	1,167.00	15,521,100
小糸製作所	52,200	6,750.00	352,350,000
ミツバ	16,500	866.00	14,289,000
S C R E E Nホールディングス	16,500	7,570.00	124,905,000
キャノン電子	8,200	2,162.00	17,728,400
キャノン	468,700	3,501.00	1,640,918,700
リコー	262,000	1,111.00	291,082,000
象印マホービン	16,500	1,440.00	23,760,000
M U T O Hホールディングス	1,400	2,272.00	3,180,800
東京エレクトロン	58,100	18,085.00	1,050,738,500
トヨタ紡織	25,400	1,950.00	49,530,000
芦森工業	1,800	2,331.00	4,195,800
ユニプレス	16,900	2,079.00	35,135,100
豊田自動織機	70,500	6,060.00	427,230,000
モリタホールディングス	14,000	2,321.00	32,494,000
三櫻工業	11,100	640.00	7,104,000
デンソー	193,100	5,263.00	1,016,285,300
東海理化電機製作所	22,900	2,206.00	50,517,400
三井E & Sホールディングス	31,400	1,711.00	53,725,400
川崎重工業	67,700	3,085.00	208,854,500
名村造船所	26,000	506.00	13,156,000
日本車輛製造	32,000	280.00	8,960,000
三菱ロジスネクスト	10,300	1,145.00	11,793,500
近畿車輛	1,100	2,387.00	2,625,700
日産自動車	1,026,500	1,040.00	1,067,560,000
いすゞ自動車	252,200	1,593.50	401,880,700
トヨタ自動車	1,058,100	6,760.00	7,152,756,000

日野自動車	124,200	1,186.00	147,301,200
三菱自動車工業	322,200	793.00	255,504,600
エフテック	5,600	1,286.00	7,201,600
レシップホールディングス	3,100	820.00	2,542,000
G M B	1,500	1,290.00	1,935,000
ファルテック	1,500	1,055.00	1,582,500
武蔵精密工業	9,300	3,500.00	32,550,000
日産車体	34,000	942.00	32,028,000
新明和工業	37,800	1,327.00	50,160,600
極東開発工業	16,200	1,620.00	26,244,000
日信工業	17,700	1,829.00	32,373,300
トピー工業	7,200	3,010.00	21,672,000
ティラド	3,200	2,943.00	9,417,600
曙ブレーキ工業	40,300	233.00	9,389,900
タチエス	14,800	1,808.00	26,758,400
N O K	46,800	2,018.00	94,442,400
フタバ産業	26,700	678.00	18,102,600
K Y B	9,100	4,520.00	41,132,000
大同メタル工業	10,900	1,154.00	12,578,600
プレス工業	46,300	596.00	27,594,800
ミクニ	11,100	660.00	7,326,000
太平洋工業	18,200	1,684.00	30,648,800
ケーヒン	20,000	2,249.00	44,980,000
河西工業	10,700	1,212.00	12,968,400
アイシン精機	71,700	4,900.00	351,330,000
マツダ	273,200	1,279.00	349,422,800
今仙電機製作所	8,100	1,113.00	9,015,300
本田技研工業	783,200	3,314.00	2,595,524,800
スズキ	172,500	7,453.00	1,285,642,500
S U B A R U	270,200	3,338.00	901,927,600
安永	4,200	1,855.00	7,791,000
ヤマハ発動機	122,900	2,820.00	346,578,000
ショーワ	22,600	1,650.00	37,290,000
T B K	10,300	482.00	4,964,600
エクセディ	10,500	3,490.00	36,645,000
豊田合成	31,600	2,751.00	86,931,600
愛三工業	15,300	915.00	13,999,500
盟和産業	1,400	1,248.00	1,747,200
日本プラスト	4,700	1,084.00	5,094,800
ヨロズ	8,800	1,590.00	13,992,000
エフ・シー・シー	14,200	3,285.00	46,647,000
シマノ	35,100	17,060.00	598,806,000

テイ・エス テック	20,200	4,055.00	81,911,000
ジャムコ	4,400	2,894.00	12,733,600
テルモ	133,400	5,830.00	777,722,000
クリエートメディック	2,900	1,230.00	3,567,000
日機装	29,400	1,156.00	33,986,400
島津製作所	104,000	3,090.00	321,360,000
JMS	8,100	626.00	5,070,600
長野計器	6,700	1,171.00	7,845,700
ブイ・テクノロジー	2,000	18,230.00	36,460,000
東京計器	5,600	1,086.00	6,081,600
愛知時計電機	1,200	4,320.00	5,184,000
インターアクション	4,600	1,515.00	6,969,000
オーバル	8,300	297.00	2,465,100
東京精密	15,700	3,140.00	49,298,000
マニー	10,600	4,485.00	47,541,000
ニコン	151,700	2,009.00	304,765,300
トプコン	46,700	1,758.00	82,098,600
オリンパス	129,700	4,515.00	585,595,500
理研計器	8,300	2,491.00	20,675,300
タムロン	7,700	2,112.00	16,262,400
H O Y A	175,200	6,494.00	1,137,748,800
シード	3,700	1,762.00	6,519,400
ノーリツ鋼機	8,800	2,527.00	22,237,600
エー・アンド・デイ	8,000	859.00	6,872,000
シチズン時計	103,900	738.00	76,678,200
リズム時計工業	3,200	2,064.00	6,604,800
大研医器	7,800	815.00	6,357,000
メニコン	11,900	2,396.00	28,512,400
シンシア	1,300	634.00	824,200
松風	4,300	1,285.00	5,525,500
セイコーホールディングス	13,400	2,846.00	38,136,400
ニプロ	60,300	1,441.00	86,892,300
中本パックス	2,200	1,835.00	4,037,000
スノーピーク	3,000	1,658.00	4,974,000
パラマウントベッドホールディングス	9,200	4,900.00	45,080,000
トランザクション	4,600	821.00	3,776,600
S H O - B I	2,600	406.00	1,055,600
ニホンフラッシュ	4,100	2,335.00	9,573,500
前田工織	9,600	1,930.00	18,528,000
永大産業	11,200	504.00	5,644,800
アートネイチャー	9,300	742.00	6,900,600
バンダイナムコホールディングス	90,000	4,185.00	376,650,000

アイフィスジャパン	1,900	724.00	1,375,600
共立印刷	14,200	343.00	4,870,600
S H O E I	4,200	4,405.00	18,501,000
フランスベッドホールディングス	10,100	937.00	9,463,700
パイロットコーポレーション	15,200	6,320.00	96,064,000
萩原工業	4,800	1,791.00	8,596,800
トッパン・フォームズ	18,600	1,052.00	19,567,200
フジシールインターナショナル	19,500	4,005.00	78,097,500
タカラトミー	36,400	1,031.00	37,528,400
廣濟堂	8,100	467.00	3,782,700
A s - m e エステール	2,500	753.00	1,882,500
アーク	43,500	108.00	4,698,000
タカノ	3,700	990.00	3,663,000
プロネクサス	7,500	1,197.00	8,977,500
ホクシン	5,900	161.00	949,900
ウッドワン	2,900	1,293.00	3,749,700
大建工業	6,800	2,199.00	14,953,200
凸版印刷	246,000	856.00	210,576,000
大日本印刷	113,900	2,410.00	274,499,000
図書印刷	5,700	866.00	4,936,200
共同印刷	2,700	2,817.00	7,605,900
N I S S H A	17,900	2,131.00	38,144,900
光村印刷	800	2,323.00	1,858,400
宝印刷	4,500	1,866.00	8,397,000
アシックス	86,400	1,599.00	138,153,600
ツツミ	2,700	2,023.00	5,462,100
小松ウオール工業	2,900	2,125.00	6,162,500
ヤマハ	56,900	5,170.00	294,173,000
河合楽器製作所	2,900	4,735.00	13,731,500
クリナップ	8,100	774.00	6,269,400
ビジョン	52,600	4,970.00	261,422,000
兼松サステック	700	1,904.00	1,332,800
キングジム	7,100	956.00	6,787,600
リンテック	20,700	2,983.00	61,748,100
イトーキ	18,300	585.00	10,705,500
任天堂	53,600	36,670.00	1,965,512,000
三菱鉛筆	14,300	1,972.00	28,199,600
タカラスタンダード	18,000	1,765.00	31,770,000
コクヨ	41,700	1,860.00	77,562,000
ナカバヤシ	8,600	627.00	5,392,200
グローブライド	3,900	2,792.00	10,888,800
オカムラ	30,400	1,464.00	44,505,600



美津濃	8,600	2,941.00	25,292,600
東京電力ホールディングス	694,800	540.00	375,192,000
中部電力	266,300	1,649.50	439,261,850
関西電力	355,100	1,529.00	542,947,900
中国電力	120,300	1,423.00	171,186,900
北陸電力	85,300	1,153.00	98,350,900
東北電力	203,800	1,400.00	285,320,000
四国電力	78,400	1,522.00	119,324,800
九州電力	192,200	1,262.00	242,556,400
北海道電力	87,300	740.00	64,602,000
沖縄電力	17,600	2,252.00	39,635,200
電源開発	69,300	2,970.00	205,821,000
エフオン	5,300	1,179.00	6,248,700
イーレックス	13,600	1,108.00	15,068,800
レノバ	4,500	1,875.00	8,437,500
東京瓦斯	185,700	2,648.00	491,733,600
大阪瓦斯	168,900	2,155.50	364,063,950
東邦瓦斯	43,100	3,600.00	155,160,000
北海道瓦斯	23,000	307.00	7,061,000
広島ガス	17,600	362.00	6,371,200
西部瓦斯	10,600	2,607.00	27,634,200
静岡ガス	26,700	925.00	24,697,500
メタウォーター	4,900	2,996.00	14,680,400
SBSホールディングス	8,600	1,253.00	10,775,800
東武鉄道	91,800	3,115.00	285,957,000
相鉄ホールディングス	27,800	3,285.00	91,323,000
東京急行電鉄	236,400	1,787.00	422,446,800
京浜急行電鉄	119,200	1,889.00	225,168,800
小田急電鉄	129,500	2,385.00	308,857,500
京王電鉄	48,600	5,450.00	264,870,000
京成電鉄	60,600	3,755.00	227,553,000
富士急行	11,900	3,010.00	35,819,000
新京成電鉄	2,200	2,196.00	4,831,200
東日本旅客鉄道	156,300	10,045.00	1,570,033,500
西日本旅客鉄道	78,500	7,468.00	586,238,000
東海旅客鉄道	77,900	22,235.00	1,732,106,500
西武ホールディングス	110,900	1,938.00	214,924,200
鴻池運輸	12,300	1,730.00	21,279,000
西日本鉄道	24,100	2,790.00	67,239,000
ハマキョウレックス	6,200	3,505.00	21,731,000
サカイ引越センター	4,600	5,640.00	25,944,000
近鉄グループホールディングス	82,400	4,340.00	357,616,000

阪急阪神ホールディングス	109,900	4,000.00	439,600,000
南海電気鉄道	39,100	2,817.00	110,144,700
京阪ホールディングス	36,700	4,010.00	147,167,000
神戸電鉄	2,000	3,995.00	7,990,000
名古屋鉄道	66,000	2,583.00	170,478,000
山陽電気鉄道	6,300	2,597.00	16,361,100
日本通運	32,400	6,770.00	219,348,000
ヤマトホールディングス	144,500	3,365.00	486,242,500
山九	21,100	5,660.00	119,426,000
丸運	4,500	337.00	1,516,500
丸全昭和運輸	29,000	540.00	15,660,000
センコーグループホールディングス	49,500	893.00	44,203,500
トナミホールディングス	2,000	6,300.00	12,600,000
ニッコンホールディングス	31,300	2,771.00	86,732,300
日本石油輸送	1,000	3,015.00	3,015,000
福山通運	12,100	5,190.00	62,799,000
セイノーホールディングス	61,700	1,791.00	110,504,700
エスライン	2,200	1,193.00	2,624,600
神奈川中央交通	2,000	3,755.00	7,510,000
日立物流	18,100	3,030.00	54,843,000
丸和運輸機関	4,300	3,380.00	14,534,000
C & F ロジホールディングス	9,000	1,167.00	10,503,000
九州旅客鉄道	69,200	3,335.00	230,782,000
S Gホールディングス	77,900	2,556.00	199,112,400
日本郵船	69,200	2,036.00	140,891,200
商船三井	52,400	2,916.00	152,798,400
川崎汽船	38,400	1,979.00	75,993,600
N S ユナイテッド海運	4,200	2,310.00	9,702,000
飯野海運	43,100	542.00	23,360,200
共栄タンカー	900	1,883.00	1,694,700
乾汽船	6,200	960.00	5,952,000
日本航空	150,900	3,974.00	599,676,600
A N A ホールディングス	160,100	3,843.00	615,264,300
パスコ	8,000	262.00	2,096,000
トランコム	2,300	7,490.00	17,227,000
日新	7,100	2,237.00	15,882,700
三菱倉庫	28,500	2,450.00	69,825,000
三井倉庫ホールディングス	47,000	354.00	16,638,000
住友倉庫	57,000	645.00	36,765,000
澁澤倉庫	4,500	1,638.00	7,371,000
東陽倉庫	14,600	344.00	5,022,400
日本トランスシティ	19,900	517.00	10,288,300

ケイヒン	1,600	1,551.00	2,481,600
中央倉庫	5,000	1,174.00	5,870,000
川西倉庫	1,700	1,549.00	2,633,300
安田倉庫	7,400	932.00	6,896,800
東洋埠頭	2,500	1,665.00	4,162,500
宇徳	6,800	499.00	3,393,200
上組	50,800	2,209.00	112,217,200
サンリツ	2,100	765.00	1,606,500
キムラユニティー	2,200	1,201.00	2,642,200
キューソー流通システム	2,300	2,715.00	6,244,500
近鉄エクスプレス	15,600	2,165.00	33,774,000
東海運	4,500	327.00	1,471,500
エーアイティー	5,900	982.00	5,793,800
内外トランスライン	2,800	1,614.00	4,519,200
日本コンセプト	2,200	1,234.00	2,714,800
NEC ネットエスアイ	9,500	2,552.00	24,244,000
システナ	27,500	1,286.00	35,365,000
デジタルアーツ	4,200	5,150.00	21,630,000
新日鉄住金ソリューションズ	12,800	3,290.00	42,112,000
キューブシステム	5,000	898.00	4,490,000
エイジア	1,900	1,355.00	2,574,500
コア	3,700	1,223.00	4,525,100
ソリトンシステムズ	4,900	1,000.00	4,900,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,200	1,638.00	6,879,600
T I S	28,500	5,110.00	145,635,000
ネオス	2,600	665.00	1,729,000
電算システム	3,300	2,026.00	6,685,800
グリー	46,100	508.00	23,418,800
コーエーテクモホールディングス	14,600	2,257.00	32,952,200
三菱総合研究所	3,400	3,840.00	13,056,000
電算	1,000	2,195.00	2,195,000
A G S	4,900	768.00	3,763,200
ファインデックス	7,400	713.00	5,276,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,000	1,676.00	3,352,000
ブレインパッド	1,900	4,480.00	8,512,000
K L a b	15,900	879.00	13,976,100
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,200	2,361.00	14,638,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,400	2,078.00	2,909,200
ネクソン	217,000	1,327.00	287,959,000
アイスタイル	21,800	1,203.00	26,225,400
エムアップ	2,900	2,302.00	6,675,800
エイチーム	5,400	2,043.00	11,032,200

テクノスジャパン	7,900	908.00	7,173,200
コロプラ	24,600	662.00	16,285,200
ブロードリーフ	42,500	683.00	29,027,500
クロス・マーケティンググループ	2,600	524.00	1,362,400
デジタルハーツホールディングス	4,600	1,353.00	6,223,800
メディアドゥホールディングス	2,800	2,446.00	6,848,800
じげん	9,200	799.00	7,350,800
サイバーリンクス	1,400	1,006.00	1,408,400
フィックスターズ	8,300	1,468.00	12,184,400
VOYAGE GROUP	4,600	1,376.00	6,329,600
オブティム	1,500	3,455.00	5,182,500
セレス	2,900	1,489.00	4,318,100
ベリサーブ	1,200	4,215.00	5,058,000
ティーガイア	8,600	2,850.00	24,510,000
セック	1,200	3,620.00	4,344,000
日本アジアグループ	9,000	405.00	3,645,000
豆蔵ホールディングス	6,500	864.00	5,616,000
テクマトリックス	4,800	2,048.00	9,830,400
プロシップ	1,300	2,497.00	3,246,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	206,100	221.00	45,548,100
GMOペイメントゲートウェイ	7,000	11,230.00	78,610,000
ザッパラス	4,400	380.00	1,672,000
システムリサーチ	1,200	3,430.00	4,116,000
インターネットイニシアティブ	14,000	2,138.00	29,932,000
さくらインターネット	10,400	636.00	6,614,400
ヴィンクス	2,500	1,087.00	2,717,500
GMOクラウド	1,900	3,710.00	7,049,000
SRAホールディングス	4,600	3,195.00	14,697,000
Minor iソリューションズ	1,800	1,376.00	2,476,800
朝日ネット	7,900	503.00	3,973,700
eBASE	2,300	1,687.00	3,880,100
アバント	2,400	1,340.00	3,216,000
アドソル日進	3,300	1,777.00	5,864,100
フリービット	5,900	965.00	5,693,500
コムチュア	4,400	3,335.00	14,674,000
サイバーコム	1,600	1,503.00	2,404,800
インフォテリア	4,300	1,001.00	4,304,300
マークラインズ	3,000	1,722.00	5,166,000
メディカル・データ・ビジョン	7,700	1,456.00	11,211,200
gumi	9,800	643.00	6,301,400
ショーケース・ティービー	2,000	915.00	1,830,000
モバイルファクトリー	2,400	1,744.00	4,185,600

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	1,230.00	4,797,000
P C Iホールディングス	1,600	2,656.00	4,249,600
パイブドHD	1,400	987.00	1,381,800
アイビーシー	1,500	1,445.00	2,167,500
ネオジャパン	2,100	1,188.00	2,494,800
ランドコンピュータ	1,000	1,085.00	1,085,000
オープンドア	3,400	2,363.00	8,034,200
マイネット	2,800	1,065.00	2,982,000
アカツキ	2,300	3,175.00	7,302,500
ベネフィットジャパン	600	971.00	582,600
U b i c o mホールディングス	1,400	1,037.00	1,451,800
L I N E	26,000	4,700.00	122,200,000
ノムラシステムコーポレーション	800	1,233.00	986,400
シンクロ・フード	3,000	919.00	2,757,000
オークネット	4,600	1,320.00	6,072,000
A O I T Y O H o l d i n g s	9,400	1,400.00	13,160,000
マクロミル	10,800	2,689.00	29,041,200
ビーグリー	2,000	1,185.00	2,370,000
オロ	900	4,500.00	4,050,000
ソルクシーズ	3,700	967.00	3,577,900
フェイス	3,100	1,219.00	3,778,900
ハイマックス	1,200	1,862.00	2,234,400
野村総合研究所	54,300	5,130.00	278,559,000
サイバネットシステム	7,100	798.00	5,665,800
C Eホールディングス	2,400	751.00	1,802,400
日本システム技術	1,500	1,813.00	2,719,500
インテージホールディングス	10,200	941.00	9,598,200
東邦システムサイエンス	2,900	867.00	2,514,300
ソースネクスト	12,300	841.00	10,344,300
F I G	7,900	311.00	2,456,900
フォーカスシステムズ	5,000	896.00	4,480,000
クレスコ	2,000	2,615.00	5,230,000
フジ・メディア・ホールディングス	88,700	1,920.00	170,304,000
オービック	26,900	9,640.00	259,316,000
ジャストシステム	14,000	1,828.00	25,592,000
T D Cソフト	3,800	1,791.00	6,805,800
ヤフー	616,300	391.00	240,973,300
トレンドマイクロ	45,500	6,490.00	295,295,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,509.00	4,225,200
日本オラクル	13,900	8,980.00	124,822,000
アルファシステムズ	2,900	2,600.00	7,540,000
フューチャー	11,700	1,655.00	19,363,500

CAC Holdings	6,600	1,025.00	6,765,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	2,216.00	8,199,200
トーセ	2,400	985.00	2,364,000
オービックビジネスコンサルタント	4,400	8,600.00	37,840,000
伊藤忠テクノソリューションズ	39,000	2,240.00	87,360,000
アイティフォー	10,400	956.00	9,942,400
東計電算	1,500	2,939.00	4,408,500
エクスネット	1,500	920.00	1,380,000
大塚商会	46,300	3,800.00	175,940,000
サイボウズ	11,400	627.00	7,147,800
ソフトブレーン	6,900	419.00	2,891,100
電通国際情報サービス	5,300	3,615.00	19,159,500
デジタルガレージ	15,400	3,790.00	58,366,000
EMシステムズ	5,900	1,051.00	6,200,900
ウェザーニューズ	2,900	3,180.00	9,222,000
C I J	6,800	732.00	4,977,600
東洋ビジネスエンジニアリング	900	1,980.00	1,782,000
日本エンタープライズ	9,400	210.00	1,974,000
WOWOW	4,100	3,325.00	13,632,500
スカラ	7,000	1,085.00	7,595,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,500	631.00	4,732,500
ネットワンシステムズ	34,900	2,241.00	78,210,900
システムソフト	20,700	118.00	2,442,600
アルゴグラフィックス	4,000	3,940.00	15,760,000
マーベラス	14,600	816.00	11,913,600
エイベックス	15,900	1,399.00	22,244,100
日本ユニシス	23,800	2,561.00	60,951,800
兼松エレクトロニクス	5,500	3,315.00	18,232,500
東京放送ホールディングス	47,300	2,210.00	104,533,000
日本テレビホールディングス	78,500	1,774.00	139,259,000
朝日放送グループホールディングス	8,700	795.00	6,916,500
テレビ朝日ホールディングス	23,500	2,063.00	48,480,500
スカパーJ S A Tホールディングス	65,300	517.00	33,760,100
テレビ東京ホールディングス	7,100	2,621.00	18,609,100
日本BS放送	3,000	1,349.00	4,047,000
ビジョン	2,700	4,540.00	12,258,000
ワイヤレスゲート	4,100	715.00	2,931,500
コネクシオ	6,100	2,084.00	12,712,400
クロップス	2,000	737.00	1,474,000
日本電信電話	613,000	5,141.00	3,151,433,000
KDDI	752,700	3,116.00	2,345,413,200
光通信	10,300	19,660.00	202,498,000

NTTドコモ	613,300	2,937.50	1,801,568,750
エムティーアイ	10,100	612.00	6,181,200
GMOインターネット	31,200	1,686.00	52,603,200
アイドママーケティングコミュニケーション	2,000	690.00	1,380,000
カドカワ	24,900	1,194.00	29,730,600
学研ホールディングス	2,900	4,360.00	12,644,000
ゼンリン	15,500	3,085.00	47,817,500
昭文社	4,100	660.00	2,706,000
インプレスホールディングス	6,900	175.00	1,207,500
アイネット	4,900	1,803.00	8,834,700
松竹	5,700	13,310.00	75,867,000
東宝	56,200	3,320.00	186,584,000
東映	3,200	12,350.00	39,520,000
エヌ・ティ・ティ・データ	265,400	1,350.00	358,290,000
ピー・シー・エー	1,400	1,552.00	2,172,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	1,975.00	2,962,500
D T S	8,900	4,125.00	36,712,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,800	4,630.00	184,274,000
シーイーシー	10,200	2,217.00	22,613,400
カブコン	36,700	2,417.00	88,703,900
アイ・エス・ビー	1,700	2,108.00	3,583,600
ジャステック	5,000	1,124.00	5,620,000
S C S K	19,700	4,895.00	96,431,500
日本システムウエア	2,900	1,952.00	5,660,800
アイネス	10,900	1,174.00	12,796,600
T K C	7,300	4,020.00	29,346,000
富士ソフト	12,800	4,690.00	60,032,000
N S D	14,100	2,258.00	31,837,800
コナミホールディングス	34,900	4,620.00	161,238,000
福井コンピュータホールディングス	2,600	1,917.00	4,984,200
J B C Cホールディングス	6,900	1,235.00	8,521,500
ミロク情報サービス	7,600	2,258.00	17,160,800
ソフトバンクグループ	386,700	9,984.00	3,860,812,800
ハウスイ	700	1,028.00	719,600
高千穂交易	3,200	1,033.00	3,305,600
伊藤忠食品	2,100	5,650.00	11,865,000
エレマテック	4,000	2,319.00	9,276,000
J A L U X	2,400	2,821.00	6,770,400
あらた	4,400	4,995.00	21,978,000
トーマンデバイス	1,300	2,681.00	3,485,300
東京エレクトロン デバイス	3,100	1,950.00	6,045,000
フィールズ	6,600	917.00	6,052,200

双日	507,300	383.00	194,295,900
アルフレッサ ホールディングス	95,300	2,560.00	243,968,000
横浜冷凍	22,000	908.00	19,976,000
神栄	1,200	1,170.00	1,404,000
ラサ商事	3,700	978.00	3,618,600
ラクーン	4,900	510.00	2,499,000
アルコニックス	9,100	1,440.00	13,104,000
神戸物産	6,500	5,230.00	33,995,000
ペッパーフードサービス	6,700	4,115.00	27,570,500
あい ホールディングス	13,800	2,248.00	31,022,400
ディーブイエックス	3,100	1,369.00	4,243,900
ダイワボウホールディングス	7,300	6,270.00	45,771,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,400	1,859.00	30,487,600
ラクト・ジャパン	1,900	6,060.00	11,514,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,200	1,185.00	19,197,000
八洲電機	6,500	898.00	5,837,000
メディアスホールディングス	4,700	836.00	3,929,200
U K Cホールディングス	5,500	2,155.00	11,852,500
ジューテックホールディングス	1,900	1,000.00	1,900,000
大光	2,100	710.00	1,491,000
O C H Iホールディングス	2,500	1,273.00	3,182,500
T O K A Iホールディングス	45,200	1,031.00	46,601,200
C o m i n i x	1,300	871.00	1,132,300
三洋貿易	4,300	1,991.00	8,561,300
ビューティガレージ	1,200	2,015.00	2,418,000
ウイン・パートナーズ	6,200	1,324.00	8,208,800
ミタチ産業	2,100	857.00	1,799,700
シップヘルスケアホールディングス	17,900	4,050.00	72,495,000
明治電機工業	2,900	1,922.00	5,573,800
デリカフーズホールディングス	1,700	1,492.00	2,536,400
スターティアホールディングス	1,900	649.00	1,233,100
コメダホールディングス	15,900	2,105.00	33,469,500
富士興産	3,300	622.00	2,052,600
協栄産業	1,000	1,882.00	1,882,000
小野建	7,600	1,762.00	13,391,200
佐島電機	6,200	947.00	5,871,400
エコトレーディング	2,000	671.00	1,342,000
伯東	5,200	1,485.00	7,722,000
コンドーテック	6,700	1,008.00	6,753,600
中山福	4,900	703.00	3,444,700
ナガイレーベン	12,400	2,664.00	33,033,600
三菱食品	9,400	2,946.00	27,692,400



松田産業	6,300	1,498.00	9,437,400
第一興商	12,800	4,930.00	63,104,000
メディパルホールディングス	85,900	2,119.00	182,022,100
S P K	1,800	2,500.00	4,500,000
萩原電気ホールディングス	3,100	3,140.00	9,734,000
アズワン	6,700	7,790.00	52,193,000
スズデン	3,000	1,371.00	4,113,000
尾家産業	2,500	1,343.00	3,357,500
シモジマ	5,300	1,015.00	5,379,500
ドウシシャ	9,100	2,184.00	19,874,400
小津産業	1,900	1,982.00	3,765,800
高速	5,100	1,174.00	5,987,400
たけびし	3,000	1,562.00	4,686,000
リックス	1,900	1,657.00	3,148,300
丸文	7,500	812.00	6,090,000
ハピネット	5,900	1,723.00	10,165,700
橋本総業ホールディングス	1,800	1,635.00	2,943,000
日本ライフライン	24,400	2,016.00	49,190,400
エクセル	2,900	2,100.00	6,090,000
マルカキカイ	2,800	1,997.00	5,591,600
I D O M	25,900	365.00	9,453,500
日本エム・ディ・エム	5,600	972.00	5,443,200
進和	5,100	2,202.00	11,230,200
エスケイジャパン	2,100	573.00	1,203,300
ダイトロン	3,900	1,934.00	7,542,600
シークス	10,900	2,279.00	24,841,100
田中商事	2,600	675.00	1,755,000
オーハシテクニカ	4,800	1,598.00	7,670,400
白銅	3,100	1,873.00	5,806,300
伊藤忠商事	629,100	1,897.50	1,193,717,250
丸紅	704,500	895.30	630,738,850
高島	1,500	2,056.00	3,084,000
長瀬産業	51,700	1,696.00	87,683,200
蝶理	5,500	1,920.00	10,560,000
豊田通商	95,700	3,705.00	354,568,500
三共生興	14,400	467.00	6,724,800
兼松	36,500	1,580.00	57,670,000
ツカモトコーポレーション	1,500	1,202.00	1,803,000
三井物産	706,300	1,800.50	1,271,693,150
日本紙パルプ商事	4,500	4,355.00	19,597,500
日立ハイテクノロジーズ	29,800	4,115.00	122,627,000
カメイ	11,200	1,350.00	15,120,000

東都水産	1,300	1,932.00	2,511,600
OUGホールディングス	1,400	2,730.00	3,822,000
スターゼン	3,400	4,430.00	15,062,000
山善	33,500	1,160.00	38,860,000
椿本興業	1,900	3,230.00	6,137,000
住友商事	540,700	1,806.50	976,774,550
内田洋行	3,900	3,290.00	12,831,000
三菱商事	601,600	3,122.00	1,878,195,200
第一実業	3,900	3,550.00	13,845,000
キャノンマーケティングジャパン	24,500	2,312.00	56,644,000
西華産業	5,200	2,003.00	10,415,600
佐藤商事	7,700	1,128.00	8,685,600
菱洋エレクトロ	8,000	1,678.00	13,424,000
東京産業	8,600	763.00	6,561,800
ユアサ商事	8,100	3,750.00	30,375,000
神鋼商事	1,900	3,180.00	6,042,000
小林産業	5,500	306.00	1,683,000
阪和興業	16,000	3,645.00	58,320,000
正栄食品工業	4,600	3,855.00	17,733,000
カナデン	8,200	1,133.00	9,290,600
菱電商事	6,200	1,562.00	9,684,400
フルサト工業	4,700	1,724.00	8,102,800
岩谷産業	19,000	3,870.00	73,530,000
すてきナイスグループ	3,700	1,254.00	4,639,800
昭光通商	3,000	872.00	2,616,000
ニチモウ	1,300	1,639.00	2,130,700
極東貿易	12,000	372.00	4,464,000
イワキ	11,800	495.00	5,841,000
三愛石油	23,000	1,342.00	30,866,000
稲畑産業	20,600	1,568.00	32,300,800
G S Iクレオス	2,300	1,423.00	3,272,900
明和産業	7,700	474.00	3,649,800
ワキタ	18,300	1,260.00	23,058,000
東邦ホールディングス	25,400	2,791.00	70,891,400
サンゲツ	28,100	2,082.00	58,504,200
ミツウロコグループホールディングス	12,400	782.00	9,696,800
シナネンホールディングス	3,500	2,590.00	9,065,000
伊藤忠エネクス	18,900	1,027.00	19,410,300
サンリオ	24,100	2,300.00	55,430,000
サンワテクノス	5,600	1,374.00	7,694,400
リョーサン	9,500	4,030.00	38,285,000
新光商事	9,400	1,572.00	14,776,800

トーホー	3,900	2,151.00	8,388,900
三信電気	7,900	1,829.00	14,449,100
東陽テクニカ	9,900	897.00	8,880,300
モスフードサービス	11,300	2,920.00	32,996,000
加賀電子	7,800	2,032.00	15,849,600
ソーダニッカ	8,900	621.00	5,526,900
立花エレテック	5,800	1,865.00	10,817,000
フォーバル	3,700	862.00	3,189,400
PALTAC	12,000	5,400.00	64,800,000
三谷産業	9,700	332.00	3,220,400
西本Wismettacホールディングス	2,300	4,445.00	10,223,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,463.00	1,024,100
国際紙パルプ商事	15,100	371.00	5,602,100
ヤマタネ	4,300	2,024.00	8,703,200
丸紅建材リース	8,000	251.00	2,008,000
日鉄住金物産	6,700	5,400.00	36,180,000
泉州電業	2,900	2,989.00	8,668,100
トラスコ中山	17,800	2,811.00	50,035,800
オートバックスセブン	34,100	1,848.00	63,016,800
モリト	6,800	842.00	5,725,600
加藤産業	13,400	3,555.00	47,637,000
イノテック	7,400	1,270.00	9,398,000
イエローハット	8,100	2,966.00	24,024,600
J Kホールディングス	8,500	752.00	6,392,000
日伝	7,100	1,997.00	14,178,700
北沢産業	6,900	243.00	1,676,700
杉本商事	4,600	1,826.00	8,399,600
因幡電機産業	11,400	4,575.00	52,155,000
バイテックホールディングス	3,900	1,879.00	7,328,100
東テク	2,800	2,758.00	7,722,400
ミスミグループ本社	99,600	2,848.00	283,660,800
アルテック	7,200	321.00	2,311,200
タキヒヨー	2,900	2,234.00	6,478,600
蔵王産業	1,400	1,528.00	2,139,200
スズケン	39,100	4,735.00	185,138,500
ジェコス	5,800	1,138.00	6,600,400
ルネサスイーストン	7,700	516.00	3,973,200
ローソン	21,700	6,700.00	145,390,000
サンエー	6,500	4,935.00	32,077,500
カワチ薬品	6,700	2,034.00	13,627,800
エービーシー・マート	15,600	5,980.00	93,288,000
ハードオフコーポレーション	3,800	955.00	3,629,000

アスクール	7,500	3,335.00	25,012,500
ゲオホールディングス	15,700	1,536.00	24,115,200
アダストリア	13,300	1,309.00	17,409,700
ジーフット	5,200	774.00	4,024,800
くらコーポレーション	5,000	6,420.00	32,100,000
キャンドウ	4,100	1,671.00	6,851,100
パルグループホールディングス	4,400	2,487.00	10,942,800
エディオン	33,400	1,229.00	41,048,600
サーラコーポレーション	17,400	664.00	11,553,600
ワッツ	2,900	1,001.00	2,902,900
ハローズ	3,300	2,503.00	8,259,900
あみやき亭	1,900	4,300.00	8,170,000
ひらまつ	11,800	437.00	5,156,600
大黒天物産	2,100	4,330.00	9,093,000
ハニーズホールディングス	8,400	1,019.00	8,559,600
ファーマライズホールディングス	2,100	577.00	1,211,700
アルペン	6,600	1,983.00	13,087,800
ハブ	2,200	934.00	2,054,800
クオール	9,500	2,033.00	19,313,500
ジーンズ	5,800	6,160.00	35,728,000
ビックカメラ	45,800	1,408.00	64,486,400
D C Mホールディングス	46,200	1,010.00	46,662,000
Monotaro	27,100	5,380.00	145,798,000
東京一番フーズ	2,200	648.00	1,425,600
DDホールディングス	1,900	2,551.00	4,846,900
きちり	2,400	768.00	1,843,200
アークランドサービスホールディングス	7,000	2,044.00	14,308,000
J.フロント リテイリング	102,400	1,586.00	162,406,400
ドトール・日レスホールディングス	15,100	2,020.00	30,502,000
マツモトキヨシホールディングス	35,500	4,090.00	145,195,000
ブロンコビリー	4,500	3,270.00	14,715,000
スタートトゥデイ	84,200	3,510.00	295,542,000
トレジャー・ファクトリー	2,600	761.00	1,978,600
物語コーポレーション	2,400	8,730.00	20,952,000
ココカラファイン	9,000	6,190.00	55,710,000
三越伊勢丹ホールディングス	160,400	1,193.00	191,357,200
Hamee	2,200	1,437.00	3,161,400
ウエルシアホールディングス	22,700	5,200.00	118,040,000
クリエイティブSDホールディングス	12,700	2,530.00	32,131,000
丸善CHIホールディングス	9,700	359.00	3,482,300
ティーライフ	1,200	1,227.00	1,472,400
エー・ピーカンパニー	1,700	557.00	946,900

チムニー	2,600	2,840.00	7,384,000
シュッピン	5,200	1,453.00	7,555,600
ネクステージ	13,200	695.00	9,174,000
ジョイフル本田	25,200	1,583.00	39,891,600
鳥貴族	2,900	2,170.00	6,293,000
キリン堂ホールディングス	3,100	1,778.00	5,511,800
ホットランド	4,900	1,234.00	6,046,600
すかいらーくホールディングス	79,900	1,621.00	129,517,900
綿半ホールディングス	3,200	2,674.00	8,556,800
ヨシックス	1,400	2,691.00	3,767,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,500	1,235.00	35,197,500
ブックオフコーポレーション	4,800	772.00	3,705,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,500	772.00	2,702,000
B E E N O S	2,000	1,820.00	3,640,000
あさひ	6,400	1,412.00	9,036,800
日本調剤	3,100	3,185.00	9,873,500
コスモス薬品	4,300	24,050.00	103,415,000
トーエル	4,200	928.00	3,897,600
一六堂	2,000	377.00	754,000
オンリー	1,500	971.00	1,456,500
セブン&アイ・ホールディングス	359,300	4,613.00	1,657,450,900
薬王堂	3,800	3,600.00	13,680,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	23,100	1,345.00	31,069,500
ツルハホールディングス	18,600	12,350.00	229,710,000
サンマルクホールディングス	6,200	2,629.00	16,299,800
フェリシモ	2,200	1,227.00	2,699,400
トリドールホールディングス	10,600	2,385.00	25,281,000
T O K Y O B A S E	7,600	575.00	4,370,000
ウイルプラスホールディングス	900	998.00	898,200
サツドラホールディングス	1,500	1,990.00	2,985,000
ダイユー・リックホールディングス	4,100	1,198.00	4,911,800
パロックジャパンリミテッド	6,800	1,017.00	6,915,600
クスリのアオキホールディングス	6,800	8,880.00	60,384,000
力の源ホールディングス	1,900	1,104.00	2,097,600
スシローグローバルホールディングス	9,400	6,010.00	56,494,000
L I X I L ビバ	10,900	1,801.00	19,630,900
メディカルシステムネットワーク	10,000	462.00	4,620,000
総合メディカル	7,500	2,266.00	16,995,000
はるやまホールディングス	4,000	936.00	3,744,000
ノジマ	15,200	2,313.00	35,157,600
カップ・クリエイト	10,700	1,316.00	14,081,200

ライトオン	7,300	1,028.00	7,504,400
良品計画	11,400	33,150.00	377,910,000
三城ホールディングス	10,800	442.00	4,773,600
アドヴァン	8,700	977.00	8,499,900
アルビス	2,800	2,979.00	8,341,200
コナカ	11,100	499.00	5,538,900
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,821.00	2,003,100
G - 7ホールディングス	2,600	2,564.00	6,666,400
イオン北海道	8,700	788.00	6,855,600
コジマ	12,800	494.00	6,323,200
ヒマラヤ	2,700	996.00	2,689,200
コーナン商事	12,200	2,474.00	30,182,800
エコス	3,500	1,616.00	5,656,000
ワタミ	10,200	1,201.00	12,250,200
マルシェ	2,300	815.00	1,874,500
ドンキホーテホールディングス	55,600	5,150.00	286,340,000
西松屋チェーン	18,900	1,164.00	21,999,600
ゼンショーホールディングス	44,500	2,179.00	96,965,500
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,592.00	7,960,000
ハークスレイ	2,100	1,037.00	2,177,700
サイゼリヤ	14,200	2,194.00	31,154,800
V Tホールディングス	29,200	504.00	14,716,800
魚力	2,400	1,503.00	3,607,200
ポブラ	2,200	760.00	1,672,000
フジ・コーポレーション	1,700	2,572.00	4,372,400
ユナイテッドアローズ	10,600	3,980.00	42,188,000
ハイデイ日高	11,300	2,223.00	25,119,900
京都きもの友禅	5,500	564.00	3,102,000
コロワイド	28,500	3,000.00	85,500,000
ピーシーデポコーポレーション	12,900	554.00	7,146,600
壱番屋	6,100	4,495.00	27,419,500
P L A N T	2,000	1,289.00	2,578,000
スギホールディングス	18,800	5,760.00	108,288,000
ヴィア・ホールディングス	10,300	709.00	7,302,700
スクロール	13,300	797.00	10,600,100
ヨンドシーホールディングス	8,800	2,261.00	19,896,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	27,400	10,230.00	280,302,000
木曽路	10,500	2,617.00	27,478,500
S R Sホールディングス	10,200	1,000.00	10,200,000
タカキュー	6,700	201.00	1,346,700
ケーヨー	16,000	530.00	8,480,000
上新電機	10,100	2,979.00	30,087,900

日本瓦斯	15,800	4,845.00	76,551,000
ロイヤルホールディングス	15,200	2,755.00	41,876,000
いなげや	9,600	1,617.00	15,523,200
鳥忠	19,400	3,420.00	66,348,000
チヨダ	10,200	2,176.00	22,195,200
ライフコーポレーション	6,500	2,648.00	17,212,000
リンガーハット	10,600	2,406.00	25,503,600
MrMaxHD	10,600	575.00	6,095,000
テンアライド	7,700	452.00	3,480,400
AOKIホールディングス	17,200	1,532.00	26,350,400
オークワ	12,000	1,090.00	13,080,000
コメリ	13,300	2,663.00	35,417,900
青山商事	16,500	3,345.00	55,192,500
しまむら	10,000	9,990.00	99,900,000
はせがわ	4,600	491.00	2,258,600
高島屋	135,000	902.00	121,770,000
松屋	17,300	1,162.00	20,102,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	40,600	1,687.00	68,492,200
近鉄百貨店	3,300	3,765.00	12,424,500
パルコ	8,300	1,194.00	9,910,200
丸井グループ	78,600	2,344.00	184,238,400
アクシアル リテイリング	7,100	3,750.00	26,625,000
イオン	329,900	2,352.50	776,089,750
イズミ	15,500	6,330.00	98,115,000
東武ストア	1,000	3,930.00	3,930,000
平和堂	17,400	2,727.00	47,449,800
フジ	10,300	1,997.00	20,569,100
ヤオコー	9,700	6,000.00	58,200,000
ゼビオホールディングス	11,700	1,609.00	18,825,300
ケースホールディングス	75,600	1,255.00	94,878,000
Olympicグループ	5,000	876.00	4,380,000
日産東京販売ホールディングス	12,500	347.00	4,337,500
Genky DrugStores	3,400	3,610.00	12,274,000
アインホールディングス	11,500	8,030.00	92,345,000
元気寿司	2,200	4,730.00	10,406,000
ヤマダ電機	287,400	542.00	155,770,800
アーランドサカモト	14,600	1,429.00	20,863,400
ニトリホールディングス	34,000	15,800.00	537,200,000
グルメ杵屋	6,000	1,200.00	7,200,000
愛眼	6,600	340.00	2,244,000
ケーユーホールディングス	4,500	861.00	3,874,500
吉野家ホールディングス	28,200	1,859.00	52,423,800

松屋フーズ	4,100	3,605.00	14,780,500
サガミチェーン	11,500	1,384.00	15,916,000
関西スーパーマーケット	6,400	1,126.00	7,206,400
王将フードサービス	6,300	6,830.00	43,029,000
プレナス	9,600	1,764.00	16,934,400
ミニストップ	6,400	2,050.00	13,120,000
アークス	16,100	2,692.00	43,341,200
パローホールディングス	20,000	2,236.00	44,720,000
藤久	700	1,431.00	1,001,700
ベルク	3,800	5,440.00	20,672,000
大庄	4,600	1,728.00	7,948,800
ファーストリテイリング	11,500	48,960.00	563,040,000
サンドラッグ	32,300	3,925.00	126,777,500
サクスパー ホールディングス	8,200	886.00	7,265,200
ヤマザワ	1,800	1,792.00	3,225,600
やまや	1,800	2,697.00	4,854,600
ペルーナ	21,000	1,128.00	23,688,000
島根銀行	1,800	1,217.00	2,190,600
じもとホールディングス	57,900	178.00	10,306,200
めぶきフィナンシャルグループ	446,100	390.00	173,979,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	11,600	2,376.00	27,561,600
九州フィナンシャルグループ	140,900	543.00	76,508,700
ゆうちょ銀行	243,200	1,295.00	314,944,000
富山第一銀行	21,800	452.00	9,853,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	512,600	536.00	274,753,600
西日本フィナンシャルホールディングス	55,000	1,253.00	68,915,000
関西みらいフィナンシャルグループ	37,500	1,019.00	38,212,500
三十三フィナンシャルグループ	7,200	2,117.00	15,242,400
新生銀行	70,000	1,680.00	117,600,000
あおぞら銀行	51,100	3,910.00	199,801,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,010,000	673.20	4,045,932,000
りそなホールディングス	942,100	614.20	578,637,820
三井住友トラスト・ホールディングス	168,800	4,389.00	740,863,200
三井住友フィナンシャルグループ	649,800	4,351.00	2,827,279,800
第四銀行	10,500	4,370.00	45,885,000
北越銀行	8,600	2,201.00	18,928,600
千葉銀行	304,100	731.00	222,297,100
群馬銀行	174,400	554.00	96,617,600
武蔵野銀行	13,700	3,090.00	42,333,000
千葉興業銀行	23,400	510.00	11,934,000
筑波銀行	35,600	267.00	9,505,200
七十七銀行	26,900	2,522.00	67,841,800



青森銀行	6,700	3,200.00	21,440,000
秋田銀行	5,500	2,818.00	15,499,000
山形銀行	9,600	2,436.00	23,385,600
岩手銀行	6,000	5,080.00	30,480,000
東邦銀行	76,600	405.00	31,023,000
東北銀行	4,400	1,346.00	5,922,400
みちのく銀行	5,500	1,796.00	9,878,000
ふくおかフィナンシャルグループ	349,000	577.00	201,373,000
静岡銀行	216,100	975.00	210,697,500
十六銀行	11,500	2,806.00	32,269,000
スルガ銀行	87,800	778.00	68,308,400
八十二銀行	155,400	498.00	77,389,200
山梨中央銀行	53,000	391.00	20,723,000
大垣共立銀行	13,600	2,774.00	37,726,400
福井銀行	7,300	2,269.00	16,563,700
北國銀行	9,700	4,270.00	41,419,000
清水銀行	3,500	2,117.00	7,409,500
富山銀行	1,700	4,220.00	7,174,000
滋賀銀行	81,000	574.00	46,494,000
南都銀行	10,000	2,845.00	28,450,000
百五銀行	82,200	441.00	36,250,200
京都銀行	32,800	5,530.00	181,384,000
紀陽銀行	32,300	1,686.00	54,457,800
ほくほくフィナンシャルグループ	57,100	1,522.00	86,906,200
広島銀行	126,700	745.00	94,391,500
山陰合同銀行	50,800	918.00	46,634,400
中国銀行	59,400	1,178.00	69,973,200
鳥取銀行	2,700	1,653.00	4,463,100
伊予銀行	122,500	723.00	88,567,500
百十四銀行	91,000	327.00	29,757,000
四国銀行	13,200	1,286.00	16,975,200
阿波銀行	69,000	698.00	48,162,000
大分銀行	4,900	3,855.00	18,889,500
宮崎銀行	5,700	3,205.00	18,268,500
佐賀銀行	5,200	2,241.00	11,653,200
十八銀行	53,000	312.00	16,536,000
沖縄銀行	8,400	4,135.00	34,734,000
琉球銀行	16,700	1,511.00	25,233,700
セブン銀行	322,200	349.00	112,447,800
みずほフィナンシャルグループ	11,665,300	193.90	2,261,901,670
高知銀行	3,000	1,130.00	3,390,000
山口フィナンシャルグループ	107,200	1,216.00	130,355,200

長野銀行	2,800	1,766.00	4,944,800
名古屋銀行	6,900	3,835.00	26,461,500
北洋銀行	129,100	378.00	48,799,800
愛知銀行	2,900	5,020.00	14,558,000
中京銀行	3,500	2,312.00	8,092,000
大光銀行	2,900	2,040.00	5,916,000
愛媛銀行	12,000	1,211.00	14,532,000
トマト銀行	3,300	1,449.00	4,781,700
京葉銀行	76,000	470.00	35,720,000
栃木銀行	44,100	367.00	16,184,700
北日本銀行	2,700	2,639.00	7,125,300
東和銀行	15,100	976.00	14,737,600
福島銀行	7,300	667.00	4,869,100
大東銀行	4,100	1,214.00	4,977,400
トモニホールディングス	70,600	469.00	33,111,400
フィデアホールディングス	82,800	171.00	14,158,800
池田泉州ホールディングス	90,900	388.00	35,269,200
F P G	27,600	1,159.00	31,988,400
マーキュリアインベストメント	3,400	935.00	3,179,000
S B Iホールディングス	97,100	2,773.00	269,258,300
ジャフコ	12,400	3,795.00	47,058,000
大和証券グループ本社	735,000	650.60	478,191,000
野村ホールディングス	1,477,200	507.80	750,122,160
岡三証券グループ	73,000	522.00	38,106,000
丸三証券	27,500	937.00	25,767,500
東洋証券	31,000	236.00	7,316,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	95,300	627.00	59,753,100
光世証券	2,100	1,130.00	2,373,000
水戸証券	25,200	377.00	9,500,400
いちよし証券	18,100	1,084.00	19,620,400
松井証券	42,100	1,154.00	48,583,400
だいこう証券ビジネス	4,300	537.00	2,309,100
マネックスグループ	87,500	519.00	45,412,500
カブドットコム証券	55,000	361.00	19,855,000
極東証券	11,600	1,412.00	16,379,200
岩井コスモホールディングス	8,900	1,432.00	12,744,800
藍澤證券	16,200	714.00	11,566,800
マネーパートナーズグループ	11,200	364.00	4,076,800
かんぽ生命保険	32,400	2,396.00	77,630,400
S O M P Oホールディングス	168,400	4,671.00	786,596,400
アニコム ホールディングス	5,900	3,655.00	21,564,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	224,500	3,456.00	775,872,000

ソニーフィナンシャルホールディングス	70,500	2,170.00	152,985,000
第一生命ホールディングス	485,600	2,058.50	999,607,600
東京海上ホールディングス	323,400	5,341.00	1,727,279,400
アドバンテッジリスクマネジメント	2,700	1,022.00	2,759,400
T & Dホールディングス	265,500	1,652.00	438,606,000
アドバンスクリエイト	2,000	2,227.00	4,454,000
全国保証	24,200	4,535.00	109,747,000
ジェイリース	1,600	713.00	1,140,800
イントラスト	1,800	530.00	954,000
アルヒ	9,800	2,804.00	27,479,200
クレディセゾン	65,100	1,789.00	116,463,900
アクリーティブ	4,600	248.00	1,140,800
芙蓉総合リース	9,800	6,300.00	61,740,000
興銀リース	16,100	2,727.00	43,904,700
東京センチュリー	17,300	5,730.00	99,129,000
日本証券金融	35,100	608.00	21,340,800
アイフル	144,100	334.00	48,129,400
リコーリース	6,800	3,500.00	23,800,000
イオンフィナンシャルサービス	60,900	2,293.00	139,643,700
アコム	172,500	426.00	73,485,000
ジャックス	10,400	2,352.00	24,460,800
オリエントコーポレーション	185,300	151.00	27,980,300
日立キャピタル	23,600	2,868.00	67,684,800
アプラスフィナンシャル	41,200	106.00	4,367,200
オリックス	572,700	1,735.00	993,634,500
三菱UFJリース	217,900	604.00	131,611,600
九州リースサービス	3,600	711.00	2,559,600
日本取引所グループ	246,400	1,875.00	462,000,000
イー・ギャランティ	9,000	1,009.00	9,081,000
アサックス	3,500	585.00	2,047,500
NECキャピタルソリューション	3,500	1,804.00	6,314,000
いちご	122,800	435.00	53,418,000
日本駐車場開発	103,800	168.00	17,438,400
ヒューリック	179,200	1,023.00	183,321,600
三栄建築設計	3,500	1,872.00	6,552,000
スター・マイカ	4,000	2,017.00	8,068,000
野村不動産ホールディングス	57,100	2,385.00	136,183,500
三重交通グループホールディングス	17,500	538.00	9,415,000
サムティ	8,100	1,809.00	14,652,900
ディア・ライフ	10,000	548.00	5,480,000
コーセーアールイー	1,900	831.00	1,578,900
エー・ディー・ワークス	115,000	37.00	4,255,000

日本商業開発	4,900	1,805.00	8,844,500
プレサンスコーポレーション	11,900	1,582.00	18,825,800
ユニゾホールディングス	11,800	2,074.00	24,473,200
THEグローバル社	4,000	820.00	3,280,000
日本管理センター	5,700	1,274.00	7,261,800
サンセイランディック	2,500	1,167.00	2,917,500
エストラスト	1,200	821.00	985,200
フージャースホールディングス	20,800	688.00	14,310,400
オープンハウス	14,000	5,720.00	80,080,000
東急不動産ホールディングス	207,900	727.00	151,143,300
飯田グループホールディングス	71,600	2,003.00	143,414,800
イーランド	1,400	997.00	1,395,800
ムゲンエステート	5,900	708.00	4,177,200
ビーロッド	1,300	1,183.00	1,537,900
ファーストブラザーズ	2,400	1,256.00	3,014,400
ハウズドゥ	3,100	2,099.00	6,506,900
シーアールイー	2,800	908.00	2,542,400
ケイアイスター不動産	3,100	2,599.00	8,056,900
グッドコムアセット	1,500	1,621.00	2,431,500
パーク24	50,100	3,215.00	161,071,500
パラカ	2,200	2,151.00	4,732,200
三井不動産	428,700	2,496.00	1,070,035,200
三菱地所	639,000	1,805.50	1,153,714,500
平和不動産	15,200	1,850.00	28,120,000
東京建物	93,800	1,327.00	124,472,600
ダイビル	22,000	1,090.00	23,980,000
京阪神ビルディング	14,200	832.00	11,814,400
住友不動産	206,000	3,737.00	769,822,000
大京	13,700	2,290.00	31,373,000
テーオーシー	29,600	749.00	22,170,400
東京楽天地	1,400	4,780.00	6,692,000
レオパレス21	102,200	576.00	58,867,200
スターツコーポレーション	11,700	2,393.00	27,998,100
フジ住宅	11,000	865.00	9,515,000
空港施設	8,700	603.00	5,246,100
明和地所	4,700	654.00	3,073,800
ゴールドクレスト	6,800	1,882.00	12,797,600
日本エスリード	3,400	1,523.00	5,178,200
日神不動産	11,500	586.00	6,739,000
日本エスコン	15,500	676.00	10,478,000
タカラレーベン	40,000	381.00	15,240,000
サンヨーハウジング名古屋	4,800	1,137.00	5,457,600

イオンモール	55,300	1,849.00	102,249,700
ファースト住建	3,200	1,367.00	4,374,400
カチタス	11,700	3,675.00	42,997,500
トーセイ	11,700	1,027.00	12,015,900
穴吹興産	900	3,085.00	2,776,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	53,300	1,188.00	63,320,400
サンフロンティア不動産	10,400	1,310.00	13,624,000
エフ・ジェー・ネクスト	6,600	970.00	6,402,000
インテリックス	2,400	824.00	1,977,600
ランドビジネス	4,200	344.00	1,444,800
グランディハウス	7,400	449.00	3,322,600
日本空港ビルデング	25,100	4,700.00	117,970,000
日本工営	5,600	2,793.00	15,640,800
L I F U L L	29,000	643.00	18,647,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,700	2,149.00	14,398,300
日本M&Aセンター	57,600	2,618.00	150,796,800
メンバーズ	2,800	1,323.00	3,704,400
中広	1,000	775.00	775,000
タケエイ	8,700	907.00	7,890,900
トラスト・テック	4,000	4,610.00	18,440,000
コシダカホールディングス	22,200	1,124.00	24,952,800
パソナグループ	7,900	1,874.00	14,804,600
C D S	2,300	1,341.00	3,084,300
リンクアンドモチベーション	15,400	1,112.00	17,124,800
G C A	9,400	956.00	8,986,400
エス・エム・エス	32,900	2,050.00	67,445,000
パーソルホールディングス	76,800	2,334.00	179,251,200
リニカル	5,400	1,609.00	8,688,600
クックパッド	26,400	424.00	11,193,600
エスクリ	3,000	780.00	2,340,000
アイ・ケイ・ケイ	4,900	778.00	3,812,200
学情	3,800	1,327.00	5,042,600
スタジオアリス	4,200	2,406.00	10,105,200
シミックホールディングス	4,600	2,351.00	10,814,600
N J S	2,000	1,752.00	3,504,000
総合警備保障	33,100	4,640.00	153,584,000
カカクコム	62,700	1,941.00	121,700,700
アイロムグループ	2,800	1,659.00	4,645,200
セントケア・ホールディング	3,600	637.00	2,293,200
サイネックス	1,300	774.00	1,006,200
ルネサンス	4,100	2,308.00	9,462,800
ディップ	11,800	2,556.00	30,160,800

オプトホールディング	5,700	2,676.00	15,253,200
ツクイ	19,700	952.00	18,754,400
キャリアデザインセンター	2,200	1,490.00	3,278,000
エムスリー	87,600	4,445.00	389,382,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	641.00	4,230,600
プラス	700	753.00	527,100
アウトソーシング	35,900	2,021.00	72,553,900
ウェルネット	8,500	1,002.00	8,517,000
ワールドホールディングス	2,700	3,410.00	9,207,000
ディー・エヌ・エー	44,900	1,871.00	84,007,900
博報堂D Yホールディングス	115,600	1,715.00	198,254,000
ぐるなび	13,200	862.00	11,378,400
エスアールジータカミヤ	10,000	681.00	6,810,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,600	1,018.00	6,718,800
ファンコミュニケーションズ	23,300	632.00	14,725,600
ライク	3,300	1,550.00	5,115,000
ビジネス・ブレークスルー	3,900	399.00	1,556,100
WDBホールディングス	3,800	3,600.00	13,680,000
ティア	3,800	971.00	3,689,800
C D G	800	1,707.00	1,365,600
バリューコマース	7,300	1,924.00	14,045,200
インフォマート	45,700	1,193.00	54,520,100
J Pホールディングス	26,400	300.00	7,920,000
エコナックホールディングス	16,500	120.00	1,980,000
E P Sホールディングス	12,600	2,158.00	27,190,800
レグス	2,100	1,172.00	2,461,200
プレステージ・インターナショナル	17,300	1,147.00	19,843,100
アミューズ	5,600	3,310.00	18,536,000
ドリームインキュベータ	2,800	1,997.00	5,591,600
クイック	5,200	1,839.00	9,562,800
T A C	5,100	269.00	1,371,900
ケネディクス	77,900	672.00	52,348,800
電通	101,300	5,200.00	526,760,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	2,009.00	7,835,100
ぴあ	2,800	5,020.00	14,056,000
イオンファンタジー	2,700	3,790.00	10,233,000
シーティーエス	8,300	867.00	7,196,100
ネクシィーズグループ	2,600	1,610.00	4,186,000
みらかホールディングス	24,800	2,830.00	70,184,000
アルプス技研	7,300	2,814.00	20,542,200
ダイオーズ	1,700	1,360.00	2,312,000
日本空調サービス	8,700	784.00	6,820,800

オリエンタルランド	98,300	11,885.00	1,168,295,500
ダスキン	22,400	2,671.00	59,830,400
明光ネットワークジャパン	10,600	1,093.00	11,585,800
ファルコホールディングス	4,300	1,766.00	7,593,800
ラウンドワン	25,900	1,432.00	37,088,800
リゾートトラスト	35,300	1,690.00	59,657,000
ビー・エム・エル	10,700	3,110.00	33,277,000
ワタベウェディング	1,500	547.00	820,500
りらいあコミュニケーションズ	13,200	1,411.00	18,625,200
リソー教育	14,100	821.00	11,576,100
早稲田アカデミー	1,200	1,976.00	2,371,200
ユー・エス・エス	101,600	1,998.00	202,996,800
東京個別指導学院	3,000	1,333.00	3,999,000
サイバーエージェント	51,300	5,700.00	292,410,000
楽天	387,800	784.80	304,345,440
クリーク・アンド・リバー社	4,300	1,150.00	4,945,000
テー・オー・ダブリュー	8,100	743.00	6,018,300
セントラルスポーツ	3,100	4,015.00	12,446,500
フルキャストホールディングス	8,400	2,460.00	20,664,000
エン・ジャパン	7,100	4,450.00	31,595,000
リソルホールディングス	900	4,445.00	4,000,500
テクノプロ・ホールディングス	15,700	6,920.00	108,644,000
アトラ	1,800	784.00	1,411,200
インターワークス	1,900	831.00	1,578,900
Keeper 技研	2,700	1,086.00	2,932,200
ファーストロジック	1,700	699.00	1,188,300
三機サービス	1,300	2,163.00	2,811,900
Gunosy	5,100	1,814.00	9,251,400
デザインワン・ジャパン	1,700	862.00	1,465,400
イー・ガーディアン	4,000	2,482.00	9,928,000
リブセンス	5,400	384.00	2,073,600
ジャパンマテリアル	22,800	1,302.00	29,685,600
ベクトル	10,100	2,461.00	24,856,100
ウチヤマホールディングス	4,200	503.00	2,112,600
ライクキッズネクスト	1,400	1,178.00	1,649,200
キャリアリンク	2,800	533.00	1,492,400
I B J	6,700	537.00	3,597,900
アサンテ	3,000	2,275.00	6,825,000
N・フィールド	5,400	1,517.00	8,191,800
バリューHR	1,900	2,002.00	3,803,800
M&Aキャピタルパートナーズ	2,100	5,790.00	12,159,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,523.00	5,330,500

ERIホールディングス	2,400	1,103.00	2,647,200
アビスト	1,300	3,970.00	5,161,000
シグマクシス	4,500	1,320.00	5,940,000
ウィルグループ	3,600	1,059.00	3,812,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,600	425.00	4,930,000
日本ビューホテル	2,700	1,328.00	3,585,600
リクルートホールディングス	641,700	3,253.00	2,087,450,100
エラン	2,900	2,622.00	7,603,800
土木管理総合試験所	3,700	560.00	2,072,000
日本郵政	472,000	1,295.00	611,240,000
ベルシステム24ホールディングス	14,000	1,834.00	25,676,000
鎌倉新書	1,500	3,560.00	5,340,000
一蔵	1,100	823.00	905,300
LITALICO	1,900	2,098.00	3,986,200
グローバルグループ	1,000	2,146.00	2,146,000
エポラブルアジア	2,400	2,453.00	5,887,200
アトラエ	1,600	2,010.00	3,216,000
ストライク	2,100	3,390.00	7,119,000
ソラスト	15,200	1,172.00	17,814,400
セラク	1,900	635.00	1,206,500
インソース	2,800	2,323.00	6,504,400
キャリアインデックス	2,400	1,036.00	2,486,400
MS - Japan	900	7,300.00	6,570,000
船場	1,600	1,022.00	1,635,200
フルテック	900	1,133.00	1,019,700
グリーンズ	1,900	1,326.00	2,519,400
日総工産	2,800	2,473.00	6,924,400
キュービーネットホールディングス	4,300	2,169.00	9,326,700
スプリックス	2,300	2,687.00	6,180,100
リログループ	45,500	2,809.00	127,809,500
東祥	5,200	4,015.00	20,878,000
エイチ・アイ・エス	14,800	3,265.00	48,322,000
ラックランド	1,600	2,523.00	4,036,800
共立メンテナンス	14,900	4,810.00	71,669,000
イチネンホールディングス	9,400	1,330.00	12,502,000
建設技術研究所	5,800	1,408.00	8,166,400
スペース	5,500	1,393.00	7,661,500
長大	3,400	808.00	2,747,200
燦ホールディングス	2,000	2,601.00	5,202,000
スバル興業	600	5,640.00	3,384,000
東京テアトル	3,500	1,404.00	4,914,000
タナベ経営	1,700	1,868.00	3,175,600



ナガワ	1,700	4,725.00	8,032,500	
よみうりランド	1,800	4,490.00	8,082,000	
東京都競馬	6,100	3,790.00	23,119,000	
カナモト	12,400	3,355.00	41,602,000	
東京ドーム	33,700	921.00	31,037,700	
西尾レントオール	8,500	3,285.00	27,922,500	
トランス・コスモス	9,300	2,539.00	23,612,700	
乃村工藝社	19,500	2,141.00	41,749,500	
藤田観光	3,300	3,350.00	11,055,000	
KNT-CTホールディングス	5,200	1,162.00	6,042,400	
日本管財	9,000	2,083.00	18,747,000	
トーカイ	8,100	2,485.00	20,128,500	
白洋舎	1,000	3,005.00	3,005,000	
セコム	88,300	8,690.00	767,327,000	
セントラル警備保障	4,000	4,205.00	16,820,000	
丹青社	17,100	1,253.00	21,426,300	
メイテック	9,700	5,140.00	49,858,000	
応用地質	9,000	1,395.00	12,555,000	
船井総研ホールディングス	17,300	2,300.00	39,790,000	
進学会ホールディングス	3,900	601.00	2,343,900	
オオバ	6,600	619.00	4,085,400	
いであ	1,700	1,078.00	1,832,600	
学究社	3,100	1,766.00	5,474,600	
ベネッセホールディングス	30,500	3,625.00	110,562,500	
イオンディライト	10,300	3,840.00	39,552,000	
ナック	5,600	1,054.00	5,902,400	
ニチイ学館	15,900	899.00	14,294,100	
ダイセキ	14,000	2,816.00	39,424,000	
ステップ	3,100	1,502.00	4,656,200	
合 計	104,689,900		210,178,197,380	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,288,466,385
国債証券	332,571,473,550
地方債証券	22,262,946,275
特殊債券	27,986,061,598
社債券	16,381,936,440
派生商品評価勘定	79,676
未収利息	981,836,735
前払費用	40,091,275
流動資産合計	401,512,891,934
資産合計	401,512,891,934
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	597,061,200
未払解約金	135,149,148
未払利息	3,290
その他未払費用	235
流動負債合計	732,213,873
負債合計	732,213,873
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	289,379,948,264
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	111,400,729,797
元本等合計	400,780,678,061
純資産合計	400,780,678,061
負債純資産合計	401,512,891,934

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 8月20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> <p>先物取引</p>

2018年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 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	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	289,379,948,264口
2. 担保資産	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。  有価証券 100,190,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3850円 (1万口当たり純資産額) (13,850円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 8月20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。

	2018年 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	244,230,444,350円
期中追加設定元本額	56,064,953,209円
期中一部解約元本額	10,915,449,295円
期末元本額	289,379,948,264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）	3,973,086,700円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,236,722円
S M T 国内債券インデックス・オープン	13,456,705,660円
世界経済インデックスファンド	1,743,651,884円
D C マイセレクション 2 5	19,432,173,363円
D C マイセレクション 5 0	22,217,574,084円
D C マイセレクション 7 5	6,270,875,555円
D C 日本債券インデックス・オープン	447,922,224円
D C 日本債券インデックス・オープン S	77,088,983,759円
D C 日本債券インデックス・オープン P	35,338,617,244円
D C マイセレクション S 2 5	7,716,995,877円
D C マイセレクション S 5 0	8,823,643,349円
D C マイセレクション S 7 5	1,794,785,250円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,271,434,097円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,140,671,597円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	369,184,378円
D C 世界経済インデックスファンド	1,398,447,868円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	89,774,777円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,869,742円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	67,169,915円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,776,492円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	973,417円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	304,601,498円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	438,157,193円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	78,442,567円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	206,219,045円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,278,124,793円

区分	2018年 8月20日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,129,217,944円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,251,429,635円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	905,495,330円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	147,804,203円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,503,360,276円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	436,072,606円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,682,197,797円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,149,540,046円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	182,041,128円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,834,989,752円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,554,097,426円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,752,305円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	662,962,534円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	63,767,085円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,821,264円
SMT インデックスバランス・オープン	72,920,679円
SMT 世界経済インデックス・オープン	3,588,021円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	7,827,756円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,378,016円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	910,537円
グローバル経済コア	305,026,963円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,616,953円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	68,208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）	49,388,735,510円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,861,888,050
地方債証券	109,931,944
特殊債券	121,862,919
社債券	58,284,970
合計	3,151,967,883

(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）

## 債券関連

（2018年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	150,430,324	-	150,510,000	79,676
	合計	150,430,324	-	150,510,000	79,676

## (注)1. 時価の算定方法

債券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. 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。

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(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,784,378,800	
	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	2,586,837,000	
	第382回利付国債(2年)	310,000,000	310,880,400	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,303,939,000	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,725,555,600	
	第385回利付国債(2年)	700,000,000	702,394,000	
	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	3,000,764,000	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,716,498,000	
	第388回利付国債(2年)	2,130,000,000	2,138,498,700	
	第389回利付国債(2年)	1,620,000,000	1,626,625,800	
	第390回利付国債(2年)	1,860,000,000	1,867,960,800	
	第391回利付国債(2年)	2,090,000,000	2,099,363,200	
	第120回利付国債(5年)	2,800,000,000	2,809,996,000	
	第121回利付国債(5年)	890,000,000	892,216,100	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,530,771,200	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,151,398,200	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,958,209,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,626,930,900	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,975,569,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,807,150,400	
第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,619,821,000		

第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,220,768,000	
第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,369,547,200	
第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,580,774,400	
第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,031,520,000	
第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,778,820,600	
第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,197,579,000	
第135回利付国債(5年)	8,660,000,000	8,737,593,600	
第136回利付国債(5年)	2,520,000,000	2,543,839,200	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	563,864,000	
第2回利付国債(40年)	420,000,000	572,905,200	
第3回利付国債(40年)	520,000,000	711,594,000	
第4回利付国債(40年)	700,000,000	960,701,000	
第5回利付国債(40年)	750,000,000	989,520,000	
第6回利付国債(40年)	460,000,000	595,437,800	
第7回利付国債(40年)	690,000,000	853,709,400	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	916,376,000	
第9回利付国債(40年)	1,090,000,000	903,958,800	
第10回利付国債(40年)	1,960,000,000	1,929,600,400	
第11回利付国債(40年)	430,000,000	406,767,100	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,413,046,200	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	487,435,200	
第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,946,423,700	
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,198,302,300	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	715,827,000	
第308回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,528,933,700	
第309回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,505,051,500	
第310回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,442,810,700	
第311回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,100,617,200	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,927,576,600	
第313回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,295,725,000	
第314回利付国債(10年)	310,000,000	319,737,100	
第315回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,174,229,800	
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,127,594,100	
第317回利付国債(10年)	710,000,000	736,568,200	
第318回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,127,408,800	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,778,878,800	
第320回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,027,864,800	
第321回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,392,930,000	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	776,925,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,007,092,800	
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,324,032,000	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,373,974,300	



第326回利付国債(10年)	860,000,000	889,730,200	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	768,800,800	
第328回利付国債(10年)	2,320,000,000	2,393,567,200	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,347,132,500	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,504,656,000	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,427,872,200	
第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,553,925,900	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,416,722,600	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,896,884,900	
第335回利付国債(10年)	2,710,000,000	2,800,920,500	
第336回利付国債(10年)	610,000,000	631,106,000	
第337回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,023,362,000	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,521,074,500	
第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,848,721,800	
第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,161,424,600	
第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,201,176,200	
第342回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,771,890,000	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,173,404,500	
第344回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,681,456,200	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,992,335,400	
第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,418,870,000	
第347回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,441,736,900	
第348回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,234,993,800	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,220,400,400	
第350回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,929,348,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,401,358,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	142,085,900	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	200,475,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	149,432,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	145,597,100	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,273,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	242,698,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	228,578,400	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,293,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	276,084,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	177,382,400	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	107,507,700	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	238,315,100	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	359,884,200	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	390,849,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	448,970,000	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	489,624,700	

第17回利付国債(30年)	330,000,000	431,838,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	446,909,550
第19回利付国債(30年)	280,000,000	363,314,000
第20回利付国債(30年)	420,000,000	559,683,600
第21回利付国債(30年)	270,000,000	350,870,400
第22回利付国債(30年)	400,000,000	534,008,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	575,021,800
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,983,400
第25回利付国債(30年)	290,000,000	378,928,500
第26回利付国債(30年)	410,000,000	543,344,300
第27回利付国債(30年)	600,000,000	807,630,000
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,524,855,900
第29回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,642,997,100
第30回利付国債(30年)	770,000,000	1,017,216,200
第31回利付国債(30年)	940,000,000	1,227,207,600
第32回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,581,010,200
第33回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,816,815,000
第34回利付国債(30年)	1,265,000,000	1,662,500,950
第35回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,116,151,400
第36回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,456,133,400
第37回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,724,788,900
第38回利付国債(30年)	760,000,000	942,225,200
第39回利付国債(30年)	910,000,000	1,149,502,900
第40回利付国債(30年)	820,000,000	1,017,874,200
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,084,990,100
第42回利付国債(30年)	800,000,000	975,664,000
第43回利付国債(30年)	900,000,000	1,099,278,000
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,356,309,000
第45回利付国債(30年)	800,000,000	939,160,000
第46回利付国債(30年)	890,000,000	1,044,868,900
第47回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,546,993,800
第48回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,460,741,300
第49回利付国債(30年)	840,000,000	966,033,600
第50回利付国債(30年)	810,000,000	811,830,600
第51回利付国債(30年)	980,000,000	858,685,800
第52回利付国債(30年)	770,000,000	712,126,800
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,014,713,100
第54回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,486,528,300
第55回利付国債(30年)	1,000,000,000	996,490,000
第56回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,433,232,000
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,153,144,400
第58回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,092,157,000
第59回利付国債(30年)	120,000,000	115,854,000

第43回利付国債(20年)	140,000,000	144,596,200	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	177,068,600	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	301,600,000	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	177,287,900	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	94,364,100	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	137,971,600	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	148,034,600	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	231,486,200	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	106,011,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	117,524,000	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	85,896,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	215,412,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	150,564,400	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	162,079,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	258,405,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	324,525,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	215,614,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	372,757,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	252,024,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	333,814,400	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	218,336,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	352,240,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	243,192,400	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	363,023,100	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	144,259,700	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	214,031,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	437,147,100	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	457,300,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	226,312,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	712,416,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	406,616,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	227,166,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	148,298,800	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	304,443,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,909,300	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,389,000	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	307,405,800	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,983,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	445,711,500	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	689,964,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	334,892,000	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	539,310,900	

第85回利付国債(20年)	290,000,000	336,275,300
第86回利付国債(20年)	210,000,000	246,695,400
第87回利付国債(20年)	550,000,000	641,938,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	495,637,800
第89回利付国債(20年)	350,000,000	410,291,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	741,415,500
第91回利付国債(20年)	450,000,000	533,218,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,032,240,000
第93回利付国債(20年)	410,000,000	478,900,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	717,726,000
第95回利付国債(20年)	610,000,000	730,981,300
第96回利付国債(20年)	320,000,000	377,836,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	477,752,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	521,549,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,367,695,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	576,998,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	873,086,500
第102回利付国債(20年)	410,000,000	502,528,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	486,372,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	430,714,800
第105回利付国債(20年)	680,000,000	816,156,400
第106回利付国債(20年)	380,000,000	459,879,800
第107回利付国債(20年)	150,000,000	180,585,000
第108回利付国債(20年)	660,000,000	781,083,600
第109回利付国債(20年)	230,000,000	272,904,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,147,077,500
第111回利付国債(20年)	490,000,000	598,324,300
第112回利付国債(20年)	790,000,000	956,208,100
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,638,751,500
第114回利付国債(20年)	910,000,000	1,107,715,700
第115回利付国債(20年)	700,000,000	859,887,000
第116回利付国債(20年)	880,000,000	1,083,447,200
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,036,855,500
第118回利付国債(20年)	690,000,000	835,948,800
第119回利付国債(20年)	270,000,000	320,665,500
第120回利付国債(20年)	790,000,000	919,939,200
第121回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,995,253,600
第122回利付国債(20年)	200,000,000	238,030,000
第123回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,511,239,500
第124回利付国債(20年)	500,000,000	608,310,000
第125回利付国債(20年)	620,000,000	771,193,200
第126回利付国債(20年)	700,000,000	853,545,000
第127回利付国債(20年)	580,000,000	699,688,800

第128回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,269,313,500	
第129回利付国債(20年)	220,000,000	263,208,000	
第130回利付国債(20年)	935,000,000	1,119,999,100	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	450,368,400	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	997,138,800	
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,295,967,600	
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,201,970,000	
第135回利付国債(20年)	550,000,000	653,438,500	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	669,732,900	
第137回利付国債(20年)	710,000,000	844,793,500	
第138回利付国債(20年)	340,000,000	395,226,200	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	600,030,300	
第140回利付国債(20年)	1,680,000,000	2,000,476,800	
第141回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,228,141,100	
第142回利付国債(20年)	490,000,000	590,993,900	
第143回利付国債(20年)	930,000,000	1,096,563,000	
第144回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,222,567,500	
第145回利付国債(20年)	1,785,000,000	2,132,236,050	
第146回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,864,371,600	
第147回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,351,941,200	
第148回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,517,477,000	
第149回利付国債(20年)	2,030,000,000	2,369,476,900	
第150回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,290,689,000	
第151回利付国債(20年)	1,655,000,000	1,853,699,300	
第152回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,958,512,500	
第153回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,065,245,000	
第154回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,665,939,200	
第155回利付国債(20年)	1,910,000,000	2,072,216,300	
第156回利付国債(20年)	1,730,000,000	1,699,292,500	
第157回利付国債(20年)	2,010,000,000	1,901,942,400	
第158回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,771,171,200	
第159回利付国債(20年)	1,700,000,000	1,717,000,000	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	1,999,296,000	
第161回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,549,163,000	
第162回利付国債(20年)	1,770,000,000	1,776,071,100	
第163回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,412,439,300	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,747,283,600	
国債証券合計	309,050,000,000	332,571,473,550	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,198,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,525,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	129,569,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,922,000	

第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,536,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,576,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,654,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,282,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	103,014,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	103,277,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	103,043,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	206,728,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	103,203,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,697,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	104,003,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	103,164,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,380,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,131,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	206,476,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,339,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,485,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,430,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,377,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	133,519,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,653,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,614,000	
第172回神奈川県公募公債	100,000,000	102,070,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,482,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,479,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	200,338,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	235,266,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,886,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,608,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,366,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,427,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,830,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,615,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,205,730	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,704,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,472,000	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,276,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,356,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,449,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,749,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,002,000	

第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,876,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,938,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	104,398,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,229,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,365,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,758,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,265,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	113,934,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	96,932,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,604,576	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,162,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,873,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,217,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,178,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,028,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,625,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,268,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,180,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,704,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,314,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,808,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,758,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,428,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	96,065,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,624,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,367,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,285,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,354,488	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	199,828,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,000,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	199,069,850	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,721,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,547,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,232,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,474,000	

平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,399,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,621,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,000,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,014,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,111,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,952,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	206,560,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,863,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	126,398,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,437,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	95,953,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	116,723,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,631,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,924,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,130,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,978,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,400,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	220,182,600	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,884,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,862,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,941,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,145,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	368,840,920	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,173,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,639,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,482,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,718,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,206,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,158,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,945,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,756,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,824,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,201,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,120,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,468,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,774,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,102,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,874,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,553,000	



第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,992,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,010,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,174,540	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,137,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,434,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,744,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,062,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,083,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,587,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,912,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,342,101	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,118,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	206,346,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,211,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,058,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	239,804,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,418,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	131,719,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,394,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,714,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,045,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,214,420	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,442,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,167,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,591,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,083,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	142,357,200	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,007,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,444,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,336,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,041,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	200,876,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,763,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,107,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,288,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,109,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	117,449,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,959,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,245,000	

	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	199,090,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	145,000,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	119,794,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,462,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,275,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,897,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,277,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,956,950	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,236,300	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	206,686,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,946,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	118,727,000	
	地方債証券合計	21,230,220,000	22,262,946,275	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,519,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,050,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,651,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,917,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,777,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,867,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,032,000	
	第14回道路債券	100,000,000	108,020,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,420,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	468,552,000	
	第21回道路債券	100,000,000	131,524,000	
	第28回道路債券	200,000,000	266,558,000	
	第33回道路債券	200,000,000	269,924,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,062,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	146,347,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,709,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,807,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,475,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,262,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,920,000	

第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,525,000	
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	239,984,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,203,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,015,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,491,000	
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	128,104,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,094,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,227,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,178,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,260,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,822,000	
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	121,225,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,007,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,584,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,327,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,141,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,771,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,810,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	310,502,570	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,954,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,534,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,289,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,723,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,789,000	
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	103,755,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,064,000	
	200,000,000	206,108,000	

第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,072,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,670,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,572,000	
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	153,977,720	
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	103,470,000	
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	228,734,000	
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	105,703,620	
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	103,588,000	
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	103,357,000	
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	103,052,000	
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	102,666,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,205,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,484,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,450,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,034,860	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	315,083,600	
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	204,913,900	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,127,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	300,258,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,089,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	320,000,000	320,899,200	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,031,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	318,372,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,906,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,699,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,602,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,254,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,752,000	

第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,437,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,322,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,115,950	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,863,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,822,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,439,050	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,568,330	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,755,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,376,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,142,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	515,520,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,180,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,709,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,525,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,865,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,135,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,022,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,473,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,458,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,372,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,180,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,512,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,003,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,958,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,213,350	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,176,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,088,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,308,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,825,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,421,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,064,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,182,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	113,232,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,337,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,176,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,863,900	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,629,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,191,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	106,930,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,965,400	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,337,000	17,134,572	

第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,539,000	17,441,533
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,859,000	17,895,659
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,331,000	18,338,624
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,060,000	19,102,423
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,542,000	15,055,914
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,370,000	32,005,728
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,616,000	18,560,569
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,012,000	16,899,865
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,531,000	19,593,567
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,993,000	16,889,727
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,240,000	19,191,580
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,716,000
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,184,000	19,686,237
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,507,000	19,994,479
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,984,000	26,960,484
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,616,000	27,731,881
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,623,000	29,973,164
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,086,000	33,315,798
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,210,000	35,558,611
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,321,000	36,656,200
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,906,000	76,829,403
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,495,000	17,185,150
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,867,000	39,147,223
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,492,000	17,166,357
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,974,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,242,000	17,141,319
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,930,000	42,564,182
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,167,000	15,971,154
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,974,000	42,707,422
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,539,000	40,110,046
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,020,000	18,048,348
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,742,000	79,175,695
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,391,000	42,820,922
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,364,000	18,333,605
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,207,000	55,086,738
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,943,000	52,696,857
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,707,000	52,490,094
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,109,000

第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,148,000	111,642,220	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,049,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,114,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,043,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,484,000	118,155,001	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,363,000	59,638,016	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,056,000	59,828,351	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,452,000	61,386,874	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,077,000	54,508,475	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,532,000	54,556,583	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,128,000	61,085,552	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	180,459,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,534,000	55,587,028	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,560,000	62,743,793	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,627,000	63,890,559	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,655,000	63,727,224	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,573,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,033,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,880,000	136,291,386	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,385,000	68,314,148	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,296,000	140,338,479	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,069,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,376,000	78,325,879	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,477,000	82,246,689	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,373,000	81,556,551	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,994,000	167,962,057	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,151,000	82,444,120	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,048,000	87,523,747	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,203,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,577,000	92,320,561	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,833,000	92,341,913	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,000,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,962,000	92,921,096	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,530,000	93,965,849	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,049,000	94,317,039	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,689,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,766,000	95,916,352	
	96,180,000	96,443,533	

第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,460,000	96,449,389	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,764,000	96,780,449	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,032,000	97,094,100	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,050,000	194,683,306	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,445,000	97,418,689	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,034,000	196,506,441	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,374,000	98,301,203	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,604,000	197,048,732	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,326,000	99,225,680	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,754,000	198,978,954	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,856,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	125,645,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,274,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,604,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,916,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,201,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,819,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,235,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,738,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,518,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,441,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,939,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,690,000	
第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,188,000	
第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,705,000	
第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,319,000	
第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,416,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,000,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	99,977,000	
第201号商工債（3年）	300,000,000	299,751,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,877,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,226,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,795,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,636,000	



	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,680,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,442,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,959,000	
	特殊債券合計	26,541,283,000	27,986,061,598	
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	99,822,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,155,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,813,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,643,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,577,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,976,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,400,000	
	第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,528,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,882,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,922,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	100,207,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	100,000,000	100,201,000	
	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	100,569,000	
	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	107,228,000	
	第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,260,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,171,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,263,000	
	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	199,754,000	
	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	100,332,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,814,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,846,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,546,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,807,000	
	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	100,045,000	

第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,839,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,184,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,826,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,121,000	
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	102,991,000	
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	99,861,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,088,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,376,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,516,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,899,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,575,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,787,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,461,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,800,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,332,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,036,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,597,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,889,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,106,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,454,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,848,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,443,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,572,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,662,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,583,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,786,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,298,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,434,000	
第6回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,223,000	
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	100,286,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,912,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,398,000	

第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,131,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,303,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,421,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,902,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,289,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,662,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,130,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,586,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	124,089,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,573,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,102,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	117,227,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,105,000	
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	102,371,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,047,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,755,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,192,000	
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	308,766,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,691,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,805,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,870,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,637,000	
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	100,481,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,308,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,393,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,251,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
	100,000,000	100,338,000	

第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債			
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,731,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,432,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,449,000	
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	102,851,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,264,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,389,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,572,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,724,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,644,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,979,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,872,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,410,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,713,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,638,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,494,730	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	120,184,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,793,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,268,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,567,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,012,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,753,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,436,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,000,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,768,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,540,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,442,000	
第20回株式会社N T T コモ無担保社債	100,000,000	102,607,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	120,420,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,115,500	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,438,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,152,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,790,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,869,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,072,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,621,000	

第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,950,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,125,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,565,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,835,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,216,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,787,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,383,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,829,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,963,580	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,203,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,547,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,785,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,199,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,084,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,240,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,376,630	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,857,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,251,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,732,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,518,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,767,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,300,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,066,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,758,000	
社債券合計	15,996,000,000	16,381,936,440	
合計		399,202,417,863	

(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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,941,224,069
コール・ローン	141,208,658
株式	326,818,641,203
投資信託受益証券	262,513,925
投資証券	7,877,278,535
派生商品評価勘定	294,416,668
未収入金	52,322
未収配当金	581,282,761
差入委託証拠金	2,447,357,764
流動資産合計	348,363,975,905
資産合計	348,363,975,905
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	39,793,432
前受金	254,530,556
未払解約金	156,969,477
未払利息	360
その他未払費用	26
流動負債合計	451,293,851
負債合計	451,293,851
純資産の部	
元本等	
元本	136,969,669,259
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	210,943,012,795
元本等合計	347,912,682,054
純資産合計	347,912,682,054
負債純資産合計	348,363,975,905

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 8月20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>

	2018年 8月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,969,669,259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) 2,5401円 (25,401円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年 8月20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



2018年 8月20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>「(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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	134,798,965,392円
期中追加設定元本額	16,139,768,754円
期中一部解約元本額	13,969,064,887円
期末元本額	136,969,669,259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）	2,319,255,803円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,181,393円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,163,983,113円
世界経済インデックスファンド	7,066,600,686円
外国株式インデックス・オープン	850,739,138円

区分	2018年 8月20日現在
DCマイセレクション25	1,002,808,984円
DCマイセレクション50	4,703,560,475円
DCマイセレクション75	5,143,655,132円
DC外国株式インデックス・オープン	7,692,827,944円
DCマイセレクションS25	390,105,763円
DCマイセレクションS50	1,881,902,332円
DCマイセレクションS75	1,467,170,902円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	121,144,833円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	182,594,577円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	115,883,505円
DC世界経済インデックスファンド	5,653,979,901円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,710,077,768円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	14,025,838円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,970,591円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	61,964,104円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	82,519,521円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	287,116,485円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	44,168,181円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	398,127,861円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	856,824,093円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	425,573,214円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,806,889,355円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,039,404,035円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	108,871,868円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	412,840,628円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	136,030,438円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	134,121,137円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,059,744,319円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,339,503,569円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,447,286,892円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,885,952,747円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,472,129,547円
分散投資コア戦略ファンドA	2,037,389,563円
分散投資コア戦略ファンドS	4,262,397,553円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	670,290,689円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	822,023,222円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,736,786,986円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	856,790,441円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,047,329円
SMT インデックスバランス・オープン	296,329,502円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,010,819,724円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,797,799,734円
SMT 世界経済インデックス・オープン	26,695,164円

区分	2018年 8月20日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	260,313,019円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	39,236,630円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	574,019円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	26,744,554円
グローバル経済コア	1,282,438,959円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	3,297,521円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	47,770円
F O F s 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)	1,572,883,722円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,320,917,257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)	398,309,229円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,576,477,318
投資信託受益証券	20,660,065
投資証券	559,877,397
合計	9,157,014,780

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2018年 8月20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	12,612,949,281	-	12,867,479,837	254,530,556
合計		12,612,949,281	-	12,867,479,837	254,530,556

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2018年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	80,023,200	-	79,930,520	92,680
	アメリカドル	33,261,000	-	33,165,000	96,000
	イギリスポンド	46,762,200	-	46,765,520	3,320
	合計	80,023,200	-	79,930,520	92,680

## (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	62.05	2,753,779.00	
	ANDEAVOR	11,677	144.84	1,691,296.68	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	17.50	326,130.00	
	APACHE CORP	29,810	42.00	1,252,020.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	31.01	1,091,862.10	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	23.60	846,744.40	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	61.53	965,467.23	
	CHEVRON CORP	154,681	117.80	18,221,421.80	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	82.25	625,017.75	
	CONCHO RESOURCES INC	16,193	135.05	2,186,864.65	
	CONOCOPHILLIPS	96,082	69.77	6,703,641.14	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	63.00	481,761.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	40.60	1,762,852.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	120.18	990,163.02	
	EOG RESOURCES INC	46,520	114.77	5,339,100.40	
	EQT CORPORATION	22,120	49.53	1,095,603.60	
	EXXON MOBIL	342,921	78.26	26,836,997.46	
	HALLIBURTON CO	71,448	39.97	2,855,776.56	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	62.51	519,770.65	
HESS CORP	22,081	62.35	1,376,750.35		

HOLLYFRONTIER CORP	14,110	68.64	968,510.40
KINDER MORGAN INC	157,150	17.95	2,820,842.50
MARATHON OIL CORP	65,596	19.83	1,300,768.68
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	77.11	2,973,824.26
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	43.84	1,328,834.24
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	26.36	423,684.28
NOBLE ENERGY INC	38,291	28.77	1,101,632.07
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	78.55	4,892,643.85
ONEOK INC	33,743	67.52	2,278,327.36
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	28.37	580,875.75
PHILLIPS 66	36,131	115.44	4,170,962.64
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	173.20	2,329,540.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	26.42	261,293.80
SCHLUMBERGER	112,385	62.83	7,061,149.55
TARGA RESOURCES CORP	16,467	53.92	887,900.64
TECHNIPFMC PLC	36,005	28.03	1,009,220.15
VALERO ENERGY CORP	35,381	111.00	3,927,291.00
WILLIAMS COS	98,038	30.47	2,987,217.86
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	166.61	2,985,984.42
ALBEMARLE CORP	8,647	95.44	825,269.68
AVERY DENNISON CORP	7,457	106.95	797,526.15
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	30.03	528,708.18
BALL CORP	27,142	40.66	1,103,593.72
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	115.69	1,278,721.57
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	47.52	842,101.92
CHEMOURS CO/THE	15,493	43.07	667,283.51
CROWN HOLDINGS INC	10,321	41.12	424,399.52
DOWDUPONT INC	187,231	67.79	12,692,389.49
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	97.69	1,158,408.02
ECOLAB INC	20,812	147.31	3,065,815.72
FMC CORP	10,402	84.44	878,344.88
FREEMONT-MCMORAN INC	111,396	13.97	1,556,202.12
INT'L PAPER CO	30,605	51.97	1,590,541.85
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	132.16	802,211.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	113.10	3,022,032.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	203.00	1,012,767.00
MOSAIC CO/THE	27,677	29.63	820,069.51
NEWMONT MINING CORP	42,952	32.06	1,377,041.12
NUCOR CORP	24,915	62.38	1,554,197.70
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	111.61	804,150.05
PPG INDUSTRIES INC	19,958	108.42	2,163,846.36
PRAXAIR INC	23,446	156.04	3,658,513.84

SEALED AIR CORP	14,689	38.95	572,136.55
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	443.39	3,073,579.48
STEEL DYNAMICS INC	18,273	43.73	799,078.29
VULCAN MATERIALS CO	10,740	110.34	1,185,051.60
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	95.59	330,263.45
WESTROCK CO	21,244	55.32	1,175,218.08
3 M COMPANY	48,314	204.77	9,893,257.78
ACUITY BRANDS INC	3,505	143.69	503,633.45
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	56.56	640,824.80
AGCO CORP	4,669	60.01	280,186.69
ALLEGION PLC	7,168	86.70	621,465.60
AMETEK INC	18,866	76.31	1,439,664.46
ARCONIC INC	36,550	20.88	763,164.00
BOEING CO	45,238	346.40	15,670,443.20
CATERPILLAR	48,537	139.34	6,763,145.58
CUMMINS INC	12,421	143.35	1,780,550.35
DEERE&CO	25,056	140.59	3,522,623.04
DOVER CORP	12,008	83.95	1,008,071.60
EATON CORP	35,279	81.00	2,857,599.00
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	74.86	3,812,395.22
FASTENAL CO	23,228	59.51	1,382,298.28
FLOWSERVE CORP	10,826	51.35	555,915.10
FLUOR CORP	11,267	56.82	640,190.94
FORTIVE CORP	25,813	80.25	2,071,493.25
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	54.93	703,653.30
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	193.68	3,885,608.16
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	12.30	8,662,717.80
GRAINGER (WW) INC	3,976	357.73	1,422,334.48
HARRIS CORP	9,793	164.66	1,612,515.38
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	44.61	679,231.86
HONEYWELL INTL INC	61,022	155.17	9,468,783.74
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	247.27	870,884.94
IDEX CORP	5,756	152.12	875,602.72
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	139.43	3,419,939.04
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	99.81	2,021,052.69
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	71.86	696,538.98
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	64.91	1,077,506.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	36.75	606,375.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	38.25	2,849,166.00
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	210.38	1,286,894.46
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	222.66	642,374.10
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	325.23	6,793,079.01

MASCO CORP	24,547	38.75	951,196.25
MIDDLEBY CORP	4,364	115.89	505,743.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	294.39	3,968,082.81
OWENS CORNING	7,979	58.28	465,016.12
PACCAR INC	27,548	67.16	1,850,123.68
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	169.57	1,755,727.78
PENTAIR PLC	13,583	42.80	581,352.40
RAYTHEON COMPANY	23,492	199.09	4,677,022.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	173.63	1,825,024.93
ROCKWELL COLLIN	13,112	137.51	1,803,031.12
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	297.88	2,412,828.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	55.06	761,369.68
SMITH (A.O.) CORP	12,146	58.33	708,476.18
SNAP-ON INC	4,900	175.34	859,166.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	86.59	734,369.79
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	141.39	1,698,800.85
TEXTRON	21,877	66.65	1,458,102.05
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	353.59	1,439,818.48
UNITED RENTALS INC	6,446	150.51	970,187.46
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	134.44	8,179,464.04
WABCO HOLDINGS INC	3,841	122.69	471,252.29
WABTEC CORP	7,158	109.97	787,165.26
XYLEM INC	13,941	75.43	1,051,569.63
CINTAS CORP	7,034	212.78	1,496,694.52
COPART INC	17,540	60.98	1,069,589.20
COSTAR GROUP INC	3,008	430.44	1,294,763.52
EQUIFAX INC	9,276	133.09	1,234,542.84
IHS MARKIT LTD	32,775	53.76	1,761,984.00
MANPOWER GROUP	5,123	88.26	452,155.98
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	26.15	719,229.60
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	74.49	1,375,159.89
ROBERT HALF INTL INC	9,566	76.96	736,199.36
ROLLINS INC	7,031	57.19	402,102.89
STERICYCLE INC	6,767	61.42	415,629.14
TRANSUNION	15,344	75.05	1,151,567.20
VERISK ANALYTICS INC	12,301	117.42	1,444,383.42
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	80.08	1,634,272.64
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	91.34	3,190,597.54
AMERCO	602	381.47	229,644.94
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	37.79	374,876.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	97.14	1,112,058.72
CSX CORP	68,519	73.69	5,049,165.11

DELTA AIR LINES INC	15,095	55.65	840,036.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	74.01	1,021,560.03
FEDEX CORP	20,716	246.94	5,115,609.04
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	122.34	872,773.56
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	115.36	1,008,592.48
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	32.90	352,030.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	174.07	3,968,621.93
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	146.80	769,966.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	59.68	684,231.20
UNION PACIFIC CORP	63,871	149.46	9,546,159.66
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	82.01	492,306.03
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	121.80	6,724,821.60
XPO LOGISTICS INC	10,037	101.71	1,020,863.27
APTIV PLC	20,954	92.76	1,943,693.04
AUTOLIV INC	6,639	92.65	615,103.35
BORGWARNER INC	15,953	45.28	722,351.84
FORD MOTOR COMPANY	299,765	9.55	2,862,755.75
GENERAL MOTORS CO	101,158	36.38	3,680,128.04
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	24.01	519,264.27
HARLEY-DAVIDSON	14,677	42.26	620,250.02
LEAR CORP	5,287	173.31	916,289.97
TESLA INC	10,369	305.50	3,167,729.50
DR HORTON INC	28,586	44.38	1,268,646.68
GARMIN LTD	9,564	65.35	625,007.40
HANESBRANDS INC	31,136	18.40	572,902.40
HASBRO INC	9,007	98.53	887,459.71
LEGGETT & PLATT INC	10,594	44.60	472,492.40
LENNAR CORP-CL A	23,545	50.57	1,190,670.65
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	130.19	1,102,969.68
MATTEL INC	27,399	15.31	419,478.69
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	72.98	842,700.06
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	190.06	962,083.72
NEWELL BRANDS INC	37,563	21.50	807,604.50
NIKE B	105,293	79.75	8,397,116.75
NVR INC	264	2,627.75	693,726.00
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	108.25	507,800.75
PULTE GROUP INC	21,959	28.09	616,828.31
PVH CORP	5,820	149.19	868,285.80
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	135.41	619,906.98
TAPESTRY INC	22,032	51.41	1,132,665.12
TOLL BROTHERS INC	11,211	34.40	385,658.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	20.49	326,815.50



UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	18.92	308,074.36
VF CORP	26,718	91.63	2,448,170.34
WHIRLPOOL CORP	5,324	127.24	677,425.76
ARAMARK	19,980	40.60	811,188.00
BLOCK H & R INC	16,984	26.42	448,717.28
CARNIVAL CORPORATION	35,126	60.58	2,127,933.08
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	510.44	1,008,119.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	113.85	1,142,029.35
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	285.04	984,243.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	77.20	1,815,975.60
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	65.86	2,129,978.26
MARRIOTT INTL A	25,016	123.85	3,098,231.60
MCDONALD'S CORP	63,834	161.15	10,286,849.10
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	22.10	390,330.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	28.55	1,274,928.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	52.49	936,316.62
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	115.72	1,606,772.20
STARBUCKS CORP	113,248	53.56	6,065,562.88
VAIL RESORTS INC	2,987	294.83	880,657.21
WYNN RESORTS LTD	8,052	142.33	1,146,041.16
YUM BRANDS INC	27,323	83.81	2,289,940.63
CBS CORP-CL B	28,628	53.22	1,523,582.16
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	299.64	4,084,692.48
COMCAST CORP-CL A	373,142	35.60	13,283,855.20
DISCOVERY INC - A	12,804	26.95	345,067.80
DISCOVERY INC-C	23,672	24.92	589,906.24
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	35.13	639,998.34
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.37	756,866.58
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	78.98	684,203.74
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.54	411,794.64
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	25.83	1,195,179.93
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	35.15	492,451.50
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	46.31	705,440.23
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.19	294,876.96
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	48.15	608,471.55
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.90	465,358.10
OMNICOM GROUP	19,030	68.59	1,305,267.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.97	902,649.85
THE WALT DISNEY CO	121,890	112.48	13,710,187.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	45.38	3,908,806.30
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	44.83	1,634,456.97
VIACOM INC-CLASS B	26,755	30.72	821,913.60

ADVANCE AUTO PARTS	6,186	159.72	988,027.92
AMAZON.COM	33,277	1,882.22	62,634,634.94
AUTOZONE INC	2,151	765.34	1,646,246.34
BEST BUY COMPANY INC	21,836	78.48	1,713,689.28
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	1,840.68	7,195,218.12
CARMAX INC	14,253	73.63	1,049,448.39
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	106.38	2,375,465.40
DOLLAR TREE INC	19,550	95.61	1,869,175.50
EXPEDIA GROUP INC	9,800	131.03	1,284,094.00
GAP	16,326	31.28	510,677.28
GENUINE PARTS CO	11,245	98.89	1,112,018.05
HOME DEPOT	94,571	195.56	18,494,304.76
KOHL'S CORP	12,602	76.44	963,296.88
L BRANDS INC	19,499	32.55	634,692.45
LKQ CORP	24,693	33.16	818,819.88
LOWES COMPANIES	66,782	97.98	6,543,300.36
MACY'S INC	25,926	36.03	934,113.78
NETFLIX INC	35,175	316.78	11,142,736.50
NORDSTROM INC	10,094	59.18	597,362.92
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	329.96	2,178,725.88
QURATE RETAIL INC	35,071	21.84	765,950.64
ROSS STORES INC	30,239	91.87	2,778,056.93
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	83.04	3,474,061.44
TIFFANY & CO	9,326	128.56	1,198,950.56
TJX COMPANIES INC	51,517	100.35	5,169,730.95
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	80.51	761,302.56
TRIPADVISOR INC	10,393	53.55	556,545.15
ULTA BEAUTY INC	4,911	235.04	1,154,281.44
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	225.68	8,050,908.32
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	8.80	298,320.00
KROGER CO	72,735	31.35	2,280,242.25
SYSCO CORP	40,229	74.83	3,010,336.07
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	69.99	4,745,112.03
WALMART INC	119,581	97.85	11,701,000.85
ALTRIA GROUP INC	152,862	61.00	9,324,582.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	50.55	2,252,861.85
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	53.57	1,180,682.80
BUNGE LIMITED	11,767	63.04	741,791.68
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	42.04	591,586.88
COCA-COLA CO	328,376	46.60	15,302,321.60
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	42.76	730,169.76
CONAGRA BRANDS INC	33,243	37.48	1,245,947.64

CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	203.93	2,858,690.74
GENERAL MILLS INC	44,875	47.21	2,118,548.75
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	101.48	1,136,576.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	38.64	906,687.60
INGREDION INC	5,835	101.74	593,652.90
JM SMUCKER CO	9,442	114.59	1,081,958.78
KELLOGG CO	21,051	73.63	1,549,985.13
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	61.02	3,044,409.84
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	126.40	1,172,486.40
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	68.56	1,035,256.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	42.71	5,135,535.82
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	62.17	2,171,722.44
PEPSICO INC	115,115	114.96	13,233,620.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	85.05	10,715,449.50
TYSON FOODS INC	24,363	62.40	1,520,251.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	57.15	1,090,593.45
CLOROX COMPANY	10,045	147.53	1,481,938.85
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	67.50	4,575,420.00
COTY INC-CL A	39,000	12.22	476,580.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	135.94	2,422,722.68
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	119.56	3,346,484.40
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	83.69	16,972,834.14
ABBOTT LABORATORIES	142,028	64.72	9,192,052.16
ABIOMED INC	3,502	358.82	1,256,587.64
AETNA INC	26,686	198.86	5,306,777.96
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	357.30	2,238,127.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	87.72	1,126,938.84
ANTHEM INC	20,871	263.95	5,508,900.45
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	72.04	3,030,794.84
BECTON DICKINSON & CO	21,729	253.12	5,500,044.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	34.41	3,873,499.29
CARDINAL HEALTH	25,252	51.90	1,310,578.80
CENTENE CORP	16,736	143.71	2,405,130.56
CERNER CORP	23,088	65.29	1,507,415.52
CIGNA CORP	19,408	188.34	3,655,302.72
CVS HEALTH CORP	81,494	73.68	6,004,477.92
DANAHER CORP	50,460	100.71	5,081,826.60
DAVITA INC	11,875	72.49	860,818.75
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	38.67	689,640.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	139.77	2,344,781.52
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	87.39	4,036,456.71
HCA HEALTHCARE INC	23,027	131.57	3,029,662.39

HENRY SCHEIN INC	12,492	80.34	1,003,607.28
HOLOGIC INC	21,094	38.33	808,533.02
HUMANA INC	11,281	324.62	3,662,038.22
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	243.50	1,754,417.50
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	524.92	4,756,300.12
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	182.19	1,448,957.07
MCKESSON CORP	16,655	129.38	2,154,823.90
MEDTRONIC PLC	110,187	90.60	9,982,942.20
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	111.44	1,173,686.08
RESMED INC	10,895	106.80	1,163,586.00
STRYKER CORP	27,181	169.98	4,620,226.38
TELEFLEX INC	3,697	238.15	880,440.55
THE COOPER COS INC	4,135	257.63	1,065,300.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	262.33	20,597,626.94
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	127.80	926,294.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	111.21	781,361.46
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	84.72	826,951.92
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	123.86	1,989,563.18
ABBVIE INC	122,922	98.81	12,145,922.82
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	64.66	1,637,385.18
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	116.00	2,056,564.00
ALKERMES PLC	12,547	44.53	558,717.91
ALLERGAN PLC	26,330	185.60	4,886,848.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	94.58	699,797.42
AMGEN	54,777	197.42	10,814,075.34
BIOGEN INC	17,262	345.22	5,959,187.64
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	101.01	1,448,584.41
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	60.89	8,093,498.80
CELGENE CORP	61,389	90.37	5,547,723.93
GILEAD SCIENCES INC	106,635	72.92	7,775,824.20
ILLUMINA INC	12,043	325.88	3,924,572.84
INCYTE CORP	14,121	68.80	971,524.80
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	120.28	1,566,165.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	173.81	864,009.51
JOHNSON & JOHNSON	217,581	134.47	29,258,117.07
LILLY (ELI) & CO	79,730	105.55	8,415,501.50
MERCK & CO	218,364	69.06	15,080,217.84
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	564.74	1,132,868.44
MYLAN NV	42,644	38.15	1,626,868.60
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	60.03	810,825.21
PERRIGO CO PLC	11,333	72.96	826,855.68
PFIZER	483,121	42.09	20,334,562.89

REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	374.26	2,451,403.00
SEATTLE GENETICS INC	9,601	74.64	716,618.64
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	24.22	1,954,311.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	230.00	7,414,740.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	125.61	407,855.67
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	176.08	3,662,287.92
WATERS CORP	6,513	187.55	1,221,513.15
ZOETIS INC	39,742	91.47	3,635,200.74
BANK OF AMERICA CORP	787,725	30.74	24,214,666.50
BB&T CORP	64,293	52.43	3,370,881.99
CIT GROUP INC	10,713	54.04	578,930.52
CITIGROUP	208,262	69.67	14,509,613.54
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	40.69	1,628,006.90
COMERICA INC	14,360	99.23	1,424,942.80
EAST WEST BANCORP INC	10,794	64.60	697,292.40
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	29.69	1,728,462.73
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	104.50	1,314,401.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	16.10	1,407,429.80
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	114.77	31,788,076.44
KEY CORP	87,033	21.59	1,879,042.47
M & T BANK CORP	11,745	176.50	2,072,992.50
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	10.85	424,180.75
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	18.72	512,628.48
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	144.55	5,478,300.45
REGIONS FINL CORP	96,209	19.49	1,875,113.41
SIGNATURE BANK	4,354	117.54	511,769.16
SUNTRUST BANKS	38,353	73.72	2,827,383.16
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	320.76	1,408,136.40
US BANCORP	127,580	53.29	6,798,738.20
WELLS FARGO & CO	378,753	58.86	22,293,401.58
ZIONS BANCORPORATION	15,186	53.73	815,943.78
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	146.59	649,833.47
ALLY FINANCIAL INC	36,028	26.95	970,954.60
AMERICAN EXPRESS	59,473	103.03	6,127,503.19
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	139.47	1,652,719.50
BANK NEW YORK CO	81,361	51.69	4,205,550.09
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	208.14	21,522,508.56
BLACKROCK INC	9,812	474.15	4,652,359.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	99.17	3,937,247.34
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	95.77	906,941.90
CME GROUP INC	27,733	169.38	4,697,415.54
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	77.92	2,303,704.80

E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	61.19	1,291,598.52
EATON VANCE CORP	10,061	53.08	534,037.88
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.72	853,010.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	233.38	6,844,568.64
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	74.05	3,473,389.30
INVESCO LTD	30,943	24.48	757,484.64
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	23.45	602,805.70
MOODY'S CORP	14,116	171.50	2,420,894.00
MORGAN STANLEY	108,682	48.37	5,256,948.34
MSCI INC	6,934	173.28	1,201,523.52
NASDAQ INC	9,070	93.04	843,872.80
NORTHERN TRUST CORP	17,320	107.70	1,865,364.00
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	115.61	2,319,830.26
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	91.43	908,082.76
S&P GLOBAL INC	20,491	203.11	4,161,927.01
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	50.90	5,018,892.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	60.38	652,224.76
STATE STREET CORP	29,345	84.96	2,493,151.20
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	30.37	1,832,738.39
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	59.41	1,390,431.64
VOYA FINANCIAL INC	14,081	49.97	703,627.57
AFLAC	61,894	46.76	2,894,163.44
ALLEGHANY CORP	1,276	637.41	813,335.16
ALLSTATE CORP	28,446	100.02	2,845,168.92
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	113.30	628,701.70
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	52.58	3,812,628.38
AON PLC	20,163	143.45	2,892,382.35
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	30.63	1,058,297.13
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	72.21	1,081,128.12
ASSURANT INC	4,769	105.27	502,032.63
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	49.98	667,083.06
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	56.15	410,007.30
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	41.48	281,898.08
CHUBB LTD	37,790	134.04	5,065,371.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	75.75	940,284.75
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	218.40	732,295.20
FNF GROUP	20,786	39.94	830,192.84
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	51.96	1,489,277.52
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	65.24	1,160,619.60
LOEWS CORP	22,051	50.16	1,106,078.16
MARKEL CORP	1,132	1,203.38	1,362,226.16
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	84.00	3,430,392.00

METLIFE INC	71,520	45.94	3,285,628.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	55.72	1,290,196.60
PROGRESSIVE CORP	46,702	66.28	3,095,408.56
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	98.80	3,314,344.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	143.44	779,022.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	131.30	426,593.70
TORCHMARK CORP	8,473	88.18	747,149.14
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	130.42	2,844,590.62
UNUM GROUP	18,574	36.00	668,664.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	148.89	1,627,367.70
WR BERKLEY CORP	7,296	77.44	565,002.24
XL GROUP LTD	20,644	56.94	1,175,469.36
CBRE GROUP INC-A	26,855	47.54	1,276,686.70
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.94	684,978.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	153.51	563,842.23
WEYERHAEUSER CO	62,107	35.65	2,214,114.55
ACCENTURE PLC-CL A	50,076	164.89	8,257,031.64
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	69.15	4,005,582.90
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	245.70	9,687,951.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	71.44	1,012,876.32
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	238.03	955,928.48
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,215.85	29,371,288.45
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,200.96	30,600,460.80
ANSYS INC	6,865	172.25	1,182,496.25
AUTODESK INC	18,086	132.35	2,393,682.10
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	142.55	5,098,728.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	133.23	1,285,669.50
CA INC	26,520	43.63	1,157,067.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	45.18	975,210.30
CDK GLOBAL INC	10,687	61.85	660,990.95
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	114.94	1,241,466.94
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	110.86	1,258,482.72
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	75.56	3,628,391.20
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	95.01	1,503,723.27
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	87.37	2,053,020.26
EBAY	78,686	34.01	2,676,110.86
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	128.01	3,209,210.70
FACEBOOK INC-A	193,825	173.80	33,686,785.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	107.10	2,905,087.50
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	24.86	975,953.88
FISERV INC	33,784	79.44	2,683,800.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	214.19	1,534,242.97

FORTINET INC	10,871	76.50	831,631.50
GARTNER INC	7,002	143.12	1,002,126.24
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	118.67	1,484,917.71
GODADDY INC - CLASS A	12,570	73.75	927,037.50
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	190.27	1,210,878.28
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	146.06	10,911,558.36
INTUIT INC	19,851	207.89	4,126,824.39
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	143.24	856,431.96
LEIDOS HOLDINGS	10,999	71.72	788,848.28
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	203.21	15,266,557.67
MERCADOLIBRE INC	3,264	324.20	1,058,188.80
MICROSOFT CORP	591,521	107.58	63,635,829.18
ORACLE CORP	250,503	48.36	12,114,325.08
PAYCHEX INC	25,506	72.32	1,844,593.92
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	85.45	7,827,818.15
RED HAT INC	13,963	140.15	1,956,914.45
SABRE CORP	17,243	25.16	433,833.88
SALESFORCE.COM INC	55,092	145.02	7,989,441.84
SERVICENOW INC	13,794	180.83	2,494,369.02
SPLUNK INC	11,773	103.41	1,217,445.93
SQUARE INC - A	22,319	72.90	1,627,055.10
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	55.85	987,483.85
SYMANTEC CORP	48,508	19.46	943,965.68
SYNOPSYS INC	12,264	93.34	1,144,721.76
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	124.30	1,187,313.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	94.89	1,196,562.90
TWITTER INC	55,701	32.73	1,823,093.73
VERISIGN INC	7,289	150.75	1,098,816.75
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	141.33	20,629,092.12
VMWARE INC-CLASS A	5,821	150.88	878,272.48
WESTERN UNION CO	38,757	18.91	732,894.87
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	142.65	1,525,071.15
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	94.49	2,212,766.82
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	46.27	460,941.74
AMPHENOL CORPORATION	24,215	94.05	2,277,420.75
APPLE INC	410,252	217.58	89,262,630.16
ARISTA NETWORKS INC	4,324	269.04	1,163,328.96
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	78.01	520,014.66
AVNET INC	10,936	47.58	520,334.88
CDW CORP/DE	12,482	85.98	1,073,202.36
CISCO SYSTEMS	390,187	45.87	17,897,877.69
COGNEX CORP	12,660	52.43	663,763.80



COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	30.88	461,131.04
CORNING	71,752	33.02	2,369,251.04
F5 NETWORKS INC	5,350	180.68	966,638.00
FLEX LTD	40,465	13.57	549,110.05
FLIR SYSTEMS INC	11,686	60.17	703,146.62
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	16.67	2,162,699.12
HP INC	134,066	24.54	3,289,979.64
IPG PHOTONICS CORP	3,207	162.06	519,726.42
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.74	868,372.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	59.82	948,326.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	122.99	1,552,133.80
NETAPP INC	20,821	81.16	1,689,832.36
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	213.09	1,536,591.99
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	54.26	1,239,081.36
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	92.95	2,603,436.55
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	39.53	815,187.66
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	64.63	1,523,781.51
XEROX CORP	16,718	26.94	450,382.92
AT&T INC	587,152	33.03	19,393,630.56
CENTURYLINK INC	73,994	23.48	1,737,379.12
SPRINT CORP	64,825	6.13	397,377.25
T-MOBILE US INC	28,273	65.90	1,863,190.70
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	54.79	18,319,967.93
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	37.85	578,688.65
AES CORP	52,646	13.94	733,885.24
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	43.59	839,369.04
AMEREN CORPORATION	18,723	64.76	1,212,501.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	72.50	2,818,220.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	89.49	1,278,185.67
ATMOS ENERGY CORP	9,385	94.34	885,380.90
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	28.29	889,465.89
CMS ENERGY CORP	21,593	49.89	1,077,274.77
CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	81.17	2,075,598.07
DOMINION ENERGY INC	53,227	71.75	3,819,037.25
DTE ENERGY COMPANY	14,355	113.62	1,631,015.10
DUKE ENERGY CORP	57,060	82.28	4,694,896.80
EDISON INTL	26,184	69.88	1,829,737.92
ENTERGY CORP	13,854	85.32	1,182,023.28
EVERGY INC	11,492	57.87	665,042.04
EVERSOURCE ENERGY	25,381	63.24	1,605,094.44
EXELON CORP	77,742	44.53	3,461,851.26
FIRSTENERGY CORP	39,519	37.30	1,474,058.70

NEXTERA ENERGY INC	37,780	175.17	6,617,922.60
NISOURCE INC	26,021	27.60	718,179.60
OGE ENERGY CORP	15,686	37.56	589,166.16
PG&E CORP	41,241	45.25	1,866,155.25
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	82.27	774,654.32
PPL CORPORATION	53,473	29.88	1,597,773.24
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	53.81	2,185,008.86
SCANA CORP	11,459	38.50	441,171.50
SEMPRA ENERGY	19,952	116.85	2,331,391.20
SOUTHERN CO	81,059	46.97	3,807,341.23
UGI CORP	13,950	55.47	773,806.50
VISTRA ENERGY CORP	29,561	22.42	662,757.62
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	68.26	1,726,090.62
XCEL ENERGY INC	40,763	48.29	1,968,445.27
ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	19.77	1,525,611.36
ANALOG DEVICES	30,277	94.58	2,863,598.66
APPLIED MATERIALS	84,218	43.77	3,686,221.86
BROADCOM INC	33,321	209.27	6,973,085.67
INTEL CORP	378,881	47.10	17,845,295.10
KLA-TENCOR CORP	12,266	112.40	1,378,698.40
LAM RESEARCH CORP	12,814	169.91	2,177,226.74
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	19.78	746,754.34
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	59.99	1,309,521.71
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	83.01	1,545,978.24
MICRON TECHNOLOGY	92,766	47.11	4,370,206.26
NVIDIA CORP	46,674	244.82	11,426,728.68
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	89.77	2,449,194.91
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	20.32	731,438.72
QORVO INC	10,609	81.50	864,633.50
QUALCOMM	120,270	66.06	7,945,036.20
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	91.85	1,332,743.50
TEXAS INSTRUMENTS	79,005	109.64	8,662,108.20
XILINX INC	20,299	71.02	1,441,634.98
アメリカドル 小計	24,872,886		2,006,351,764.86 (221,822,251,122)
カナダドル			
ALTAGAS INCOME LTD	11,886	25.13	298,695.18
ARC RESOURCES LTD	27,117	14.30	387,773.10
CAMECO CORP	28,709	13.54	388,719.86
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	44.64	4,468,017.60
CENOVUS ENERGY INC	77,803	11.96	930,523.88
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	8.13	351,573.72
ENBRIDGE	138,840	47.04	6,531,033.60

ENCANA CORP	76,271	16.41	1,251,607.11
HUSKY ENERGY INC	31,439	22.00	691,658.00
IMPERIAL OIL	24,763	40.48	1,002,406.24
INTER PIPELINE LTD	30,317	24.72	749,436.24
KEYERA CORP	14,929	37.38	558,046.02
PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	46.20	1,953,151.20
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	23.60	433,060.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	15.15	303,151.50
SUNCOR ENERGY	134,041	52.69	7,062,620.29
TOURMALINE OIL CORP	19,965	21.41	427,450.65
TRANSCANADA CORP	70,703	57.93	4,095,824.79
VERMILION ENERGY INC	10,067	40.10	403,686.70
AGNICO EAGLE MINES	17,661	46.52	821,589.72
BARRICK GOLD CORP	94,395	13.10	1,236,574.50
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	63.50	834,326.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	17.18	977,542.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	87.40	1,246,061.80
GOLDCORP INC	68,688	14.04	964,379.52
KINROSS GOLD CORP	107,615	3.80	408,937.00
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.43	400,222.49
METHANEX CORP	7,099	92.06	653,533.94
NUTRIEN LTD	51,428	73.11	3,759,901.08
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	29.72	1,357,520.44
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.06	217,260.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	91.57	396,223.39
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	24.13	888,900.94
BOMBARDIER B	157,835	4.64	732,354.40
CAE INC	18,372	26.26	482,448.72
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	30.75	361,743.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	53.72	790,382.36
WSP GLOBAL INC	9,471	70.30	665,811.30
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	116.33	7,042,501.87
CP RAILWAY LIMITED	11,959	263.29	3,148,685.11
LINAMAR CORP	3,889	55.07	214,167.23
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	71.33	1,995,670.74
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	38.92	687,288.28
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	80.44	1,477,843.68
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.21	978,117.87
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	165.77	896,649.93
DOLLARAMA INC	26,700	48.93	1,306,431.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	62.97	2,144,947.11
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	25.32	291,154.68

	LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	69.31	1,082,483.58
	METRO INC	19,179	43.03	825,272.37
	WESTON (GEORGE) LTD	4,775	106.06	506,436.50
	SAPUTO INC	20,412	41.92	855,671.04
	AURORA CANNABIS INC	53,000	6.50	344,500.00
	BANK MONTREAL	52,905	105.83	5,598,936.15
	BANK NOVA SCOTIA	96,431	77.42	7,465,688.02
	CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	121.66	4,300,072.70
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	65.59	1,851,474.52
	ROYAL BANK OF CANADA	116,879	102.80	12,015,161.20
	TORONTO-DOMINION BANK	148,256	78.70	11,667,747.20
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	57.44	3,924,243.36
	CI FINANCIAL CORP	18,671	21.96	410,015.16
	IGM FINANCIAL INC	7,685	38.33	294,566.05
	ONEX CORP	6,603	96.58	637,717.74
	THOMSON REUTERS CORP	22,284	56.09	1,249,909.56
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	732.34	1,688,043.70
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	32.60	775,488.80
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	53.90	443,597.00
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	106.99	1,119,757.34
	MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	24.54	3,939,602.52
	POWER CORP OF CANADA	29,774	29.78	886,669.72
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	31.35	650,199.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	53.03	2,626,894.08
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.41	254,410.65
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	13.13	517,322.00
	CGI GROUP INC - CL A	21,192	85.28	1,807,253.76
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	941.77	1,601,950.77
	OPEN TEXT CORP	19,994	50.69	1,013,495.86
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	179.09	1,314,878.78
	BCE INC	12,539	54.25	680,240.75
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	69.47	2,006,363.07
	TELUS CORP	16,454	48.92	804,929.68
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.90	209,115.90
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.36	334,084.64
	EMERA INC	4,086	41.93	171,325.98
	FORTIS INC	34,128	43.54	1,485,933.12
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.47	423,316.74
	カナダドル 小計	3,293,712		147,452,375.29 (12,481,843,568)
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.82	435,882.18
	ENI	202,686	15.82	3,207,303.26

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	17.37	692,689.12
NESTE OIL OYJ	11,086	72.90	808,169.40
OMV AG	12,139	44.28	537,514.92
REPSOL SA	110,036	16.21	1,783,683.56
SNAM SPA	173,485	3.68	639,986.16
TENARIS SA	40,648	14.46	587,770.08
TOTAL SA	195,662	52.40	10,252,688.80
VOPAK	6,360	38.46	244,605.60
AIR LIQUIDE	34,556	105.85	3,657,752.60
AKZO NOBEL	19,791	79.46	1,572,592.86
ARCELORMITTAL	53,985	25.00	1,349,894.92
ARKEMA	5,335	105.35	562,042.25
BASF SE	73,727	77.57	5,719,003.39
COVESTRO AG	16,178	76.72	1,241,176.16
CRH PLC	71,124	28.40	2,019,921.60
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	31.50	423,801.00
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	48.80	281,185.60
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	68.50	781,379.50
IMERYS SA	3,000	62.45	187,350.00
K+S AG	14,355	19.18	275,400.67
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	89.18	1,358,568.12
LANXESS	7,293	67.16	489,797.88
LINDE AG - TENDER	15,262	189.50	2,892,149.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	35.52	694,948.80
SOLVAY SA	5,511	113.00	622,743.00
STORA ENSO OYJ R	47,237	14.16	669,112.10
SYMRISE AG	9,083	77.66	705,385.78
THYSSEN KRUPP	33,044	19.33	638,740.52
UMICORE	17,605	46.18	812,998.90
UPM KYMMENE OYJ	43,990	30.35	1,335,096.50
VOESTALPINE AG	8,140	38.38	312,413.20
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	34.63	713,066.33
AIRBUS SE	46,842	107.72	5,045,820.24
ALSTOM	13,816	36.83	508,843.28
ANDRITZ AG	5,242	50.55	264,983.10
BOUYGUES ORD	16,815	36.49	613,579.35
BRENTAG AG	11,626	51.16	594,786.16
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	10.12	775,728.36
DASSAULT AVIATION SA	213	1,525.00	324,825.00
EIFFAGE	6,079	94.30	573,249.70
FERROVIAL SA	37,634	17.80	670,073.37
GEA GROUP AG	13,382	32.14	430,097.48

HOCHTIEF AG	1,354	138.30	187,258.20
KION GROUP AG	5,887	57.40	337,913.80
KONE OYJ-B	26,924	45.84	1,234,196.16
LEGRAND SA	21,312	62.54	1,332,852.48
LEONARDO SPA	35,425	9.68	343,055.70
MAN SE	3,262	93.85	306,138.70
METSO OYJ	9,561	29.64	283,388.04
MTU AERO ENGINES AG	3,907	187.10	730,999.70
OSRAM LICHT AG	7,440	38.64	287,481.60
PRYSMIAN SPA	14,715	20.73	305,041.95
REXEL SA	24,339	13.38	325,655.82
SAFRAN SA	27,252	106.80	2,910,513.60
SAINT-GOBAIN	39,044	35.50	1,386,062.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	67.86	3,041,078.04
SIEMENS	61,389	110.00	6,752,790.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	11.94	208,929.99
THALES SA	8,109	115.15	933,751.35
VINCI S.A.	40,049	81.92	3,280,814.08
WARTSILA OYJ	34,386	17.94	616,884.84
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.26	435,361.08
EDENRED	18,941	34.75	658,199.75
RANDSTAD NV	9,588	53.04	508,547.52
RELX NV	80,302	19.10	1,534,169.71
SOCIETE BIC SA	2,424	77.70	188,344.80
TELEPERFORMANCE	4,523	161.50	730,464.50
WOLTERS KLUWER	23,031	54.64	1,258,413.84
ADP	2,382	190.50	453,771.00
AENA SME SA	5,610	152.60	856,086.00
ATLANTIA SPA	42,039	19.34	813,034.26
BOLLORE	61,805	4.06	251,299.13
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	23.15	391,906.35
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	30.75	2,416,704.00
FRAPORT AG	3,561	76.84	273,627.24
GETLINK	36,478	10.93	398,886.93
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.67	355,721.19
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	81.41	2,189,277.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.75	353,113.25
CONTINENTAL AG	8,828	182.65	1,612,434.20
DAIMLER AG	74,263	54.92	4,078,523.96
FAURECIA	5,945	53.12	315,798.40
FERRARI NV	9,947	105.15	1,045,927.05
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	13.71	1,186,504.53

MICHELIN	13,802	108.00	1,490,616.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	36.51	375,760.92
PEUGEOT SA	46,029	24.41	1,123,567.89
PIRELLI & C SPA	39,097	7.60	297,215.39
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	53.40	621,255.60
RENAULT SA	15,041	72.20	1,085,960.20
SCHAEFFLER AG	15,247	11.68	178,084.96
VALEO SA	19,350	39.27	759,874.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	138.74	2,050,577.20
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	137.10	355,637.40
ADIDAS AG	14,964	207.00	3,097,548.00
HERMES INTERNATIONAL	2,561	544.60	1,394,720.60
HUGO BOSS AG	4,852	70.18	340,513.36
KERING	6,060	453.10	2,745,786.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	56.20	748,527.80
LVMH	22,399	296.90	6,650,263.10
MONCLER SPA	15,736	37.30	586,952.80
PUMA AG	772	451.00	348,172.00
SEB SA	2,075	154.70	321,002.50
ACCOR	14,931	43.14	644,123.34
PADDY POWER PLC	7,143	77.35	552,511.05
SODEXO	7,035	92.82	652,988.70
AXEL SPRINGER SE	3,827	60.05	229,811.35
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	20.30	243,112.80
JC DECAUX SA	4,674	27.12	126,758.88
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	22.49	431,223.26
PUBLICIS GROUPE	17,601	56.06	986,712.06
RTL GROUP	3,513	61.55	216,225.15
SES	31,369	17.50	549,114.34
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	44.56	222,710.88
VIVENDI	83,098	21.40	1,778,297.20
INDITEX	86,470	27.55	2,382,248.50
ZALANDO SE	9,155	44.42	406,665.10
CARREFOUR	43,442	14.95	649,675.11
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	30.79	113,522.73
COLRUYT SA	4,160	51.26	213,241.60
JERONIMO MARTINS	20,234	12.99	262,839.66
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	20.91	2,102,186.85
METRO AG	13,712	11.60	159,127.76
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	86.97	5,291,167.83
DANONE (GROUPE)	48,771	67.69	3,301,308.99
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.57	321,921.82

HEINEKEN HOLDING NV	8,980	83.10	746,238.00
HEINEKEN NV	20,246	86.00	1,741,156.00
KERRY GROUP PLC-A	13,146	97.00	1,275,162.00
PERNOD-RICARD	17,495	138.95	2,430,930.25
REMY COINTREAU	1,575	123.70	194,827.50
BEIERSDORF AG	7,693	98.50	757,760.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	95.45	822,588.10
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	107.95	1,545,196.30
LOREAL	20,321	203.40	4,133,291.40
UNILEVER NV-CVA	125,731	49.55	6,229,971.05
BIOMERIEUX	3,246	73.30	237,931.80
ESSILOR INTERNATIONAL	17,239	122.85	2,117,811.15
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	85.02	1,530,019.92
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	65.00	2,200,250.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	37.39	2,784,431.70
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	140.40	455,738.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	37.84	473,062.50
BAYER	72,150	78.40	5,656,560.00
EUROFINS SCIENTIFIC	971	446.40	433,454.40
GRIFOLS SA	22,128	24.55	543,242.40
IPSEN	2,722	144.25	392,648.50
MERCK KGAA	10,480	90.02	943,409.60
ORION OYJ-CLASS B	7,975	30.23	241,084.25
QIAGEN N.V.	17,548	32.73	574,346.04
RECORDATI SPA	7,493	30.97	232,058.21
SANOFI	91,271	73.30	6,690,164.30
UCB (GROUPE)	10,465	77.92	815,432.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	22.52	747,416.28
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	5.44	2,946,407.36
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.32	588,695.16
BANCO SANTANDER SA	1,302,544	4.33	5,652,389.68
BANKIA SA	110,053	3.15	347,107.16
BANKINTER SA	58,881	7.57	445,729.17
BNP PARIBAS	90,844	50.99	4,632,135.56
CAIXABANK	277,342	3.78	1,049,462.12
COMMERZBANK AG	80,494	8.13	654,416.22
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	11.79	1,095,069.86
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	34.57	798,843.56
ING GROEP NV-CVA	314,846	11.69	3,681,809.12
INTESA SANPAOLO	1,163,318	2.18	2,538,941.53
KBC GROEP NV	20,232	62.50	1,264,500.00
MEDIOBANCA	53,990	8.40	453,623.98



RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	25.16	314,248.40
SOCIETE GENERALE	63,719	35.23	2,245,138.96
UNICREDIT SPA	163,189	12.94	2,111,665.66
AMUNDI SA	4,764	59.36	282,791.04
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	9.75	1,572,560.24
DEUTSCHE BOERSE	15,552	111.80	1,738,713.60
EURAZEO SA	3,198	65.15	208,349.70
EXOR NV	7,813	54.26	423,933.38
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	88.74	554,358.78
NATIXIS	69,996	5.79	405,556.82
WENDEL	2,023	123.60	250,042.80
AEGON	133,499	5.27	704,073.72
AGEAS	16,065	44.56	715,856.40
ALLIANZ SE-REG	36,019	184.24	6,636,140.56
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.45	1,469,336.29
AXA	157,703	21.52	3,394,557.07
CNP ASSURANCES	11,830	19.99	236,481.70
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	113.90	536,013.40
MAPFRE SA	90,939	2.52	229,984.73
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	184.35	2,334,792.75
NN GROUP NV	23,899	37.25	890,237.75
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.85	315,339.75
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	43.11	1,561,142.43
SCOR SE	13,354	35.68	476,470.72
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	41.77	1,150,888.81
VONOVIA SE	40,469	43.16	1,746,642.04
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	75.84	2,744,346.24
ATOS SE	7,634	98.76	753,933.84
CAPGEMINI SA	13,238	111.05	1,470,079.90
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	132.15	1,383,478.35
DELIVERY HERO SE	8,671	45.84	397,478.64
SAP SE	78,835	101.98	8,039,593.30
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	88.00	601,040.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	43.82	416,859.66
WIRECARD AG	9,864	178.80	1,763,683.20
INGENICO GROUP	4,681	65.88	308,384.28
NOKIA OYJ	458,694	4.58	2,101,277.21
1&1 DRILLISCH AG	3,773	45.62	172,124.26
DEUTSCHE TELEKOM	268,918	13.94	3,750,061.51
ELISA A	11,722	36.55	428,439.10
ILIAD SA	2,053	126.30	259,293.90
KPN (KON.)	261,596	2.29	599,578.03

	ORANGE	164,543	14.14	2,327,460.73
	PROXIMUS	13,141	20.37	267,682.17
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.60	512,554.26
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.52	247,767.46
	TELEFONICA	377,880	7.31	2,763,436.44
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.58	240,076.69
	E.ON SE	183,255	9.52	1,744,587.60
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	13.37	664,970.32
	ENDESA	24,774	19.62	486,189.75
	ENEL	656,974	4.42	2,907,109.95
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.39	655,863.34
	ENGIE	151,158	13.07	1,976,390.85
	FORTUM OYJ	38,328	21.07	807,570.96
	IBERDROLA SA	476,207	6.50	3,095,345.50
	INNOGY SE	11,000	37.19	409,090.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	26,034	23.27	605,811.18
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.17	597,630.35
	RWE STAMM	42,828	21.01	899,816.28
	SUEZ	28,043	12.60	353,482.01
	TERNA SPA	105,905	4.60	487,374.81
	UNIPER SE	14,751	25.30	373,200.30
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	18.08	827,015.36
	ASML HOLDING NV	33,413	171.68	5,736,343.84
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	21.22	1,925,566.46
	STMICROELECTRONICS	57,598	16.95	976,286.10
	ユーロ 小計	15,526,826		314,508,158.90 (39,756,976,366)
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.48	8,870,274.99
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	24.72	9,224,625.52
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	25.11	7,640,435.07
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	6.59	356,184.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	15.34	1,341,114.84
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.27	296,529.12
	BHP BILLITTON PLC	168,203	16.29	2,740,699.68
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	51.38	526,285.34
	FRESNILLO PLC	17,743	9.24	164,087.26
	GLENCORE PLC	943,407	3.05	2,877,391.35
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	35.66	503,198.26
	MONDI PLC	27,192	20.99	570,760.08
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	50.38	367,471.72
	RIO TINTO PLC REG	96,058	37.06	3,559,909.48
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	23.22	975,727.62

BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.24	1,604,497.46
BUNZL PLC	27,712	23.38	647,906.56
DCC PLC	7,320	69.05	505,446.00
FERGUSON PLC	19,208	60.71	1,166,117.68
MEGGITT PLC	66,268	5.30	351,750.54
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.21	903,162.54
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	10.23	1,369,576.05
SMITHS GROUP PLC	28,628	15.91	455,614.62
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	11.19	207,630.45
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	18.35	341,053.10
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.17	141,238.19
EXPERIAN PLC	75,041	19.02	1,427,279.82
G4S PLC	132,555	2.52	334,568.82
INTERTEK GROUP PLC	12,430	52.78	656,055.40
RELX PLC	82,063	17.14	1,406,559.82
EASYJET PLC	11,633	15.74	183,161.58
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.64	348,917.65
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.37	383,697.24
BURBERRY GROUP PLC	35,328	22.44	792,760.32
PERSIMMON PLC	26,389	24.62	649,697.18
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.70	462,448.56
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	37.37	396,084.63
CARNIVAL PLC	13,721	46.16	633,361.36
COMPASS GROUP PLC	126,022	16.97	2,139,223.45
GVC HOLDINGS PLC	42,500	10.99	467,075.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	47.50	663,290.00
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.70	241,188.09
TUI AG-DI	37,945	14.75	559,878.47
WHITBREAD PLC	14,664	39.79	583,480.56
INFORMA PLC	100,899	7.78	785,599.61
ITV PLC	295,435	1.66	492,194.71
PEARSON	66,305	9.17	608,282.07
SKY PLC	83,042	15.32	1,272,618.65
WPP PLC	98,371	12.76	1,255,213.96
KINGFISHER PLC	170,994	2.73	467,326.60
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.99	404,436.37
NEXT PLC	11,202	54.60	611,629.20
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.63	442,673.12
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.34	496,328.91
TESCO	786,019	2.56	2,016,138.73
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	23.38	674,396.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	42.03	7,835,190.57

COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.13	469,294.80
DIAGEO	200,277	27.93	5,594,737.99
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	29.87	2,298,821.50
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	67.83	3,638,333.37
UNILEVER PLC	99,877	44.15	4,409,569.55
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.12	239,088.06
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	4.66	139,955.84
NMC HEALTH PLC	9,509	40.60	386,065.40
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.79	979,462.33
ASTRAZENECA	101,347	59.30	6,009,877.10
GLAXOSMITHKLINE	403,375	16.17	6,522,573.75
SHIRE PLC	74,526	44.42	3,310,817.55
BARCLAYS	1,365,547	1.82	2,493,488.82
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	6.96	11,389,931.49
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.60	3,567,467.54
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.40	711,917.31
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.44	1,505,730.51
3I GROUP PLC	79,251	9.22	730,852.72
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	21.72	444,586.68
INVESTEC PLC	54,280	4.98	270,585.80
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	44.08	1,159,127.68
SCHRODERS PLC	8,614	30.66	264,105.24
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	11.26	504,108.75
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.17	701,433.87
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.37	331,114.35
AVIVA PIC	318,261	4.84	1,542,929.32
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.32	377,988.66
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.53	1,232,478.84
PRUDENTIAL	212,799	17.19	3,658,014.81
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.40	554,535.50
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.46	357,324.66
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	12.45	436,373.38
SAGE GROUP PLC	89,321	6.65	594,699.21
BT GROUP PLC	663,615	2.25	1,498,774.47
VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.75	3,827,651.68
CENTRICA PLC	440,558	1.45	642,774.12
NATIONAL GRID PLC	272,668	8.29	2,261,508.39
SEVERN TRENT PLC	18,112	20.14	364,775.68
SSE PLC	80,824	12.65	1,022,423.60
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.52	442,970.58
イギリスポンド 小計	24,513,636		154,287,714.97 (21,736,053,284)

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	23.40	407,113.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	596.50	400,848.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,297.00	1,699,780.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	47.75	1,925,948.50
	SIKA AG-BR	10,500	138.70	1,456,350.00
	ABB LTD	149,127	22.37	3,335,970.99
	GEBERIT AG-REG	3,021	428.70	1,295,102.70
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	218.80	323,605.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	224.80	671,927.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	57.96	766,463.04
	SGS SA	437	2,563.00	1,120,031.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	157.95	626,271.75
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	84.20	3,493,879.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	424.10	1,053,040.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	79.15	311,692.70
	DUFREY AG-REG	2,548	118.40	301,683.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,681.00	268,960.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	81,500.00	652,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,760.00	507,000.00
	NESTLE SA - REGISTERED	252,246	81.48	20,553,004.08
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	179.50	743,130.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	778.00	606,062.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	310.50	1,787,548.50
	NOVARTIS	180,510	82.48	14,888,464.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	239.95	13,686,028.15
	VIFOR PHARMA AG	3,601	175.40	631,615.40
	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	14.71	3,113,768.67
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	53.36	920,673.44
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	76.55	260,040.35
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	744.50	1,110,049.50
	UBS GROUP AG	317,371	15.34	4,868,471.14
	BALOISE HOLDING AG	3,877	151.80	588,528.60
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	348.00	1,026,252.00	
SWISS RE LTD	26,239	86.72	2,275,446.08	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	295.50	3,636,127.50	
SWISS PRIME SITE-REG	6,277	87.30	547,982.10	
TEMENOS AG	5,252	166.50	874,458.00	
SWISSCOM	2,064	449.10	926,942.40	
	スイスフラン 小計	1,408,816		93,662,259.49 (10,408,686,897)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	283.30	4,020,310.30
	BOLIDEN AB	20,141	251.70	5,069,489.70

	ALFA LAVAL AB	25,639	238.40	6,112,337.60	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	182.85	14,681,940.75	
	ATLAS COPCO A	53,833	249.60	13,436,716.80	
	ATLAS COPCO B	29,972	229.80	6,887,565.60	
	EPIROC AB-A	53,833	94.77	5,101,753.41	
	EPIROC AB-B	29,972	87.00	2,607,564.00	
	SANDVIK AB	87,313	156.40	13,655,753.20	
	SKANSKA B	28,530	165.50	4,721,715.00	
	SKF AB-B	28,335	173.00	4,901,955.00	
	VOLVO B	123,214	148.60	18,309,600.40	
	SECURITAS B	22,844	159.50	3,643,618.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	204.40	3,713,948.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	71.98	2,786,489.76	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	129.10	9,548,494.20	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	272.60	1,561,998.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	526.20	7,971,403.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	235.30	11,428,756.30	
	NORDEA BANK AB	244,135	93.76	22,890,097.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	95.78	13,285,643.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	110.40	13,267,540.80	
	SWEDBANK AB-A	71,353	208.90	14,905,641.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	186.85	2,390,185.20	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	403.10	14,814,731.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	283.00	5,123,432.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	295.20	2,149,056.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	71.92	17,848,314.48	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	529.40	11,384,217.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	547.00	3,388,118.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,266	114.35	3,803,967.10	
	TELIA CO AB	235,437	42.26	9,949,567.62	
	スウェーデンクローナ 小計	1,992,279		275,361,922.92 (3,318,111,171)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	272.60	2,810,778.60	
	EQUINOR ASA	92,696	212.20	19,670,091.20	
	NORSK HYDRO	106,150	44.68	4,742,782.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	365.00	4,916,550.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	265.00	1,847,315.00	
	MARINE HARVEST	32,238	181.40	5,847,973.20	
	ORKLA	69,804	70.66	4,932,350.64	
	DNB ASA	80,217	166.00	13,316,022.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	134.20	2,492,630.80	
	TELENOR ASA	60,821	160.30	9,749,606.30	

	ノルウェークローネ 小計	491,252		70,326,099.74 (918,458,862)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	655.60	4,852,095.60
	NOVOZYMES A/S	17,687	339.80	6,010,042.60
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	410.50	7,274,060.00
	ISS A/S	14,253	215.00	3,064,395.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,295.00	2,480,205.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	8,794.00	4,467,352.00
	DSV A/S	14,599	586.20	8,557,933.80
	PANDORA A/S	8,431	372.50	3,140,547.50
	CARLSBERG AS-B	8,236	784.00	6,457,024.00
	COLOPLAST-B	9,476	680.00	6,443,680.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	260.80	1,935,136.00
	GENMAB A/S	4,512	1,052.50	4,748,880.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	380.10	1,851,467.10
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	310.00	44,622,020.00
	DANSKE BANK A/S	59,378	182.90	10,860,236.20
TRYG A/S	9,828	157.80	1,550,858.40	
ORSTED A/S	15,908	407.00	6,474,556.00	
	デンマーククローネ 小計	344,469		124,790,489.20 (2,115,198,791)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	32.94	679,519.26
	OIL SEARCH LTD	118,781	9.15	1,086,846.15
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	8.89	1,193,055.78
	SANTOS	156,437	6.21	971,473.77
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	36.75	2,826,663.00
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.75	468,759.50
	AMCOR	88,486	14.35	1,269,774.10
	BHP BILLITON LTD	258,265	32.74	8,455,596.10
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	16.86	831,670.08
	BORAL LIMITED	81,732	6.60	539,431.20
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.21	566,985.96
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.79	570,770.21
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.00	821,986.00
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	20.27	1,239,692.93
	ORICA LTD	29,211	17.27	504,473.97
	RIO TINTO LTD	32,522	73.12	2,378,008.64
	SOUTH32 LTD	408,172	3.36	1,371,457.92
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	48.98	451,595.60
	BRAMBLES LTD	129,297	9.94	1,285,212.18
SEEK LTD	26,358	22.31	588,046.98	
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.45	709,717.15	

	TRANSURBAN GROUP	182,844	11.88	2,172,186.72	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	31.00	1,355,475.00	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	14.01	424,895.28	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	56.06	309,619.38	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	68.38	223,123.94	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.77	795,855.42	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.78	170,716.14	
	WESFARMERS LTD	93,277	52.53	4,899,840.81	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	29.60	3,043,501.60	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.53	439,618.90	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	19.02	1,110,292.50	
	COCHLEAR LIMITED	4,811	203.00	976,633.00	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.16	303,002.64	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	55.51	679,886.48	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	25.61	813,808.97	
	CSL LIMITED	36,265	215.85	7,827,800.25	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	30.28	7,111,893.88	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.28	401,568.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.63	493,507.42	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	74.29	10,421,624.07	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	28.85	6,420,077.05	
	WESTPAC BANKING	277,750	30.33	8,424,157.50	
	AMP LTD	244,230	3.43	837,708.90	
	ASX LTD	15,814	68.31	1,080,254.34	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	11.48	505,900.64	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	124.56	3,335,467.68	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.78	1,420,285.68	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.30	707,889.60	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.10	1,255,332.30	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	15.22	1,566,457.62	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	19.06	620,669.84	
	REA GROUP LTD	3,593	92.95	333,969.35	
	TELSTRA CORP	342,339	3.08	1,054,404.12	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.98	188,220.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	21.60	1,109,030.40	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.61	194,171.45	
	オーストラリアドル 小計	5,815,961		101,839,583.85 (8,227,619,979)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.90	528,843.60	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.86	583,181.75	
	A2 MILK CO LTD	66,854	10.85	725,365.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	14.90	678,069.20	



	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.35	484,831.95	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.96	575,978.04	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.17	350,424.48	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		3,926,694.92 (287,473,335)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	89.55	19,073,791.80	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	13.90	1,376,100.00	
	MTR CORP	114,000	39.80	4,537,200.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	26.20	1,205,200.00	
	LI & FUNG	554,800	2.82	1,564,536.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	46.15	5,491,850.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	20.00	1,370,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	53.50	10,593,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	13.68	919,296.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	36.10	7,321,080.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	11.50	1,127,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.26	1,090,320.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	18.50	2,604,800.00	
	WH GROUP LTD	699,000	6.11	4,270,890.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	28.50	3,111,060.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	37.55	11,640,500.00	
	HANG SENG BANK	61,100	207.20	12,659,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	220.00	21,318,000.00	
	AIA GROUP LTD	968,600	65.90	63,830,740.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	55.35	11,955,378.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	21.85	1,769,850.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.56	2,691,880.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	40.95	4,661,911.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	40.10	2,365,900.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	37.70	2,431,650.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.52	5,170,580.00	
	SINO LAND CO	235,400	12.72	2,994,288.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	118.10	15,589,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	90.75	3,675,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	30.60	2,943,720.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	22.65	2,061,150.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	53.10	4,832,100.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	51.20	3,328,000.00	
	PCCW LTD	357,000	4.40	1,570,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	57.55	2,877,500.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	94.20	12,575,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	737,913	15.80	11,659,025.40	

	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	56.85	6,310,350.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	85.60	2,028,720.00	
	香港ドル 小計	7,660,909		278,598,362.60	(3,922,664,945)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.64	745,672.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.66	284,620.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.26	355,340.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.06	211,894.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.29	381,285.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.56	414,263.48	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.05	258,560.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.07	454,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.80	355,880.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	33.55	332,145.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.27	115,225.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.26	582,236.00	
	DBS GROUP	145,600	25.09	3,653,104.00	
	OCBC BANK	260,000	11.22	2,917,200.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	26.81	2,967,867.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.41	461,643.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.29	615,559.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.59	299,208.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.89	327,275.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.87	459,259.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.11	1,993,332.73		
	シンガポールドル 小計	3,459,876		18,186,318.21	(1,466,726,563)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	373.00	1,130,936.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	19.05	1,290,751.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	433.30	632,618.00	
	BANK HAPOALIM BM	84,067	25.55	2,147,911.85	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	23.57	2,729,264.58	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	63.70	522,340.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	180.30	779,436.90	
	NICE LTD	4,894	407.00	1,991,858.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	3.79	585,956.74	
	イスラエルシェケル 小計	444,132		11,811,073.87	(356,576,320)
	合 計	90,391,020		326,818,641,203	(326,818,641,203)

## (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	895,710.00		
		LENDLEASE GROUP	44,009	915,827.29		
		SYDNEY AIRPORT	89,860	651,485.00		
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,463,022.29	(198,987,570)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,735,335.00		
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,776,480.00		
	香港ドル 小計		488,500	4,511,815.00	(63,526,355)	
	投資信託受益証券合計			711,940	262,513,925	(262,513,925)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	694,336.80		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,100,235.04		
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	5,426,851.83		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	1,033,909.44		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,979,659.20		
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,625,709.30		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	673,030.80		
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,734,721.86		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	2,086,680.72		
		DUKE REALTY CORP	29,929	866,145.26		
		EQUINIX INC	6,496	2,850,249.92		
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,948,584.15		
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,235,437.18		
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	960,556.56		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	779,911.44		
		GGP INC	55,941	1,198,256.22		
		HCP INC	36,011	980,219.42		
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,242,990.84		
		INVITATION HOMES INC	24,000	556,800.00		
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	747,438.72		
		KIMCO REALTY CORP	35,407	601,564.93		
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	526,315.44		
		MACERICH CO/THE	10,128	585,600.96		
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	898,532.44		
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	506,148.60		
		PROLOGIS INC	43,653	2,943,521.79		
PUBLIC STORAGE	12,835	2,869,520.95				
REALTY INCOME CORP	21,691	1,276,515.35				
REGENCY CENTERS CORP	11,717	764,065.57				

	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,478,142.12
	SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,661,719.12
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	853,972.62
	UDR INC	20,960	834,836.80
	VENTAS INC	27,813	1,659,601.71
	VEREIT INC	77,798	619,272.08
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	1,022,252.55
	WELLTOWER INC	29,615	1,975,320.50
アメリカドル 小計		919,180	55,798,628.23 (6,169,096,337)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	192,031.05
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	391,122.50
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	176,700.78
カナダドル 小計		30,576	759,854.33 (64,321,669)
ユーロ	COVIVIO	3,578	320,231.00
	GECINA SA	3,549	519,218.70
	ICADE	2,845	234,143.50
	KLEPIERRE	17,225	544,999.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,790	2,011,795.50
ユーロ 小計		37,987	3,630,387.70 (458,917,309)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	507,614.28
	HAMMERSON PLC	61,184	300,658.17
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	540,709.25
	SEGRO PLC	81,695	537,226.32
イギリスポンド 小計		280,843	1,886,208.02 (265,728,985)
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	778,685.90
	GOODMAN GROUP	140,271	1,484,067.18
	GPT GROUP	136,015	711,358.45
	MIRVAC GROUP	306,089	740,735.38
	SCENTRE GROUP	426,663	1,821,851.01
	STOCKLAND	207,412	893,945.72
	VICINITY CENTERS	291,115	809,299.70
オーストラリアドル 小計		1,581,655	7,239,943.34 (584,915,022)
香港ドル	LINK REIT	179,500	13,821,500.00
香港ドル 小計		179,500	13,821,500.00 (194,606,720)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	537,200.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	425,250.00

	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	442,663.00	
	SUNTEC REIT	173,000	326,970.00	
	シンガポールドル 小計	813,800	1,732,083.00 (139,692,493)	
	投資証券合計	3,843,541	7,877,278,535 (7,877,278,535)	
	合計		8,139,792,460 (8,139,792,460)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 599銘柄	97.3%			66.2%
	投資証券 37銘柄			2.7%	1.8%
カナダドル	株式 87銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	98.9%			11.9%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 97銘柄	98.8%			6.5%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	91.3%			2.5%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			6.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	93.8%			1.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.7%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.3%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2018年 8月20日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	482,235,908
コール・ローン	2,721,320,932
国債証券	246,233,291,798
派生商品評価勘定	14,726,574
未収利息	1,676,549,185
前払費用	99,204,535
差入委託証拠金	131,280,906
流動資産合計	251,358,609,838
資産合計	251,358,609,838
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,271,734
前受金	9,976,994
未払解約金	134,939,639
未払利息	6,950
その他未払費用	409
流動負債合計	146,195,726
負債合計	146,195,726
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	93,887,447,277
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	157,324,966,835
元本等合計	251,212,414,112
純資産合計	251,212,414,112
負債純資産合計	251,358,609,838

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,887,447,277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 2.6757円 (1万口当たり純資産額) (26,757円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



2018年 8月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	91,834,362,516円
期中追加設定元本額	16,614,688,962円
期中一部解約元本額	14,561,604,201円
期末元本額	93,887,447,277円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,031,568,885円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	838,116,474円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	552,338,378円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,950,914,694円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,734,618円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,092,497,172円
世界経済インデックスファンド	6,468,212,603円
D C マイセレクション 2 5	1,524,454,998円
D C マイセレクション 5 0	1,218,419,728円
D C マイセレクション 7 5	774,798,319円

区分	2018年 8月20日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,742,229,999円
D C マイセレクション S 2 5	612,485,568円
D C マイセレクション S 5 0	470,665,399円
D C マイセレクション S 7 5	217,224,833円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	46,979,929円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	50,941,054円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	22,973,093円
D C 世界経済インデックスファンド	5,192,163,505円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	580,100,592円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,355,707円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,850,777円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,962,616円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	61,813,632円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	170,438,258円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	259,943,261円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	199,640,349円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	598,428,514円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,555,376,618円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	703,709,472円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,475,795,012円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	962,526,609円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	119,975,752円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	716,707,541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）	549,575,599円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	273,223,268円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	349,207,284円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,136,958,229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）	968,628,226円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	878,222,863円
外国債券ファンド・シリーズ 1	642,195,021円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,447,993,655円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,621,875,077円
分散投資コア戦略ファンド A	1,019,746,959円
分散投資コア戦略ファンド S	2,912,392,804円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	212,972,524円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,228,073,415円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,219,449,966円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,702,618円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	120,715,580円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	949,693,292円
S M T インデックスバランス・オープン	270,284,804円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	24,624,026,570円
S M T 世界経済インデックス・オープン	24,101,750円

区分	2018年 8月20日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	83,808,964円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	108,100,260円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	521,694円
グローバル経済コア	1,112,847,235円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	2,874,300円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	8,242円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	995,625,157円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	7,240,968,547円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	359,309,415円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	122,213,072
合計	122,213,072

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2018年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,045,604,728	-	2,055,581,722	9,976,994
	合計	2,045,604,728	-	2,055,581,722	9,976,994

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2018年 8月20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				
	買建	2,805,470,454	-	2,808,948,300	3,477,846
	アメリカドル	1,366,763,776	-	1,366,133,000	630,776
	カナダドル	121,885,228	-	122,554,000	668,772
	ユーロ	1,125,166,593	-	1,128,841,300	3,674,707
	イギリスポンド	191,654,857	-	191,420,000	234,857
	合計	2,805,470,454	-	2,808,948,300	3,477,846

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,420,565.31	
		T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,256,723.00	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,903,168.32	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,382,543.52	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,780,261.20	
		T 1.125% 09/30/21	15,300,000.00	14,587,444.42	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,916,862.72	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,442,433.36	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,332,740.48	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,375,778.31	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,236,061.87	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,418,935.99	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,559,433.10	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,919,055.65	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,916,305.00	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,654,847.80	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,910,345.10	
		T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,121,993.25	

T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	979,837.46	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,181,146.84	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,517,095.59	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,432,654.69	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,689,399.95	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,338,992.82	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,897,814.96	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,474,718.72	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,838,851.94	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,534,569.83	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,322,319.93	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,391,787.85	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,786,789.36	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,649,089.28	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,051,734.14	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,785,581.80	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,940,750.75	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,916,871.01	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,935,139.85	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,442,509.14	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,433,714.37	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,328,615.95	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,577,478.30	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,750,957.70	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,946,586.56	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,906,703.55	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,397,230.00	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,436,244.52	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,506,765.17	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,836,004.17	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,981,166.07	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,241,474.53	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,419,919.10	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,235,867.55	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,822,845.71	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,670,183.26	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,731,178.80	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,219,421.21	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,752,162.34	
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,959,831.15	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,768,011.14	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,924,377.28	

T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,031,786.26
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,429,987.42
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,701,089.87
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,716,296.15
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,871,478.60
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,157,983.41
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,260,404.22
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,282,839.87
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,389,067.20
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,935,223.96
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,179,354.93
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,962,039.89
T 2.125% 02/29/24	15,750,000.00	15,230,856.69
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,150,972.09
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,493,176.99
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,386,017.47
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,054,752.32
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,626,793.20
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,002,333.38
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,436,434.94
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,966,148.28
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,701,388.16
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,937,500.24
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,416,745.27
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,544,139.24
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,017,865.77
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,461,715.46
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,963,299.59
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,561,999.89
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,170,292.04
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,105,326.47
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,831,640.98
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,791,225.37
T 2.25% 11/15/27	10,650,000.00	10,118,718.98
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,948,620.64
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,131,876.45
T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,508,973.77
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,214,296.12
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,285,371.56
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,911,422.15
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,706,220.08
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,897,890.42
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,009,016.22

T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,857,001.70
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,300,703.43
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,924,824.85
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,497,564.29
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,393,917.23
T 2.625% 03/31/25	3,000,000.00	2,966,946.90
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,501,162.42
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,994,266.25
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,997,156.45
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,294,379.88
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,603,926.61
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,869,361.46
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	9,426,010.21
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,897,905.64
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,014,440.93
T 2.75% 11/15/47	8,550,000.00	8,097,962.78
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	5,028,691.23
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,612,336.35
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,441,328.35
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,520,192.37
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,998,074.78
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,935,285.88
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,731,419.00
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,057,562.65
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,139,956.53
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,919,850.11
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,662,101.70
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,664,133.48
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,935,913.25
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,530,075.52
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,348,376.26
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,142,110.62
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,421,057.01
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,941,641.88
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,150,184.65
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,400,101.13
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,099,265.65
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,362,600.36
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,121,078.26
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,319,897.12
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,973,250.92
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,840,255.37

T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,252,870.60	
T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,735,483.31	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,107,287.60	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,355,889.52	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,543,205.65	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,730,599.96	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,214,422.82	
T 3.75% 11/15/43	7,050,000.00	7,965,192.08	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,604,051.36	
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,949,832.12	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,490,334.26	
T 3% 05/15/47	6,700,000.00	6,672,246.92	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,035,458.27	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,079,926.47	
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,386,075.66	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,213,110.08	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,324,141.86	
T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	5,095,427.02	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,297,932.52	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,240,631.16	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,233,228.08	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	309,885.63	
T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	4,920,706.67	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,429,275.43	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,517,883.32	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,572,368.05	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,014,405.69	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,472,064.54	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,065,822.59	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,832,132.44	
T 6.25% 05/15/30	400,000.00	533,330.26	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,919,275.92	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,978,259.40	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,216,265.70	
アメリカドル 小計	1,025,570,000.00	1,005,833,769.17	(111,204,981,519)
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,926,694.50	
CAN 0.75% 03/01/21	2,850,000.00	2,753,342.25	
CAN 0.75% 08/01/19	2,770,000.00	2,739,045.25	
CAN 0.75% 09/01/20	2,470,000.00	2,403,544.65	
CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,563,593.80	
CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,471,187.50	
CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,048,211.00	



	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,324,244.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,177,582.50
	CAN 1.75% 03/01/23	1,050,000.00	1,030,107.75
	CAN 1.75% 09/01/19	2,600,000.00	2,594,033.00
	CAN 1% 06/01/27	2,570,000.00	2,314,130.80
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,432,605.00
	CAN 2.25% 06/01/25	2,050,000.00	2,051,394.00
	CAN 2.5% 06/01/24	2,610,000.00	2,647,988.55
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,604,417.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,550,000.00	1,713,858.25
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	712,956.60
	CAN 2% 06/01/28	1,000,000.00	977,015.00
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	375,950.00
	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,193,207.75
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,844,190.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,500,000.00	3,115,750.00
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,604,360.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,900,000.00	2,526,534.50
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,290,688.00
	CAN 5% 06/01/37	1,710,000.00	2,413,365.75
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	524,354.40
	カナダドル 小計	58,620,000.00	61,374,351.80 (5,195,338,879)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	20,692,477.50
	MBONO 10% 12/05/24	40,000,000.00	44,288,600.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	21,750,000.00	19,143,588.75
	MBONO 5% 12/11/19	35,680,000.00	34,426,204.80
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,667,382.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,950,000.00	34,747,832.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,410,000.00	37,477,213.15
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	16,842,388.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	23,786,671.50
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,829,185.25
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,270,254.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,700,000.00	15,438,307.50
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,846,708.75
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	9,237,003.75
	MBONO 8% 12/07/23	6,400,000.00	6,444,864.00
	メキシコペソ 小計	360,040,000.00	360,138,681.95 (2,110,412,676)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,722,533.50
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,181,543.00

BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,155,217.30
BGB 0.8% 06/22/28	1,250,000.00	1,263,575.00
BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	868,887.00
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	814,552.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,340,381.25
BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,200,655.50
BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,199,676.50
BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,307,845.50
BGB 2.15% 06/22/66	630,000.00	678,154.05
BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,966,905.60
BGB 2.25% 06/22/57	450,000.00	503,743.50
BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,756,664.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,260,000.00	1,862,695.80
BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	3,000,813.75
BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,344,597.50
BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,079,520.00
BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	3,557,642.55
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,694,263.25
BGB 4.25% 09/28/22	1,350,000.00	1,604,110.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,420,000.00	1,867,633.70
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,606,692.50
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,429,294.95
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,303,238.60
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,537,593.45
BKO 0% 12/13/19	800,000.00	807,264.00
BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,483,489.50
BTPS 0.35% 06/15/20	4,350,000.00	4,278,486.00
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,624,915.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,352,211.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,184,631.50
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,523,975.50
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	1,980,850.00
BTPS 0.9% 08/01/22	500,000.00	475,447.50
BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,220,258.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,877,590.00
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,350,848.25
BTPS 1.25% 12/01/26	2,600,000.00	2,286,453.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,821,801.50
BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	641,889.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,018,169.25
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	2,942,048.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,415,504.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,456,584.00

BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,559,096.50	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	1,911,780.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	2,941,040.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,516,550.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,950,000.00	2,756,789.75	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	1,775,235.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,159,476.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,318,272.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,600,000.00	2,219,152.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	765,403.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,450,000.00	1,320,812.25	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,503,372.75	
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,226,979.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,459,844.25	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,860,000.00	1,789,757.10	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,210,000.00	3,247,460.70	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,050,000.00	4,256,671.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,260,177.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,211,660.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,265,852.75	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,705,965.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,741,915.25	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,729,026.75	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	3,988,282.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	4,707,087.50	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,251,312.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,636,233.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,277,099.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,760,000.00	3,112,976.40	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,777,436.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,700,000.00	3,950,601.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,416,644.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,250,000.00	3,859,261.25	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,295,046.25	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,819,917.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,879,594.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,381,831.00	
BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,295,155.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	2,999,892.75	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	4,134,725.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,424,479.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	3,988,734.75	

BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	4,913,259.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,828,470.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,049,692.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,500,129.25
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,331,136.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,529,523.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,350,327.55
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,138,282.25
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,090,361.00
DBR 1.25% 08/15/48	1,100,000.00	1,181,042.50
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,770,307.25
DBR 1.5% 05/15/23	2,050,000.00	2,233,300.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,518,885.50
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,565,818.75
DBR 1.75% 02/15/24	1,350,000.00	1,500,525.00
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,348,740.00
DBR 1% 08/15/24	3,000,000.00	3,215,820.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,279,848.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,649,012.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,172,810.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,569,770.00
DBR 2.5% 07/04/44	3,200,000.00	4,390,208.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,390,000.00	4,709,930.40
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,584,674.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,346,424.50
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,585,423.75
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,777,417.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,050,000.00	3,128,259.00
DBR 3% 07/04/20	5,340,000.00	5,709,581.40
DBR 4.0% 01/04/37	3,050,000.00	4,799,236.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,103,356.50
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,353,308.60
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,240,301.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,791,350.50
DBR 5.5% 01/04/31	2,300,000.00	3,716,880.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	3,011,650.00
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,706,690.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,650,000.00	2,742,382.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,657,610.00
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,089,325.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,800,190.50
FRTR 0.5% 05/25/25	4,750,000.00	4,862,266.25
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,376,900.40

FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,788,720.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	3,600,000.00	3,653,766.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	1,550,000.00	1,563,756.25	
FRTR 0% 03/25/23	750,000.00	755,752.50	
FRTR 0% 03/25/24	2,450,000.00	2,450,257.25	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,151,639.50	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,616,045.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,387,233.00	
FRTR 1.25% 05/25/36	3,600,000.00	3,642,714.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,850,000.00	6,296,296.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,800,000.00	5,241,816.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,200,000.00	1,204,380.00	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,150,000.00	2,332,578.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,355,532.50	
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,821,458.75	
FRTR 1% 11/25/25	7,050,000.00	7,449,629.25	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,506,053.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000.00	7,848,091.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,256,130.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,813,705.75	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,700,000.00	6,863,170.50	
FRTR 2% 05/25/48	2,800,000.00	3,091,158.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,681,507.75	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,653,779.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,757,680.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	1,880,000.00	2,347,894.40	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,910,000.00	6,584,449.20	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,290,242.40	
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,146,948.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,675,093.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,020,000.00	6,532,379.40	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,711,170.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,379,056.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,794,266.75	
FRTR 4% 10/25/38	3,800,000.00	5,709,918.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,086,623.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,756,492.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,693,516.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,410,125.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,240,887.20	
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,005,293.45	
IRISH 0.9% 05/15/28	600,000.00	604,080.00	

IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	519,365.60
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	778,818.75
IRISH 1% 05/15/26	1,650,000.00	1,709,713.50
IRISH 2.4% 05/15/30	1,450,000.00	1,668,326.50
IRISH 2% 02/18/45	1,060,000.00	1,136,203.40
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,360,427.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,120,000.00	1,325,212.00
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,254,574.40
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,059,438.50
IRISH 5.9% 10/18/19	310,000.00	333,157.00
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	884,290.45
NETHER 0.25% 01/15/20	1,320,000.00	1,337,602.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,160,000.00	2,190,099.60
NETHER 0.5% 07/15/26	3,800,000.00	3,898,914.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,650,000.00	1,714,614.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,100,000.00	1,135,755.50
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,827,099.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	906,907.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,143,235.25
NETHER 2.25% 07/15/22	1,600,000.00	1,767,856.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,316,292.50
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,493,916.10
NETHER 2% 07/15/24	2,450,000.00	2,754,057.25
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,278,001.00
NETHER 3.5% 07/15/20	2,800,000.00	3,023,132.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,601,434.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,980,000.00	3,192,027.30
NETHER 4% 01/15/37	1,940,000.00	3,023,538.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,690,962.00
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	269,779.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,375,485.75
OBL 0.25% 10/16/20	4,600,000.00	4,690,114.00
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,819,973.55
OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,843,472.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,664,188.00
OBL 0% 10/08/21	3,800,000.00	3,866,500.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,060,132.50
RAGB 0.5% 04/20/27	1,100,000.00	1,106,946.50
RAGB 0.75% 02/20/28	250,000.00	255,216.25
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,533,715.00
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	504,055.00
RAGB 0% 09/20/22	670,000.00	677,678.20
RAGB 1.2% 10/20/25	1,850,000.00	1,982,876.25

RAGB 1.5% 02/20/47	640,000.00	667,977.60	
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	381,844.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,927,686.25	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,538,257.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	585,595.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,139,505.60	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,030,000.00	1,475,624.35	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,738,852.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,437,181.25	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,263,124.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	829,780.30	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,899,738.75	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,751,957.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	675,337.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,287,320.75	
RFGB 0.375% 09/15/20	790,000.00	806,084.40	
RFGB 0.5% 04/15/26	550,000.00	560,059.50	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	351,751.75	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	540,945.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	650,000.00	682,561.75	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	546,901.20	
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	765,111.00	
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	590,240.70	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	702,685.75	
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	831,472.95	
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	792,777.10	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	875,919.60	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	670,026.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	746,581.50	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	885,976.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,429,879.40	
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,104,477.00	
SPGB 0.35% 07/30/23	480,000.00	478,377.60	
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,074,292.50	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,373,429.50	
SPGB 0.75% 07/30/21	1,760,000.00	1,802,530.40	
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,085,440.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	3,100,000.00	3,138,936.00	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,422,823.20	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,220,000.00	2,223,674.10	
SPGB 1.4% 07/30/28	580,000.00	577,506.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,631,889.00	

	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,112,692.75	
	SPGB 1.6% 04/30/25	2,900,000.00	3,053,105.50	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,146,293.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,250,000.00	2,321,673.75	
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,851,128.75	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,200,000.00	2,319,504.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	950,000.00	979,635.25	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,600,704.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,100,000.00	2,277,796.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,407,683.75	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,650,281.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,680,000.00	3,564,895.80	
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,122,768.00	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,100,498.75	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,264,495.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,850,000.00	4,079,518.50	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,744,180.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,333,887.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,286,912.50	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,221,310.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,806,741.50	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,000,000.00	3,064,980.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,170,032.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,800,000.00	4,374,123.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,420,000.00	5,105,136.60	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,250,000.00	5,103,612.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,250,151.80	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,511,034.00	
	ユーロ 小計	682,360,000.00	772,893,165.80 (97,701,425,088)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,450,020.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,800,000.00	2,769,340.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,200,000.00	4,190,634.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	5,730,000.00	5,833,856.25	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,662,517.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,670,000.00	2,537,367.75	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,350,000.00	1,381,232.25	
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	818,540.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,980,000.00	2,054,834.10	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,150,000.00	3,258,895.50	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,940,000.00	1,959,235.10	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,923,662.50	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,300,000.00	3,004,628.00	



UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,419,989.00	
UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,468,346.00	
UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,387,835.00	
UKT 3.25% 01/22/44	3,350,000.00	4,383,408.00	
UKT 3.5% 01/22/45	3,300,000.00	4,525,867.50	
UKT 3.5% 07/22/68	2,400,000.00	3,989,964.00	
UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,153,453.50	
UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	567,723.75	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	796,608.75	
UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,451,285.00	
UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,915,702.00	
UKT 4.25% 06/07/32	2,050,000.00	2,743,658.50	
UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,830,015.50	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	847,342.30	
UKT 4.25% 12/07/40	2,250,000.00	3,308,040.00	
UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,282,573.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,864,028.15	
UKT 4.25% 12/07/55	2,370,000.00	4,099,626.00	
UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,426,822.45	
UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,956,363.25	
UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,817,122.25	
UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,469,177.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,907,351.50	
UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,367,874.25	
UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,612,871.25	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,371,684.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,814,062.50	
UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,862,681.50	
イギリスポンド 小計	94,620,000.00	116,486,238.85 (16,410,581,329)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	423,188.00
	SWISS 2% 04/28/21	800,000.00	859,164.00
	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	662,409.00
	SWISS 4% 04/08/28	720,000.00	1,010,534.40
スイスフラン 小計	2,470,000.00	2,955,295.40 (328,421,977)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,650,000.00	7,863,588.00
	SGB 1.5% 11/13/23	11,500,000.00	12,456,052.50
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,835,176.75
	SGB 2.5% 05/12/25	8,150,000.00	9,460,194.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	8,349,412.50
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	16,107,828.45

	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,531,920.00	
スウェーデンクローナ 小計		67,570,000.00	76,604,172.20	(923,080,275)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,610,000.00	4,588,263.85	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,694,872.50	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,350,000.00	5,437,847.00	
	NGB 2% 04/26/28	2,930,000.00	3,010,296.65	
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,924,853.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	11,320,000.00	12,135,492.80	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,024,330.75	
ノルウェークローネ 小計		43,060,000.00	44,815,957.30	(585,296,402)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	3,500,000.00	3,565,730.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,800,000.00	6,943,276.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,195,947.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	13,090,000.00	14,735,936.60	
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,914,236.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,850,000.00	31,152,444.75	
	DGB 4% 11/15/19	12,590,000.00	13,318,457.40	
デンマーククローネ 小計		71,130,000.00	88,826,027.75	(1,505,601,170)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,197,206.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,084,037.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,007,980.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	3,800,000.00	3,824,966.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,473,090.75	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,902,851.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,530,000.00	2,448,723.75	
	POLGB 2% 04/25/21	6,760,000.00	6,797,957.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,763,149.60	
	POLGB 4% 10/25/23	3,750,000.00	4,024,650.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,393,069.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,725,580.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	744,918.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,091,706.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,287,016.75	
ポーランドズロチ 小計		49,670,000.00	50,766,902.50	(1,489,500,919)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,835,265.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,294,435.30	
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	401,820.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	800,000.00	791,512.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,596,995.35	

	ACGB 2.75% 05/21/41	440,000.00	422,980.80	
	ACGB 2.75% 06/21/35	820,000.00	811,365.40	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,100,000.00	2,118,973.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,613,545.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,104,945.75	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,650,000.00	1,677,942.75	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,393,506.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,850,000.00	4,057,284.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,470,000.00	2,629,537.30	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,200,000.00	1,260,456.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,691,497.50	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,589,568.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	5,021,670.10	
	ACGB 4.5% 04/15/20	4,090,000.00	4,257,199.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,550,786.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,523,307.25	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,450,000.00	3,957,305.25	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,341,425.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,489,408.05	
	オーストラリアドル 小計	61,540,000.00	65,432,731.25 (5,286,310,357)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	244,585.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	410,000.00	409,454.70	
	SIGB 1.75% 04/01/22	360,000.00	357,046.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	550,000.00	541,659.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	877,116.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	190,000.00	177,005.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	720,000.00	724,266.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	170,000.00	173,113.55	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	693,588.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	614,404.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	833,267.25	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	290,620.40	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	484,577.05	
	SIGB 2% 07/01/20	760,000.00	761,797.40	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,169.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,098,831.15	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	843,527.10	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,032,165.50	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	835,680.00	
	シンガポールドドル 小計	11,860,000.00	12,140,874.55 (979,161,532)	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,472,550.00	

マレーシア リンギット	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,667,627.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,002,360.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,276,844.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	960,000.00	962,572.80	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,154,686.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,268,137.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,103,388.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,069,960.00	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	756,011.25	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,805.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,106,529.90	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,680,627.50	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,077,070.25	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,910,222.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,397,930.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,675,987.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,950,000.00	2,988,895.75	
	MGS 4.232% 06/30/31	1,030,000.00	1,004,049.15	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,331,834.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,225,487.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,830,384.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,660,147.50	
	MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	392,006.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,662,870.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,877,333.75	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	645,975.00	
マレーシアリンギット 小計		43,920,000.00	43,713,291.10	(1,178,947,460)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	27,500,000.00	29,827,462.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,837,919.90	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,735,531.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,091,402.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	5,350,000.00	5,320,735.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,449,546.00	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,553,425.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,717,874.80	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	14,749,029.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,279,308.30	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,370,889.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,816,089.25	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,143,737.50	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,531,545.75	

	南アフリカランド 小計	194,570,000.00	177,424,496.75 (1,334,232,215)	
	合計		246,233,291,798 (246,233,291,798)	

## 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 179銘柄	100.0%	45.2%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 285銘柄	100.0%	39.7%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.7%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.1%
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 27銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,218,978,446
コール・ローン	30,324,945
株式	46,794,325,781
投資信託受益証券	67,970,012
投資証券	193,856,495
派生商品評価勘定	454,675
未収入金	4,341,705
未収配当金	133,398,002
前払金	58,259,592
差入委託証拠金	168,762,597
流動資産合計	48,670,672,250
資産合計	48,670,672,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,733,888
未払金	935,604
未払解約金	16,670,769
未払利息	77
その他未払費用	3
流動負債合計	76,340,341
負債合計	76,340,341
純資産の部	
元本等	
元本	17,830,347,012
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,763,984,897
元本等合計	48,594,331,909
純資産合計	48,594,331,909
負債純資産合計	48,670,672,250

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

2018年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,830,347,012口

		2018年 8月20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)	2.7254円 (27,254円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		2018年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2018年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。		



2018年 8月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	15,871,852,301円
期中追加設定元本額	2,946,229,178円
期中一部解約元本額	987,734,467円
期末元本額	17,830,347,012円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,762,577,190円
世界経済インデックスファンド	2,994,654,403円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,685,681,503円
DC 世界経済インデックスファンド	2,415,624,519円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	97,419,190円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	279,028,719円

区分	2018年 8月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	344,828,906円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	370,533,810円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,682,757円
S M T インデックスバランス・オープン	125,613,969円
S M T 世界経済インデックス・オープン	15,814,294円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	152,171,016円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	22,702,542円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	463,719円
グローバル経済コア	535,754,745円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	8,795,730円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,326,062,665
投資信託受益証券	6,751,700
投資証券	43,501,363
合計	3,362,812,328

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2018年 8月20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	1,591,389,584	-	1,533,129,992	58,259,592
	合計	1,591,389,584	-	1,533,129,992	58,259,592

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2018年 8月20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	15,550,768	-	15,530,874	19,894
	アメリカドル	15,550,768	-	15,530,874	19,894
	売建	55,368	-	55,095	273
	ブラジルリアル	55,368	-	55,095	273
合計		15,606,136	-	15,585,969	19,621

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	487,161	4.16	2,030,974.20	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	1.18	123,136.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	37,814	65.00	2,457,910.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	152.40	1,313,230.80	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	6.28	679,757.95	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	119,005	4.06	483,874.33	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	65.98	1,460,203.38	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	12.20	206,546.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	56,475	16.06	906,988.50	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	22.93	355,621.37	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	12.30	229,026.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	30.35	216,213.40	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	15.16	384,306.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	43.63	235,689.26	
	51JOB INC-ADR	1,655	71.70	118,663.50	
	DP WORLD LTD	21,152	21.00	444,192.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	32.83	358,963.22	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	12,213	83.37	1,018,197.81	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	29,537	31.12	919,191.44	

	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	34.86	1,161,047.16	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	33,525	38.45	1,289,036.25	
	JD.COM INC-ADR	61,163	32.22	1,970,671.86	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	7.15	259,108.85	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	14.84	459,579.96	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	4.54	425,357.46	
	CREDICORP LTD	5,824	221.76	1,291,530.24	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	225,496	11.48	2,588,694.08	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.33	274,486.02	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	43.36	87,630.56	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.31	59,421.60	
	58.COM INC-ADR	7,312	66.65	487,344.80	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	97,798	172.78	16,897,538.44	
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	78.28	414,727.44	
	BAIDU INC - SPON ADR	23,220	222.67	5,170,397.40	
	FANG HOLDINGS LTD-ADR	12,536	2.70	33,847.20	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	31.21	137,480.05	
	MOMO INC-SPON ADR	10,135	38.15	386,650.25	
	NETEASE INC-ADR	6,861	206.63	1,417,688.43	
	SINA CORP	5,725	69.01	395,082.25	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	74.90	287,466.20	
	YY INC-ADR	4,344	73.64	319,892.16	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	7.50	298,905.00	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	0.87	95,351.13	
	アメリカドル 小計	2,212,065		50,151,619.95 (5,544,763,101)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	12.75	15,696,027.75	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	52.54	15,803,611.68	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	300.33	4,354,785.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	63.51	6,151,070.52	
	ALFA S.A.B. -A	242,900	24.15	5,866,035.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	69.90	2,621,250.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	326.94	5,062,665.90	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	173.10	5,379,948.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	197.61	3,355,417.80	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	66.00	2,263,800.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	209,790	68.73	14,418,866.70	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	131.06	1,428,554.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	53.31	24,979,999.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	124.87	4,204,997.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	117.82	5,101,606.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	182.43	29,086,639.20	

	GRUMA S.A.B. -B	14,210	237.01	3,367,912.10	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	39.10	5,176,840.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	33.18	6,032,124.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	29.55	5,014,635.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	219,300	125.88	27,605,484.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	29.97	7,567,425.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,812,440	15.72	44,211,556.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	85.46	3,221,842.00	
	メキシコペソ 小計	6,767,185		247,973,093.50 (1,453,122,327)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	36.08	663,872.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	20.95	5,306,635.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	326,340	18.46	6,024,236.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	42.84	1,229,508.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	56.40	834,720.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	71,700	9.01	646,017.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	22,500	75.87	1,707,075.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	15.65	1,361,550.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	43.94	1,770,782.00	
	VALE SA	267,478	50.80	13,587,882.40	
	EMBRAER SA	69,700	19.42	1,353,574.00	
	WEG SA	66,872	17.50	1,170,260.00	
	CCR SA	101,100	9.64	974,604.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	34,302	22.34	766,306.68	
	RUMO SA	97,700	13.58	1,326,766.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.21	1,410,858.64	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	16.44	1,047,491.04	
	LOJAS RENNER S.A.	60,370	29.02	1,751,937.40	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,100	133.65	948,915.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	27,700	18.00	498,600.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	14.35	595,525.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	80.41	1,190,068.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	75.73	1,597,903.00	
	AMBEV SA	406,600	19.18	7,798,588.00	
	BRF SA	52,500	20.13	1,056,825.00	
	JBS SA	111,900	8.89	994,791.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	43.89	276,507.00	
	NATURA COSMETICOS SA	10,700	26.30	281,410.00	
	ODONTOPREV S.A.	12,400	12.85	159,340.00	
	HYPERA SA	35,300	28.42	1,003,226.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	96,969	25.11	2,434,891.59	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	273,361	28.62	7,823,591.82	

	BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	31.26	2,160,066.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	271,721	42.98	11,678,568.58	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	370,067	9.95	3,682,166.65	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	22.55	3,889,942.65	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	25.90	1,458,170.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,200	59.05	425,160.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	54.23	395,879.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	9.43	538,104.09	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	16,500	18.66	307,890.00	
	CIELO SA	99,269	14.67	1,456,276.23	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	40.11	1,275,498.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	11.54	841,266.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	18.80	332,760.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	16.18	202,250.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	8.20	541,134.40	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	25.14	656,154.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	13.71	364,686.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	37.05	496,470.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	24,000	58.66	1,407,840.00	
	ブラジルリアル 小計	4,298,707		101,704,538.57 (2,874,170,259)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	10,163.00	454,590,990.00	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	2,522.10	212,562,588.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	29,881.00	294,537,017.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	6,402.30	141,535,646.10	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	5,404.70	286,951,737.10	
	CENCOSUD SA	137,988	1,604.00	221,332,752.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,815.30	82,185,041.90	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,543.80	38,696,285.60	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	99.13	231,496,306.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,530	43,005.00	108,802,650.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	51.27	321,966,422.67	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	6.52	109,304,992.05	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,451.10	101,128,807.20	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	360.06	58,779,074.88	
	COLBUN SA	475,888	141.06	67,128,761.28	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	106.01	229,255,211.81	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	64.95	166,355,006.10	
	チリペソ 小計	31,124,924		3,126,609,290.09 (515,577,871)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	3,095.00	1,105,927,065.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	9,100.00	291,300,100.00	

	GRUPO ARGOS SA	17,723	19,160.00	339,572,680.00
	BANCOLOMBIA SA	20,302	33,560.00	681,335,120.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	33,800.00	1,293,796,400.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,190.00	361,412,520.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	36,400.00	757,848,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	35,460.00	445,413,060.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,580.00	685,939,380.00
	コロンビアペソ 小計	853,241		5,962,544,325.00 (217,632,867)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	19.10	83,237.80
	OPAP SA	17,668	9.10	160,867.14
	JUMBO SA	8,599	13.24	113,850.76
	ALPHA BANK AE	129,138	1.56	201,713.55
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.74	110,243.72
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.22	92,190.14
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	2.29	42,596.29
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.65	216,120.45
	ユーロ 小計	749,160		1,020,819.85 (129,041,837)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	120.90	1,402,802.70
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	11.33	1,322,834.15
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	52,814	5.11	269,879.54
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	25.10	597,656.10
	KOC HOLDING AS	62,460	14.85	927,531.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	5.15	222,315.20
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	25.44	250,227.84
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	15.37	955,875.67
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	54.80	178,538.40
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	21.30	143,775.00
	ARCELIK AS	15,358	12.81	196,735.98
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,412	64.85	1,388,568.20
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	21.14	237,402.20
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	28.10	124,117.70
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	14.08	135,534.08
	AKBANK T.A.S.	176,098	5.82	1,024,890.36
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	5.84	1,401,553.28
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	5.80	304,099.80
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	3.86	429,112.34
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	3.39	176,086.77
	YAPI VE KREDI BANKASI	213,344	1.67	356,284.48
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	7.19	441,796.74
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	10.97	1,043,203.12

トルコリラ 小計		1,456,208		13,530,820.65 (249,373,024)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	935.50	6,981,636.50
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	76.95	2,055,873.15
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	259.00	1,165,500.00
	CEZ AS	13,737	547.00	7,514,139.00
チェココルナ 小計		52,417		17,717,148.65 (87,168,371)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	2,740.00	90,069,280.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,390.00	81,809,420.00
	OTP BANK NYRT	19,549	10,330.00	201,941,170.00
ハンガリーフォリント 小計		67,599		373,819,870.00 (146,275,715)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	66.32	365,821.12
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	95.72	2,528,348.08
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	5.36	785,223.92
	GRUPA AZOTY SA	2,786	35.76	99,627.36
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	74.50	310,739.50
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	84.00	1,103,088.00
	CCC SA	3,138	210.00	658,980.00
	LPP SA	124	8,720.00	1,081,280.00
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	22.00	517,044.00
	DINO POLSKA SA	4,430	101.20	448,316.00
	ALIOR BANK SA	8,830	65.80	581,014.00
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	71.30	143,313.00
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	8.78	289,889.26
	BANK PEKAO SA	15,510	111.55	1,730,140.50
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	342.00	820,116.00
	M BANK SA	747	388.60	290,284.20
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	39.15	2,995,170.75
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	40.83	2,080,329.33
	CD PROJEKT SA	6,704	203.20	1,362,252.80
	ORANGE POLSKA SA	55,658	4.87	271,054.46
PLAY COMMUNICATIONS SA	18,973	20.10	381,357.30	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	8.97	569,559.12	
ポーランドズロチ 小計		564,509		19,412,948.70 (569,575,914)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.06	299,880.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.98	1,340,160.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,175,400	7.21	15,684,634.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	287,000	16.72	4,798,640.00
	CNOOC LTD-R	1,538,000	11.98	18,425,240.00



KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	6.78	1,749,240.00
PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	5.71	10,015,340.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	8.73	1,239,660.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.05	1,037,000.00
ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	7.46	432,680.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	45.30	4,983,000.00
BBMG CORPORATION - H	131,000	2.80	366,800.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	3.22	1,081,920.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	7.52	2,481,600.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	8.56	1,797,600.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.50	278,600.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	8.97	744,510.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	7.27	1,206,820.00
MMG LIMITED	168,000	3.76	631,680.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	8.44	1,088,760.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	4.37	869,630.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	5.94	537,570.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.66	1,939,140.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.58	567,920.00
BOC AVIATION LTD	8,500	53.05	450,925.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	8.01	2,499,120.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	26.65	4,250,675.00
CHINA INTL MARINE CO-H	26,500	8.34	221,010.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	191,500	9.15	1,752,225.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.67	2,001,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.93	1,518,100.00
CITIC LTD	502,000	10.96	5,501,920.00
CRRG CORP LTD-H	313,050	6.77	2,119,348.50
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	13.04	3,755,520.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	16.20	567,000.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	2.12	303,160.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.47	414,960.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	17.50	665,000.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	6.98	499,070.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	10.34	439,450.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	143,800	8.07	1,160,466.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	26,400	8.18	215,952.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	39,500	44.85	1,771,575.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	281,000	6.38	1,792,780.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	6.43	758,740.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	8.49	916,920.00
CAR INC	42,000	6.39	268,380.00

CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	4.42	291,720.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	15.28	1,490,518.16
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.83	850,080.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	227,000	1.15	261,050.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.37	289,820.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	3.14	460,010.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	7.32	746,640.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	9.47	643,960.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	52,000	13.42	697,840.00
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	3.33	366,300.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.27	551,760.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	5.83	682,110.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	9.72	2,430,000.00
BYD CO LTD-H	49,500	43.40	2,148,300.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	4.78	1,195,000.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	45,500	6.75	307,125.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.50	1,995,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	25.05	681,360.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	421,000	15.26	6,424,460.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	4.48	912,800.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	6.79	1,713,415.76
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	12.20	1,122,400.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	39.65	4,401,150.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	20.55	2,383,800.00
HENGTECH NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.26	430,560.00
SHENZHEN INTERNATIONAL GROUP	70,000	92.00	6,440,000.00
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	108,000	2.69	290,520.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	2.61	307,980.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.82	1,189,000.00
CHINA LITERATURE LTD	11,800	50.00	590,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.75	445,468.50
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	16.04	673,680.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	9.20	1,794,000.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.94	302,820.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	21.60	5,551,200.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	142,000	32.55	4,622,100.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	6.01	724,205.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	15.28	2,261,440.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	36.90	1,033,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.59	607,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	379,000	6.10	2,311,900.00

HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	65.95	4,385,675.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	6.49	1,856,140.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	6.19	668,520.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	19.22	2,467,848.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	35.20	3,505,920.00
3SBIO INC	119,000	14.00	1,666,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	13.18	1,318,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	17.62	6,695,600.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	10.86	1,710,450.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	5.42	899,720.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	64,000	12.78	817,920.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.74	549,310.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	31.80	1,764,900.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.71	548,910.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	9.00	5,211,000.00
SSY GROUP LTD	114,000	5.55	632,700.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	11.08	409,960.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	39,000	62.50	2,437,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.63	8,777,340.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,588,200	3.54	23,322,228.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.57	5,277,435.75
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.83	4,594,296.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,081,620	6.79	54,874,199.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.17	706,910.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	357,423	28.65	10,240,168.95
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.53	3,049,242.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	4.10	569,900.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,981,515	5.62	33,616,114.30
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	202,000	4.79	967,580.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	2.05	1,705,600.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	13.24	820,880.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.84	1,261,440.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.82	1,687,140.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	63,600	12.56	798,816.00
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	1,148,000	0.47	539,560.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	14.04	2,793,960.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.05	994,050.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	9.86	1,041,216.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	16.12	954,304.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	7.01	1,940,368.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	11.54	1,832,552.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	667,000	18.44	12,299,480.00

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	226,400	29.60	6,701,440.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	205,000	1.59	325,950.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	23.95	3,396,684.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	32.55	2,180,850.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.39	2,345,880.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	9.67	5,930,494.96
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	68.70	30,674,550.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	35.15	376,105.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	11.10	1,576,200.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	26.80	6,378,400.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	3.19	1,843,820.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	23.20	7,587,328.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	26.30	6,393,819.30
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	24.80	2,995,840.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.34	1,197,840.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	657,285	11.10	7,295,863.50
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	3.23	1,800,725.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	5.68	727,040.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	8.19	458,640.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	14.06	967,328.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	14.00	980,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.93	457,080.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	8.32	740,480.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	9.14	859,160.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	20.00	2,470,000.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.54	853,440.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	20.70	2,742,750.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.77	370,815.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	3.99	748,488.09
SOHO CHINA LTD	113,000	3.21	362,730.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	23.10	4,874,100.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	358,000	1.39	497,620.00
YUZHOU PROPERTIES CO	100,000	3.80	380,000.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	136,000	8.01	1,089,360.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	13.22	872,520.00
TENCENT HOLDINGS LTD	482,000	337.00	162,434,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	20.65	1,631,350.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	80.85	4,851,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	7.86	668,100.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	57,000	5.42	308,940.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	25.95	1,738,650.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.49	516,810.00

	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	23.75	501,125.00	
	LENOVO GROUP LTD	578,000	4.90	2,832,200.00	
	MEITU INC	143,000	4.56	652,080.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	61,100	88.55	5,410,405.00	
	ZTE CORP-H	48,508	13.08	634,484.64	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	5.59	726,700.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	528,000	73.30	38,702,400.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.55	3,905,000.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	8.98	4,561,840.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	34.70	1,353,300.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	3.72	1,517,760.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.96	2,630,320.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	25.45	3,461,200.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	6.64	1,679,920.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.71	282,150.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	33.70	2,898,200.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	14.36	2,518,744.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	1.98	273,240.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	61,000	72.20	4,404,200.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	13.20	2,930,400.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.05	561,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	5.08	1,879,600.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.72	832,320.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	7.05	324,300.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	0.53	548,550.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	8.51	2,255,150.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	146,000	2.13	310,980.00	
	香港ドル 小計	75,145,629		752,762,427.01 (10,598,894,972)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	3.44	767,009.92	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	26.90	675,190.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	9.14	1,920,314.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.70	678,210.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.68	512,256.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.80	374,360.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.95	386,295.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.59	433,167.14	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	3.49	226,152.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	9.37	502,175.78	
	MISC BHD	125,040	6.07	758,992.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.66	256,200.00	

	UMW HOLDINGS BHD	34,000	5.85	198,900.00	
	GENTING BHD	205,300	8.61	1,767,633.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.06	1,133,946.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	1.82	215,670.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	35.90	391,310.00	
	FGV HOLDINGS BHD	80,300	1.69	135,707.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	37.70	320,450.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.45	132,300.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.57	820,954.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.68	1,352,464.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	146.40	1,010,160.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	16.90	890,292.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.24	876,369.04	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	72,000	6.86	493,920.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.48	1,256,564.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	49,200	10.40	511,680.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	4.05	285,930.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.85	501,270.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	421,219	5.89	2,480,979.91	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	19.14	1,173,128.88	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	17.82	266,106.06	
	MALAYAN BANKING BHD	348,360	9.78	3,406,960.80	
	PUBLIC BANK BERHAD	228,020	24.50	5,586,490.00	
	RHB BANK BHD	53,119	5.09	270,375.71	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.81	278,423.25	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.28	214,074.88	
	SP SETIA BHD	180,947	2.91	526,555.77	
	MY EG SERVICES BHD	320,300	1.20	384,360.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	278,374	4.35	1,210,926.90	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.54	1,415,118.00	
	MAXIS BHD	135,500	5.75	779,125.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.62	255,398.24	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	18.26	1,378,630.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	15.70	4,623,257.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.33	335,645.45	
	マレーシアリングット 小計	6,534,541		44,371,398.83 (1,196,696,626)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	20.30	2,405,550.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	35.50	2,438,850.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	6.55	3,751,840.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	134.50	16,772,150.00	
	PTT PCL-NVDR	852,400	51.50	43,898,600.00	

	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	83.50	10,028,350.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	57.25	5,833,775.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	81.75	18,388,354.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	27,200	450.00	12,240,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	64.50	27,612,450.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	8.25	3,227,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.25	3,399,375.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	37.75	6,108,327.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	14.30	3,312,380.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	63.00	2,192,400.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	56.50	3,830,700.00	
	CP ALL PCL-NVDR	408,000	69.75	28,458,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	25.75	8,773,025.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.20	4,368,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	25.50	11,620,350.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	174.50	4,467,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	208.00	3,369,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	216.00	27,302,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	215.00	11,094,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	19.40	4,796,650.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	144.00	21,312,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.24	2,993,760.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	78.50	10,369,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	132,300	11.30	1,494,990.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	69.75	2,252,925.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	197.00	20,862,300.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	6.20	3,767,795.80	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	225.00	5,220,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	93.50	2,767,600.00	
	タイパーツ 小計	8,353,138		340,730,948.30 (1,134,634,057)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	56.00	13,324,640.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	12.40	7,323,440.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	11.38	3,931,221.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	53.50	12,324,260.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	927.50	21,151,637.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	89.95	5,688,438.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	271.20	6,902,040.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	134.00	8,492,920.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	89.50	5,356,127.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	128.10	22,253,660.10	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	51,502	74.75	3,849,774.50	

	SECURITY BANK CORP	30,810	199.00	6,131,190.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	999.00	22,347,630.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,350	895.00	5,683,250.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	4.89	3,597,573.00	
	AYALA LAND INC	637,000	42.50	27,072,500.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.94	3,151,720.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	20.30	1,887,900.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	36.00	31,951,800.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,970.00	3,526,300.00	
	PLDT INC	6,225	1,395.00	8,683,875.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	36.50	3,266,750.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	363.00	10,566,930.00	
	フィリピンペソ 小計	5,041,698		238,465,576.60 (493,623,743)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,780.00	2,561,954,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	33,400.00	4,305,260,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	17,600.00	4,297,920,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	14,425.00	2,740,750,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	8,150.00	1,911,990,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	4,010.00	562,202,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	1,840.00	722,016,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	4,460.00	550,810,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	7,100.00	12,220,520,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,875.00	999,375,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	6,425.00	1,191,837,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	4,770.00	2,061,117,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	71,600.00	2,205,280,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,550.00	3,258,545,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,650.00	1,392,650,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,100.00	2,617,510,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	42,525.00	5,043,465,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,210.00	1,516,614,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	23,375.00	19,429,300,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	6,800.00	1,336,200,000.00	
	BANK MANDIRI	1,424,996	6,700.00	9,547,473,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,075.00	5,732,165,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	2,490.00	2,227,554,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	3,050.00	14,902,605,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,165.00	796,161,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	505.00	813,252,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	3,350.00	15,219,385,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	5,525.00	737,035,000.00		



	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	1,795.00	1,420,742,500.00	
	インドネシアルピア 小計	25,481,096		122,321,688,200.00 (929,644,830)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	53,700.00	226,989,900.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	125,000.00	425,125,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	201,000.00	1,055,652,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	20,400.00	218,402,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	53,300.00	385,998,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	379,000.00	296,757,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	102,500.00	107,727,500.00	
	LG CHEM LTD	3,844	365,500.00	1,404,982,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	202,000.00	96,758,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	336,000.00	470,400,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	110,000.00	123,970,000.00	
	POSCO	6,562	313,000.00	2,053,906,000.00	
	CJ CORP	1,230	138,500.00	170,355,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	78,300.00	310,381,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,310.00	43,913,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	34,550.00	148,841,400.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	14,750.00	49,294,500.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	44,700.00	151,890,600.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	31,400.00	88,705,000.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	55,700.00	122,595,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	60,300.00	384,714,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	103,000.00	341,754,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	379,000.00	306,990,000.00	
	KCC CORP	870	333,000.00	289,710,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	39,750.00	205,746,000.00	
	LG CORP	8,323	71,300.00	593,429,900.00	
	LOTTE CORP	2,370	48,100.00	113,997,000.00	
	POSCO DAEWOO CORP	5,988	18,100.00	108,382,800.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,354	122,000.00	775,188,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	10,311	15,800.00	162,913,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	6,620.00	245,939,620.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,769	262,000.00	725,478,000.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	36,450.00	34,299,450.00		
S-1 CORPORATION	960	85,500.00	82,080,000.00		
CJ LOGISTICS	862	143,500.00	123,697,000.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	128,500.00	186,967,500.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	27,750.00	152,736,000.00		
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,120.00	152,248,320.00		
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	45,150.00	319,029,900.00		

HANON SYSTEMS	19,000	12,050.00	228,950,000.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	232,000.00	1,293,864,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	126,500.00	1,666,764,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	87,200.00	252,182,400.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	80,900.00	242,942,700.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	32,100.00	662,126,700.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	92,800.00	369,529,600.00
HANSSEM CO LTD	615	91,500.00	56,272,500.00
HLB INC	2,398	92,500.00	221,815,000.00
LG ELECTRONICS INC	9,197	72,400.00	665,862,800.00
KANGWON LAND INC	8,683	29,450.00	255,714,350.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	19,550.00	99,118,500.00
CJ ENM CO LTD	830	243,900.00	202,437,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	102,000.00	311,202,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	96,000.00	117,312,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	182,500.00	188,705,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	296,500.00	157,145,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	161,500.00	88,663,500.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	24,700.00	37,568,700.00
EMART	1,661	207,000.00	343,827,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,300.00	46,278,300.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	340,500.00	263,887,500.00
KT&G CORP	10,696	105,000.00	1,123,080,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	105,000.00	209,265,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	782,000.00	53,176,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	260,500.00	748,416,500.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	138,000.00	97,980,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,180,000.00	885,000,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	659,000.00	88,965,000.00
PACIFIC CORP	2,115	96,100.00	203,251,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,499	90,100.00	225,159,900.00
CELLTRION INC	6,864	263,000.00	1,805,232,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	72,000.00	80,064,000.00
HANMI PHARM CO LTD	472	434,000.00	204,848,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	616	77,200.00	47,555,200.00
MEDY-TOX INC	317	639,300.00	202,658,100.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	458,000.00	715,854,000.00
SILLAJEN INC	4,157	61,500.00	255,655,500.00
VIROMED CO LTD	1,015	201,400.00	204,421,000.00
YUHAN CORPORATION	600	226,000.00	135,600,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	8,100.00	188,049,600.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,970.00	122,391,720.00

	HANA FINANCIAL GROUP	26,441	43,550.00	1,151,505,550.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	15,250.00	275,201,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	34,088	51,200.00	1,745,305,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37,696	42,900.00	1,617,158,400.00	
	WOORI BANK	45,214	16,250.00	734,727,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	65,300.00	300,510,600.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,760.00	241,273,920.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	12,050.00	136,140,900.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	34,700.00	65,895,300.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	31,350.00	181,077,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	68,200.00	287,053,800.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	4,875.00	145,747,875.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	38,450.00	166,027,100.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,975	37,500.00	149,062,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	272,000.00	687,072,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	90,900.00	481,770,000.00	
	KAKAO CORP	4,122	127,000.00	523,494,000.00	
	NAVER CORP	2,391	755,000.00	1,805,205,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,650	371,500.00	612,975,000.00	
	NETMARBLE CORP	2,465	119,000.00	293,335,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	338	240,500.00	81,289,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	229,000.00	714,709,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	18,774	22,450.00	421,476,300.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	142,500.00	201,637,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	137,500.00	627,825,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	408,195	44,100.00	18,001,399,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	71,650	35,850.00	2,568,652,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	213,500.00	1,008,574,000.00	
	KT CORP	3,800	28,750.00	109,250,000.00	
	SK TELECOM	1,647	261,500.00	430,690,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	30,650.00	749,913,550.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	54,700.00	78,330,400.00	
	SK HYNIX INC	48,768	74,500.00	3,633,216,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,262,609		68,854,240,755.00 (6,795,913,562)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	121.00	13,218,040.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	44.25	13,150,038.00	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.65	27,614,433.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	268,061	118.00	31,631,198.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	109.00	42,381,816.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,752	83.30	33,299,341.60	
	TAIWAN CEMENT	327,721	42.05	13,780,668.05	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	285.50	3,426,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	432,028	32.45	14,019,308.60
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,619	264.00	5,443,416.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	21.45	2,380,950.00
CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.12	1,187,451.36
EVA AIRWAYS CORP	143,931	15.00	2,158,965.00
EVERGREEN MARINE	119,812	13.00	1,557,556.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	25.15	4,451,550.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	46.75	8,277,601.75
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	389.50	4,649,461.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	177.50	5,842,590.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	32.15	1,286,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	130.00	3,310,320.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	266.50	4,264,000.00
POU CHEN	153,780	32.30	4,967,094.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	63.00	2,321,361.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	252.50	6,565,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	317.50	14,460,220.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	55.10	1,970,155.60
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	77.00	28,828,415.00
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	238.50	3,100,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	18.05	7,154,478.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	10.95	13,761,741.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	21.15	29,128,562.55
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	714,614	21.75	15,542,854.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	724,153	20.25	14,664,098.25
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	852,972	17.55	14,969,658.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	25.55	23,054,761.45
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	10.85	12,552,245.65
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	15.00	13,574,835.00
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	10.40	1,996,394.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	18.70	13,565,765.40
CHAILEASE HOLDING CO LTD	140,177	99.10	13,891,540.70
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	49.90	27,498,991.80
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	15.25	11,775,333.25
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	51.80	37,915,061.80
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163,157	30.00	4,894,710.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	11.65	7,173,732.15
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	47.80	2,013,336.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	34.30	1,911,676.20
ACER INC	255,803	24.10	6,164,852.30
ADVANTECH CO LTD	56,402	197.50	11,139,395.00

ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	245.50	13,525,086.00	
AU OPTRONICS CORP	590,090	13.10	7,730,179.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	361.50	20,858,550.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	65.70	1,891,634.40	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	11.05	8,563,750.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.85	8,138,676.00	
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	105.00	19,624,815.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	75.50	7,010,175.00	
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	187.00	2,618,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,395,311	81.10	113,159,722.10	
HTC CORPORATION	37,430	43.20	1,616,976.00	
INVENTEC CO LTD	136,511	25.90	3,535,634.90	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	4,430.00	35,617,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	35.25	5,303,433.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	75,000	100.50	7,537,500.00	
PEGATRON CORP	159,474	65.40	10,429,599.60	
QUANTA COMPUTER INC	242,270	52.20	12,646,494.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	42.15	3,291,915.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	261.00	7,047,000.00	
WISTRON CORP	242,695	21.20	5,145,134.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	38.80	6,060,055.60	
YAGEO CORPORATION	22,764	630.00	14,341,320.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	75.90	1,663,879.80	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	107.00	38,232,705.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	70.40	11,052,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	106.00	16,133,200.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	73.70	21,617,315.50	
GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	393.50	7,083,000.00	
MACRONIX INTERNATIONAL	127,000	33.20	4,216,400.00	
MEDIATEK INC	129,804	247.00	32,061,588.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	65.00	6,695,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	149.50	5,986,727.50	
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	258.50	2,998,341.50	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	84.80	4,050,896.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	136.50	3,814,356.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,079,389	239.50	498,013,665.50	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	17.20	16,804,400.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	75.10	6,683,900.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	146.50	4,688,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	15.95	3,253,800.00	
新台湾ドル 小計	27,466,148		1,584,630,300.01 (5,688,822,777)	

インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	377.60	24,966,912.00
	COAL INDIA LTD	41,924	281.40	11,797,413.60
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	267.55	15,899,158.75
	INDIAN OIL CORP LTD	117,608	159.55	18,764,356.40
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	163.05	16,763,822.70
	PETRONET LNG LTD	49,423	218.00	10,774,214.00
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	237,229	1,203.75	285,564,408.75
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	228.65	8,502,350.25
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,400.65	34,960,224.00
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,045.85	28,595,630.70
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	219.70	17,360,913.70
	JSW STEEL LTD	80,284	334.00	26,814,856.00
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,123.70	9,110,959.60
	SHREE CEMENT LTD	901	17,758.40	16,000,318.40
	TATA STEEL LTD	25,839	580.15	14,990,495.85
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	4,285.70	31,517,037.80
	UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	616.75	16,169,951.50
	VEDANTA LTD	110,508	215.20	23,781,321.60
	ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	128.35	18,431,445.05
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	73.85	3,765,980.75
	EICHER MOTORS LTD	939	28,476.15	26,739,104.85
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	678.95	15,939,030.20
	LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,240.15	43,968,278.10
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,018.25	5,455,783.50
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	374.10	23,390,976.60
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,674	638.50	4,261,349.00
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,049.95	8,777,582.00
	BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,661.35	25,189,677.75
	BHARAT FORGE LTD	13,392	630.65	8,445,664.80
	BOSCH LTD	431	18,847.95	8,123,466.45
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,242.30	10,534,232.70
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	961.50	60,524,502.00
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	9,152.10	86,935,797.90
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	311.90	15,977,077.50
	TATA MOTORS LTD	147,050	258.25	37,975,662.50
	TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	941.55	26,192,979.45
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	503.50	24,826,074.50
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,616.70	17,825,734.20
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,739	6,629.90	18,159,296.10
	ITC LTD	272,605	313.75	85,529,818.75
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	10,873.00	26,040,835.00	
UNITED SPIRITS LTD	17,805	638.65	11,371,163.25	

	DABUR INDIA LTD	58,111	456.20	26,510,238.20
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	1,345.85	25,065,110.40
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,784.75	106,531,727.50
	MARICO LTD	42,465	371.15	15,760,884.75
	AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	655.90	13,338,382.40
	CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	357.25	3,753,268.50
	CIPLA LTD	31,308	646.90	20,253,145.20
	DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,364.15	24,643,899.60
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	600.15	9,624,005.40
	LUPIN LTD	16,340	881.25	14,399,625.00
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,703.20	18,114,143.20
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	623.50	51,719,325.00
	AXIS BANK LTD	152,061	627.30	95,387,865.30
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	129,894	1,885.65	244,934,621.10
	ICICI BANK LTD	190,983	340.00	64,934,220.00
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,266.90	34,102,414.20
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	557.80	15,602,223.80
	STATE BANK OF INDIA	132,502	302.10	40,028,854.20
	YES BANK LTD	152,956	393.20	60,142,299.20
	BAJAJ FINANCE LTD	17,670	2,851.20	50,380,704.00
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	480.90	13,431,056.10
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	110.05	5,300,888.40
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,326.85	16,103,978.45
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	7,097.35	22,477,307.45
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,003.05	45,978,808.95
	INFOSYS LTD	148,301	1,430.35	212,122,335.35
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	81,948	2,012.75	164,940,837.00
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	687.70	33,047,423.50
	VAKRANGEE LTD	36,538	45.00	1,644,210.00
	WIPRO LTD	89,034	280.05	24,933,971.70
	BHARTI AIRTEL LTD	124,727	371.40	46,323,607.80
	BHARTI INFRATEL LTD	45,240	282.55	12,782,562.00
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	50.90	7,240,779.50
	GAIL INDIA LTD	53,170	387.70	20,614,009.00
	NTPC LTD	145,475	158.00	22,985,050.00
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	113,285	187.10	21,195,623.50
	TATA POWER CO LTD	93,250	68.65	6,401,612.50
	インドルピー 小計	4,583,567		2,839,466,876.65 (4,514,752,333)
パキスタンル ピー	HABIB BANK LTD	66,500	151.74	10,090,710.00
	MCB BANK LTD	53,300	201.77	10,754,341.00
	パキスタンルピー 小計	119,800		20,845,051.00 (18,760,545)

カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	15,948	119.52	1,906,104.96	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	39.04	796,376.96	
	DOHA BANK QSC	12,309	25.59	314,987.31	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	36.74	990,069.52	
	QATAR ISLAMIC BANK	8,258	124.00	1,023,992.00	
	QATAR NATIONAL BANK	37,868	163.52	6,192,175.36	
	QATAR INSURANCE CO	18,964	35.41	671,515.24	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,751	35.01	306,372.51	
	EZDAN HOLDING GROUP	67,796	9.31	631,180.76	
	OOREDOO QSC	7,280	70.00	509,600.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	188.19	711,734.58	
カタールリアル 小計		228,303		14,054,109.20	(427,947,625)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	144.81	2,843,778.78	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	410.83	1,311,369.36	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	107.70	5,212,895.40	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	35.66	2,302,958.46	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	265.00	1,423,580.00	
	MONDI LTD	9,893	392.58	3,883,793.94	
	SAPPI LIMITED	49,985	96.06	4,801,559.10	
	SASOL LTD	48,270	528.50	25,510,695.00	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	189.00	5,235,678.00	
	NASPERS LTD-N SHS	37,044	3,180.00	117,799,920.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	200.16	2,489,990.40	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	220.98	4,706,653.02	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	169.78	4,080,152.96	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	83.00	3,931,461.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	50.40	4,217,673.60	
	BID CORP LTD	26,440	291.93	7,718,629.20	
	CLICKS GROUP LTD	20,499	187.25	3,838,437.75	
	PICK N PAY STORES LTD	52,108	71.12	3,705,920.96	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	210.76	7,263,421.88	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	188.69	2,757,326.97	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	100.72	886,839.60	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	275.00	3,581,325.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	79,877	23.75	1,897,078.75	
	NETCARE LTD	99,170	27.04	2,681,556.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	261.11	7,865,938.75	
	ABSA GROUP LTD	61,049	158.18	9,656,730.82	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	938.41	3,023,557.02		
NEDBANK GROUP LTD	14,966	258.96	3,875,595.36		
STANDARD BANK GROUP LTD	112,744	183.77	20,718,964.88		



	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	55.57	561,479.28	
	FIRSTSTRAND LTD	284,395	62.97	17,908,353.15	
	INVESTEC LTD	28,883	92.20	2,663,012.60	
	PSG GROUP LTD	18,494	217.51	4,022,629.94	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	266.00	3,098,102.00	
	REMGRO LTD	46,153	199.00	9,184,447.00	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	75.34	5,605,145.32	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	163.26	5,713,446.96	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	113.36	705,779.36	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	16.15	1,099,459.70	
	OLD MUTUAL LTD	407,000	28.96	11,786,720.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	38.15	1,541,565.20	
	SANLAM LTD	138,975	74.36	10,334,181.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	124.61	3,852,193.54	
	MTN GROUP LTD	142,669	101.00	14,409,569.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	48.76	553,572.28	
	VODACOM GROUP	42,279	125.60	5,310,242.40	
	南アフリカランド 小計	2,470,977		367,573,381.49 (2,764,151,828)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	296,657	1.97	584,414.29	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	7.00	1,291,780.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.01	644,225.88	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	14.15	1,521,591.95	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	1.94	526,675.08	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	2.11	382,350.99	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	5.20	158,834.00	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.03	364,675.29	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	5.05	1,518,141.10	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	16.80	2,313,780.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,818,544		9,306,468.58 (280,776,157)	
香港・オフショア 人民元	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.55	225,990.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.04	247,036.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	21.60	231,120.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	10.30	243,080.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	6.48	220,320.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	22.03	251,142.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	14.25	242,250.00	
	CHINA NUCLEAR ENGINEERING -A	31,800	7.94	252,492.00	
	LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	16,640	16.42	273,228.80	
	SUZHOUGOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.65	218,090.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	16,900	11.75	198,575.00	

ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	21.20	220,480.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.09	183,631.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.22	208,800.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	98,400	2.33	229,272.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	8.73	535,149.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.96	250,668.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	56.67	301,427.73	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	30.38	252,154.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	11,600	22.31	258,796.00	
HEILAN HOME CO LTD -A	21,400	9.99	213,786.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	5,400	41.12	222,048.00	
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	12.91	219,470.00	
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	21,060	9.93	209,125.80	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	14.15	240,550.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,300	65.48	281,564.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	634.86	380,916.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	44.11	194,084.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,800	60.61	230,318.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	25.18	256,836.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	3,200	64.88	207,616.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	30.28	211,960.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	75,200	3.50	263,200.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	37,900	6.52	247,108.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	6.35	202,565.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	43,100	4.95	213,345.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	5.12	222,208.00	
POLY REAL ESTATE GROUP CO -A	21,100	10.95	231,045.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,500	16.13	282,275.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	113,300	4.53	513,249.00	
香港・オフショア人民元 小計	1,194,619		10,086,970.33 (163,005,440)	
合 計	207,846,684		46,794,325,781 (46,794,325,781)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	973,280.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,059,573.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	372,313.76	
	ブラジルリアル 小計	99,662	2,405,166.76 (67,970,012)		

投資信託受益証券合計			99,662	67,970,012 (67,970,012)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,747,008.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	7,747,008.00 (45,397,466)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	225,145.80	
	トルコリラ 小計		135,630	225,145.80 (4,149,437)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	773,416.80	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	1,441,456.80	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,656,469.65	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,315,223.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,666,164.90	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	1,337,374.20	
南アフリカランド 小計		1,024,432	19,190,105.35 (144,309,592)		
投資証券合計			1,468,462	193,856,495 (193,856,495)	
合計				261,826,507 (261,826,507)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 43銘柄	100.0%			11.8%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.0%			3.1%
	投資証券 1銘柄			3.0%	0.1%
ブラジルレアル	株式 51銘柄	97.7%			6.1%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.3%		0.1%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.5%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 23銘柄	98.4%			0.5%
	投資証券 1銘柄			1.6%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%

ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%			1.2%
香港ドル	株式	201銘柄	100.0%			22.5%
マレーシアリングギット	株式	47銘柄	100.0%			2.5%
タイバーツ	株式	34銘柄	100.0%			2.4%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.0%
インドネシアルピア	株式	29銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式	114銘柄	100.0%			14.4%
新台湾ドル	株式	89銘柄	100.0%			12.1%
インドルピー	株式	79銘柄	100.0%			9.6%
パキスタンルピー	株式	2銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	46銘柄	95.0%			5.9%
	投資証券	6銘柄			5.0%	0.3%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	10銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人民元	株式	40銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	273,646,064
コール・ローン	389,050,333
国債証券	41,488,900,314
未収利息	557,991,729
前払費用	75,980,096
流動資産合計	42,785,568,536
資産合計	42,785,568,536
負債の部	
流動負債	
前受収益	86,715

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
未払金	37,437,675
未払解約金	9,966,353
未払利息	993
その他未払費用	33
流動負債合計	47,491,769
負債合計	47,491,769
純資産の部	
元本等	
元本	27,405,750,667
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,332,326,100
元本等合計	42,738,076,767
純資産合計	42,738,076,767
負債純資産合計	42,785,568,536

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	27,405,750,667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 1.5595円 (1万口当たり純資産額) (15,595円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年 8月20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

	2018年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	18,501,751,599円
期中追加設定元本額	9,756,119,220円
期中一部解約元本額	852,120,152円
期末元本額	27,405,750,667円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,944,448,747円
世界経済インデックスファンド	4,967,264,812円
DC 新興国債券インデックス・オープン	3,686,994,137円
DC 世界経済インデックスファンド	4,013,946,741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）	1,874,223,848円
コア投資戦略ファンド（安定型）	200,114,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	657,518,583円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	110,610,765円
分散投資コア戦略ファンドA	127,653,556円
分散投資コア戦略ファンドS	392,779,744円

区分	2018年 8月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	150,733,726円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,747,947,250円
コア投資戦略ファンド（切替型）	141,134,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	190,348,209円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	95,278,443円
S M T インデックスバランス・オープン	208,630,277円
外国債券S M T Bセレクション（S M A専用）	3,570,380,349円
S M T 世界経済インデックス・オープン	27,732,523円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	84,705,528円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	118,116,681円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	801,496円
グローバル経済コア	958,468,838円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	135,917,735円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,711,210,373
合計		1,711,210,373

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	11,800,000.00	14,073,270.00	
		MBONO 10% 12/05/24	77,350,000.00	85,643,080.25	



	MBONO 5.75% 03/05/26	52,300,000.00	46,032,629.50
	MBONO 5% 12/11/19	44,000,000.00	42,453,840.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	75,600,000.00	72,309,510.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	98,400,000.00	95,109,504.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	15,300,000.00	15,031,714.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	62,700,000.00	61,177,330.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	35,800,000.00	35,260,673.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	52,600,000.00	51,172,962.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	34,450,000.00	33,750,492.75
	MBONO 8.5% 05/31/29	31,400,000.00	32,749,101.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	33,029,576.25
	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000.00	85,267,325.00
	MBONO 8% 11/07/47	28,500,000.00	28,459,957.50
	MBONO 8% 12/07/23	35,000,000.00	35,245,350.00
	メキシコペソ 小計	771,650,000.00	766,766,316.25 (4,493,250,613)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/20	18,550,000.00	16,672,981.15
	BLTN 0% 01/01/22	16,750,000.00	12,111,255.00
	BLTN 0% 04/01/20	13,300,000.00	11,676,149.80
	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000.00	32,160,598.70
	BLTN 0% 07/01/21	14,700,000.00	11,299,404.90
	BLTN 0% 10/01/19	9,750,000.00	8,967,825.75
	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000.00	15,042,616.20
	BNTNF 10% 01/01/23	20,050,000.00	19,585,741.98
	BNTNF 10% 01/01/25	11,950,000.00	11,297,458.14
	BNTNF 10% 01/01/27	11,900,000.00	10,931,696.84
	BNTNF 10% 01/01/29	1,850,000.00	1,660,891.12
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,512,000.00
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	522,000.00
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,932,062.50
	ブラジルレアル 小計	174,900,000.00	155,372,682.08 (4,390,831,995)
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	6,710,000,000.00	6,949,379,250.00
	チリペソ 小計	6,710,000,000.00	6,949,379,250.00 (1,145,952,638)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	22,335,178,250.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	22,100,000,000.00	23,158,479,500.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	38,600,000,000.00	48,188,240,000.00
	コロンビアペソ 小計	84,350,000,000.00	93,681,897,750.00 (3,419,389,267)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,650,000.00	5,924,307.50
	PERUGB 6.15% 08/12/32	5,900,000.00	6,043,576.50
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,100,000.00	7,560,577.00

	PERUGB 6.9% 08/12/37	4,700,000.00	5,077,010.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,050,000.00	6,684,584.50	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	2,150,000.00	2,361,388.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,800,000.00	6,936,684.00	
	ペルーヌエボソル 小計	37,350,000.00	40,588,128.00 (1,354,425,831)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	13,900,000.00	12,142,275.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	18,450,000.00	18,336,255.75	
	ウルグアイペソ 小計	32,350,000.00	30,478,531.25 (106,674,859)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	924,944.00	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	7,800,000.00	6,517,485.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	5,545,690.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	10,750,000.00	6,080,845.00	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,300,000.00	5,089,852.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	6,621,408.75	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	4,208,121.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	6,100,704.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	8,550,000.00	5,547,881.25	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	3,385,096.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	5,950,000.00	3,080,523.25	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	5,750,000.00	4,406,196.25	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	2,766,540.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	6,050,000.00	3,321,661.75	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	3,101,697.50	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	6,650,000.00	4,326,091.00	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	6,700,000.00	4,933,243.50	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	1,852,710.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	9,650,000.00	5,974,701.00	
		トルコリラ 小計	133,750,000.00	83,785,391.75 (1,544,164,769)
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	32,300,000.00	27,964,532.50	
	CZGB 0.45% 10/25/23	29,800,000.00	28,070,110.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	31,500,000.00	27,223,875.00	
	CZGB 0% 02/10/20	17,000,000.00	16,723,070.00	
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	43,270,029.50	
	CZGB 1% 06/26/26	28,100,000.00	25,973,813.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	32,000,000.00	32,980,480.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	44,500,000.00	45,898,635.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	35,700,000.00	37,528,732.50	
	CZGB 3.85% 09/29/21	41,600,000.00	44,866,848.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	33,700,000.00	38,080,494.50	

	CZGB 5.7% 05/25/24	32,600,000.00	40,047,959.00	
	チェココロナ 小計	401,900,000.00	408,628,579.50	(2,010,452,611)
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	217,000,000.00	210,109,165.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	596,000,000.00	587,206,020.00	
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	228,799,400.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	348,779,915.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	267,000,000.00	255,326,760.00	
	HGB 2% 10/30/19	93,000,000.00	94,551,705.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	572,000,000.00	596,332,880.00	
	HGB 3% 06/26/24	529,000,000.00	536,080,665.00	
	HGB 3% 10/27/27	408,000,000.00	393,636,360.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	521,000,000.00	602,398,435.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	453,000,000.00	533,276,130.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	268,547,070.00	
	HGB 7% 06/24/22	433,000,000.00	511,576,510.00	
	ハンガリーフォリント 小計	4,897,000,000.00	5,166,621,015.00	(2,021,698,803)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000.00	13,333,045.50	
	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000.00	13,308,214.50	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,341,097.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	11,300,000.00	11,374,241.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000.00	13,996,445.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	12,500,000.00	11,898,937.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,900,000.00	2,806,837.50	
	POLGB 2% 04/25/21	9,750,000.00	9,804,746.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	11,550,000.00	11,810,972.25	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,625,076.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	6,250,000.00	6,732,281.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,600,000.00	6,918,780.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,308,046.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	8,001,886.75	
	ポーランドズロチ 小計	135,000,000.00	137,260,607.50	(4,027,226,224)
ロシアルー ブル	RFLB 6.4% 05/27/20	98,800,000.00	96,569,590.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	61,000,000.00	56,027,890.00	
	RFLB 6.8% 12/11/19	81,200,000.00	80,646,216.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	39,000,000.00	34,591,440.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	151,000,000.00	137,076,290.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	154,139,130.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	45,000,000.00	40,095,000.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	167,583,325.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	128,200,000.00	126,167,389.00	

	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	64,032,754.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	61,300,625.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	165,200,000.00	153,840,848.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	198,500,000.00	189,992,290.00	
	RFLB 7% 01/25/23	65,200,000.00	61,995,746.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	101,600,408.00	
	RFLB 7% 12/15/21	129,000,000.00	124,800,405.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	151,000,000.00	147,879,585.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	113,150,000.00	112,935,580.75	
	ロシアルーブル 小計	1,997,300,000.00	1,911,274,512.25 (3,153,602,945)	
マレーシア リンギット	MGS 3.492% 03/31/20	12,750,000.00	12,765,045.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	13,400,000.00	13,459,630.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,562,194.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	6,150,000.00	6,175,061.25	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,200,000.00	7,195,788.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	8,850,000.00	8,683,443.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,950,000.00	8,805,636.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	5,950,000.00	5,907,308.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	6,550,000.00	6,585,239.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	3,350,000.00	3,402,762.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,748,784.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,108,504.25	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,000,000.00	6,046,800.00	
	マレーシアリンギット 小計	92,450,000.00	92,446,196.75 (2,493,273,926)	
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	92,700,000.00	91,766,047.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	110,000,000.00	106,204,450.00	
	THAIGB 2.55% 06/26/20	57,850,000.00	58,692,874.50	
	THAIGB 2% 12/17/22	112,000,000.00	111,063,680.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	164,700,000.00	169,994,281.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,211,780.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	144,000,000.00	154,717,200.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000.00	106,355,525.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	13,500,000.00	14,636,497.50	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	97,103,450.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	113,011,050.00	
	タイバーツ 小計	1,063,750,000.00	1,112,756,836.00 (3,705,480,263)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	23,870,750.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	15,000,000.00	15,025,275.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	20,057,800.00	

フィリピンペソ 小計		60,000,000.00	58,953,825.00 (122,034,417)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,474,792,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,396,057,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	20,018,480,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,759,548,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	32,500,000,000.00	29,820,375,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	25,700,000,000.00	22,704,922,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	22,921,705,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	20,000,000,000.00	18,257,300,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	22,800,000,000.00	21,432,000,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	36,000,000,000.00	35,467,560,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	42,800,000,000.00	40,272,018,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,702,000,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	16,474,338,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	35,000,000,000.00	35,962,500,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	55,200,000,000.00	56,533,632,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	32,579,625,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	46,218,150,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	26,900,000,000.00	28,049,437,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,541,026,000.00	
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	34,487,537,500.00		
インドネシアルピア 小計		536,900,000,000.00	534,073,003,000.00 (4,058,954,822)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	74,050,000.00	80,317,221.75	
	SAGB 6.25% 03/31/36	30,300,000.00	21,550,723.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	20,494,031.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	21,500,000.00	20,885,637.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	9,750,000.00	9,696,667.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	26,100,000.00	25,426,098.00	
	SAGB 7% 02/28/31	36,300,000.00	29,696,848.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	31,900,000.00	28,651,144.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	41,707,224.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	41,300,000.00	36,946,773.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000.00	52,386,473.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	26,800,000.00	24,935,658.00	
	SAGB 8% 01/31/30	39,800,000.00	35,854,825.00	
	SAGB 9% 01/31/40	31,500,000.00	29,095,132.50	
南アフリカランド 小計		504,050,000.00	457,644,459.00 (3,441,486,331)	
合計			41,488,900,314 (41,488,900,314)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.8%
ブラジルレアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.8%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	8.2%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	3.3%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	3.7%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.8%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	4.9%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.7%
ロシアルーブル	国債証券 18銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券 13銘柄	100.0%	6.0%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.9%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	9.8%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2018年 8月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,008,840,225

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
投資証券	101,972,040,400
派生商品評価勘定	57,185,550
未収入金	26,317,006
未収配当金	667,335,660
差入委託証拠金	66,202,500
流動資産合計	104,797,921,341
資産合計	104,797,921,341
負債の部	
流動負債	
前受金	57,185,550
未払金	127,519,779
未払解約金	86,208,044
未払利息	5,130
その他未払費用	198
流動負債合計	270,918,701
負債合計	270,918,701
純資産の部	
元本等	
元本	63,469,051,269
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,057,951,371
元本等合計	104,527,002,640
純資産合計	104,527,002,640
負債純資産合計	104,797,921,341

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 8月20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>

	2018年 8月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	63,469,051,269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 1.6469円 (1万口当たり純資産額) (16,469円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項



2018年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	56,610,278,571円
期中追加設定元本額	12,789,870,392円
期中一部解約元本額	5,931,097,694円

区分	2018年 8月20日現在
期末元本額	63,469,051,269円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,757,042,770円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,706,415円
SMT J-REITインデックス・オープン	10,523,214,234円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	30,152,920,114円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,148,471,572円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,385,342,709円
分散投資コア戦略ファンドA	2,153,498,617円
分散投資コア戦略ファンドS	3,328,727,637円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,441,562,998円
SMT インデックスバランス・オープン	37,570,744円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	720,312,824円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	857,135円
グローバル経済コア	435,153,156円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,523,621円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,406,876,038円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	2,967,270,685円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	7,526,807,716
合計	7,526,807,716

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 投資証券関連

(2018年 8月20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	2,487,609,450	-	2,544,795,000	57,185,550
合計		2,487,609,450	-	2,544,795,000	57,185,550

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,000	2,064,000,000	
	MCUBS MidCity投資法人	13,566	1,064,931,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,807	1,971,639,600	
	産業ファンド投資法人	14,026	1,638,236,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,733	3,373,237,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,142	1,213,425,800	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	5,769	2,815,272,000	
	GLP投資法人	26,616	2,957,037,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,591	1,201,923,800	
	日本プロロジスリート投資法人	16,148	3,518,649,200	
	星野リゾート・リート投資法人	1,832	1,029,584,000	
	Oneリート投資法人	1,398	352,715,400	
	イオンリート投資法人	12,358	1,480,488,400	
	ヒューリックリート投資法人	8,682	1,452,498,600	
	日本リート投資法人	3,886	1,367,872,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	71,364	1,123,983,000	
	日本ヘルスケア投資法人	551	95,488,300	
	積水ハウス・リート投資法人	31,062	2,211,614,400	
	トーセイ・リート投資法人	1,935	216,913,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,412	1,058,438,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,594	176,615,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,183	201,272,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	35,683	5,577,252,900	
	いちごホテルリート投資法人	2,105	296,384,000	
	ラサールロジポート投資法人	9,082	969,957,600	
	スターアジア不動産投資法人	3,272	348,795,200	
マリモ地方創生リート投資法人	1,035	116,541,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,055	658,627,500		

大江戸温泉リート投資法人	1,943	167,292,300	
さくら総合リート投資法人	2,605	236,013,000	
投資法人みらい	2,801	533,870,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,825	412,450,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,116	293,284,800	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,205	131,465,500	
ザイマックス・リート投資法人	1,110	124,875,000	
日本ビルファンド投資法人	11,658	7,391,172,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,039	7,066,893,000	
日本リートールファンド投資法人	22,753	4,707,595,700	
オリックス不動産投資法人	23,987	4,221,712,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,621	3,086,505,000	
プレミアム投資法人	11,446	1,291,108,800	
東急リアル・エステート投資法人	8,072	1,241,473,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,698	869,104,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,552	4,596,151,200	
森トラスト総合リート投資法人	8,604	1,393,848,000	
インヴィンシブル投資法人	42,128	2,032,676,000	
フロンティア不動産投資法人	4,095	1,838,655,000	
平和不動産リート投資法人	7,497	817,922,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,039	1,731,600,600	
福岡リート投資法人	6,226	1,091,417,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,724	2,588,180,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,988	897,921,200	
大和証券オフィス投資法人	2,779	1,900,836,000	
阪急リート投資法人	4,994	699,659,400	
スターツプロシード投資法人	1,897	316,040,200	
大和ハウスリート投資法人	15,073	4,054,637,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,858	2,914,128,800	
日本賃貸住宅投資法人	13,541	1,209,211,300	
ジャパンエクセレント投資法人	10,780	1,560,944,000	
合計	631,541	101,972,040,400	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	495,061,358
コール・ローン	33,926,790
投資証券	66,989,766,176
派生商品評価勘定	76,098
未収入金	3,474,601
未収配当金	194,892,640
流動資産合計	67,717,197,663
資産合計	67,717,197,663
負債の部	
流動負債	
未払金	211,192,034
未払解約金	1,715,412
未払利息	86
その他未払費用	6
流動負債合計	212,907,538
負債合計	212,907,538
純資産の部	
元本等	
元本	37,293,344,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,210,945,659
元本等合計	67,504,290,125
純資産合計	67,504,290,125
負債純資産合計	67,717,197,663

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2018年 8月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 収益及び費用の計上基準	(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。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	37,293,344,466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 1.8101円 (1万口当たり純資産額) (18,101円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2018年 8月20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。

	2018年 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	35,098,614,677円
期中追加設定元本額	6,013,978,851円
期中一部解約元本額	3,819,249,062円
期末元本額	37,293,344,466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）	175,145,387円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,709,318,701円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,209,216円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	8,524,225,187円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	18,341,958,329円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,020,946,145円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,377,266,640円
分散投資コア戦略ファンドA	712,695,239円
分散投資コア戦略ファンドS	1,551,711,545円
コア投資戦略ファンド（切替型）	650,814,725円
S M T インデックスバランス・オープン	209,509,873円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,756,375円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	810,244円
グローバル経済コア	416,806,502円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	2,407,173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）	504,256,399円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	541,506,786円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	1,479,822,981
合計	1,479,822,981

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



## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2018年 8月20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	81,573,302	-	81,649,400	76,098
	アメリカドル	49,743,000	-	49,743,000	-
	カナダドル	9,268,270	-	9,310,400	42,130
	オーストラリアドル	9,664,432	-	9,693,600	29,168
	シンガポールドル	12,897,600	-	12,902,400	4,800
	合計	81,573,302	-	81,649,400	76,098

## (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	40,490	1,144,652.30	
		AGREE REALTY CORP	17,490	977,516.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	38,120	915,261.20	
		ALEXANDER'S INC	2,050	758,295.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	52,740	6,843,542.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,370	881,378.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	72,140	3,034,929.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	137,010	3,151,230.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	24,000	572,880.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	80,083	3,516,444.53	

APPLE HOSPITALITY REIT INC	109,243	1,928,138.95	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	25,300	404,547.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	297,814.10	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,760	13,146,432.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	88,020.00	
BOSTON PROPERTIES	80,460	10,632,789.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	158,485.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	89,498	1,513,411.18	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	153,640	2,813,148.40	
CAMDEN PROPERTY TRUST	47,340	4,492,566.00	
CARETRUST REIT INC	38,680	700,881.60	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	398,595.60	
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	146,331.00	
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	518,955.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,800	968,798.00	
CITY OFFICE REIT INC	20,000	258,400.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	88,622.00	
COLONY CAPITAL INC	248,970	1,526,186.10	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	64,270	1,505,846.10	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	305,841.00	
CORECIVIC INC	62,220	1,572,299.40	
CORESITE REALTY CORP	19,430	2,243,193.50	
CORPORATE OFFICE PPTYS	55,120	1,685,018.40	
COUSINS PROPERTIES INC	212,193	2,003,101.92	
CUBESMART	92,620	2,940,685.00	
CYRUSONE INC	50,370	3,351,116.10	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	49,590	3,406,337.10	
DDR CORPORATION	84,059	1,210,449.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	105,350	1,249,451.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	106,920	13,261,287.60	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	81,260	3,190,267.60	
DUKE REALTY CORP	182,550	5,282,997.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	33,000	674,850.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	18,530	1,833,914.10	
EDUCATION REALTY TRUST INC	43,270	1,790,945.30	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	72,970	1,294,487.80	
EPR PROPERTIES	32,670	2,296,701.00	
EQUITY COMMONWEALTH	61,250	1,961,837.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	45,270	4,322,379.60	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	191,160	12,970,206.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	34,490	8,392,796.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	64,560	6,144,820.80	

FARMLAND PARTNERS INC	13,000	91,390.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,390	4,836,770.40
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	65,170	2,179,936.50
FOREST CITY REALTY TRUST-A	135,850	3,403,042.50
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	31,500	856,800.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	456,224.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	105,260	3,730,414.40
GEO GROUP INC/THE	61,800	1,567,866.00
GETTY REALTY CORP	17,300	505,852.00
GGP INC	323,930	6,938,580.60
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	303,750.00
GLADSTONE LAND CORP	5,000	66,100.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	89,300.00
GLOBAL NET LEASE INC	32,910	702,299.40
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	56,710	962,368.70
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	81,300	2,224,368.00
HCP INC	240,480	6,545,865.60
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	63,070	1,941,925.30
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	104,170	3,011,554.70
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	395,556.00
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,710	2,756,836.90
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	87,160	2,514,566.00
HOST HOTELS AND RESORTS INC	387,320	8,106,607.60
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	82,820	2,825,818.40
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	516,500.00
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,000	240,400.00
INFREIT INC	19,000	400,520.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	346,922.70
INVITATION HOMES INC	150,470	3,490,904.00
IRON MOUNTAIN INC	143,850	5,247,648.00
ISTAR INC	35,000	354,200.00
JBG SMITH PROPERTIES	49,300	1,850,722.00
KILROY REALTY CORPORATION	50,370	3,677,010.00
KIMCO REALTY CORP	216,430	3,677,145.70
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	722,255.50
LASALLE HOTEL PROPERTIES	58,940	2,035,787.60
LEXINGTON CORP PROPERTIES	106,456	973,007.84
LIBERTY PROPERTY TRUST	75,200	3,347,904.00
LIFE STORAGE INC	23,540	2,406,729.60
LTC PROPERTIES INC	19,700	902,654.00
MACERICH CO/THE	57,130	3,303,256.60

MACK-CALI REALTY CORP	47,270	1,025,759.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	650,080	549,317.60	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	18,500	190,920.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	184,960	2,761,452.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	58,220	6,001,899.80	
MONMOUTH REIT -CL A	42,460	717,998.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	78,320	3,597,237.60	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	926,466.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,390	1,767,466.60	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	260,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	325,600.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	411,757.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	101,006	3,304,916.32	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	232,320.00	
PARAMOUNT GROUP INC	110,170	1,759,414.90	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	102,280	3,366,034.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35,900	1,397,946.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	341,439.60	
PHYSICIANS REALTY TRUST	95,870	1,671,014.10	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,406,418.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	17,500	312,550.00	
PROLOGIS INC	275,330	18,565,501.90	
PS BUSINESS PARKS INC	10,900	1,434,767.00	
PUBLIC STORAGE	77,370	17,297,610.90	
QTS REALTY TRUST INC	25,240	1,113,336.40	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	39,850	543,554.00	
REALTY INCOME CORP	148,490	8,738,636.50	
REGENCY CENTERS CORP	75,270	4,908,356.70	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,150	1,201,359.50	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	118,480	1,486,924.00	
RETAIL VALUE	8,405	283,248.50	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	49,590	1,597,789.80	
RLJ LODGING TRUST	91,870	2,013,790.40	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,930	2,319,750.20	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	89,960	2,092,469.60	
SAUL CENTERS INC	6,700	399,588.00	
SELECT INCOME REIT	36,490	772,128.40	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	124,370	2,360,542.60	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	14,500	723,405.00	
SIMON PROPERTY GROUP	160,650	28,672,812.00	
SL GREEN REALTY CORP	45,150	4,779,579.00	

	SPIRIT MTA REIT	23,901	247,614.36
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	215,600	1,821,820.00
	STAG INDUSTRIAL INC	52,790	1,523,519.40
	STORE CAPITAL CORP	87,240	2,529,960.00
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	54,080	737,651.20
	SUN COMMUNITIES INC	40,840	4,159,962.40
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	117,150	1,920,088.50
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,110	1,197,301.80
	TAUBMAN CENTERS INC	32,640	2,079,168.00
	TERRENO REALTY CORP	30,340	1,162,325.40
	TIER REIT INC	26,300	624,362.00
	UDR INC	136,780	5,447,947.40
	UMH PROPERTIES INC	14,000	230,020.00
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	427,475.70
	URBAN EDGE PROPERTIES	54,720	1,259,107.20
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	374,550.00
	VENTAS INC	185,680	11,079,525.60
	VEREIT INC	493,360	3,927,145.60
	VORNADO REALTY TRUST	88,610	6,813,222.90
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	824,107.50
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	42,580	1,352,340.80
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	61,770	1,919,811.60
	WELLTOWER INC	193,190	12,885,773.00
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	19,240.00
	WHITESTONE REIT	22,610	303,200.10
	WP CAREY INC	54,600	3,618,888.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,410	1,345,354.80
	アメリカドル 小計	12,185,500	440,741,803.70 (48,728,413,817)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	89,536.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	25,510	1,122,695.10
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	559,270.80
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,100	572,427.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	35,850	1,681,006.50
	CHOICE PROPERTIES REIT	74,430	954,936.90
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	649,250.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	288,644.40
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	198,706.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	50,000	730,000.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	21,000	216,510.00

DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	12,820	320,500.00	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,940	662,073.00	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	70,130	1,424,340.30	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	26,000	301,340.00	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	292,500.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	130,342.80	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	169,614.20	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	415,927.86	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	23,000	263,810.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	82,320	2,078,580.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	136,850.00	
SLATE RETAIL REIT	10,300	132,973.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	33,810	1,060,957.80	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,000	177,600.00	
カナダドル 小計	720,240	14,630,391.66 (1,238,462,654)	
ユーロ			
AEDIFICA	9,300	750,510.00	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	73,000	958,490.00	
ALTAREA	2,000	362,000.00	
BEFIMMO S.C.A.	12,800	638,080.00	
BENI STABILI SPA	547,000	413,805.50	
COFINIMMO	10,700	1,181,280.00	
COVIVIO	28,470	2,548,065.00	
EUROCOMMERCIAL	24,540	890,311.20	
GECINA SA	24,550	3,591,665.00	
GREEN REIT PLC	377,170	569,526.70	
HAMBORNER REIT AG	44,000	408,320.00	
HIBERNIA REIT PLC	332,550	495,499.50	
ICADE	23,800	1,958,740.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	19,790	129,011.01	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	171,672	1,568,223.72	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	8,000	183,600.00	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	190,000	275,500.00	
KLEPIERRE	105,800	3,347,512.00	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	405,930.00	
MERCIALYS	28,020	418,618.80	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	176,470	2,109,698.85	
NSI NV	9,200	295,320.00	

	RETAIL ESTATES	3,600	278,280.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	69,650	12,986,242.50	
	VASTNED RETAIL	8,500	310,250.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,600	1,014,800.00	
	WERELDHAVE NV	21,780	688,901.40	
	ユーロ 小計	2,377,354	38,778,181.18 (4,901,949,882)	
イギリスポ ンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	39,000	36,972.00	
	ASSURA PLC	1,167,980	673,924.46	
	BIG YELLOW GROUP PLC	77,290	732,709.20	
	BRITISH LAND CO PLC	507,380	3,243,172.96	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	131,225.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	105,350.00	
	DERWENT LONDON PLC	56,070	1,727,516.70	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	271,150.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	152,000	1,072,664.00	
	HAMMERSON PLC	402,770	1,979,211.78	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	193,580	203,452.58	
	INTU PROPERTIES PLC	471,100	754,466.65	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	383,850	3,544,854.75	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	378,110	694,209.96	
	LXI REIT PLC	100,000	108,500.00	
	NEWRIVER REIT PL	173,000	452,395.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	388,000	441,544.00	
	RDI REIT PLC	772,000	258,234.00	
	REGIONAL REIT LTD	170,000	161,500.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	108,990	599,445.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	157,500.00	
SEGRO PLC	515,430	3,389,467.68		
SHAFTESBURY PLC	132,430	1,215,045.25		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	738,900	1,100,961.00		
UNITE GROUP PLC	138,000	1,206,810.00		
WORKSPACE GROUP PLC	72,420	760,410.00		
	イギリスポンド 小計	8,066,300	25,022,691.97 (3,525,196,844)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	159,010	594,697.40	
	ARENA REIT	141,000	308,790.00	
	BWP TRUST	247,960	810,829.20	
	CHARTER HALL GROUP	231,600	1,655,940.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	101,000	429,250.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	829,157.80	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	855,940	980,051.30	
	DEXUS	514,310	5,405,398.10	

	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	281,298.00	
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	362,422.50	
	GOODMAN GROUP	837,140	8,856,941.20	
	GPT GROUP	913,750	4,778,912.50	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	135,200	502,944.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	250,380.00	
	INDUSTRIA REIT	75,000	198,750.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	283,500.00	
	INVESTA OFFICE FUND	247,180	1,260,618.00	
	MIRVAC GROUP	1,883,730	4,558,626.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	294,000	515,970.00	
	PROPERTYLINK GROUP	207,000	215,280.00	
	RURAL FUNDS GROUP	158,600	328,302.00	
	SCENTRE GROUP	2,770,380	11,829,522.60	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	392,000	956,480.00	
	STOCKLAND	1,279,290	5,513,739.90	
	VICINITY CENTERS	1,634,080	4,542,742.40	
	VIVA ENERGY REIT	230,000	494,500.00	
	<b>オーストラリアドル 小計</b>	<b>14,058,850</b>	<b>56,745,043.50</b>	<b>(4,584,432,064)</b>
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	452,350.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	500,000	732,500.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	158,100.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,068,600.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	530,000	749,950.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	327,120.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	395,540.60	
	<b>ニュージーランドドル 小計</b>	<b>2,688,460</b>	<b>3,884,160.60</b>	<b>(284,359,397)</b>
香港ドル	CHAMPION REIT	993,000	5,342,340.00	
	FORTUNE REIT	739,000	6,820,970.00	
	LINK REIT	1,116,500	85,970,500.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,900,320.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	483,000	1,560,090.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,802,980.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	600,000	3,126,000.00	
	<b>香港ドル 小計</b>	<b>5,044,500</b>	<b>107,523,200.00</b>	<b>(1,513,926,656)</b>
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	340,000	472,600.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	348,000	278,400.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,215,566	3,306,339.52	



	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	746,280.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	518,200	378,286.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,399,528	2,449,174.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,431,300	3,163,173.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	316,560	459,012.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	385,900	598,145.00	
	ESR REIT	804,679	410,386.29	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	312,000.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	432,640.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	666,926.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	500,400.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	824,020	881,701.40	
	KEPPEL DC REIT	519,460	716,854.80	
	KEPPEL REIT	955,300	1,136,807.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	281,430.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,024,530	1,659,738.60	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	645,760	1,265,689.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,072,652	1,351,541.52	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,051,900	1,209,685.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	590,000	442,500.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	538,560.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	210,557.60	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	207,174.00	
	SPH REIT	322,300	320,688.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	480,284.00	
	SUNTEC REIT	1,119,900	2,116,611.00	
	シンガポールドル 小計	19,706,395	26,993,584.83 (2,177,032,616)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	83,370	1,192,191.00	
	イスラエルシェケル 小計	83,370	1,192,191.00 (35,992,246)	
	合計	64,930,969	66,989,766,176 (66,989,766,176)	

(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。

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 161銘柄	100.0%	72.7%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	7.3%
イギリスポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.3%
オーストラリアドル	投資証券 26銘柄	100.0%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 貸借対照表

項目	2018年 8月20日現在
	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	9,978,917
コール・ローン	16,783,194
投資信託受益証券	16,439,241,028
派生商品評価勘定	177,431,935
未収入金	117,136
流動資産合計	16,643,552,210
資産合計	16,643,552,210
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	12,592,784
未払解約金	4,256,285
未払利息	42
その他未払費用	1
流動負債合計	16,849,112
負債合計	16,849,112
<b>純資産の部</b>	
元本等	

	2018年 8月20日現在
項目	金額（円）
元本	18,603,798,505
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,977,095,407
元本等合計	16,626,703,098
純資産合計	16,626,703,098
負債純資産合計	16,643,552,210

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,603,798,505口

	2018年 8月20日現在	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	1,977,095,407円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8937円 (8,937円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2018年 8月20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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い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に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2018年 8月20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。

	2018年 8月20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>(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> <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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年11月30日
期首元本額	12,687,400,777円
期中追加設定元本額	7,861,369,996円
期中一部解約元本額	1,944,972,268円
期末元本額	18,603,798,505円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,500,037,534円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,994,260,219円
分散投資コア戦略ファンドA	2,353,994,388円

区分	2018年 8月20日現在
分散投資コア戦略ファンドS	3,172,880,325円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,455,617,851円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	944,751,021円
グローバル経済コア	2,148,825,230円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	33,431,937円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2018年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	1,011,010,392	
合計	1,011,010,392	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2018年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	3,316,437	-	3,316,500	63	
	アメリカドル	3,316,437	-	3,316,500	63	
	売建	17,060,992,205	-	16,883,560,333	177,431,872	
	アメリカドル	17,060,992,205	-	16,883,560,333	177,431,872	
合計		17,064,308,642	-	16,886,876,833	177,431,935	

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	13,100,500	148,690,675.00	
	アメリカドル 小計		13,100,500	148,690,675.00 (16,439,241,028)	
合計			13,100,500	16,439,241,028 (16,439,241,028)	

(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	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル経済コア】

## 【純資産額計算書】

(2018年 9月28日現在)

資産総額	13,590,176,634円
負債総額	148,742,439円
純資産総額( - )	13,441,434,195円
発行済口数	13,505,462,020口
1口当たり純資産額( / )	0.9953円
(1万口当たり純資産額)	(9,953円)

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 9月28日現在)

資産総額	233,917,333,266円
負債総額	1,257,859,286円
純資産総額( - )	232,659,473,980円
発行済口数	141,109,251,439口
1口当たり純資産額( / )	1.6488円
(1万口当たり純資産額)	(16,488円)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 9月28日現在)

資産総額	421,378,680,855円
負債総額	7,888,457,336円
純資産総額( - )	413,490,223,519円
発行済口数	299,453,635,421口
1口当たり純資産額( / )	1.3808円
(1万口当たり純資産額)	(13,808円)



## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 9月28日現在)

資産総額	365,667,475,362円
負債総額	325,398,110円
純資産総額（ - ）	365,342,077,252円
発行済口数	136,779,646,955口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6710円
（1万口当たり純資産額）	（26,710円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 9月28日現在)

資産総額	264,229,641,921円
負債総額	334,436,531円
純資産総額（ - ）	263,895,205,390円
発行済口数	95,779,443,941口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7552円
（1万口当たり純資産額）	（27,552円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 9月28日現在)

資産総額	52,345,165,882円
負債総額	56,170,140円
純資産総額（ - ）	52,288,995,742円
発行済口数	18,191,468,111口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8744円
（1万口当たり純資産額）	（28,744円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2018年 9月28日現在）

資産総額	46,467,177,999円
負債総額	15,010,927円
純資産総額（ - ）	46,452,167,072円
発行済口数	28,518,803,061口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6288円
（1万口当たり純資産額）	（16,288円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2018年 9月28日現在）

資産総額	108,355,196,754円
負債総額	489,185,143円
純資産総額（ - ）	107,866,011,611円
発行済口数	64,311,067,896口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6773円
（1万口当たり純資産額）	（16,773円）

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2018年 9月28日現在）

資産総額	71,393,810,081円
負債総額	359,044,769円
純資産総額（ - ）	71,034,765,312円
発行済口数	39,544,309,500口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7963円
（1万口当たり純資産額）	（17,963円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

（2018年 9月28日現在）

資産総額	16,657,646,342円
負債総額	479,848,002円
純資産総額（ - ）	16,177,798,340円

発行済口数	18,147,003,769口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8915円
（1万口当たり純資産額）	（8,915円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

###### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2018年10月1日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2018年11月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年9月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	501	10,406,019
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	69	247,362
単位型公社債投資信託	0	0
合計	570	10,653,380

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		20,260,630	23,973,152
前払費用		143,622	157,614
未収委託者報酬		5,252,944	5,373,307
繰延税金資産		61,677	94,211
その他		5,474	9,842
流動資産合計		25,724,348	29,608,128
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	47,993	36,782
器具備品	1	73,765	79,655
その他	1	2,830	1,912
有形固定資産合計		124,589	118,350
無形固定資産			
ソフトウェア		221,499	210,679
その他		6,656	4,377
無形固定資産合計		228,156	215,056
投資その他の資産			
投資有価証券		71,153	42,802
長期前払費用		9,828	7,810
長期貸付金		19,838	17,088
会員権		25,000	25,000
繰延税金資産		137,359	154,422
その他		145	70
貸倒引当金		19,838	17,088
投資その他の資産合計		243,485	230,105
固定資産合計		596,231	563,512
資産合計		26,320,580	30,171,641

		(単位：千円)	
		前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
負債の部			
流動負債			
預り金		13,630	24,591

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178



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

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136
収益分配金	129	116
投資有価証券売却益	307	499
貸倒引当金戻入	3,000	2,750
その他	1,591	4,351
営業外収益合計	9,697	9,854
営業外費用		

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

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

評価・換算差額等

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

当期末残高	182	182	25,592,216
-------	-----	-----	------------

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

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

### (1) 概要

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

### (2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)

建 物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
そ の 他	1,759	"	2,677	"
計	362,567	"	392,342	"

## ( 損益計算書関係 )

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

## ( 株主資本等変動計算書関係 )

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(金融商品関係)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

#### 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-

(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496
----------------	---	--------	--------	-----

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）



該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

## 前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

## 2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

## 2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

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

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の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

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

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

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2018年11月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2018年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2018年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

### 第3【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は提出されておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2018年10月19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

松崎雅則

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」に掲げられているグローバル経済コアの2017年11月30日から2018年8月20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、グローバル経済コアの2018年8月20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。