

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年6月5日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）
愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2019年 6月 6日から2019年12月 5日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」とい
うことがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の中長期的な成長を
目指します。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

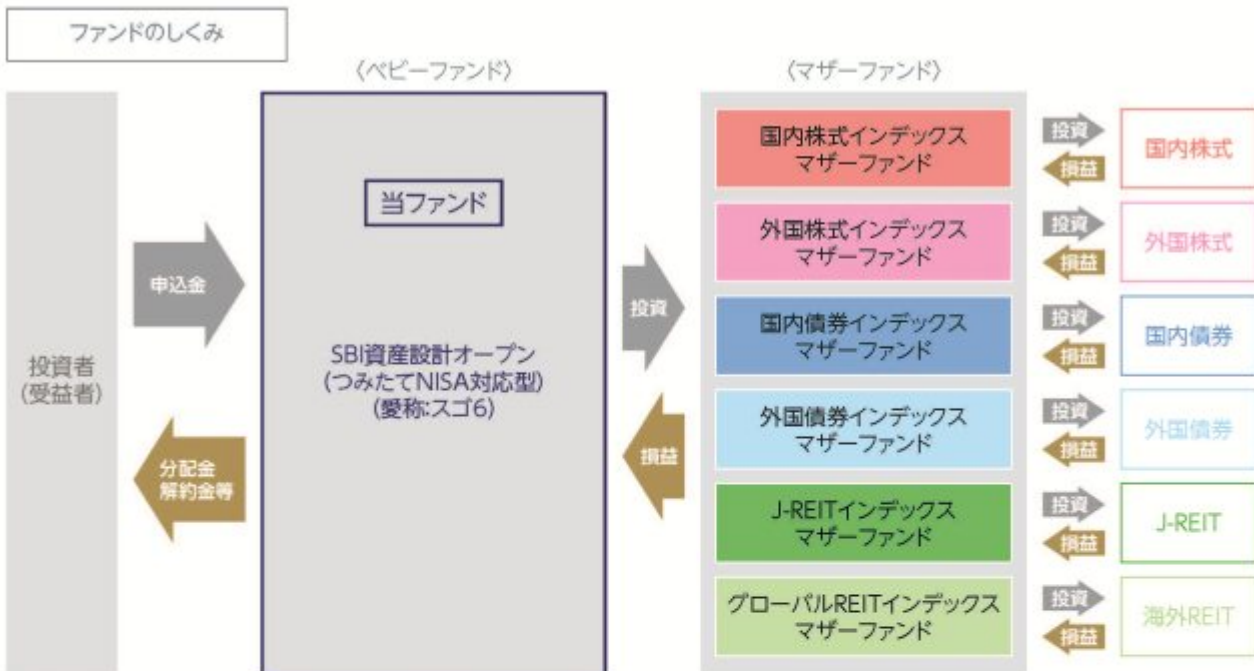
[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1. 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6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。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

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、各マザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)
海外 R E I T	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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。詳しくは下記をご覧ください。

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数

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

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

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

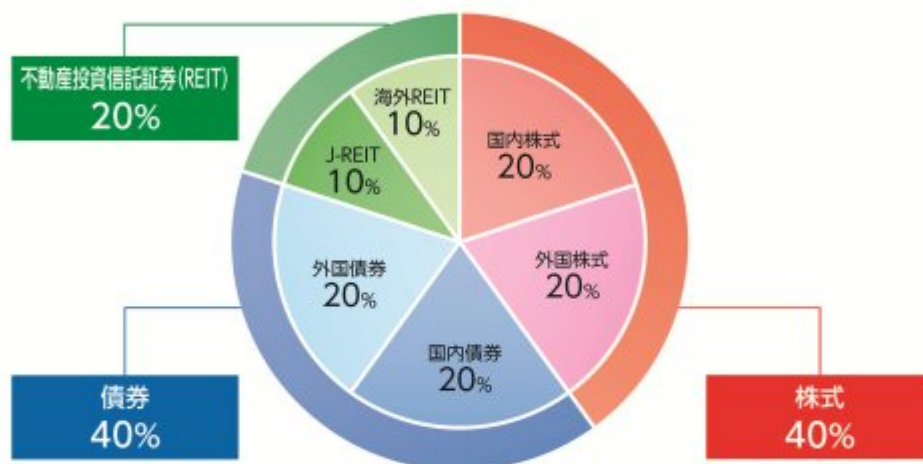
「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE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

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

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

3. 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券(REIT)20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.54%[※](税抜0.5%)です。)
- ※消費税率が10%になった場合は、0.55%となります。

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は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

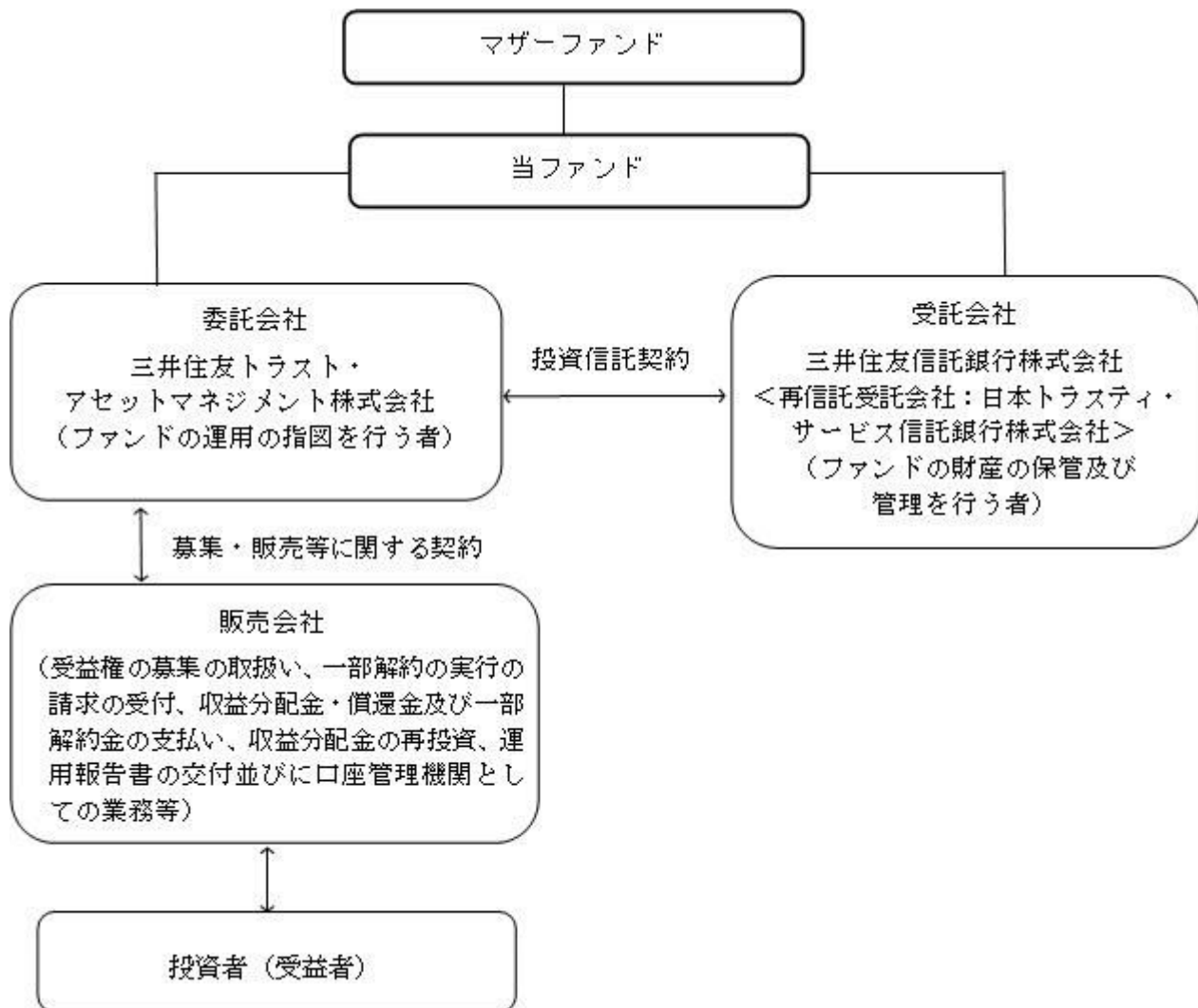
(2) 【ファンドの沿革】

2017年12月19日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 3月29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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。
- ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	TOPIX（東証株価指数）	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	10%

- ハ．各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ホ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。
- ヘ．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「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、スワップ取引及び金利先渡し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。）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方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所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、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債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。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、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

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券、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。

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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における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号口に掲げるものをいいます。）のうち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を行うことを指図することができます。

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、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成

割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

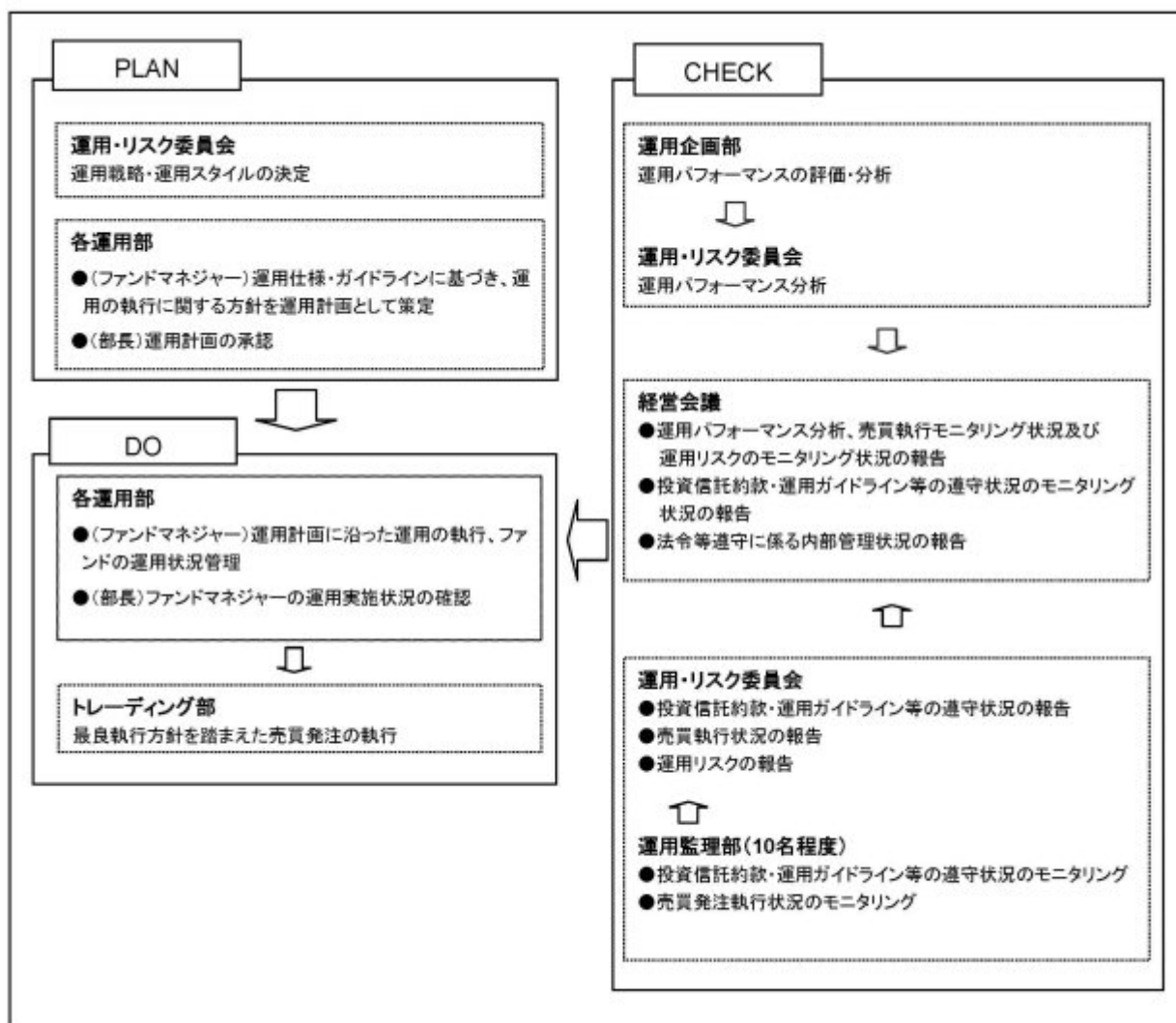
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（3）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用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は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- （イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（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。）、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。）及び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。）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します。（以下同じ。）
- （ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- （ハ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- （イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- （ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとしします。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します。
- （ニ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- （イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するた

め、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。

(ロ) 金利先渡取引及び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) 金利先渡取引及び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、金利先渡取引及び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。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

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

カ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

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。

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。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

（2）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2018年12月～2019年3月の4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年4月～2019年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}
 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{*3}
 日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}
 先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}
 新興国債… JPモルガン・ガバメント・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・ダイバーシファイド(円ベース)^{*6}

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

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

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

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

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

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

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの直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】

ありません。

(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。

「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せん。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

* 消費税率が10%になった場合は、0.55%となります。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の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に相当する額を、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いません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

上記は、2019年 3月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年3月29日現在の状況について記載してあります。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（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	68,660,121	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		671,924	0.97
合計(純資産総額)		69,332,045	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	5,641,963	2.5277	14,261,674	2.5378	14,318,173	20.65
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	9,219,910	1.5023	13,851,989	1.4636	13,494,260	19.46
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	4,793,174	2.7110	12,994,435	2.7696	13,275,174	19.15
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	9,287,776	1.3885	12,896,972	1.4177	13,167,280	18.99
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	3,852,865	1.7939	6,911,888	1.9160	7,382,089	10.65
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	3,818,795	1.6717	6,383,954	1.8391	7,023,145	10.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

(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 9月 5日)	41,839,685	41,839,685	9,973	9,973
	2018年 3月末日	25,853,199		9,585	
	4月末日	28,753,091		9,810	
	5月末日	32,524,968		9,780	
	6月末日	35,654,255		9,866	
	7月末日	38,734,879		9,986	
	8月末日	41,784,937		10,026	
	9月末日	43,894,538		10,215	
	10月末日	45,812,847		9,770	
	11月末日	52,498,979		9,929	
	12月末日	53,177,126		9,411	
	2019年 1月末日	60,342,132		9,743	
	2月末日	65,209,264		9,966	
	3月末日	69,332,045		10,087	

【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12月19日～2018年 9月 5日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0.3
第2期中間計算期間	2018年 9月 6日～2019年 3月 5日	0.5

(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12月19日～2018年 9月 5日	44,509,649	2,557,562	41,952,087
第2期中間計算期間	2018年 9月 6日～2019年 3月 5日	30,639,140	6,132,021	66,459,206

(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	378,411,258,300	83.31
地方債証券	日本	24,963,573,024	5.50
特殊債券	日本	31,303,289,120	6.89
社債券	日本	16,038,930,420	3.53
	フランス	1,399,658,000	0.31
	オーストラリア	601,653,000	0.13
	オランダ	200,640,000	0.04
	アメリカ	105,910,000	0.02
	イギリス	100,535,000	0.02
	スウェーデン	100,254,000	0.02
	小計		18,547,580,420
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		970,588,555	0.21
合計(純資産総額)		454,196,289,419	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,060,000,000	101.29	9,177,235,100	101.45	9,191,641,800	0.100	2023/12/20	2.02
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	101.31	5,977,821,000	0.100	2023/6/20	1.32
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,790,000,000	101.04	5,850,216,000	101.24	5,861,796,000	0.100	2023/3/20	1.29
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	100.88	5,588,752,000	0.100	2022/3/20	1.23
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.87	4,842,112,800	100.97	4,846,656,000	0.100	2022/6/20	1.07
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	100.56	4,806,863,600	0.100	2021/3/20	1.06
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	101.38	4,775,073,100	101.91	4,800,102,300	0.100	2028/12/20	1.06

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	101.06	4,790,528,400	0.100	2022/9/20	1.05
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	103.82	4,744,950,100	103.25	4,718,707,800	1.000	2021/12/20	1.04
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	3,890,000,000	103.24	4,016,200,500	103.84	4,039,492,700	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	3,940,000,000	100.66	3,966,004,000	102.22	4,027,665,000	0.100	2028/3/20	0.89
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	3,870,000,000	103.30	3,997,835,300	104.00	4,024,838,700	0.400	2025/9/20	0.89
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	3,830,000,000	100.31	3,841,976,700	102.00	3,906,944,700	0.100	2028/9/20	0.86
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	102.38	3,900,716,100	1.200	2020/12/20	0.86
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	3,620,000,000	103.49	3,746,338,000	103.90	3,761,180,000	0.500	2024/9/20	0.83
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,530,000,000	102.62	3,622,486,000	103.47	3,652,702,800	0.300	2025/12/20	0.80
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	100.41	3,624,909,300	0.100	2020/9/20	0.80
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	103.83	3,561,609,100	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,380,000,000	102.23	3,455,374,000	102.92	3,478,797,400	0.300	2024/12/20	0.77
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	3,430,000,000	101.02	3,464,997,700	101.37	3,477,196,800	0.100	2023/9/20	0.77
日本	国債証券	第390回利付国債（2年）	3,320,000,000	100.38	3,332,616,000	100.35	3,331,620,000	0.100	2020/7/1	0.73
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	102.29	3,283,797,900	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	104.07	3,267,871,600	103.09	3,237,245,800	1.200	2021/6/20	0.71
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	100.72	3,223,040,000	0.100	2021/9/20	0.71
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	102.27	3,221,568,000	0.100	2026/6/20	0.71
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	101.16	3,206,835,400	0.100	2022/12/20	0.71
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	117.98	2,996,934,100	120.26	3,054,756,400	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	2,920,000,000	100.88	2,945,696,000	102.38	2,989,700,400	0.100	2027/3/20	0.66
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	100.48	2,974,296,800	0.100	2020/12/20	0.65
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	102.19	2,973,758,100	0.100	2026/3/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.31
地方債証券	5.50
特殊債券	6.89
社債券	4.08
合計	99.79

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

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。

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	271,889,555,400	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,226,874,620	2.24
合計(純資産総額)		278,116,430,020	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	6,224,720,000	2.24

(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	1,328,300	6,883.03	9,142,734,148	6,487.00	8,616,682,100	3.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	488,800	8,015.37	3,917,915,447	10,745.00	5,252,156,000	1.89
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,040,700	4,473.81	4,655,895,257	4,521.00	4,705,004,700	1.69
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,093,000	661.63	5,354,634,116	550.00	4,451,150,000	1.60

日本	株式	キーエンス	電気機器	58,500	63,241.13	3,699,606,240	68,970.00	4,034,745,000	1.45
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	800,000	5,003.72	4,002,978,012	4,703.00	3,762,400,000	1.35
日本	株式	ソニー	電気機器	799,600	5,354.19	4,281,213,208	4,645.00	3,714,142,000	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	828,600	4,404.92	3,649,919,321	3,876.00	3,211,653,600	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,005,500	3,395.19	3,413,872,112	2,995.00	3,011,472,500	1.08
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	106,700	22,564.09	2,407,589,084	25,710.00	2,743,257,000	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,975,100	190.04	3,036,002,360	171.30	2,736,534,630	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	816,000	2,987.08	2,437,463,864	3,161.00	2,579,376,000	0.93
日本	株式	三菱商事	卸売業	823,800	3,069.10	2,528,324,640	3,074.00	2,532,361,200	0.91
日本	株式	花王	化学	289,400	8,280.29	2,396,318,460	8,718.00	2,522,989,200	0.91
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,030,800	2,889.30	2,978,296,320	2,385.00	2,458,458,000	0.88
日本	株式	任天堂	その他製品	73,400	39,645.85	2,910,005,464	31,560.00	2,316,504,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	426,100	5,283.38	2,251,248,476	5,362.00	2,284,748,200	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	212,000	10,474.09	2,220,507,482	10,680.00	2,264,160,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	113,300	22,078.57	2,501,502,772	18,880.00	2,139,104,000	0.77
日本	株式	ダイキン工業	機械	162,700	12,677.10	2,062,565,708	12,970.00	2,110,219,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	374,100	5,369.58	2,008,763,400	5,512.00	2,062,039,200	0.74
日本	株式	キヤノン	電気機器	641,700	3,592.95	2,305,598,112	3,213.00	2,061,782,100	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	492,100	4,848.43	2,385,913,600	4,176.00	2,055,009,600	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	143,500	16,055.96	2,304,030,456	14,025.00	2,012,587,500	0.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	536,700	3,842.14	2,062,081,514	3,585.00	1,924,069,500	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	205,700	10,414.77	2,142,319,320	9,280.00	1,908,896,000	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	690,800	2,901.15	2,004,116,300	2,745.00	1,896,246,000	0.68
日本	株式	資生堂	化学	236,900	7,901.69	1,871,911,356	7,987.00	1,892,120,300	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,099,000	1,675.02	1,840,849,982	1,658.50	1,822,691,500	0.66
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	740,400	2,773.72	2,053,662,288	2,451.50	1,815,090,600	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	0.13
		鉱業	0.28
		建設業	2.93
		食料品	4.27
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.30
		化学	7.21
		医薬品	5.78
		石油・石炭製品	0.60

ゴム製品	0.76
ガラス・土石製品	0.88
鉄鋼	0.95
非鉄金属	0.75
金属製品	0.55
機械	4.82
電気機器	12.71
輸送用機器	7.60
精密機器	2.01
その他製品	2.00
電気・ガス業	1.90
陸運業	4.84
海運業	0.14
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.10
卸売業	4.85
小売業	4.66
銀行業	5.95
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	2.14
その他金融業	1.11
不動産業	2.46
サービス業	4.90
小計	97.76
合計	97.76

(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	391円		6,245,143,860	6,224,720,000	2.24

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	130,684,636,926	45.60
	フランス	28,137,836,454	9.82
	イタリア	24,762,485,342	8.64
	イギリス	19,382,347,001	6.76
	ドイツ	18,806,494,632	6.56
	スペイン	15,959,000,292	5.57
	ベルギー	6,961,517,185	2.43
	オーストラリア	5,934,583,858	2.07
	カナダ	5,638,425,081	1.97
	オランダ	5,579,882,578	1.95
	オーストリア	4,128,400,964	1.44
	メキシコ	2,243,254,547	0.78
	アイルランド	2,207,280,323	0.77
	フィンランド	1,786,631,879	0.62
	ポーランド	1,740,816,754	0.61
	南アフリカ	1,537,906,951	0.54
	デンマーク	1,452,144,111	0.51
	マレーシア	1,323,939,756	0.46
	シンガポール	1,124,691,373	0.39
	スウェーデン	1,016,305,195	0.35
ノルウェー	656,863,796	0.23	
	小計	281,065,444,998	98.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,555,049,077	1.94
合計(純資産総額)		286,620,494,075	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	1,017,493,898	0.35
	買建	ドイツ	1,208,128,615	0.42

(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。

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		3,018,244,300	1.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	10,577.47	1,851,058,334	10,903.06	1,908,036,127	1.750	2023/5/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,136.67	1,772,957,883	11,565.30	1,841,197,324	2.875	2028/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,375.03	1,706,255,368	11,584.38	1,737,658,152	3.000	2025/9/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,881.57	1,630,460,588	10,472.01	1,727,883,233	2.500	2046/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,189.03	1,595,556,854	11,561.45	1,648,662,916	2.875	2028/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,452.08	1,531,230,713	11,011.67	1,613,210,624	2.250	2027/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,702.69	1,567,944,833	10,978.83	1,608,399,947	1.875	2022/10/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,069.03	1,544,130,062	11,116.80	1,550,794,748	2.500	2020/5/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/23	12,680,000	10,874.99	1,378,948,852	11,060.44	1,402,464,504	2.125	2023/11/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,798.44	1,349,805,107	11,180.36	1,397,546,165	2.375	2024/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,945.87	1,312,854,935	10,492.14	1,384,963,458	1.500	2026/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,454.86	1,285,948,325	10,919.49	1,343,097,705	2.000	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,000,000	10,844.64	1,301,357,203	11,020.28	1,322,433,973	2.000	2023/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,582.64	1,269,917,136	11,009.25	1,321,110,045	2.125	2025/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.875% 01/31/22	12,000,000	10,901.86	1,308,223,547	11,002.61	1,320,314,061	1.875	2022/1/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/15/21	11,500,000	11,063.15	1,272,262,277	11,129.76	1,279,922,629	2.375	2021/4/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/20	11,500,000	11,022.13	1,267,545,741	11,084.58	1,274,727,524	2.250	2020/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,400.03	1,265,404,262	11,377.33	1,262,884,055	3.625	2021/2/15	0.44
フランス	国債証券	FRTR 2.25% 10/25/22	9,240,000	13,730.19	1,268,669,872	13,654.82	1,261,706,082	2.250	2022/10/25	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 10/31/23	11,000,000	11,274.80	1,240,228,898	11,423.74	1,256,611,850	2.875	2023/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/30/20	11,100,000	11,131.96	1,235,648,007	11,170.77	1,239,956,162	2.750	2020/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	11,046.16	1,215,078,563	11,236.47	1,236,012,102	2.750	2021/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,663.44	1,162,315,824	11,282.56	1,229,799,055	2.875	2045/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,116.77	1,222,845,414	11,157.14	1,227,286,011	2.625	2020/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,703.22	1,198,761,073	10,954.50	1,226,904,473	1.750	2022/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 12/31/20	11,000,000	11,060.68	1,216,675,307	11,117.75	1,222,952,766	2.375	2020/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/21	11,000,000	10,811.39	1,189,253,925	10,921.28	1,201,341,328	1.375	2021/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 06/30/25	10,500,000	10,889.45	1,143,392,342	11,411.53	1,198,210,856	2.750	2025/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	10,987.76	1,142,727,891	11,447.59	1,190,549,956	2.750	2028/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	10,000,000	11,155.98	1,115,598,371	11,587.03	1,158,703,246	3.000	2025/10/31	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.06
合計	98.06

(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	36	アメリカドル	4,139,956.54	459,493,776	4,177,968.84	463,712,761	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	22	アメリカドル	2,703,291.16	300,038,286	2,739,000	304,001,610	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	15	アメリカドル	2,191,435	243,227,371	2,250,468.75	249,779,527	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,677,210	208,913,278	1,679,400	209,186,064	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	19	ユーロ	2,516,786	313,490,864	2,528,900	314,999,784	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	33	ユーロ	5,422,512	675,428,094	5,490,870	683,942,767	0.24

(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	13,830,000.00	1,533,568,098	1,532,778,900	0.53
	カナダドル	買建	1,660,000.00	137,774,637	137,049,600	0.05
	ユーロ	買建	8,440,000.00	1,058,408,456	1,051,370,800	0.37
	イギリスポンド	買建	2,050,000.00	298,157,166	297,045,000	0.10

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

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

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	219,185,657,138	61.85
	イギリス	21,889,843,172	6.18
	カナダ	13,334,147,361	3.76
	フランス	13,015,317,998	3.67
	スイス	12,575,567,466	3.55
	ドイツ	11,000,235,078	3.10
	オーストラリア	8,078,909,548	2.28
	オランダ	6,335,057,613	1.79
	アイルランド	5,962,670,358	1.68
	スペイン	3,900,571,534	1.10
	香港	3,525,527,288	0.99
	スウェーデン	3,177,728,422	0.90
	イタリア	2,521,686,286	0.71
	デンマーク	2,314,165,013	0.65
	シンガポール	1,592,585,335	0.45
	フィンランド	1,586,744,169	0.45
	バミューダ	1,416,816,258	0.40
	ベルギー	1,305,314,287	0.37
	ケイマン	974,155,969	0.27
	ノルウェー	927,366,295	0.26
	ジャージー	917,972,743	0.26
	イスラエル	671,665,697	0.19
	キュラソー	576,599,128	0.16
	ルクセンブルク	421,748,140	0.12
	ニュージーランド	314,890,355	0.09
	オーストリア	307,584,292	0.09
	ポルトガル	205,885,311	0.06
	パナマ	196,257,273	0.06
	リベリア	173,296,262	0.05
	パプアニューギニア	73,886,818	0.02
英ヴァージン諸島	59,786,711	0.02	
マン島	33,457,760	0.01	
モーリシャス	9,606,162	0.00	
	小計	338,582,703,240	95.54
投資信託受益証券	オーストラリア	166,042,650	0.05
	香港	91,648,410	0.03

	小計	257,691,060	0.07
投資証券	アメリカ	7,341,609,684	2.07
	オーストラリア	657,135,711	0.19
	フランス	425,716,422	0.12
	イギリス	272,898,296	0.08
	香港	231,731,269	0.07
	シンガポール	152,291,559	0.04
	カナダ	68,523,865	0.02
	小計	9,149,906,806	2.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,383,706,063	1.80
合計(純資産総額)		354,374,007,169	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	4,336,473,641	1.22
	買建	カナダ	238,474,248	0.07
	買建	ドイツ	1,095,126,580	0.31
	買建	イギリス	467,288,662	0.13
	買建	オーストラリア	242,525,760	0.07

(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		506,424,440	0.14

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
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	408,495	20,851.69	8,517,811,638	20,946.03	8,556,349,669	2.41
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	629,369	10,982.92	6,912,315,086	12,978.06	8,167,989,085	2.30
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,878	179,123.88	6,426,606,783	196,831.88	7,061,934,399	1.99
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,575	20,256.64	4,204,772,129	18,374.39	3,814,064,938	1.08
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	232,241	13,592.34	3,156,700,053	15,414.29	3,579,830,403	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,194	119,479.56	3,249,127,311	129,690.70	3,526,809,034	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,842	120,421.61	3,111,935,447	130,110.24	3,362,309,011	0.95
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,954	8,722.75	3,192,128,133	8,961.33	3,279,435,510	0.93
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,626	12,261.11	3,514,354,185	11,177.80	3,203,848,934	0.90
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	264,885	8,607.89	2,280,100,973	10,615.75	2,811,953,469	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	151,622	14,601.13	2,213,852,922	17,166.82	2,602,868,082	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	111,982	21,677.67	2,427,509,134	22,271.25	2,493,979,498	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	215,536	8,377.36	1,805,624,741	11,493.01	2,477,158,373	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	806,339	3,339.68	2,692,921,569	3,033.35	2,445,913,808	0.69
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	501,305	3,992.88	2,001,652,592	4,693.76	2,353,008,916	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	357,539	5,453.15	1,949,715,676	6,557.28	2,344,486,623	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	393,606	6,122.57	2,409,883,361	5,894.67	2,320,180,983	0.65
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	386,562	4,802.53	1,856,478,424	5,922.42	2,289,384,994	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	165,353	13,520.91	2,235,723,444	13,653.98	2,257,728,175	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	83,390	27,290.62	2,275,765,414	26,885.10	2,241,949,131	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	629,839	3,524.62	2,219,948,255	3,441.79	2,167,779,807	0.61
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	387,027	6,075.59	2,351,418,377	5,448.49	2,108,716,261	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	79,548	21,293.44	1,693,851,071	26,067.11	2,073,586,578	0.59
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	225,569	6,628.32	1,495,144,146	9,171.10	2,068,716,691	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,692	20,703.64	2,022,580,391	21,094.75	2,060,789,235	0.58

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	187,725	8,500.98	1,595,847,363	10,633.59	1,996,191,359	0.56
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	46,611	39,926.24	1,861,002,337	41,559.09	1,937,111,005	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	155,353	10,952.49	1,701,502,676	12,287.70	1,908,931,509	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,838	24,525.13	1,492,060,406	30,258.23	1,840,850,714	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	350,267	4,744.67	1,661,904,503	5,169.91	1,810,850,337	0.51

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.41
		素材	4.37
		資本財	6.92
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	1.15
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.83
		メディア・娯楽	5.75
		小売	4.72
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.92
		家庭用品・パーソナル用品	2.09
		ヘルスケア機器・サービス	4.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.31
		銀行	7.81
		各種金融	4.10
		保険	3.78
		不動産	0.66
		ソフトウェア・サービス	8.88
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.16		
電気通信サービス	2.38		
公益事業	3.42		
半導体・半導体製造装置	2.91		
		小計	95.54
投資信託受益証券			0.07

投資証券		2.58
合計		98.20

(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	277	アメリカドル	38,693,086.5	4,294,545,670	39,070,850	4,336,473,641	1.22
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	15	カナダドル	2,872,855.5	237,412,779	2,885,700	238,474,248	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	26	スイスフラン	2,379,812	265,372,835	2,399,280	267,543,712	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	205	ユーロ	6,611,252.5	823,497,611	6,644,050	827,582,868	0.23
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	3,080,215	242,228,108	3,084,000	242,525,760	0.07
	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	45	イギリスポンド	3,187,603.75	462,138,791	3,223,125	467,288,662	0.13

(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	4,059,000.00	448,683,480	450,372,440	0.13
	ユーロ	買建	450,000.00	55,834,650	56,052,000	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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

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

投資証券	日本	110,662,458,920	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,633,706,878	2.32
合計(純資産総額)		113,296,165,798	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	2,627,345,000	2.32

(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	11,340	681,486.68	7,728,058,951	750,000	8,505,000,000	7.51
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,711	611,005.12	7,155,480,960	653,000	7,647,283,000	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	36,435	147,326.67	5,367,847,221	163,200	5,946,192,000	5.25
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	22,133	215,192.23	4,762,849,626	222,700	4,929,019,100	4.35
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,828	177,133.15	4,574,994,998	174,900	4,517,317,200	3.99
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,334	177,970.29	4,152,758,746	190,100	4,435,793,400	3.92
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,712	247,601.92	3,890,321,367	245,700	3,860,438,400	3.41
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,708	238,912.7	3,752,840,691	235,800	3,703,946,400	3.27
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,413	298,165.48	3,402,962,623	308,500	3,520,910,500	3.11
日本	投資証券	G L P 投資法人	29,019	112,852.97	3,274,880,336	118,700	3,444,555,300	3.04
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,413	417,236.5	3,092,974,174	456,000	3,380,328,000	2.98
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,695	80,432.15	3,031,889,894	89,300	3,366,163,500	2.97
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	6,152	480,557.35	2,956,388,817	460,000	2,829,920,000	2.50
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,623	726,329.43	2,631,491,524	769,000	2,786,087,000	2.46
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,215	71,168.65	2,150,360,759	83,700	2,528,995,500	2.23
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	40,401	46,600.1	1,882,690,640	54,200	2,189,734,200	1.93
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,891	526,139.2	2,047,207,627	562,000	2,186,742,000	1.93
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,703	722,515.84	1,952,960,315	788,000	2,129,964,000	1.88
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,431	139,451.13	1,872,968,127	148,800	1,998,532,800	1.76
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,984	442,563.44	1,763,172,744	464,500	1,850,568,000	1.63

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,652	228,383.07	1,747,587,251	234,900	1,797,454,800	1.59
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,467	165,165.9	1,563,625,575	188,800	1,787,369,600	1.58
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,644	113,324.06	1,546,193,474	123,700	1,687,762,800	1.49
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,487	149,210.85	1,564,774,183	160,900	1,687,358,300	1.49
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,780	370,771.89	1,401,517,744	427,000	1,614,060,000	1.42
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,021	126,549.59	1,521,252,621	130,600	1,569,942,600	1.39
日本	投資証券	プレミアム投資法人	11,134	123,316.91	1,373,010,475	139,600	1,554,306,400	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,856	276,406.26	1,342,228,798	303,500	1,473,796,000	1.30
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,370	162,949.25	1,363,885,222	172,200	1,441,314,000	1.27
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,852	161,803.17	1,270,478,490	179,300	1,407,863,600	1.24

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.68
合計	97.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,385	円	2,547,624,400	2,627,345,000	2.32

(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	56,315,684,481	72.28
	オーストラリア	5,346,228,584	6.86
	イギリス	3,881,603,438	4.98
	フランス	3,160,154,138	4.06

シンガポール	2,906,265,775	3.73
香港	1,836,830,117	2.36
カナダ	1,483,864,117	1.90
ベルギー	674,491,527	0.87
スペイン	523,974,199	0.67
ニュージーランド	349,961,322	0.45
オランダ	234,693,474	0.30
ドイツ	221,095,744	0.28
アイルランド	183,091,118	0.23
ガーンジー	141,666,337	0.18
イスラエル	50,774,505	0.07
マン島	33,496,782	0.04
イタリア	27,315,647	0.04
韓国	10,135,650	0.01
小計	77,381,326,955	99.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	530,519,151	0.68
合計(純資産総額)	77,911,846,106	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		166,672,100	0.21

(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	178,330	20,904.50	3,727,899,735	20,351.12	3,629,216,371	4.66
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	363,000	7,486.27	2,717,518,006	8,004.59	2,905,669,364	3.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	86,390	22,906.11	1,978,859,379	24,306.81	2,099,865,316	2.70
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	222,630	7,744.12	1,724,075,425	8,721.59	1,941,688,517	2.49
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,140	20,288.85	1,625,948,805	22,300.11	1,787,130,880	2.29
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	212,070	7,497.37	1,589,968,211	8,394.17	1,780,152,417	2.28

アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	118,770	12,269.94	1,457,301,308	13,278.84	1,577,128,254	2.02
香港	投資証券	LINK REIT	1,220,500	1,025.16	1,251,214,439	1,290.98	1,575,643,531	2.02
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	205,190	6,667.16	1,368,036,469	7,242.09	1,486,005,986	1.91
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	79,310	20,079.07	1,592,471,200	18,168.32	1,440,929,586	1.85
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	175,060	6,998.10	1,225,088,347	8,198.83	1,435,287,407	1.84
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	88,840	13,789.39	1,225,050,083	14,828.26	1,317,342,974	1.69
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	37,970	28,200.33	1,070,766,879	32,205.96	1,222,860,616	1.57
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	13,911.41	903,407,033	15,897.09	1,032,357,525	1.33
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,056,490	316.91	968,660,365	323.99	990,292,979	1.27
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	919,750	822.57	756,562,804	1,058.49	973,550,224	1.25
アメリカ	投資証券	HCP INC	273,990	3,200.95	877,028,729	3,517.27	963,697,657	1.24
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	420,830	2,098.82	883,246,800	2,105.48	886,049,275	1.14
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	72,480	10,093.43	731,571,850	11,405.33	826,658,492	1.06
アメリカ	投資証券	UDR INC	157,830	4,533.94	715,591,987	5,050.04	797,048,602	1.02
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	91,380	7,265.40	663,912,746	8,692.73	794,342,289	1.02
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,170	11,162.26	727,444,764	12,166.72	792,905,390	1.02
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	99,150	7,775.95	770,986,375	7,494.04	743,034,542	0.95
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	96,960	7,238.76	701,870,926	7,552.86	732,326,227	0.94
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	209,770	3,169.87	664,944,553	3,421.82	717,795,538	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,580	10,864.71	571,266,940	12,777.16	671,823,535	0.86
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,270	14,291.66	618,400,170	15,399.86	666,352,050	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	167,490	3,644.91	610,486,244	3,954.57	662,351,549	0.85
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	48,870	11,429.75	558,571,892	13,165.63	643,404,524	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,700	10,319.14	574,776,177	11,285.46	628,600,300	0.81

(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	99.32
合計	99.32

(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	1,260,000.00	139,387,500	139,803,500	0.18
	オーストラリアドル	買建	180,000.00	14,063,220	14,151,600	0.02
	香港ドル	買建	900,000.00	12,722,850	12,717,000	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。

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12月19日

作成基準日：2019年3月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額 10,087円

純資産総額 0.69億円

※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9月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

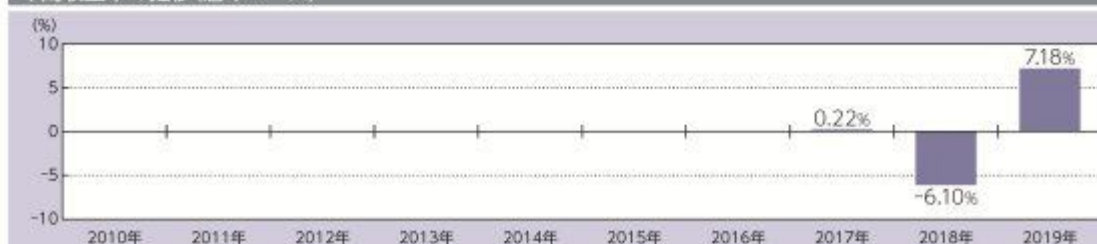
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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	20.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	19.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.6%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	19.1%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	19.0%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.4%
		第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/06/20	0.3%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.6%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
		PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.1%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移 (暦年ベース)



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

※ファンドには、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 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5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、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年12月19日設定）

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年9月6日から翌年9月5日までとします。

ただし、第1計算期間は、2017年12月19日から2018年9月5日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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。

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ち

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

替口座簿に記載又は記録されます。

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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12月19日から2018年9月5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】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (2018年 9月 5日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		506,042
親投資信託受益証券		41,379,142
流動資産合計		41,885,184
資産合計		41,885,184
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		4,507
未払委託者報酬		40,567
未払利息		1
その他未払費用		424
流動負債合計		45,499
負債合計		45,499
純資産の部		
元本等		
元本		41,952,087
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		112,402
（分配準備積立金）		360,571
元本等合計		41,839,685
純資産合計		41,839,685
負債純資産合計		41,885,184

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2017年12月19日 至 2018年 9月 5日
営業収益	
有価証券売買等損益	303,634
営業収益合計	303,634
営業費用	
支払利息	159
受託者報酬	10,750
委託者報酬	96,662
その他費用	991
営業費用合計	108,562
営業利益又は営業損失（ ）	195,072
経常利益又は経常損失（ ）	195,072
当期純利益又は当期純損失（ ）	195,072
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（ ）	4,909
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	14,926
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,926
剰余金減少額又は欠損金増加額	327,309
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	327,309
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	112,402

(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9月6日から翌年9月5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12月19日から2018年9月5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 9月 5日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		41,952,087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	112,402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)	0.9973円 (9,973円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年12月19日 至 2018年 9月 5日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	360,571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	38,099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	398,670円
当ファンドの期末残存口数	F	41,952,087口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	95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12月19日 至 2018年 9月 5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 9月 5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12月19日 至 2018年 9月 5日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	44,009,649円
期中一部解約元本額	2,557,562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 9月 5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	319,568
合計	319,568

（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	2,578,636	4,241,598	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	2,457,185	4,444,801	
	国内株式インデックス マザーファンド	5,292,829	8,121,846	
	外国株式インデックス マザーファンド	3,368,117	8,742,284	
	国内債券インデックス マザーファンド	5,678,716	7,860,478	
	外国債券インデックス マザーファンド	2,941,574	7,968,135	
合計		22,317,057	41,379,142	

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2018年 9月 5日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	993,261,764
国債証券	336,104,825,100
地方債証券	22,800,185,585
特殊債券	29,114,127,239
社債券	16,861,939,040
派生商品評価勘定	49,676
未収利息	1,064,249,094
前払費用	68,890,773
流動資産合計	407,007,528,271
資産合計	407,007,528,271
負債の部	

	2018年 9月 5日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	160,549,207
未払利息	2,065
その他未払費用	235
流動負債合計	460,551,507
負債合計	460,551,507
純資産の部	
元本等	
元本	293,713,040,447
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,833,936,317
元本等合計	406,546,976,764
純資産合計	406,546,976,764
負債純資産合計	407,007,528,271

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <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>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	293,713,040,447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。

	2018年 9月 5日現在	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	有価証券	100,047,000円
	1口当たり純資産額	1.3842円
	(1万口当たり純資産額)	(13,842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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月19日
期首元本額	248,458,759,773円
期中追加設定元本額	56,479,413,372円
期中一部解約元本額	11,225,132,698円
期末元本額	293,713,040,447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）	3,966,515,617円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,514,700円
S M T 国内債券インデックス・オープン	13,787,123,515円
世界経済インデックスファンド	1,715,386,501円
D C マイセレクション 2 5	19,525,148,173円

区分	2018年 9月 5日現在
DCマイセレクション50	22,377,635,332円
DCマイセレクション75	6,346,315,621円
DC日本債券インデックス・オープン	449,653,877円
DC日本債券インデックス・オープンS	77,557,874,929円
DC日本債券インデックス・オープンP	35,661,260,900円
DCマイセレクションS25	7,775,505,033円
DCマイセレクションS50	8,906,729,013円
DCマイセレクションS75	1,811,793,193円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,188,920,553円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,157,059,840円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	380,240,507円
DC世界経済インデックスファンド	1,421,010,233円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	89,758,892円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	8,869,742円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	67,169,915円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	16,022,228円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	973,417円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	300,251,522円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	435,910,951円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	76,032,032円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	207,374,948円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,251,413,711円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,129,076,549円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,272,872,105円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	911,099,003円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	138,334,129円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,506,953,408円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	367,630,222円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,667,767,995円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,135,675,956円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	180,163,499円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,860,914,875円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,233,724,005円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	49,160,398円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	653,020,720円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	63,673,069円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,110,063円
SMT インデックスバランス・オープン	66,768,990円
SMT 世界経済インデックス・オープン	4,009,429円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	6,578,003円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	17,873,609円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	904,311円
グローバル経済コア	301,390,885円

区分	2018年 9月 5日現在
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	5,678,716円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	278,118円
F O F s 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）	52,604,690,255円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,151,755,300
地方債証券	139,935,634
特殊債券	150,033,278
社債券	75,054,370
合計	3,516,778,582

(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 9月 5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	150,270,000	-	150,320,000	50,000
合計		150,270,000	-	150,320,000	50,000

(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。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	2,586,269,400	
	第382回利付国債(2年)	310,000,000	310,812,200	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,303,640,000	
	第384回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,725,142,800	
	第385回利付国債(2年)	700,000,000	702,226,000	
	第386回利付国債(2年)	2,990,000,000	3,000,016,500	
	第387回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,716,036,300	
	第388回利付国債(2年)	2,130,000,000	2,137,923,600	
	第389回利付国債(2年)	2,780,000,000	2,790,619,600	
	第390回利付国債(2年)	2,180,000,000	2,188,720,000	
	第391回利付国債(2年)	2,850,000,000	2,861,941,500	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,529,961,600	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,150,613,200	
	第124回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,957,663,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,625,847,900	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,974,237,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,804,856,000	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,618,983,800	
	第129回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,219,488,000	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,368,744,800	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,578,281,400	
	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,028,840,000	
	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,775,502,600	
	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,195,233,200	
	第135回利付国債(5年)	8,360,000,000	8,428,468,400	
	第136回利付国債(5年)	3,680,000,000	3,710,912,000	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	564,352,000	
	第2回利付国債(40年)	420,000,000	573,438,600	
	第3回利付国債(40年)	520,000,000	713,195,600	
	第4回利付国債(40年)	730,000,000	1,005,509,300	
	第5回利付国債(40年)	890,000,000	1,178,618,100	
	第6回利付国債(40年)	460,000,000	597,724,000	
	第7回利付国債(40年)	690,000,000	855,896,700	
	第8回利付国債(40年)	800,000,000	920,088,000	
	第9回利付国債(40年)	1,090,000,000	906,563,900	
	第10回利付国債(40年)	1,960,000,000	1,932,344,400	
第11回利付国債(40年)	490,000,000	464,863,000		
第305回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,944,972,100		
第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,197,331,200		
第307回利付国債(10年)	700,000,000	715,274,000		
第308回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,527,726,800		

第309回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,503,263,000	
第310回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,441,823,700	
第311回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,099,958,400	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,923,995,200	
第313回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,294,450,000	
第314回利付国債(10年)	310,000,000	319,448,800	
第315回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,171,139,200	
第316回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,126,536,800	
第317回利付国債(10年)	710,000,000	735,851,100	
第318回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,312,367,200	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,777,391,100	
第320回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,025,441,200	
第321回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,391,777,600	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	776,325,000	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,006,093,700	
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,322,777,600	
第325回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,371,638,500	
第326回利付国債(10年)	860,000,000	888,853,000	
第327回利付国債(10年)	740,000,000	768,016,400	
第328回利付国債(10年)	2,320,000,000	2,391,247,200	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,343,442,500	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,502,582,400	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,426,023,000	
第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,549,123,900	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,413,367,400	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,892,699,900	
第335回利付国債(10年)	4,220,000,000	4,355,293,200	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	526,692,300	
第337回利付国債(10年)	2,980,000,000	3,040,017,200	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,516,493,000	
第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,844,121,600	
第340回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,156,420,500	
第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,196,074,300	
第342回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,928,594,900	
第343回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,168,333,000	
第344回利付国債(10年)	2,560,000,000	2,573,337,600	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,988,989,200	
第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,411,526,000	
第347回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,436,342,300	
第348回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,232,201,700	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,214,429,800	
第350回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,922,312,400	代用有価証券 100,000,000円

第351回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,638,409,200	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	141,575,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	199,985,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	148,982,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	145,299,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,155,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	242,063,800	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	227,977,200	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	60,181,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,601,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	176,963,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	107,307,000	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	237,842,000	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	359,173,700	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	390,033,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	448,014,600	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	488,577,600	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	744,887,400	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	446,309,250	
第19回利付国債(30年)	280,000,000	362,826,800	
第20回利付国債(30年)	420,000,000	558,906,600	
第21回利付国債(30年)	270,000,000	350,681,400	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	533,696,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	574,217,700	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,694,600	
第25回利付国債(30年)	290,000,000	378,731,300	
第26回利付国債(30年)	410,000,000	543,057,300	
第27回利付国債(30年)	600,000,000	807,900,000	
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,525,398,300	
第29回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,642,185,300	
第30回利付国債(30年)	820,000,000	1,081,768,600	
第31回利付国債(30年)	940,000,000	1,225,525,000	
第32回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,646,707,600	
第33回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,816,142,900	
第34回利付国債(30年)	1,265,000,000	1,663,462,350	
第35回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,117,529,200	
第36回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,955,584,800	
第37回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,774,569,600	
第38回利付国債(30年)	790,000,000	979,126,000	
第39回利付国債(30年)	910,000,000	1,149,138,900	
第40回利付国債(30年)	820,000,000	1,017,579,000	
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,084,705,300	

第42回利付国債(30年)	800,000,000	975,408,000
第43回利付国債(30年)	900,000,000	1,097,784,000
第44回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,354,466,400
第45回利付国債(30年)	800,000,000	938,960,000
第46回利付国債(30年)	890,000,000	1,044,646,400
第47回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,606,593,000
第48回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,462,138,300
第49回利付国債(30年)	900,000,000	1,036,026,000
第50回利付国債(30年)	890,000,000	892,011,400
第51回利付国債(30年)	980,000,000	858,842,600
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,424,407,600
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,014,777,300
第54回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,486,543,200
第55回利付国債(30年)	1,000,000,000	997,660,000
第56回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,434,916,800
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,153,156,000
第58回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,092,168,000
第59回利付国債(30年)	120,000,000	115,858,800
第44回利付国債(20年)	170,000,000	176,845,900
第45回利付国債(20年)	290,000,000	301,231,700
第46回利付国債(20年)	170,000,000	177,080,500
第47回利付国債(20年)	90,000,000	94,252,500
第48回利付国債(20年)	130,000,000	137,790,900
第49回利付国債(20年)	140,000,000	147,861,000
第50回利付国債(20年)	220,000,000	231,231,000
第51回利付国債(20年)	100,000,000	105,888,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	117,381,000
第53回利付国債(20年)	80,000,000	85,791,200
第54回利付国債(20年)	200,000,000	215,136,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	150,407,600
第56回利付国債(20年)	150,000,000	161,878,500
第57回利付国債(20年)	240,000,000	258,096,000
第58回利付国債(20年)	300,000,000	324,063,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	215,316,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	372,284,500
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,736,000
第62回利付国債(20年)	320,000,000	333,369,600
第63回利付国債(20年)	200,000,000	217,960,000
第64回利付国債(20年)	320,000,000	351,606,400
第65回利付国債(20年)	220,000,000	242,743,600
第66回利付国債(20年)	330,000,000	362,366,400
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,988,000
第68回利付国債(20年)	190,000,000	213,605,600

第69回利付国債(20年)	390,000,000	436,289,100	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	456,472,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	225,916,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	710,955,000	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,781,200	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,692,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	148,031,000	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	303,917,400	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,326,400	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,049,000	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	306,852,300	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,521,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	444,896,400	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	688,680,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	334,138,000	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	538,107,700	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	335,503,900	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	246,111,600	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	640,436,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	494,251,800	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	409,157,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	739,034,100	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	531,486,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,028,887,200	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	477,736,100	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	715,957,000	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	729,102,500	
第96回利付国債(20年)	320,000,000	376,889,600	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	476,520,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	520,220,800	
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,364,153,000	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	575,467,200	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	870,719,850	
第102回利付国債(20年)	410,000,000	501,389,000	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	485,284,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	429,775,200	
第105回利付国債(20年)	680,000,000	814,354,400	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	458,853,800	
第107回利付国債(20年)	150,000,000	180,181,500	
第108回利付国債(20年)	660,000,000	779,380,800	
第109回利付国債(20年)	230,000,000	272,303,900	
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,144,484,000	

第111回利付国債(20年)	490,000,000	596,937,600
第112回利付国債(20年)	790,000,000	954,019,800
第113回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,634,958,000
第114回利付国債(20年)	910,000,000	1,105,122,200
第115回利付国債(20年)	700,000,000	857,850,000
第116回利付国債(20年)	880,000,000	1,080,860,000
第117回利付国債(20年)	850,000,000	1,034,407,500
第118回利付国債(20年)	690,000,000	833,492,400
第119回利付国債(20年)	270,000,000	319,928,400
第120回利付国債(20年)	790,000,000	917,877,300
第121回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,990,555,800
第122回利付国債(20年)	200,000,000	237,476,000
第123回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,507,561,800
第124回利付国債(20年)	500,000,000	606,840,000
第125回利付国債(20年)	620,000,000	769,271,200
第126回利付国債(20年)	700,000,000	851,466,000
第127回利付国債(20年)	670,000,000	806,311,500
第128回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,374,760,200
第129回利付国債(20年)	220,000,000	262,574,400
第130回利付国債(20年)	935,000,000	1,117,988,850
第131回利付国債(20年)	380,000,000	449,570,400
第132回利付国債(20年)	840,000,000	995,358,000
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,293,613,200
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,198,990,000
第135回利付国債(20年)	550,000,000	652,267,000
第136回利付国債(20年)	570,000,000	668,547,300
第137回利付国債(20年)	710,000,000	842,706,100
第138回利付国債(20年)	340,000,000	394,274,200
第139回利付国債(20年)	510,000,000	598,561,500
第140回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,996,831,200
第141回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,225,040,800
第142回利付国債(20年)	520,000,000	626,002,000
第143回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,188,719,500
第144回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,999,087,200
第145回利付国債(20年)	1,785,000,000	2,128,255,500
第146回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,860,861,600
第147回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,347,543,300
第148回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,514,682,000
第149回利付国債(20年)	2,030,000,000	2,365,071,800
第150回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,289,912,900
第151回利付国債(20年)	1,765,000,000	1,974,858,500
第152回利付国債(20年)	1,850,000,000	2,069,891,000
第153回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,121,384,100

	第154回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,665,522,000	
	第155回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,070,191,700	
	第156回利付国債（20年）	1,730,000,000	1,699,361,700	
	第157回利付国債（20年）	2,010,000,000	1,900,635,900	
	第158回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,771,206,800	
	第159回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,716,966,000	
	第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	2,000,875,500	
	第161回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,651,135,600	
	第162回利付国債（20年）	1,770,000,000	1,777,575,600	
	第163回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,413,651,900	
	第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,748,867,800	
	第165回利付国債（20年）	550,000,000	538,840,500	
	国債証券合計	312,410,000,000	336,104,825,100	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,010,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,266,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	129,415,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	126,890,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,337,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,313,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	234,246,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	232,882,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	102,961,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	103,226,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,984,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	206,606,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,104,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,602,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,843,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	103,029,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,210,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,827,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,048,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	206,290,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,238,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,332,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,284,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,208,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	133,551,000	
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,454,000	
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,498,000	
	第172回神奈川県公募公債	100,000,000	102,012,000	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,132,000	

第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,360,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	200,000,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	234,858,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,807,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,507,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,252,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,300,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,687,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,440,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	153,941,480	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,583,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,342,000	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,984,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	102,317,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	117,246,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,612,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,852,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	105,679,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,791,000	
第4回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	208,422,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,086,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,294,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,614,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,091,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	113,949,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	96,940,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,521,944	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,076,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,775,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,827,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,000,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	120,757,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,538,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,188,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,101,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,606,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,173,000	

平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,682,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,458,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,108,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	96,075,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,361,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,308,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,187,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,191,689	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	199,486,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	119,159,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,928,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	198,919,310	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,631,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,444,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,093,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,341,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,245,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,450,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,827,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,818,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,920,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,740,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	206,402,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,671,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	126,375,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,305,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,964,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,452,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,580,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,780,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,956,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,794,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,246,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	220,000,000	219,817,400	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,846,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,796,000	

第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,871,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,067,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	368,531,200	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,094,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,503,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,402,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,629,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,098,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,052,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,849,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,552,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,681,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,042,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,987,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,184,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,357,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,929,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,671,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,377,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,644,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,642,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,024,060	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,508,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,690,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,132,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,288,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,907,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,917,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,417,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,568,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,005,962	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,955,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	206,158,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,168,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,910,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	239,264,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,377,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	131,559,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,195,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,566,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,948,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,174,640	

	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,362,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,073,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,488,000	
	平成28年度第6回京都市公募公債	100,000,000	99,917,000	
	平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	142,014,000	
	平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	240,776,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,771,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,240,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,268,000	
	平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,876,000	
	平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	200,522,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,627,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,865,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,188,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,935,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	117,194,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,755,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,070,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	198,796,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	144,763,650	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	119,587,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,110,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,195,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,690,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,102,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,784,750	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,000,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	206,520,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,608,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	118,479,000	
	地方債証券合計	21,730,220,000	22,800,185,585	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,377,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,951,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,398,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,753,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,559,000	

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	104,746,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,778,000	
第14回道路債券	100,000,000	107,939,000	
第17回道路債券	100,000,000	106,355,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	467,632,000	
第21回道路債券	100,000,000	131,519,000	
第28回道路債券	200,000,000	266,554,000	
第33回道路債券	200,000,000	270,120,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,801,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	146,237,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,453,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,592,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,236,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,788,000	
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	137,604,000	
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	239,566,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,396,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,986,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,448,000	
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	127,982,000	
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	102,036,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,096,000	
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	102,111,000	
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	204,132,000	
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	205,664,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,945,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,922,000	
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	103,484,000	
	100,000,000	103,232,000	

第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,967,000	
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	309,510,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,932,000	
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	310,300,900	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,692,000	
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	103,399,000	
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	103,171,000	
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	309,360,000	
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	116,587,000	
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	103,628,000	
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	310,749,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,910,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,814,000	
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	308,244,000	
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	208,250,000	
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	153,770,520	
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	103,328,000	
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	228,324,000	
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	105,555,720	
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	103,411,000	
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	103,181,000	
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	102,873,000	
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	102,487,000	
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	304,692,000	
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	203,232,000	
	100,000,000	100,296,000	

第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	105,866,870	
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	314,571,680	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	204,573,600	
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	99,957,000	
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	299,742,000	
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	99,911,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	520,728,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,060,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,970,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	317,991,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,857,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,553,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,389,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,372,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,665,600	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	238,008,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,374,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,242,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,051,310	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,786,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,586,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,341,080	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,467,330	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,693,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,416,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,077,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	515,300,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,149,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,581,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,398,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,728,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,985,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,684,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,332,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,843,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,906,000	

第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,049,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,366,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,851,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,793,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,786,650	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,000,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,912,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,152,900	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,584,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,276,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,877,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,971,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	112,968,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,120,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,000,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,502,700	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,584,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,924,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	106,792,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,931,800	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,337,000	17,123,463	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,539,000	17,424,332	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,859,000	17,880,486	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,979,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,331,000	18,310,548	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,060,000	19,086,711	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,542,000	15,043,844	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,370,000	31,973,536	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,616,000	18,543,482	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,093,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	16,012,000	16,883,693	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,531,000	19,574,665	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,993,000	16,869,256	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,240,000	19,179,542	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,518,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,184,000	19,662,257	
	19,507,000	19,980,239	

第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券			
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,984,000	26,913,014	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,616,000	27,674,245	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,623,000	29,911,013	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,086,000	33,261,087	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,210,000	35,540,345	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,321,000	36,631,489	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,906,000	76,793,450	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,495,000	17,175,748	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,867,000	39,123,997	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,492,000	17,153,823	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,909,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,242,000	17,130,599	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,930,000	42,524,252	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,167,000	15,953,257	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,974,000	42,665,849	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,539,000	40,075,510	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,020,000	18,038,647	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,742,000	79,121,133	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,391,000	42,774,069	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,364,000	18,300,440	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,207,000	55,035,575	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,943,000	52,649,910	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,707,000	52,447,843	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,075,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,148,000	111,544,564	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,003,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,067,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,844,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,484,000	118,052,865	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,363,000	59,585,242	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,056,000	59,778,141	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,452,000	61,332,514	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,077,000	54,471,500	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,532,000	54,509,304	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,128,000	61,026,843	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	180,136,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,534,000	55,537,777	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,560,000	62,684,444	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,627,000	63,830,165	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,655,000	63,685,915	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,342,000	

第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,830,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,880,000	136,189,838	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,385,000	68,270,997	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,296,000	140,201,183	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,831,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,376,000	78,254,849	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,477,000	82,170,236	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,373,000	81,504,958	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,994,000	167,908,269	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,151,000	82,441,715	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,048,000	87,522,046	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,964,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,577,000	92,331,670	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,833,000	92,353,053	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,752,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,962,000	92,932,252	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,530,000	93,977,073	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,049,000	94,329,266	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,443,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,766,000	95,861,766	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,180,000	96,459,883	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,460,000	96,431,062	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,764,000	96,725,294	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,032,000	97,039,762	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,050,000	194,648,197	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,445,000	97,400,175	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,034,000	196,469,195	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,374,000	98,321,861	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,604,000	197,092,205	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,326,000	99,170,058	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,754,000	198,946,993	

	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,070,000	
	第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	125,602,000	
	第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,153,000	
	第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,210,000	
	第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,764,000	
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,918,000	
	第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,593,000	
	い第779号商工債	100,000,000	100,229,000	
	い第786号商工債	300,000,000	300,756,000	
	い第795号商工債	200,000,000	199,524,000	
	い第780号農林債	100,000,000	100,430,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,940,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,696,000	
	第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,181,000	
	第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,678,000	
	第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,310,000	
	第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,414,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,998,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	99,978,000	
	第201号商工債（3年）	300,000,000	299,760,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,000,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,878,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,136,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,801,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,515,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,523,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,376,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,830,000	
	特殊債券合計	27,641,283,000	29,114,127,239	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,811,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,981,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,651,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,600,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,356,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,828,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,334,000	

第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,492,000	
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,862,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,702,000	
第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,191,000	
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	100,455,000	
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	107,117,000	
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,164,000	
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	100,322,000	
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	199,692,000	
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	100,316,000	
第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,786,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,672,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,586,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,599,000	
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	99,669,000	
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	99,909,000	
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	101,753,000	
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	102,018,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,891,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,746,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,275,000	
第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	102,828,000	
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	99,803,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	102,927,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,102,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,762,000	
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	101,452,000	
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	99,726,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,403,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	99,763,000	

第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,539,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,873,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,537,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,414,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,986,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,429,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,874,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,990,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,418,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,736,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,344,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,423,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,622,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,448,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,707,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,101,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,265,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,219,000	
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	100,278,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,634,000	
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	100,378,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,001,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,214,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,266,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,572,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,184,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,458,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,039,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,460,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	123,869,000	
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	102,534,000	
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	104,038,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,945,000	

第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,074,000	
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	102,213,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,959,000	
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	102,675,000	
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	308,283,000	
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	102,634,000	
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	103,720,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,235,000	
第23回リコー株式会社無担保社債	100,000,000	99,596,000	
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	100,435,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,135,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,464,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,161,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,804,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,568,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,820,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,305,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,658,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,120,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,314,000	
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	102,888,000	
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	104,129,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,212,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,445,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,646,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,953,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,509,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,828,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,591,000	

第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,992,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,568,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,745,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,465,470	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,922,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,941,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,389,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,538,400	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	129,576,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,269,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,149,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,625,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,360,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,321,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,486,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	120,315,600	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,104,100	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,353,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,079,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,624,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,700,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,908,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,438,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,845,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,959,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,394,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,683,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,638,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,194,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,661,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,778,360	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,049,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,427,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,629,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,054,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,917,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,111,000	

第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,768,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,324,110	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,724,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,083,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,623,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,310,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,633,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,785,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,149,000	
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	100,988,000	
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	99,627,000	
社債券合計	16,496,000,000	16,861,939,040	
合計		404,881,076,964	

(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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,671,857,941
株式	215,570,566,010
派生商品評価勘定	671,760
未収入金	676,740
未収配当金	124,926,175
前払金	29,035,700
差入委託証拠金	37,538,100
流動資産合計	218,435,272,426
資産合計	218,435,272,426
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,735,000
未払金	605,698,820
未払解約金	84,646,449

	2018年 9月 5日現在
項目	金額（円）
未払利息	5,557
その他未払費用	252
流動負債合計	720,086,078
負債合計	720,086,078
純資産の部	
元本等	
元本	141,877,070,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	75,838,115,798
元本等合計	217,715,186,348
純資産合計	217,715,186,348
負債純資産合計	218,435,272,426

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,877,070,550口

	2018年 9月 5日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5345円 (15,345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 9月 5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 9月 5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

	2018年 9月 5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> <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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月19日
期首元本額	119,717,601,942円
期中追加設定元本額	30,759,283,259円
期中一部解約元本額	8,599,814,651円
期末元本額	141,877,070,550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）	649,726,312円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,590,996,616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	9,537,028,917円
世界経済インデックスファンド	1,793,497,974円
日本株式インデックス・オープン	5,883,948,386円
DCマイセレクション25	5,681,684,621円
DCマイセレクション50	17,214,770,932円

区分	2018年 9月 5日現在
D Cマイセレクション7 5	16,267,897,443円
D C日本株式インデックス・オープン	5,267,359,938円
D CマイセレクションS 2 5	2,263,268,612円
D CマイセレクションS 5 0	6,819,592,001円
D CマイセレクションS 7 5	4,650,535,963円
D C日本株式インデックス・オープンS	5,626,677,234円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	359,076,074円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	571,830,288円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	365,723,814円
D C世界経済インデックスファンド	1,452,724,063円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	448,594,444円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	23,646,951円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	51,833,842円
マイセレクション7 5 V A 1（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V A 1（適格機関投資家専用）	346,444,976円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,623,644円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	124,814,097円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	454,103,092円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	70,006,730円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	654,678,154円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,873,668,750円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	751,935,659円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,340,189,817円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	671,124,981円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	55,567,648円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	835,740,762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）	452,260,062円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	479,621,011円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	616,903,341円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	56,416,985円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	940,348,460円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,862,091,170円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,553,296,678円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	185,271,048円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	204,956,975円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,661,280円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,645,471円
S M T インデックスバランス・オープン	73,232,563円
S M T 世界経済インデックス・オープン	4,960,323円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	44,937,193円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,733,595円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	891,044円
グローバル経済コア	326,358,625円

区分	2018年 9月 5日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,292,829円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	43,320,270円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	605,141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）	33,031,626,680円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,799,130,859	
合計	6,799,130,859	

(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 9月 5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	1,647,215,700	-	1,618,180,000	29,035,700
合計		1,647,215,700	-	1,618,180,000	29,035,700

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,900	3,215.00	12,538,500	
日本水産	111,700	624.00	69,700,800	
マルハニチロ	18,800	3,800.00	71,440,000	

カネコ種苗	3,400	1,513.00	5,144,200
サカタのタネ	14,600	3,835.00	55,991,000
ホクト	10,100	1,906.00	19,250,600
ホクリヨウ	1,600	803.00	1,284,800
住石ホールディングス	25,800	134.00	3,457,200
日鉄鉱業	2,800	5,090.00	14,252,000
三井松島産業	5,000	1,789.00	8,945,000
国際石油開発帝石	482,700	1,207.00	582,618,900
石油資源開発	15,700	2,326.00	36,518,200
K&Oエナジーグループ	5,800	1,740.00	10,092,000
ヒノキヤグループ	2,500	2,803.00	7,007,500
ショーボンドホールディングス	9,400	7,920.00	74,448,000
ミライト・ホールディングス	30,500	1,727.00	52,673,500
タマホーム	7,300	1,035.00	7,555,500
サンヨーホームズ	1,500	923.00	1,384,500
日本アクア	2,800	411.00	1,150,800
ファーストコーポレーション	3,200	1,146.00	3,667,200
ベステラ	1,800	1,270.00	2,286,000
TATERU	14,200	756.00	10,735,200
ダイセキ環境ソリューション	2,200	902.00	1,984,400
第一カッター興業	1,300	2,090.00	2,717,000
安藤・間	81,000	816.00	66,096,000
東急建設	38,100	1,010.00	38,481,000
コムシスホールディングス	34,900	3,010.00	105,049,000
ミサワホーム	8,300	857.00	7,113,100
ピーアールホールディングス	9,700	444.00	4,306,800
高松コンストラクショングループ	6,400	2,850.00	18,240,000
東建コーポレーション	3,700	7,330.00	27,121,000
ソネック	1,200	852.00	1,022,400
ヤマウラ	4,700	873.00	4,103,100
大成建設	98,800	4,985.00	492,518,000
大林組	297,700	1,033.00	307,524,100
清水建設	303,700	948.00	287,907,600
飛島建設	90,100	182.00	16,398,200
長谷工コーポレーション	115,800	1,411.00	163,393,800
松井建設	10,800	861.00	9,298,800
銭高組	1,400	5,010.00	7,014,000
鹿島建設	436,000	787.00	343,132,000
不動テトラ	75,000	213.00	15,975,000
大末建設	3,200	1,253.00	4,009,600
鉄建建設	6,000	2,777.00	16,662,000
西松建設	22,900	2,597.00	59,471,300

三井住友建設	68,700	730.00	50,151,000
大豊建設	36,000	586.00	21,096,000
前田建設工業	70,800	1,317.00	93,243,600
佐田建設	6,500	418.00	2,717,000
ナカノフドー建設	7,600	659.00	5,008,400
奥村組	16,300	3,350.00	54,605,000
東鉄工業	11,900	2,880.00	34,272,000
イチケン	1,800	2,152.00	3,873,600
富士ピー・エス	2,600	622.00	1,617,200
浅沼組	35,000	339.00	11,865,000
戸田建設	115,400	754.00	87,011,600
熊谷組	15,600	2,950.00	46,020,000
青木あすなろ建設	6,500	947.00	6,155,500
北野建設	21,000	407.00	8,547,000
植木組	1,200	2,557.00	3,068,400
三井ホーム	12,000	978.00	11,736,000
矢作建設工業	13,400	814.00	10,907,600
ピーエス三菱	11,700	515.00	6,025,500
日本ハウスホールディングス	18,900	558.00	10,546,200
大東建託	35,400	15,470.00	547,638,000
新日本建設	11,800	1,152.00	13,593,600
N I P P O	23,000	2,034.00	46,782,000
東亜道路工業	2,000	3,570.00	7,140,000
前田道路	31,100	2,124.00	66,056,400
日本道路	2,700	5,890.00	15,903,000
東亜建設工業	7,300	2,964.00	21,637,200
若築建設	5,300	1,520.00	8,056,000
東洋建設	31,000	410.00	12,710,000
五洋建設	118,000	659.00	77,762,000
世紀東急工業	13,300	671.00	8,924,300
福田組	3,200	5,500.00	17,600,000
住友林業	63,400	1,816.00	115,134,400
日本基礎技術	10,900	385.00	4,196,500
日成ビルド工業	14,700	1,017.00	14,949,900
巴コーポレーション	12,200	458.00	5,587,600
大和ハウス工業	293,200	3,284.00	962,868,800
ライト工業	19,100	1,411.00	26,950,100
積水ハウス	323,000	1,777.50	574,132,500
日特建設	8,400	736.00	6,182,400
北陸電気工事	5,500	964.00	5,302,000
ユアテック	13,800	879.00	12,130,200
西部電気工業	1,700	3,940.00	6,698,000

四電工	1,500	2,646.00	3,969,000
中電工	12,800	2,625.00	33,600,000
関電工	39,400	1,069.00	42,118,600
きんでん	66,000	1,706.00	112,596,000
東京エネシス	11,200	1,073.00	12,017,600
トーエネック	2,800	3,025.00	8,470,000
住友電設	7,800	1,854.00	14,461,200
日本電設工業	15,200	2,128.00	32,345,600
協和エクシオ	35,600	3,075.00	109,470,000
新日本空調	7,700	1,597.00	12,296,900
N D S	1,600	6,160.00	9,856,000
九電工	19,600	4,250.00	83,300,000
三機工業	21,000	1,174.00	24,654,000
日揮	85,500	2,223.00	190,066,500
中外炉工業	3,000	2,830.00	8,490,000
ヤマト	8,100	628.00	5,086,800
太平電業	6,700	2,651.00	17,761,700
高砂熱学工業	27,300	1,941.00	52,989,300
三晃金属工業	1,100	3,420.00	3,762,000
朝日工業社	2,100	3,135.00	6,583,500
明星工業	17,900	847.00	15,161,300
大気社	12,500	3,510.00	43,875,000
ダイダン	6,600	2,701.00	17,826,600
日比谷総合設備	11,100	1,869.00	20,745,900
東芝プラントシステム	21,500	2,339.00	50,288,500
O S J Bホールディングス	43,600	295.00	12,862,000
東洋エンジニアリング	10,100	954.00	9,635,400
千代田化工建設	64,300	792.00	50,925,600
新興プランテック	19,100	1,029.00	19,653,900
日本製粉	29,500	1,792.00	52,864,000
日清製粉グループ本社	108,800	2,203.00	239,686,400
日東富士製粉	600	5,070.00	3,042,000
昭和産業	8,200	2,832.00	23,222,400
鳥越製粉	7,800	982.00	7,659,600
中部飼料	10,900	1,475.00	16,077,500
フィード・ワン	59,200	202.00	11,958,400
東洋精糖	1,500	1,226.00	1,839,000
日本甜菜製糖	5,100	1,913.00	9,756,300
三井製糖	7,000	3,045.00	21,315,000
塩水港精糖	10,600	256.00	2,713,600
日新製糖	4,200	2,277.00	9,563,400
森永製菓	20,900	4,165.00	87,048,500

中村屋	2,300	4,600.00	10,580,000
江崎グリコ	24,800	5,370.00	133,176,000
名糖産業	4,300	1,692.00	7,275,600
井村屋グループ	3,500	3,290.00	11,515,000
不二家	5,400	2,438.00	13,165,200
山崎製パン	72,700	2,129.00	154,778,300
第一屋製パン	1,500	1,096.00	1,644,000
モロゾフ	1,500	5,300.00	7,950,000
亀田製菓	5,500	5,050.00	27,775,000
寿スピリッツ	8,600	4,680.00	40,248,000
カルビー	40,500	3,575.00	144,787,500
森永乳業	17,800	2,980.00	53,044,000
六甲バター	6,500	2,470.00	16,055,000
ヤクルト本社	51,800	7,970.00	412,846,000
明治ホールディングス	58,800	7,300.00	429,240,000
雪印メグミルク	21,400	2,743.00	58,700,200
プリマハム	63,000	516.00	32,508,000
日本ハム	38,400	4,005.00	153,792,000
林兼産業	3,100	677.00	2,098,700
丸大食品	47,000	440.00	20,680,000
S Foods	6,200	4,360.00	27,032,000
伊藤ハム米久ホールディングス	57,300	808.00	46,298,400
サッポロホールディングス	32,500	2,286.00	74,295,000
アサヒグループホールディングス	186,200	4,920.00	916,104,000
キリンホールディングス	402,300	2,730.00	1,098,279,000
宝ホールディングス	66,600	1,115.00	74,259,000
オエノンホールディングス	25,100	398.00	9,989,800
養命酒製造	2,700	2,395.00	6,466,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	68,100	2,960.00	201,576,000
サントリー食品インターナショナル	59,500	4,485.00	266,857,500
ダイドーグループホールディングス	4,600	5,270.00	24,242,000
伊藤園	29,400	4,385.00	128,919,000
キーコーヒー	8,700	2,098.00	18,252,600
ユニカフェ	2,700	1,166.00	3,148,200
ジャパンフーズ	1,300	1,411.00	1,834,300
日清オイリオグループ	10,500	3,085.00	32,392,500
不二製油グループ本社	24,100	3,340.00	80,494,000
かどや製油	1,000	5,980.00	5,980,000
J - オイルミルズ	4,600	3,740.00	17,204,000
キッコーマン	64,000	5,680.00	363,520,000
味の素	204,500	1,870.50	382,517,250
キユーピー	49,500	2,659.00	131,620,500

ハウス食品グループ本社	33,900	3,215.00	108,988,500
カゴメ	35,600	3,110.00	110,716,000
焼津水産化学工業	4,200	1,095.00	4,599,000
アリアケジャパン	8,100	9,700.00	78,570,000
ピエトロ	1,200	1,633.00	1,959,600
エバラ食品工業	1,900	2,091.00	3,972,900
ニチレイ	42,300	2,720.00	115,056,000
東洋水産	48,800	4,055.00	197,884,000
イトアンド	2,800	1,738.00	4,866,400
大冷	1,000	1,989.00	1,989,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	867.00	1,473,900
日清食品ホールディングス	34,900	7,060.00	246,394,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,457.00	13,113,000
一正蒲鉾	3,500	1,014.00	3,549,000
フジッコ	9,600	2,320.00	22,272,000
ロック・フィールド	9,600	1,735.00	16,656,000
日本たばこ産業	513,500	2,910.00	1,494,285,000
ケンコーマヨネーズ	5,900	2,875.00	16,962,500
わらべや日洋ホールディングス	5,800	2,200.00	12,760,000
なとり	5,000	1,728.00	8,640,000
イフジ産業	1,500	766.00	1,149,000
ピクルスコーポレーション	1,800	2,101.00	3,781,800
北の達人コーポレーション	27,000	564.00	15,228,000
ユーグレナ	35,300	813.00	28,698,900
ミヨシ油脂	3,400	1,279.00	4,348,600
理研ビタミン	3,400	3,810.00	12,954,000
片倉工業	10,700	1,323.00	14,156,100
ゲンゼ	6,900	5,650.00	38,985,000
東洋紡	34,300	1,998.00	68,531,400
ユニチカ	27,100	659.00	17,858,900
富士紡ホールディングス	5,200	3,095.00	16,094,000
倉敷紡績	94,000	305.00	28,670,000
シキボウ	4,500	1,280.00	5,760,000
日本毛織	28,600	907.00	25,940,200
トーア紡コーポレーション	3,800	538.00	2,044,400
ガイドーリミテッド	10,400	393.00	4,087,200
帝国繊維	9,800	2,648.00	25,950,400
帝人	76,300	2,115.00	161,374,500
東レ	673,300	815.90	549,345,470
サカイオーベックス	2,300	2,362.00	5,432,600
住江織物	2,300	2,757.00	6,341,100
日本フェルト	5,100	502.00	2,560,200

イチカワ	6,000	340.00	2,040,000
日東製網	1,000	1,756.00	1,756,000
アツギ	6,200	1,153.00	7,148,600
ダイニック	3,400	938.00	3,189,200
セーレン	21,400	1,841.00	39,397,400
ソトー	3,400	1,021.00	3,471,400
東海染工	1,300	1,370.00	1,781,000
小松精練	14,200	858.00	12,183,600
ワコールホールディングス	25,300	3,205.00	81,086,500
ホギメディカル	11,700	3,810.00	44,577,000
レナウン	24,200	122.00	2,952,400
クラウドシアホールディングス	2,300	521.00	1,198,300
T S Iホールディングス	32,000	741.00	23,712,000
マツオカコーポレーション	2,200	3,420.00	7,524,000
三陽商会	5,200	2,005.00	10,426,000
ナイガイ	3,400	503.00	1,710,200
オンワードホールディングス	53,900	711.00	38,322,900
ルックホールディングス	3,200	1,251.00	4,003,200
ゴールドウイン	5,300	7,070.00	37,471,000
デサント	21,200	2,115.00	44,838,000
キング	4,600	455.00	2,093,000
ヤマトインターナショナル	5,900	508.00	2,997,200
特種東海製紙	5,100	4,370.00	22,287,000
王子ホールディングス	391,000	763.00	298,333,000
日本製紙	41,600	1,999.00	83,158,400
三菱製紙	13,200	610.00	8,052,000
北越コーポレーション	51,700	609.00	31,485,300
中越パルプ工業	3,700	1,656.00	6,127,200
巴川製紙所	14,000	273.00	3,822,000
大王製紙	37,000	1,594.00	58,978,000
阿波製紙	2,200	604.00	1,328,800
レンゴー	89,500	953.00	85,293,500
トーモク	5,300	1,992.00	10,557,600
ザ・パック	6,600	3,135.00	20,691,000
クラレ	146,400	1,571.00	229,994,400
旭化成	578,700	1,578.00	913,188,600
共和レザー	5,400	952.00	5,140,800
昭和電工	57,700	5,200.00	300,040,000
住友化学	683,000	612.00	417,996,000
住友精化	3,800	5,580.00	21,204,000
日産化学	53,600	5,310.00	284,616,000
ラサ工業	3,300	2,559.00	8,444,700

クレハ	8,000	7,640.00	61,120,000
多木化学	1,300	4,795.00	6,233,500
テイカ	7,100	2,517.00	17,870,700
石原産業	16,700	1,557.00	26,001,900
片倉コープアグリ	2,200	1,128.00	2,481,600
日東エフシー	5,500	752.00	4,136,000
日本曹達	64,000	634.00	40,576,000
東ソー	134,100	1,677.00	224,885,700
トクヤマ	26,900	3,295.00	88,635,500
セントラル硝子	18,900	2,527.00	47,760,300
東亜合成	54,500	1,247.00	67,961,500
大阪ソーダ	9,200	2,999.00	27,590,800
関東電化工業	22,200	1,149.00	25,507,800
デンカ	34,100	3,640.00	124,124,000
信越化学工業	152,900	10,065.00	1,538,938,500
日本カーバイド工業	2,900	1,727.00	5,008,300
堺化学工業	6,400	2,765.00	17,696,000
第一稀元素化学工業	7,100	1,330.00	9,443,000
エア・ウォーター	76,500	1,918.00	146,727,000
大陽日酸	71,500	1,616.00	115,544,000
日本化学工業	3,400	3,765.00	12,801,000
東邦アセチレン	1,300	1,499.00	1,948,700
日本パーカライズン	47,400	1,443.00	68,398,200
高压ガス工業	13,700	829.00	11,357,300
チタン工業	1,000	2,891.00	2,891,000
四国化成工業	13,400	1,444.00	19,349,600
戸田工業	1,800	2,823.00	5,081,400
ステラ ケミファ	4,700	3,785.00	17,789,500
保土谷化学工業	3,000	3,270.00	9,810,000
日本触媒	14,600	8,010.00	116,946,000
大日精化工業	7,200	3,345.00	24,084,000
カネカ	125,000	995.00	124,375,000
三菱瓦斯化学	76,500	2,310.00	176,715,000
三井化学	84,400	2,752.00	232,268,800
J S R	93,300	2,078.00	193,877,400
東京応化工業	14,900	3,470.00	51,703,000
大阪有機化学工業	8,000	1,349.00	10,792,000
三菱ケミカルホールディングス	621,600	970.50	603,262,800
K Hネオケム	13,600	4,100.00	55,760,000
ダイセル	125,100	1,245.00	155,749,500
住友ベークライト	75,000	1,044.00	78,300,000
積水化学工業	189,700	1,866.00	353,980,200

日本ゼオン	78,300	1,152.00	90,201,600
アイカ工業	26,000	4,200.00	109,200,000
宇部興産	46,700	2,683.00	125,296,100
積水樹脂	14,300	2,069.00	29,586,700
タキロンシーアイ	18,700	618.00	11,556,600
旭有機材	5,400	2,491.00	13,451,400
日立化成	45,900	2,307.00	105,891,300
ニチバン	4,600	2,613.00	12,019,800
リケンテクノス	19,900	571.00	11,362,900
大倉工業	4,400	2,101.00	9,244,400
積水化成成品工業	11,600	952.00	11,043,200
群栄化学工業	2,200	3,150.00	6,930,000
タイガースポリマー	4,500	754.00	3,393,000
ミライアル	3,100	1,218.00	3,775,800
ダイキアクシス	3,000	1,131.00	3,393,000
ダイキョーニシカワ	18,300	1,321.00	24,174,300
竹本容器	1,600	2,904.00	4,646,400
森六ホールディングス	4,700	2,957.00	13,897,900
日本化薬	60,200	1,271.00	76,514,200
カーリットホールディングス	8,700	972.00	8,456,400
日本精化	7,700	1,316.00	10,133,200
扶桑化学工業	8,800	2,652.00	23,337,600
トリケミカル研究所	2,200	4,220.00	9,284,000
A D E K A	39,900	1,795.00	71,620,500
日油	35,800	3,530.00	126,374,000
ハリマ化成グループ	7,200	914.00	6,580,800
花王	217,900	8,599.00	1,873,722,100
第一工業製薬	18,000	724.00	13,032,000
石原ケミカル	2,200	2,166.00	4,765,200
日華化学	2,900	1,141.00	3,308,900
ニイタカ	1,400	1,713.00	2,398,200
三洋化成工業	5,800	5,360.00	31,088,000
有機合成薬品工業	5,900	265.00	1,563,500
大日本塗料	10,600	1,246.00	13,207,600
日本ペイントホールディングス	71,600	4,315.00	308,954,000
関西ペイント	97,500	2,070.00	201,825,000
神東塗料	6,600	214.00	1,412,400
中国塗料	26,600	1,106.00	29,419,600
日本特殊塗料	5,800	2,297.00	13,322,600
藤倉化成	11,700	636.00	7,441,200
太陽ホールディングス	7,100	4,295.00	30,494,500
D I C	39,300	3,800.00	149,340,000

サカティンクス	18,900	1,419.00	26,819,100
東洋インキＳＣホールディングス	18,300	2,792.00	51,093,600
T & K T O K A	6,200	1,135.00	7,037,000
富士フイルムホールディングス	184,000	4,615.00	849,160,000
資生堂	176,100	7,651.00	1,347,341,100
ライオン	123,400	2,342.00	289,002,800
高砂香料工業	5,600	3,810.00	21,336,000
マンダム	17,300	3,305.00	57,176,500
ミルボン	10,900	4,990.00	54,391,000
ファンケル	21,500	5,380.00	115,670,000
コーセー	15,000	19,520.00	292,800,000
コタ	4,300	1,422.00	6,114,600
シーズ・ホールディングス	10,700	4,800.00	51,360,000
シーボン	1,100	2,574.00	2,831,400
ポーラ・オルビスホールディングス	37,800	3,795.00	143,451,000
ノエビアホールディングス	5,600	6,380.00	35,728,000
アジュバンコスメジャパン	1,900	965.00	1,833,500
エステー	6,400	2,032.00	13,004,800
アグロ カネショウ	3,600	2,694.00	9,698,400
コニシ	14,600	1,710.00	24,966,000
長谷川香料	10,600	2,200.00	23,320,000
星光PMC	6,000	1,028.00	6,168,000
小林製薬	24,800	7,940.00	196,912,000
荒川化学工業	8,000	1,653.00	13,224,000
メック	6,100	1,841.00	11,230,100
日本高純度化学	2,500	2,368.00	5,920,000
タカラバイオ	23,200	2,748.00	63,753,600
J C U	10,700	2,624.00	28,076,800
新田ゼラチン	6,100	808.00	4,928,800
O A T アグリオ	1,300	2,714.00	3,528,200
デクセリアルズ	22,700	1,137.00	25,809,900
アース製薬	6,700	5,100.00	34,170,000
北興化学工業	9,000	555.00	4,995,000
大成ラミック	2,700	3,115.00	8,410,500
クミアイ化学工業	38,700	865.00	33,475,500
日本農薬	20,800	790.00	16,432,000
アキレス	6,700	2,266.00	15,182,200
有沢製作所	14,900	1,000.00	14,900,000
日東電工	66,900	8,290.00	554,601,000
レック	5,300	5,260.00	27,878,000
きもと	15,100	299.00	4,514,900
藤森工業	7,400	3,430.00	25,382,000

前澤化成工業	6,000	1,219.00	7,314,000
ウェーブロックホールディングス	2,200	998.00	2,195,600
J S P	5,200	2,718.00	14,133,600
エフピコ	7,300	6,310.00	46,063,000
天馬	6,900	1,832.00	12,640,800
信越ポリマー	18,100	911.00	16,489,100
東リ	22,200	348.00	7,725,600
ニフコ	32,500	2,987.00	97,077,500
日本バルカー工業	7,200	3,195.00	23,004,000
ユニ・チャーム	187,900	3,550.00	667,045,000
協和発酵キリン	111,000	1,963.00	217,893,000
武田薬品工業	326,400	4,558.00	1,487,731,200
アステラス製薬	871,400	1,829.00	1,593,790,600
大日本住友製薬	65,700	2,185.00	143,554,500
塩野義製薬	124,800	6,495.00	810,576,000
田辺三菱製薬	108,100	1,831.00	197,931,100
わかもと製薬	10,200	282.00	2,876,400
あすか製薬	10,100	1,334.00	13,473,400
日本新薬	23,200	6,760.00	156,832,000
バイオフェルミン製薬	1,500	2,764.00	4,146,000
中外製薬	92,400	6,480.00	598,752,000
科研製薬	16,000	5,700.00	91,200,000
エーザイ	106,100	9,807.00	1,040,522,700
ロート製薬	48,700	3,505.00	170,693,500
小野薬品工業	209,200	2,896.00	605,843,200
久光製薬	26,200	8,050.00	210,910,000
持田製薬	6,100	8,530.00	52,033,000
参天製薬	167,900	1,710.00	287,109,000
扶桑薬品工業	3,100	2,735.00	8,478,500
日本ケミファ	1,200	4,485.00	5,382,000
ツムラ	31,700	3,815.00	120,935,500
日医工	23,400	1,610.00	37,674,000
キッセイ薬品工業	15,700	3,200.00	50,240,000
生化学工業	17,200	1,582.00	27,210,400
栄研化学	14,400	2,345.00	33,768,000
日水製薬	3,700	1,352.00	5,002,400
鳥居薬品	5,300	2,339.00	12,396,700
J C R ファーマ	6,200	5,840.00	36,208,000
東和薬品	4,300	7,480.00	32,164,000
富士製薬工業	6,000	1,857.00	11,142,000
沢井製薬	17,800	5,870.00	104,486,000
ゼリア新薬工業	19,000	2,377.00	45,163,000

第一三共	253,500	4,283.00	1,085,740,500
キョーリン製薬ホールディングス	24,700	2,179.00	53,821,300
大幸薬品	4,700	1,873.00	8,803,100
ダイト	5,200	3,260.00	16,952,000
大塚ホールディングス	168,800	5,262.00	888,225,600
大正製薬ホールディングス	19,800	12,490.00	247,302,000
ペプチドリーム	40,500	4,310.00	174,555,000
日本コークス工業	74,600	112.00	8,355,200
昭和シェル石油	82,900	2,199.00	182,297,100
ニチレキ	11,300	1,169.00	13,209,700
ユシロ化学工業	5,000	1,470.00	7,350,000
ビーピー・カストロール	3,600	1,505.00	5,418,000
富士石油	21,400	454.00	9,715,600
MORESCO	3,200	1,604.00	5,132,800
出光興産	74,400	5,560.00	413,664,000
JXTGホールディングス	1,414,000	755.10	1,067,711,400
コスモエネルギーホールディングス	25,700	3,920.00	100,744,000
横浜ゴム	51,300	2,290.00	117,477,000
東洋ゴム工業	45,500	1,795.00	81,672,500
ブリヂストン	272,300	3,999.00	1,088,927,700
住友ゴム工業	79,600	1,620.00	128,952,000
藤倉ゴム工業	7,700	580.00	4,466,000
オカモト	31,000	1,207.00	37,417,000
フコク	3,900	931.00	3,630,900
ニッタ	9,200	3,945.00	36,294,000
住友理工	17,100	1,025.00	17,527,500
三ツ星ベルト	22,000	1,351.00	29,722,000
バンドー化学	16,800	1,206.00	20,260,800
日東紡績	13,200	2,494.00	32,920,800
A G C	89,300	4,395.00	392,473,500
日本板硝子	43,000	1,121.00	48,203,000
石塚硝子	1,200	2,497.00	2,996,400
日本山村硝子	37,000	183.00	6,771,000
日本電気硝子	38,300	3,425.00	131,177,500
オハラ	3,500	2,695.00	9,432,500
住友大阪セメント	168,000	466.00	78,288,000
太平洋セメント	56,000	3,305.00	185,080,000
日本ヒューム	8,800	901.00	7,928,800
日本コンクリート工業	18,900	339.00	6,407,100
三谷セキサン	4,700	2,878.00	13,526,600
アジアパイルホールディングス	11,400	851.00	9,701,400
東海カーボン	80,500	1,984.00	159,712,000

日本カーボン	4,400	6,830.00	30,052,000
東洋炭素	5,500	3,225.00	17,737,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,900	6,590.00	32,291,000
TOTO	68,200	4,615.00	314,743,000
日本碍子	108,100	1,759.00	190,147,900
日本特殊陶業	74,700	2,965.00	221,485,500
MARUWA	3,100	8,230.00	25,513,000
品川リフラクトリーズ	2,300	4,800.00	11,040,000
黒崎播磨	1,800	8,650.00	15,570,000
ヨータイ	7,000	846.00	5,922,000
イソライト工業	4,600	609.00	2,801,400
東京窯業	11,200	502.00	5,622,400
ニッカトー	4,000	1,347.00	5,388,000
フジインコーポレーテッド	7,900	2,919.00	23,060,100
クニミネ工業	2,300	984.00	2,263,200
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,184.00	2,249,600
ニチアス	49,000	1,414.00	69,286,000
ニチハ	13,400	3,125.00	41,875,000
新日鐵住金	392,100	2,161.00	847,328,100
神戸製鋼所	160,400	898.00	144,039,200
中山製鋼所	12,100	683.00	8,264,300
合同製鐵	4,700	2,212.00	10,396,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	236,600	2,376.00	562,161,600
日新製鋼	24,200	1,505.00	36,421,000
東京製鐵	46,800	856.00	40,060,800
共英製鋼	9,900	1,942.00	19,225,800
大和工業	18,600	3,135.00	58,311,000
東京鐵鋼	3,600	1,686.00	6,069,600
大阪製鐵	5,800	2,033.00	11,791,400
淀川製鋼所	12,800	2,601.00	33,292,800
丸一鋼管	31,000	3,305.00	102,455,000
モリ工業	2,800	2,899.00	8,117,200
大同特殊鋼	15,500	5,020.00	77,810,000
日本高周波鋼業	3,100	750.00	2,325,000
日本冶金工業	72,300	346.00	25,015,800
山陽特殊製鋼	10,100	2,515.00	25,401,500
愛知製鋼	4,900	3,985.00	19,526,500
日立金属	94,400	1,255.00	118,472,000
日本金属	2,200	1,630.00	3,586,000
大平洋金属	5,400	3,535.00	19,089,000
新日本電工	52,200	276.00	14,407,200
栗本鐵工所	4,400	1,748.00	7,691,200

虹技	1,300	1,812.00	2,355,600
日本鑄鉄管	9,000	157.00	1,413,000
三菱製鋼	6,500	2,077.00	13,500,500
日亜鋼業	12,800	317.00	4,057,600
日本精線	1,400	4,110.00	5,754,000
エンビプロ・ホールディングス	1,800	770.00	1,386,000
シンニッタン	13,400	457.00	6,123,800
新家工業	2,000	1,871.00	3,742,000
大紀アルミニウム工業所	14,500	741.00	10,744,500
日本軽金属ホールディングス	256,400	241.00	61,792,400
三井金属鉱業	23,700	3,060.00	72,522,000
東邦亜鉛	4,900	3,630.00	17,787,000
三菱マテリアル	57,900	2,954.00	171,036,600
住友金属鉱山	112,000	3,547.00	397,264,000
DOWAホールディングス	22,200	3,275.00	72,705,000
古河機械金属	14,500	1,699.00	24,635,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,200	1,589.00	14,618,800
東邦チタニウム	15,800	1,131.00	17,869,800
UACJ	13,400	2,459.00	32,950,600
CKサンエツ	1,700	3,090.00	5,253,000
古河電気工業	29,200	3,695.00	107,894,000
住友電気工業	327,700	1,702.50	557,909,250
フジクラ	106,000	613.00	64,978,000
昭和電線ホールディングス	11,000	770.00	8,470,000
東京特殊電線	1,200	2,179.00	2,614,800
タツタ電線	17,600	622.00	10,947,200
カナレ電気	1,500	1,996.00	2,994,000
平河ヒューテック	4,500	1,538.00	6,921,000
リョービ	10,800	4,030.00	43,524,000
アーレスティ	10,900	822.00	8,959,800
アサヒホールディングス	15,100	2,076.00	31,347,600
稲葉製作所	4,900	1,291.00	6,325,900
宮地エンジニアリンググループ	2,500	2,975.00	7,437,500
トーカロ	24,400	1,259.00	30,719,600
アルファC o	3,100	1,409.00	4,367,900
SUMCO	96,800	1,905.00	184,404,000
川田テクノロジーズ	1,800	5,790.00	10,422,000
RS Technologies	1,700	5,970.00	10,149,000
東洋製罐グループホールディングス	55,800	2,066.00	115,282,800
ホッカンホールディングス	22,000	402.00	8,844,000
コロナ	4,800	1,193.00	5,726,400
横河ブリッジホールディングス	16,300	2,330.00	37,979,000

駒井ハルテック	1,900	2,345.00	4,455,500
高田機工	800	2,765.00	2,212,000
三和ホールディングス	84,100	1,286.00	108,152,600
文化シャッター	25,800	820.00	21,156,000
三協立山	12,200	1,310.00	15,982,000
アルインコ	6,300	1,037.00	6,533,100
東洋シャッター	2,200	663.00	1,458,600
LIXILグループ	129,200	2,112.00	272,870,400
日本フィルコン	6,700	579.00	3,879,300
ノーリツ	19,600	1,661.00	32,555,600
長府製作所	9,500	2,411.00	22,904,500
リンナイ	15,600	8,210.00	128,076,000
ダイニチ工業	4,600	740.00	3,404,000
日東精工	12,100	650.00	7,865,000
三洋工業	1,100	2,118.00	2,329,800
岡部	17,700	1,000.00	17,700,000
ジーテクト	9,700	1,820.00	17,654,000
東プレ	16,400	2,677.00	43,902,800
高周波熱錬	16,900	1,030.00	17,407,000
東京製綱	6,300	1,487.00	9,368,100
サンコール	4,800	790.00	3,792,000
モリテック スチール	6,800	607.00	4,127,600
パイオラックス	13,000	2,394.00	31,122,000
エイチワン	8,600	1,287.00	11,068,200
日本発條	87,300	1,166.00	101,791,800
中央発條	1,100	3,655.00	4,020,500
アドバネクス	1,400	2,077.00	2,907,800
立川ブラインド工業	3,900	1,188.00	4,633,200
三益半導体工業	6,800	1,780.00	12,104,000
日本ドライケミカル	1,200	2,385.00	2,862,000
日本製鋼所	28,700	2,717.00	77,977,900
三浦工業	38,000	3,115.00	118,370,000
タクマ	29,900	1,348.00	40,305,200
ツガミ	23,000	1,141.00	26,243,000
オークマ	10,300	6,140.00	63,242,000
東芝機械	50,000	505.00	25,250,000
アマダホールディングス	135,400	1,155.00	156,387,000
アイダエンジニアリング	22,400	956.00	21,414,400
滝澤鉄工所	2,700	1,733.00	4,679,100
F U J I	26,200	1,836.00	48,103,200
牧野フライス製作所	45,000	949.00	42,705,000
オーエスジー	43,200	2,481.00	107,179,200

ダイジェット工業	1,200	1,819.00	2,182,800
旭ダイヤモンド工業	26,300	795.00	20,908,500
D M G 森精機	55,600	1,785.00	99,246,000
ソディック	19,000	1,049.00	19,931,000
ディスコ	11,900	19,000.00	226,100,000
日東工器	5,400	2,473.00	13,354,200
日進工具	2,300	2,924.00	6,725,200
パンチ工業	7,200	862.00	6,206,400
富士ダイス	4,400	853.00	3,753,200
豊和工業	5,100	955.00	4,870,500
O K K	3,600	1,079.00	3,884,400
東洋機械金属	6,800	727.00	4,943,600
島精機製作所	11,100	4,970.00	55,167,000
オプトラン	8,500	3,285.00	27,922,500
N C ホールディングス	2,700	676.00	1,825,200
フリー	6,200	931.00	5,772,200
ヤマシンフィルタ	13,200	989.00	13,054,800
日阪製作所	12,500	1,102.00	13,775,000
やまびこ	17,000	1,276.00	21,692,000
平田機工	3,300	8,530.00	28,149,000
ペガサスミシン製造	8,100	987.00	7,994,700
ナプテスコ	48,300	2,864.00	138,331,200
三井海洋開発	9,300	3,355.00	31,201,500
レオン自動機	7,800	1,937.00	15,108,600
S M C	27,800	35,150.00	977,170,000
新川	5,900	632.00	3,728,800
ホソカワミクロン	3,100	6,210.00	19,251,000
ユニオンツール	4,000	3,805.00	15,220,000
オイレス工業	11,300	2,306.00	26,057,800
日精エー・エス・ビー機械	2,500	4,830.00	12,075,000
サトーホールディングス	11,500	3,635.00	41,802,500
技研製作所	6,000	2,500.00	15,000,000
日本エアーテック	2,900	750.00	2,175,000
カワタ	1,800	2,252.00	4,053,600
日精樹脂工業	7,600	1,180.00	8,968,000
オカダアイヨン	2,900	1,783.00	5,170,700
ワイエイシイホールディングス	2,800	832.00	2,329,600
小松製作所	427,900	3,025.00	1,294,397,500
住友重機械工業	50,800	3,575.00	181,610,000
日立建機	41,500	3,200.00	132,800,000
日工	2,500	2,424.00	6,060,000
巴工業	3,800	2,279.00	8,660,200

井関農機	9,000	1,930.00	17,370,000	
TOWA	6,800	1,064.00	7,235,200	
丸山製作所	2,100	1,724.00	3,620,400	
北川鉄工所	4,300	2,828.00	12,160,400	
ローツェ	4,400	2,197.00	9,666,800	
タカキタ	3,000	646.00	1,938,000	
クボタ	475,400	1,690.00	803,426,000	
荏原実業	2,700	2,183.00	5,894,100	
三菱化工機	3,200	1,832.00	5,862,400	
月島機械	17,700	1,440.00	25,488,000	
帝国電機製作所	6,200	1,599.00	9,913,800	
新東工業	21,300	1,048.00	22,322,400	
澁谷工業	7,800	4,230.00	32,994,000	
アイチ コーポレーション	15,600	615.00	9,594,000	
小森コーポレーション	22,500	1,315.00	29,587,500	
鶴見製作所	7,600	1,801.00	13,687,600	
住友精密工業	15,000	385.00	5,775,000	
酒井重工業	1,700	3,140.00	5,338,000	
荏原製作所	39,300	3,710.00	145,803,000	
石井鐵工所	1,500	1,739.00	2,608,500	
西島製作所	9,200	1,006.00	9,255,200	
北越工業	10,000	1,191.00	11,910,000	
ダイキン工業	120,900	13,970.00	1,688,973,000	
オルガノ	3,300	3,090.00	10,197,000	
トーヨーカネツ	3,700	3,125.00	11,562,500	
栗田工業	48,000	3,205.00	153,840,000	
椿本チエイン	53,000	970.00	51,410,000	
大同工業	3,900	1,117.00	4,356,300	
木村化工機	7,900	430.00	3,397,000	
アネスト岩田	14,900	1,044.00	15,555,600	
ダイフク	45,100	5,580.00	251,658,000	
サムコ	2,400	1,204.00	2,889,600	
加藤製作所	4,300	3,225.00	13,867,500	
油研工業	1,800	2,272.00	4,089,600	
タダノ	43,000	1,164.00	50,052,000	
フジテック	27,300	1,452.00	39,639,600	
C K D	24,600	1,542.00	37,933,200	
キトー	6,700	2,103.00	14,090,100	
平和	27,500	2,605.00	71,637,500	
理想科学工業	8,800	2,799.00	24,631,200	
SANKYO	22,200	4,275.00	94,905,000	
日本金銭機械	8,200	1,316.00	10,791,200	

マースエンジニアリング	5,600	2,332.00	13,059,200
福島工業	5,500	5,110.00	28,105,000
オーイズミ	3,500	497.00	1,739,500
ダイコク電機	4,100	1,785.00	7,318,500
竹内製作所	14,800	2,767.00	40,951,600
アマノ	27,400	2,267.00	62,115,800
J U K I	12,600	1,258.00	15,850,800
サンデンホールディングス	10,800	1,369.00	14,785,200
蛇の目ミシン工業	8,000	628.00	5,024,000
マックス	13,600	1,550.00	21,080,000
グローリー	26,400	2,835.00	74,844,000
新晃工業	9,000	1,688.00	15,192,000
大和冷機工業	13,700	1,160.00	15,892,000
セガサミーホールディングス	87,900	1,772.00	155,758,800
日本ピストンリング	3,200	2,179.00	6,972,800
リケン	4,100	5,870.00	24,067,000
T P R	9,900	2,657.00	26,304,300
ツバキ・ナカシマ	13,300	2,202.00	29,286,600
ホシザキ	25,900	10,580.00	274,022,000
大豊工業	7,200	1,158.00	8,337,600
日本精工	182,000	1,237.00	225,134,000
N T N	205,100	440.00	90,244,000
ジェイテクト	94,400	1,507.00	142,260,800
不二越	8,200	5,190.00	42,558,000
日本トムソン	28,200	770.00	21,714,000
T H K	55,200	2,868.00	158,313,600
ユーシン精機	7,800	1,168.00	9,110,400
前澤給装工業	3,500	1,959.00	6,856,500
イーグル工業	10,900	1,537.00	16,753,300
前澤工業	6,500	429.00	2,788,500
日本ピラー工業	9,000	1,545.00	13,905,000
キッツ	35,800	964.00	34,511,200
マキタ	115,500	4,965.00	573,457,500
日立造船	70,800	446.00	31,576,800
三菱重工業	148,500	4,074.00	604,989,000
I H I	68,100	3,980.00	271,038,000
スター精密	14,200	1,925.00	27,335,000
日清紡ホールディングス	57,810	1,238.00	71,568,780
イビデン	54,500	1,543.00	84,093,500
コニカミノルタ	207,800	1,087.00	225,878,600
ブラザー工業	108,400	2,176.00	235,878,400
ミネベアミツミ	164,700	2,084.00	343,234,800

日立製作所	2,128,000	710.10	1,511,092,800
三菱電機	886,300	1,466.00	1,299,315,800
富士電機	267,000	879.00	234,693,000
東洋電機製造	3,700	1,583.00	5,857,100
安川電機	102,800	3,475.00	357,230,000
シンフォニアテクノロジー	58,000	364.00	21,112,000
明電舎	76,000	374.00	28,424,000
オリジン電気	2,800	1,670.00	4,676,000
山洋電気	4,400	5,670.00	24,948,000
デンヨー	8,400	1,619.00	13,599,600
東芝テック	64,000	689.00	44,096,000
芝浦メカトロニクス	14,000	403.00	5,642,000
マブチモーター	24,600	4,530.00	111,438,000
日本電産	106,600	15,975.00	1,702,935,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,900	2,022.00	7,885,800
トレックス・セミコンダクター	2,800	1,670.00	4,676,000
東光高岳	4,700	1,657.00	7,787,900
ダブル・スコープ	13,300	985.00	13,100,500
ダイヘン	49,000	589.00	28,861,000
ヤーマン	13,100	1,807.00	23,671,700
JVCケンウッド	69,600	314.00	21,854,400
ミマキエンジニアリング	8,300	1,050.00	8,715,000
第一精工	4,200	1,638.00	6,879,600
日新電機	21,200	980.00	20,776,000
大崎電気工業	19,500	788.00	15,366,000
オムロン	94,300	4,785.00	451,225,500
日東工業	14,400	1,892.00	27,244,800
I D E C	11,200	2,280.00	25,536,000
不二電機工業	1,300	1,356.00	1,762,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	160,000	527.00	84,320,000
サクサホールディングス	2,400	2,087.00	5,008,800
メルコホールディングス	4,400	4,110.00	18,084,000
テクノメディカ	1,800	2,085.00	3,753,000
日本電気	114,800	3,070.00	352,436,000
富士通	912,000	796.00	725,952,000
沖電気工業	36,300	1,387.00	50,348,100
岩崎通信機	3,900	737.00	2,874,300
電気興業	5,200	3,340.00	17,368,000
サンケン電気	52,000	619.00	32,188,000
ナカヨ	2,000	1,622.00	3,244,000
アイホン	5,300	1,600.00	8,480,000
ルネサスエレクトロニクス	92,300	807.00	74,486,100

セイコーエプソン	132,100	1,850.00	244,385,000
ワコム	69,600	500.00	34,800,000
アルバック	20,500	4,530.00	92,865,000
アクセル	4,200	691.00	2,902,200
E I Z O	8,200	4,870.00	39,934,000
日本信号	24,800	1,111.00	27,552,800
京三製作所	21,300	632.00	13,461,600
能美防災	11,900	2,319.00	27,596,100
ホーチキ	6,700	1,598.00	10,706,600
星和電機	3,900	452.00	1,762,800
エレコム	8,000	2,899.00	23,192,000
パナソニック	1,012,500	1,313.50	1,329,918,750
シャープ	87,900	2,501.00	219,837,900
アンリツ	64,800	1,755.00	113,724,000
富士通ゼネラル	27,300	1,813.00	49,494,900
ソニー	593,600	6,234.00	3,700,502,400
T D K	46,400	12,510.00	580,464,000
帝国通信工業	4,300	1,255.00	5,396,500
タムラ製作所	34,600	788.00	27,264,800
アルプス電気	76,500	3,365.00	257,422,500
池上通信機	28,000	142.00	3,976,000
日本電波工業	7,800	478.00	3,728,400
鈴木	4,800	822.00	3,945,600
日本トリム	2,000	5,610.00	11,220,000
ローランド ディー . ジー .	4,700	2,522.00	11,853,400
フォスター電機	10,700	1,507.00	16,124,900
クラリオン	48,000	317.00	15,216,000
S M K	24,000	322.00	7,728,000
ヨコオ	6,000	1,484.00	8,904,000
ホシデン	22,800	1,063.00	24,236,400
ヒロセ電機	14,500	12,690.00	184,005,000
日本航空電子工業	23,000	2,042.00	46,966,000
T O A	9,800	1,200.00	11,760,000
マクセルホールディングス	17,900	1,763.00	31,557,700
古野電気	10,800	1,384.00	14,947,200
ユニデンホールディングス	26,000	280.00	7,280,000
アルパイン	21,300	2,428.00	51,716,400
スミダコーポレーション	9,000	1,377.00	12,393,000
アイコム	5,100	2,409.00	12,285,900
リオン	3,900	2,268.00	8,845,200
本多通信工業	7,300	814.00	5,942,200
横河電機	88,900	2,248.00	199,847,200

新電元工業	3,200	5,440.00	17,408,000
アズビル	26,600	4,725.00	125,685,000
東亜ディーケーケー	4,700	1,280.00	6,016,000
日本光電工業	36,700	3,230.00	118,541,000
チノー	3,300	1,483.00	4,893,900
共和電業	10,100	415.00	4,191,500
日本電子材料	4,000	841.00	3,364,000
堀場製作所	17,600	6,870.00	120,912,000
アドバンテスト	49,600	2,710.00	134,416,000
小野測器	4,600	800.00	3,680,000
エスベック	8,000	2,211.00	17,688,000
キーエンス	43,500	60,710.00	2,640,885,000
日置電機	4,700	3,825.00	17,977,500
シスメックス	69,000	9,630.00	664,470,000
日本マイクロニクス	14,800	824.00	12,195,200
メガチップス	7,200	2,185.00	15,732,000
O B A R A G R O U P	5,200	5,300.00	27,560,000
澤藤電機	1,200	1,994.00	2,392,800
コーセル	12,600	1,306.00	16,455,600
イリソ電子工業	7,500	5,810.00	43,575,000
オブテックスグループ	15,800	2,323.00	36,703,400
千代田インテグレ	4,100	2,225.00	9,122,500
アイ・オー・データ機器	4,000	1,222.00	4,888,000
レーザーテック	18,300	4,140.00	75,762,000
スタンレー電気	67,700	3,590.00	243,043,000
岩崎電気	3,700	1,523.00	5,635,100
ウシオ電機	54,100	1,491.00	80,663,100
岡谷電機産業	7,000	542.00	3,794,000
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	742.00	5,936,000
日本セラミック	9,100	2,925.00	26,617,500
遠藤照明	5,000	806.00	4,030,000
古河電池	6,700	840.00	5,628,000
双信電機	4,700	532.00	2,500,400
山一電機	6,700	1,563.00	10,472,100
図研	6,000	1,671.00	10,026,000
日本電子	33,000	1,118.00	36,894,000
カシオ計算機	71,500	1,782.00	127,413,000
ファナック	84,200	21,255.00	1,789,671,000
日本シイエムケイ	16,100	791.00	12,735,100
エンプラス	4,100	3,250.00	13,325,000
大真空	3,600	1,347.00	4,849,200
ローム	39,800	10,030.00	399,194,000

浜松ホトニクス	63,600	4,375.00	278,250,000
三井ハイテック	12,000	1,520.00	18,240,000
新光電気工業	33,800	999.00	33,766,200
京セラ	145,500	6,777.00	986,053,500
太陽誘電	43,100	3,245.00	139,859,500
村田製作所	93,000	18,985.00	1,765,605,000
ユーシン	13,300	736.00	9,788,800
双葉電子工業	14,700	2,046.00	30,076,200
北陸電気工業	3,900	1,186.00	4,625,400
ニチコン	28,200	1,195.00	33,699,000
日本ケミコン	7,200	3,290.00	23,688,000
K O A	12,500	2,121.00	26,512,500
市光工業	13,600	1,065.00	14,484,000
小糸製作所	53,100	6,580.00	349,398,000
ミツバ	16,700	894.00	14,929,800
S C R E E Nホールディングス	16,800	8,170.00	137,256,000
キャノン電子	8,300	2,356.00	19,554,800
キャノン	477,100	3,466.00	1,653,628,600
リコー	266,700	1,142.00	304,571,400
象印マホービン	16,800	1,500.00	25,200,000
M U T O Hホールディングス	1,400	2,320.00	3,248,000
東京エレクトロン	59,100	18,210.00	1,076,211,000
トヨタ紡織	25,800	1,892.00	48,813,600
芦森工業	1,900	2,215.00	4,208,500
ユニプレス	17,200	2,082.00	35,810,400
豊田自動織機	71,700	6,170.00	442,389,000
モリタホールディングス	14,200	2,354.00	33,426,800
三櫻工業	11,300	650.00	7,345,000
デンソー	196,600	5,238.00	1,029,790,800
東海理化電機製作所	23,400	2,229.00	52,158,600
三井E & Sホールディングス	32,000	1,755.00	56,160,000
川崎重工業	68,900	2,999.00	206,631,100
名村造船所	26,400	521.00	13,754,400
日本車輛製造	32,000	291.00	9,312,000
三菱ロジスネクスト	10,500	1,267.00	13,303,500
近畿車輛	1,100	2,394.00	2,633,400
日産自動車	1,044,900	1,030.00	1,076,247,000
いすゞ自動車	256,700	1,573.50	403,917,450
トヨタ自動車	1,077,100	6,721.00	7,239,189,100
日野自動車	126,400	1,137.00	143,716,800
三菱自動車工業	328,000	760.00	249,280,000
エフテック	5,700	1,230.00	7,011,000

レシップホールディングス	3,100	823.00	2,551,300	
G M B	1,500	1,292.00	1,938,000	
ファルテック	1,500	1,038.00	1,557,000	
武蔵精密工業	9,500	3,710.00	35,245,000	
日産車体	34,500	992.00	34,224,000	
新明和工業	38,500	1,323.00	50,935,500	
極東開発工業	16,500	1,685.00	27,802,500	
日信工業	18,000	1,821.00	32,778,000	
トピー工業	7,300	2,891.00	21,104,300	
ティラド	3,200	2,936.00	9,395,200	
曙ブレーキ工業	40,900	245.00	10,020,500	
タチエス	15,100	1,746.00	26,364,600	
N O K	47,700	2,025.00	96,592,500	
フタバ産業	27,200	690.00	18,768,000	
K Y B	9,200	4,175.00	38,410,000	
大同メタル工業	11,200	938.00	10,505,600	
プレス工業	46,900	548.00	25,701,200	
ミクニ	11,300	674.00	7,616,200	
太平洋工業	18,600	1,714.00	31,880,400	
ケーヒン	20,400	2,240.00	45,696,000	
河西工業	10,900	1,197.00	13,047,300	
アイシン精機	73,000	5,010.00	365,730,000	
マツダ	278,100	1,244.00	345,956,400	
今仙電機製作所	8,300	1,073.00	8,905,900	
本田技研工業	797,300	3,184.00	2,538,603,200	
スズキ	175,600	7,303.00	1,282,406,800	
S U B A R U	275,100	3,171.00	872,342,100	
安永	4,300	1,923.00	8,268,900	
ヤマハ発動機	125,100	2,736.00	342,273,600	
ショーワ	23,000	1,664.00	38,272,000	
T B K	10,600	484.00	5,130,400	
エクセディ	10,700	3,400.00	36,380,000	
豊田合成	32,200	2,758.00	88,807,600	
愛三工業	15,700	916.00	14,381,200	
盟和産業	1,400	1,248.00	1,747,200	
日本プラスト	4,900	996.00	4,880,400	
ヨロズ	9,000	1,631.00	14,679,000	
エフ・シー・シー	14,500	3,280.00	47,560,000	
シマノ	35,700	16,880.00	602,616,000	
テイ・エス テック	20,600	4,035.00	83,121,000	
ジャムコ	4,500	3,065.00	13,792,500	
テルモ	135,800	6,130.00	832,454,000	

クリエートメディック	2,900	1,182.00	3,427,800
日機装	29,400	1,265.00	37,191,000
島津製作所	105,900	3,310.00	350,529,000
JMS	8,100	608.00	4,924,800
長野計器	6,900	1,151.00	7,941,900
ブイ・テクノロジー	2,100	18,880.00	39,648,000
東京計器	5,600	1,134.00	6,350,400
愛知時計電機	1,200	4,295.00	5,154,000
インターアクション	4,700	1,861.00	8,746,700
オーバル	8,700	296.00	2,575,200
東京精密	16,000	3,320.00	53,120,000
マニー	10,800	4,860.00	52,488,000
ニコン	154,400	2,048.00	316,211,200
トプコン	47,600	1,873.00	89,154,800
オリンパス	132,000	4,425.00	584,100,000
理研計器	8,500	2,302.00	19,567,000
タムロン	7,900	2,187.00	17,277,300
HOYA	178,400	6,474.00	1,154,961,600
シード	3,800	2,118.00	8,048,400
ノーリツ鋼機	9,000	2,890.00	26,010,000
エー・アンド・デイ	8,000	897.00	7,176,000
シチズン時計	105,800	722.00	76,387,600
リズム時計工業	3,200	2,055.00	6,576,000
大研医器	7,800	825.00	6,435,000
メニコン	12,200	2,566.00	31,305,200
シンシア	1,300	637.00	828,100
松風	4,300	1,300.00	5,590,000
セイコーホールディングス	13,700	3,120.00	42,744,000
ニプロ	61,300	1,495.00	91,643,500
中本パックス	2,200	1,783.00	3,922,600
スノーピーク	3,100	1,704.00	5,282,400
パラマウントベッドホールディングス	9,300	4,955.00	46,081,500
トランザクション	4,800	779.00	3,739,200
SHO-BI	2,600	403.00	1,047,800
ニホンフラッシュ	4,100	2,301.00	9,434,100
前田工織	9,800	2,098.00	20,560,400
永大産業	11,500	493.00	5,669,500
アートネイチャー	9,500	712.00	6,764,000
バンダイナムコホールディングス	91,600	4,340.00	397,544,000
アイフィスジャパン	1,900	730.00	1,387,000
共立印刷	14,600	341.00	4,978,600
SHOEI	4,300	4,675.00	20,102,500

フランスベッドホールディングス	10,100	935.00	9,443,500
パイロットコーポレーション	15,500	6,070.00	94,085,000
萩原工業	4,900	1,834.00	8,986,600
トッパン・フォームズ	19,000	1,084.00	20,596,000
フジシールインターナショナル	19,900	3,825.00	76,117,500
タカラトミー	37,100	1,085.00	40,253,500
廣済堂	8,100	514.00	4,163,400
A s - m e エステール	2,500	753.00	1,882,500
アーク	44,800	110.00	4,928,000
タカノ	3,900	1,004.00	3,915,600
プロネクサス	7,600	1,185.00	9,006,000
ホクシン	5,900	160.00	944,000
ウッドワン	3,000	1,267.00	3,801,000
大建工業	6,900	2,165.00	14,938,500
凸版印刷	250,000	863.00	215,750,000
大日本印刷	115,900	2,495.00	289,170,500
図書印刷	5,900	825.00	4,867,500
共同印刷	2,700	2,804.00	7,570,800
N I S S H A	18,200	2,322.00	42,260,400
光村印刷	800	2,308.00	1,846,400
宝印刷	4,600	1,763.00	8,109,800
アシックス	88,000	1,592.00	140,096,000
ツツミ	2,800	2,141.00	5,994,800
小松ウオール工業	3,000	2,048.00	6,144,000
ヤマハ	58,000	5,360.00	310,880,000
河合楽器製作所	3,000	4,215.00	12,645,000
クリナップ	8,100	761.00	6,164,100
ピジョン	53,500	5,430.00	290,505,000
兼松サステック	700	1,896.00	1,327,200
キングジム	7,300	959.00	7,000,700
リンテック	21,100	2,994.00	63,173,400
イトーキ	18,500	601.00	11,118,500
任天堂	54,600	39,650.00	2,164,890,000
三菱鉛筆	14,600	1,933.00	28,221,800
タカラスタANDARD	18,300	1,807.00	33,068,100
コクヨ	42,500	1,912.00	81,260,000
ナカバヤシ	8,600	635.00	5,461,000
グローブライド	4,000	3,190.00	12,760,000
オカムラ	30,900	1,455.00	44,959,500
美津濃	8,800	2,887.00	25,405,600
東京電力ホールディングス	707,300	499.00	352,942,700
中部電力	271,100	1,587.50	430,371,250

関西電力	361,500	1,564.00	565,386,000
中国電力	122,500	1,368.00	167,580,000
北陸電力	86,800	1,063.00	92,268,400
東北電力	207,500	1,388.00	288,010,000
四国電力	79,800	1,453.00	115,949,400
九州電力	195,700	1,239.00	242,472,300
北海道電力	88,800	762.00	67,665,600
沖縄電力	17,900	2,219.00	39,720,100
電源開発	70,500	2,824.00	199,092,000
エフオン	5,300	1,227.00	6,503,100
イーレックス	13,900	1,133.00	15,748,700
レノバ	9,200	1,242.00	11,426,400
東京瓦斯	186,200	2,599.00	483,933,800
大阪瓦斯	171,900	2,028.00	348,613,200
東邦瓦斯	43,900	3,670.00	161,113,000
北海道瓦斯	24,000	299.00	7,176,000
広島ガス	18,000	362.00	6,516,000
西部瓦斯	10,700	2,521.00	26,974,700
静岡ガス	27,200	903.00	24,561,600
メタウォーター	5,000	2,996.00	14,980,000
SBSホールディングス	8,700	1,327.00	11,544,900
東武鉄道	93,400	3,095.00	289,073,000
相鉄ホールディングス	28,300	3,440.00	97,352,000
東京急行電鉄	240,600	1,832.00	440,779,200
京浜急行電鉄	121,400	1,877.00	227,867,800
小田急電鉄	131,800	2,467.00	325,150,600
京王電鉄	49,500	5,510.00	272,745,000
京成電鉄	61,700	3,785.00	233,534,500
富士急行	12,100	3,145.00	38,054,500
新京成電鉄	2,300	2,202.00	5,064,600
東日本旅客鉄道	157,500	10,130.00	1,595,475,000
西日本旅客鉄道	79,900	7,427.00	593,417,300
東海旅客鉄道	79,300	22,155.00	1,756,891,500
西武ホールディングス	112,900	2,002.00	226,025,800
鴻池運輸	12,500	1,801.00	22,512,500
西日本鉄道	24,600	2,964.00	72,914,400
ハマキョウレックス	6,300	3,610.00	22,743,000
サカイ引越センター	4,700	6,070.00	28,529,000
近鉄グループホールディングス	83,900	4,340.00	364,126,000
阪急阪神ホールディングス	111,900	3,955.00	442,564,500
南海電気鉄道	39,800	2,776.00	110,484,800
京阪ホールディングス	37,400	4,045.00	151,283,000

神戸電鉄	2,000	3,995.00	7,990,000
名古屋鉄道	67,200	2,542.00	170,822,400
山陽電気鉄道	6,400	2,533.00	16,211,200
日本通運	32,900	6,900.00	227,010,000
ヤマトホールディングス	147,100	3,211.00	472,338,100
山九	21,500	5,710.00	122,765,000
丸運	4,500	336.00	1,512,000
丸全昭和運輸	30,000	539.00	16,170,000
センコーグループホールディングス	50,500	872.00	44,036,000
トナミホールディングス	2,000	6,180.00	12,360,000
ニッコンホールディングス	31,900	2,721.00	86,799,900
日本石油輸送	1,000	2,965.00	2,965,000
福山通運	12,300	4,895.00	60,208,500
セイノーホールディングス	62,800	1,656.00	103,996,800
エスライン	2,300	1,151.00	2,647,300
神奈川中央交通	2,100	3,695.00	7,759,500
日立物流	18,400	3,055.00	56,212,000
丸和運輸機関	4,400	3,870.00	17,028,000
C & F ロジホールディングス	9,200	1,191.00	10,957,200
九州旅客鉄道	70,400	3,325.00	234,080,000
S Gホールディングス	79,300	2,615.00	207,369,500
日本郵船	70,500	2,034.00	143,397,000
商船三井	53,300	2,890.00	154,037,000
川崎汽船	39,000	2,049.00	79,911,000
N S ユナイテッド海運	4,200	2,256.00	9,475,200
飯野海運	43,800	583.00	25,535,400
共栄タンカー	900	1,876.00	1,688,400
乾汽船	6,400	946.00	6,054,400
日本航空	153,600	4,037.00	620,083,200
A N A ホールディングス	163,000	3,773.00	614,999,000
パスコ	8,000	268.00	2,144,000
トランコム	2,300	7,250.00	16,675,000
日新	7,200	2,273.00	16,365,600
三菱倉庫	29,000	2,605.00	75,545,000
三井倉庫ホールディングス	48,000	371.00	17,808,000
住友倉庫	58,000	688.00	39,904,000
澁澤倉庫	4,600	1,651.00	7,594,600
東陽倉庫	15,000	341.00	5,115,000
日本トランスシティ	20,200	506.00	10,221,200
ケイヒン	1,600	1,532.00	2,451,200
中央倉庫	5,100	1,195.00	6,094,500
川西倉庫	1,700	1,528.00	2,597,600

安田倉庫	7,400	917.00	6,785,800
東洋埠頭	2,600	1,657.00	4,308,200
宇徳	7,100	521.00	3,699,100
上組	51,800	2,299.00	119,088,200
サンリツ	2,100	756.00	1,587,600
キムラユニティー	2,200	1,171.00	2,576,200
キューソー流通システム	2,300	2,762.00	6,352,600
近鉄エクスプレス	15,800	2,162.00	34,159,600
東海運	4,500	327.00	1,471,500
エーアイティー	5,900	979.00	5,776,100
内外トランスライン	2,800	1,639.00	4,589,200
日本コンセプト	2,300	1,148.00	2,640,400
NEC ネットエスアイ	9,700	2,580.00	25,026,000
システナ	28,000	1,404.00	39,312,000
デジタルアーツ	4,300	4,975.00	21,392,500
新日鉄住金ソリューションズ	13,100	3,460.00	45,326,000
キューブシステム	5,200	928.00	4,825,600
エイジア	1,900	1,351.00	2,566,900
コア	3,800	1,265.00	4,807,000
ソリトンシステムズ	5,100	933.00	4,758,300
ソフトクリエイイトホールディングス	4,300	1,701.00	7,314,300
T I S	29,000	5,360.00	155,440,000
ネオス	2,600	595.00	1,547,000
電算システム	3,400	2,105.00	7,157,000
グリー	46,900	568.00	26,639,200
コーエーテクモホールディングス	14,900	2,237.00	33,331,300
三菱総合研究所	3,400	4,150.00	14,110,000
電算	1,000	2,179.00	2,179,000
A G S	5,100	794.00	4,049,400
ファインデックス	7,600	744.00	5,654,400
ヒト・コミュニケーションズ	2,100	1,713.00	3,597,300
ブレインパッド	1,900	4,205.00	7,989,500
K L a b	15,900	1,004.00	15,963,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,400	2,534.00	16,217,600
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,200.00	3,300,000
ネクソン	221,000	1,397.00	308,737,000
アイスタイル	22,200	1,302.00	28,904,400
エムアップ	2,900	2,638.00	7,650,200
エイチーム	5,500	2,127.00	11,698,500
テクノスジャパン	8,100	945.00	7,654,500
コロプラ	25,100	716.00	17,971,600
ブロードリーフ	43,300	704.00	30,483,200

クロス・マーケティンググループ	2,600	528.00	1,372,800
デジタルハーツホールディングス	4,700	1,574.00	7,397,800
メディアドゥホールディングス	2,900	2,598.00	7,534,200
じげん	9,400	808.00	7,595,200
サイバーリンクス	1,400	1,110.00	1,554,000
フィックスターズ	8,400	1,568.00	13,171,200
VOYAGE GROUP	4,700	1,509.00	7,092,300
オブティム	1,600	4,100.00	6,560,000
セレス	2,900	1,683.00	4,880,700
ペリサーブ	1,200	4,255.00	5,106,000
ティーガイア	8,800	2,875.00	25,300,000
セック	1,200	4,375.00	5,250,000
日本アジアグループ	9,000	417.00	3,753,000
豆蔵ホールディングス	6,500	936.00	6,084,000
テクマトリックス	4,800	2,090.00	10,032,000
プロシップ	1,300	2,345.00	3,048,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	210,300	234.00	49,210,200
GMOペイメントゲートウェイ	7,200	14,080.00	101,376,000
ザッパラス	4,400	377.00	1,658,800
システムリサーチ	1,200	3,940.00	4,728,000
インターネットイニシアティブ	14,200	2,420.00	34,364,000
さくらインターネット	10,600	696.00	7,377,600
ヴィンクス	2,500	1,171.00	2,927,500
GMOクラウド	2,000	3,765.00	7,530,000
SRAホールディングス	4,700	3,330.00	15,651,000
Minor iソリューションズ	1,800	1,433.00	2,579,400
朝日ネット	8,200	508.00	4,165,600
eBASE	2,400	1,698.00	4,075,200
アバント	2,500	1,370.00	3,425,000
アドソル日進	3,400	1,831.00	6,225,400
フリービット	5,900	1,083.00	6,389,700
コムチュア	4,500	3,945.00	17,752,500
サイバーコム	1,700	1,844.00	3,134,800
インフォテリア	4,500	1,132.00	5,094,000
マークライنز	3,100	1,781.00	5,521,100
メディカル・データ・ビジョン	7,800	1,829.00	14,266,200
gumi	10,000	762.00	7,620,000
ショーケース・ティービー	2,000	934.00	1,868,000
モバイルファクトリー	2,500	1,649.00	4,122,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,000	1,363.00	5,452,000
PCIホールディングス	1,600	2,775.00	4,440,000
パイブドHD	1,400	1,017.00	1,423,800

アイピーシー	1,500	1,517.00	2,275,500
ネオジャパン	2,200	1,216.00	2,675,200
ランドコンピュータ	1,000	1,116.00	1,116,000
オープンドア	3,500	3,355.00	11,742,500
マイネット	2,800	1,071.00	2,998,800
アカツキ	2,300	3,795.00	8,728,500
ベネフィットジャパン	600	978.00	586,800
U b i c o mホールディングス	1,400	975.00	1,365,000
L I N E	26,500	4,825.00	127,862,500
カナミックネットワーク	1,400	2,151.00	3,011,400
ノムラシステムコーポレーション	800	1,170.00	936,000
シンクロ・フード	3,000	865.00	2,595,000
オークネット	4,700	1,295.00	6,086,500
A O I T Y O H o l d i n g s	9,600	1,422.00	13,651,200
マクロミル	11,000	2,577.00	28,347,000
ビーグリー	2,000	1,266.00	2,532,000
オロ	900	5,090.00	4,581,000
ソルクシーズ	3,900	992.00	3,868,800
フェイス	3,200	1,213.00	3,881,600
ハイマックス	1,300	1,917.00	2,492,100
野村総合研究所	55,300	5,530.00	305,809,000
サイバネットシステム	7,300	814.00	5,942,200
C Eホールディングス	2,400	818.00	1,963,200
日本システム技術	1,500	2,189.00	3,283,500
インテージホールディングス	10,400	1,002.00	10,420,800
東邦システムサイエンス	3,100	872.00	2,703,200
ソースネクスト	13,100	1,062.00	13,912,200
F I G	8,300	312.00	2,589,600
フォーカスシステムズ	5,000	989.00	4,945,000
クレスコ	2,000	3,080.00	6,160,000
フジ・メディア・ホールディングス	90,300	1,877.00	169,493,100
オービック	27,400	10,850.00	297,290,000
ジャストシステム	14,200	2,000.00	28,400,000
T D Cソフト	3,900	1,992.00	7,768,800
ヤフー	627,400	375.00	235,275,000
トレンドマイクロ	46,300	7,100.00	328,730,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,676.00	4,692,800
日本オラクル	14,100	9,240.00	130,284,000
アルファシステムズ	2,900	2,882.00	8,357,800
フューチャー	11,900	1,838.00	21,872,200
C A C H o l d i n g s	6,600	1,050.00	6,930,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	2,449.00	9,061,300

トーセ	2,400	1,002.00	2,404,800
オービックビジネスコンサルタント	4,500	9,300.00	41,850,000
伊藤忠テクノソリューションズ	39,700	2,443.00	96,987,100
アイティフォー	10,600	985.00	10,441,000
東計電算	1,500	2,960.00	4,440,000
エクスネット	1,500	899.00	1,348,500
大塚商会	47,100	4,090.00	192,639,000
サイボウズ	11,400	694.00	7,911,600
ソフトブレーン	7,200	441.00	3,175,200
電通国際情報サービス	5,400	3,885.00	20,979,000
デジタルガレージ	15,700	3,695.00	58,011,500
E Mシステムズ	6,100	1,238.00	7,551,800
ウェザーニューズ	3,000	3,220.00	9,660,000
C I J	7,000	750.00	5,250,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,173.00	2,173,000
日本エンタープライズ	9,400	211.00	1,983,400
WOWOW	4,200	3,350.00	14,070,000
スカラ	7,100	1,159.00	8,228,900
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,500	643.00	4,822,500
ネットワンシステムズ	35,600	2,524.00	89,854,400
システムソフト	21,900	123.00	2,693,700
アルゴグラフィックス	4,000	4,320.00	17,280,000
マーベラス	15,000	863.00	12,945,000
エイベックス	16,200	1,470.00	23,814,000
日本ユニシス	24,200	2,711.00	65,606,200
兼松エレクトロニクス	5,600	3,585.00	20,076,000
東京放送ホールディングス	48,100	2,308.00	111,014,800
日本テレビホールディングス	79,900	1,817.00	145,178,300
朝日放送グループホールディングス	8,900	800.00	7,120,000
テレビ朝日ホールディングス	24,000	2,029.00	48,696,000
スカパーJ S A Tホールディングス	66,700	522.00	34,817,400
テレビ東京ホールディングス	7,200	2,737.00	19,706,400
日本BS放送	3,100	1,318.00	4,085,800
ビジョン	2,700	4,625.00	12,487,500
ワイヤレスゲート	4,100	739.00	3,029,900
コネクシオ	6,200	2,088.00	12,945,600
クロップス	2,000	728.00	1,456,000
日本電信電話	624,000	4,793.00	2,990,832,000
K D D I	766,200	2,911.00	2,230,408,200
光通信	10,500	21,430.00	225,015,000
N T T ドコモ	624,300	2,840.00	1,773,012,000
エムティーアイ	10,300	638.00	6,571,400

GMOインターネット	31,800	1,888.00	60,038,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,000	709.00	1,418,000
カドカワ	25,400	1,223.00	31,064,200
学研ホールディングス	3,000	4,575.00	13,725,000
ゼンリン	15,800	3,465.00	54,747,000
昭文社	4,300	645.00	2,773,500
インプレスホールディングス	6,900	170.00	1,173,000
アイネット	5,000	1,926.00	9,630,000
松竹	5,800	13,590.00	78,822,000
東宝	57,200	3,345.00	191,334,000
東映	3,300	12,630.00	41,679,000
エヌ・ティ・ティ・データ	270,200	1,422.00	384,224,400
ピー・シー・エー	1,400	1,594.00	2,231,600
ビジネスブレイン太田昭和	1,600	2,193.00	3,508,800
D T S	9,100	4,470.00	40,677,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,500	5,090.00	206,145,000
シーイーシー	10,400	2,456.00	25,542,400
カプコン	37,300	2,804.00	104,589,200
アイ・エス・ビー	1,800	2,148.00	3,866,400
ジャステック	5,100	1,155.00	5,890,500
S C S K	20,100	5,290.00	106,329,000
日本システムウエア	3,000	1,959.00	5,877,000
アイネス	11,100	1,238.00	13,741,800
T K C	7,400	4,230.00	31,302,000
富士ソフト	13,000	5,320.00	69,160,000
N S D	14,400	2,306.00	33,206,400
コナミホールディングス	35,600	4,620.00	164,472,000
福井コンピュータホールディングス	2,600	2,151.00	5,592,600
J B C Cホールディングス	7,000	1,340.00	9,380,000
ミロク情報サービス	7,700	2,477.00	19,072,900
ソフトバンクグループ	393,600	9,850.00	3,876,960,000
ハウスイ	700	1,001.00	700,700
高千穂交易	3,400	1,026.00	3,488,400
伊藤忠食品	2,200	5,730.00	12,606,000
エレマテック	4,100	2,443.00	10,016,300
J A L U X	2,500	2,786.00	6,965,000
あらた	4,400	5,180.00	22,792,000
トーマンデバイス	1,300	2,705.00	3,516,500
東京エレクトロン デバイス	3,200	1,961.00	6,275,200
フィールズ	6,600	891.00	5,880,600
双日	516,400	379.00	195,715,600
アルフレッサ ホールディングス	97,000	2,711.00	262,967,000

横浜冷凍	22,800	894.00	20,383,200
神栄	1,200	1,276.00	1,531,200
ラサ商事	3,900	979.00	3,818,100
ラクーン	5,200	638.00	3,317,600
アルコニックス	9,300	1,529.00	14,219,700
神戸物産	6,600	5,560.00	36,696,000
ペッパーフードサービス	6,900	3,910.00	26,979,000
あい ホールディングス	14,000	2,474.00	34,636,000
ディーブイエックス	3,100	1,400.00	4,340,000
ダイワボウホールディングス	7,400	6,570.00	48,618,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,700	1,970.00	32,899,000
ラクト・ジャパン	1,900	5,710.00	10,849,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,400	1,260.00	20,664,000
八洲電機	6,700	937.00	6,277,900
メディアスホールディングス	4,700	828.00	3,891,600
U K Cホールディングス	5,600	2,361.00	13,221,600
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	702.00	1,474,200
O C H Iホールディングス	2,500	1,297.00	3,242,500
T O K A Iホールディングス	46,100	1,070.00	49,327,000
黒谷	1,500	530.00	795,000
C o m i n i x	1,300	866.00	1,125,800
三洋貿易	4,400	2,046.00	9,002,400
ビューティガレージ	1,200	2,310.00	2,772,000
ウイン・パートナーズ	6,300	1,320.00	8,316,000
ミタチ産業	2,100	878.00	1,843,800
シップヘルスケアホールディングス	18,200	4,200.00	76,440,000
明治電機工業	3,000	1,982.00	5,946,000
デリカフーズホールディングス	1,700	1,504.00	2,556,800
スターティアホールディングス	1,900	728.00	1,383,200
コメダホールディングス	16,300	2,192.00	35,729,600
富士興産	3,300	634.00	2,092,200
協栄産業	1,100	1,910.00	2,101,000
小野建	7,700	1,744.00	13,428,800
佐島電機	6,400	963.00	6,163,200
エコートレーディング	2,000	665.00	1,330,000
伯東	5,300	1,592.00	8,437,600
コンドーテック	6,700	1,089.00	7,296,300
中山福	4,900	695.00	3,405,500
ナガイレーベン	12,600	2,556.00	32,205,600
三菱食品	9,600	2,958.00	28,396,800
松田産業	6,400	1,545.00	9,888,000

第一興商	13,000	5,100.00	66,300,000
メディバルホールディングス	87,500	2,200.00	192,500,000
S P K	1,900	2,405.00	4,569,500
萩原電気ホールディングス	3,200	3,195.00	10,224,000
アズワン	6,800	8,110.00	55,148,000
スズデン	3,000	1,333.00	3,999,000
尾家産業	2,600	1,319.00	3,429,400
シモジマ	5,300	1,012.00	5,363,600
ドウシシャ	9,300	2,217.00	20,618,100
小津産業	1,900	1,965.00	3,733,500
高速	5,200	1,167.00	6,068,400
たけびし	3,100	1,590.00	4,929,000
リックス	2,000	1,669.00	3,338,000
丸文	7,700	840.00	6,468,000
ハピネット	6,000	1,775.00	10,650,000
橋本総業ホールディングス	1,800	1,583.00	2,849,400
日本ライフライン	24,900	2,141.00	53,310,900
タカショー	4,000	472.00	1,888,000
エクセル	2,900	1,921.00	5,570,900
マルカキカイ	2,800	2,044.00	5,723,200
I D O M	26,300	370.00	9,731,000
日本エム・ディ・エム	5,800	1,118.00	6,484,400
進和	5,200	2,122.00	11,034,400
エスケイジャパン	2,100	573.00	1,203,300
ダイترون	4,000	1,943.00	7,772,000
シークス	11,100	2,139.00	23,742,900
田中商事	2,600	681.00	1,770,600
オーハシテクニカ	4,900	1,593.00	7,805,700
白銅	3,100	1,904.00	5,902,400
伊藤忠商事	640,400	1,945.50	1,245,898,200
丸紅	717,100	901.30	646,322,230
高島	1,500	2,060.00	3,090,000
長瀬産業	52,600	1,851.00	97,362,600
蝶理	5,600	1,963.00	10,992,800
豊田通商	97,400	3,720.00	362,328,000
三共生興	14,700	469.00	6,894,300
兼松	37,200	1,623.00	60,375,600
ツカモトコーポレーション	1,600	1,205.00	1,928,000
三井物産	718,900	1,797.50	1,292,222,750
日本紙パルプ商事	4,600	4,360.00	20,056,000
日立ハイテクノロジーズ	30,300	4,265.00	129,229,500
カメイ	11,400	1,333.00	15,196,200

東都水産	1,300	2,121.00	2,757,300
OUGホールディングス	1,400	2,758.00	3,861,200
スターゼン	3,500	4,625.00	16,187,500
山善	34,100	1,236.00	42,147,600
椿本興業	2,000	3,100.00	6,200,000
住友商事	550,400	1,773.50	976,134,400
内田洋行	4,000	2,943.00	11,772,000
三菱商事	612,400	3,100.00	1,898,440,000
第一実業	4,000	3,570.00	14,280,000
キャノンマーケティングジャパン	24,900	2,348.00	58,465,200
西華産業	5,300	1,959.00	10,382,700
佐藤商事	7,800	1,128.00	8,798,400
菱洋エレクトロ	8,100	1,721.00	13,940,100
東京産業	8,600	755.00	6,493,000
ユアサ商事	8,300	3,825.00	31,747,500
神鋼商事	2,000	3,120.00	6,240,000
小林産業	5,500	336.00	1,848,000
阪和興業	16,300	3,670.00	59,821,000
正栄食品工業	4,600	3,950.00	18,170,000
カナデン	8,300	1,131.00	9,387,300
菱電商事	6,300	1,628.00	10,256,400
フルサト工業	4,800	1,713.00	8,222,400
岩谷産業	19,400	3,900.00	75,660,000
すてきナイスグループ	3,700	1,254.00	4,639,800
昭光通商	3,000	898.00	2,694,000
ニチモウ	1,400	1,651.00	2,311,400
極東貿易	13,000	375.00	4,875,000
イワキ	11,800	498.00	5,876,400
三愛石油	23,500	1,331.00	31,278,500
稲畑産業	21,000	1,638.00	34,398,000
G S Iクレオス	2,300	1,406.00	3,233,800
明和産業	8,000	483.00	3,864,000
ワキタ	18,600	1,343.00	24,979,800
東邦ホールディングス	25,800	2,905.00	74,949,000
サンゲツ	28,600	2,098.00	60,002,800
ミツウロコグループホールディングス	12,600	768.00	9,676,800
シナネンホールディングス	3,600	2,657.00	9,565,200
伊藤忠エネクス	19,300	1,059.00	20,438,700
サンリオ	24,500	2,309.00	56,570,500
サンワテクノス	5,700	1,450.00	8,265,000
リョーサン	9,600	4,225.00	40,560,000
新光商事	9,600	1,642.00	15,763,200

トーホー	3,900	2,126.00	8,291,400
三信電気	8,100	1,899.00	15,381,900
東陽テクニカ	10,100	929.00	9,382,900
モスフードサービス	11,500	2,979.00	34,258,500
加賀電子	7,900	2,181.00	17,229,900
ソーダニッカ	8,900	607.00	5,402,300
立花エレテック	5,900	1,854.00	10,938,600
フォーバル	3,700	933.00	3,452,100
PALTAC	12,200	5,770.00	70,394,000
三谷産業	10,100	335.00	3,383,500
西本Wismettacホールディングス	2,300	4,820.00	11,086,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,465.00	1,025,500
国際紙パルプ商事	15,100	373.00	5,632,300
ヤマタネ	4,400	1,927.00	8,478,800
丸紅建材リース	9,000	252.00	2,268,000
日鉄住金物産	6,800	5,420.00	36,856,000
泉州電業	2,900	3,030.00	8,787,000
トラスコ中山	18,200	3,000.00	54,600,000
オートバックスセブン	34,700	1,876.00	65,097,200
モリト	6,800	885.00	6,018,000
加藤産業	13,600	3,545.00	48,212,000
イノテック	7,500	1,319.00	9,892,500
イエローハット	8,200	3,005.00	24,641,000
J Kホールディングス	8,700	737.00	6,411,900
日伝	7,200	1,955.00	14,076,000
北沢産業	6,900	242.00	1,669,800
杉本商事	4,700	1,832.00	8,610,400
因幡電機産業	11,600	4,735.00	54,926,000
バイテックホールディングス	4,000	2,110.00	8,440,000
東テク	2,900	2,921.00	8,470,900
ミスミグループ本社	101,400	2,800.00	283,920,000
アルテック	7,200	331.00	2,383,200
タキヒヨー	2,900	2,159.00	6,261,100
蔵王産業	1,400	1,507.00	2,109,800
スズケン	39,800	5,030.00	200,194,000
ジェコス	6,000	1,169.00	7,014,000
ルネサスイーストン	8,000	528.00	4,224,000
ローソン	22,100	6,520.00	144,092,000
サンエー	6,600	5,170.00	34,122,000
カワチ薬品	6,800	2,111.00	14,354,800
エービーシー・マート	15,900	6,160.00	97,944,000
ハードオフコーポレーション	3,800	950.00	3,610,000

アスクール	7,600	3,305.00	25,118,000
ゲオホールディングス	16,000	1,606.00	25,696,000
アダストリア	13,500	1,392.00	18,792,000
ジーフット	5,400	752.00	4,060,800
くらコーポレーション	5,100	6,830.00	34,833,000
キャンドウ	4,200	1,685.00	7,077,000
パルグループホールディングス	4,500	2,489.00	11,200,500
エディオン	34,000	1,267.00	43,078,000
サーラコーポレーション	17,800	652.00	11,605,600
ワッツ	2,900	932.00	2,702,800
ハローズ	3,300	2,497.00	8,240,100
あみやき亭	1,900	4,425.00	8,407,500
ひらまつ	12,100	433.00	5,239,300
大黒天物産	2,100	4,305.00	9,040,500
ハニーズホールディングス	8,400	1,003.00	8,425,200
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	6,700	1,996.00	13,373,200
ハブ	2,200	973.00	2,140,600
クオール	9,700	2,276.00	22,077,200
ジーンズ	6,000	5,500.00	33,000,000
ビックカメラ	46,600	1,487.00	69,294,200
D C Mホールディングス	47,000	1,009.00	47,423,000
MonotaRO	27,600	6,270.00	173,052,000
東京一番フーズ	2,200	660.00	1,452,000
DDホールディングス	1,900	2,652.00	5,038,800
きちり	2,400	806.00	1,934,400
アークランドサービスホールディングス	7,000	2,014.00	14,098,000
J．フロント リテイリング	104,200	1,597.00	166,407,400
ドトール・日レスホールディングス	15,400	1,969.00	30,322,600
マツモトキヨシホールディングス	36,100	4,285.00	154,688,500
ブロンコビリー	4,600	3,430.00	15,778,000
スタートトゥデイ	85,700	3,745.00	320,946,500
トレジャー・ファクトリー	2,600	735.00	1,911,000
物語コーポレーション	2,500	10,370.00	25,925,000
ココカラファイン	9,100	6,680.00	60,788,000
三越伊勢丹ホールディングス	163,300	1,261.00	205,921,300
Hamee	2,300	1,545.00	3,553,500
ウエルシアホールディングス	23,100	5,240.00	121,044,000
クリエイティブSDホールディングス	12,900	2,603.00	33,578,700
丸善CHIホールディングス	10,100	365.00	3,686,500
ティーライフ	1,200	1,066.00	1,279,200
エー・ピーカンパニー	1,700	572.00	972,400

チムニー	2,700	2,916.00	7,873,200
シュッピン	5,300	1,396.00	7,398,800
ネクステージ	13,400	750.00	10,050,000
ジョイフル本田	25,600	1,635.00	41,856,000
鳥貴族	2,900	2,351.00	6,817,900
キリン堂ホールディングス	3,200	1,851.00	5,923,200
ホットランド	4,900	1,298.00	6,360,200
すかいらーくホールディングス	81,400	1,607.00	130,809,800
綿半ホールディングス	3,300	2,757.00	9,098,100
ヨシックス	1,400	2,729.00	3,820,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,000	1,274.00	36,946,000
ブックオフコーポレーション	5,000	754.00	3,770,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,500	851.00	2,978,500
B E E N O S	2,100	1,780.00	3,738,000
あさひ	6,500	1,452.00	9,438,000
日本調剤	3,100	3,480.00	10,788,000
コスモス薬品	4,400	23,380.00	102,872,000
トーエル	4,200	924.00	3,880,800
一六堂	2,000	377.00	754,000
オンリー	1,500	866.00	1,299,000
セブン&アイ・ホールディングス	365,800	4,499.00	1,645,734,200
薬王堂	3,800	3,700.00	14,060,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	23,500	1,319.00	30,996,500
ツルハホールディングス	18,900	13,390.00	253,071,000
サンマルクホールディングス	6,300	2,600.00	16,380,000
フェリシモ	2,300	1,265.00	2,909,500
トリドールホールディングス	10,800	2,522.00	27,237,600
T O K Y O B A S E	7,900	687.00	5,427,300
ウイルプラスホールディングス	900	946.00	851,400
ジャパンミート	3,300	2,159.00	7,124,700
サツドラホールディングス	1,500	1,975.00	2,962,500
ダイユー・リックホールディングス	4,100	1,194.00	4,895,400
パロックジャパンリミテッド	7,000	969.00	6,783,000
クスリのアオキホールディングス	6,900	8,100.00	55,890,000
力の源ホールディングス	2,000	1,182.00	2,364,000
スシローグローバルホールディングス	9,600	6,490.00	62,304,000
L I X I L ビバ	11,100	1,745.00	19,369,500
メディカルシステムネットワーク	10,300	435.00	4,480,500
総合メディカル	7,600	2,268.00	17,236,800
はるやまホールディングス	4,200	920.00	3,864,000
ノジマ	15,500	2,405.00	37,277,500

カップ・クリエイト	10,900	1,341.00	14,616,900
ライトオン	7,300	1,018.00	7,431,400
良品計画	11,600	33,000.00	382,800,000
三城ホールディングス	10,800	484.00	5,227,200
アドヴァン	8,900	1,014.00	9,024,600
アルビス	2,800	2,994.00	8,383,200
コナカ	11,100	504.00	5,594,400
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,876.00	2,063,600
G - 7ホールディングス	2,600	2,723.00	7,079,800
イオン北海道	8,700	799.00	6,951,300
コジマ	12,800	463.00	5,926,400
ヒマラヤ	2,700	946.00	2,554,200
コーナン商事	12,400	2,587.00	32,078,800
エコス	3,600	1,559.00	5,612,400
ワタミ	10,400	1,244.00	12,937,600
マルシェ	2,300	818.00	1,881,400
ドンキホーテホールディングス	56,600	5,350.00	302,810,000
西松屋チェーン	19,200	1,195.00	22,944,000
ゼンショーホールディングス	45,300	2,226.00	100,837,800
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,616.00	8,080,000
ハークスレイ	2,100	1,020.00	2,142,000
サイゼリヤ	14,400	2,159.00	31,089,600
V Tホールディングス	29,500	492.00	14,514,000
魚力	2,500	1,552.00	3,880,000
ポブラ	2,200	636.00	1,399,200
フジ・コーポレーション	1,800	2,601.00	4,681,800
ユナイテッドアローズ	10,800	4,230.00	45,684,000
ハイデイ日高	11,500	2,226.00	25,599,000
京都きもの友禅	5,500	554.00	3,047,000
コロワイド	29,000	3,015.00	87,435,000
ピーシーデポコーポレーション	13,200	527.00	6,956,400
壺番屋	6,200	4,540.00	28,148,000
P L A N T	2,100	1,296.00	2,721,600
スギホールディングス	19,200	5,420.00	104,064,000
ヴィア・ホールディングス	10,600	723.00	7,663,800
スクロール	13,500	748.00	10,098,000
ヨンドシーホールディングス	8,900	2,355.00	20,959,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	27,900	9,810.00	273,699,000
木曽路	10,700	2,649.00	28,344,300
S R Sホールディングス	10,400	1,003.00	10,431,200
タカキュー	6,700	203.00	1,360,100
ケーヨー	16,000	530.00	8,480,000

上新電機	10,300	2,915.00	30,024,500
日本瓦斯	16,000	5,200.00	83,200,000
ロイヤルホールディングス	15,500	2,781.00	43,105,500
いなげや	9,800	1,644.00	16,111,200
鳥忠	19,800	3,575.00	70,785,000
チヨダ	10,300	2,185.00	22,505,500
ライフコーポレーション	6,600	2,661.00	17,562,600
リンガーハット	10,800	2,366.00	25,552,800
MrMaxHD	10,900	576.00	6,278,400
テンアライド	8,000	454.00	3,632,000
AOKIホールディングス	17,500	1,460.00	25,550,000
オークワ	13,000	1,044.00	13,572,000
コメリ	13,500	2,666.00	35,991,000
青山商事	16,800	3,340.00	56,112,000
しまむら	10,200	10,180.00	103,836,000
はせがわ	4,600	487.00	2,240,200
高島屋	68,500	1,812.00	124,122,000
松屋	17,600	1,167.00	20,539,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	41,400	1,691.00	70,007,400
近鉄百貨店	3,400	3,495.00	11,883,000
パルコ	8,400	1,163.00	9,769,200
丸井グループ	80,000	2,459.00	196,720,000
アクシアル リテイリング	7,300	3,775.00	27,557,500
イオン	335,800	2,376.50	798,028,700
イズミ	15,800	6,820.00	107,756,000
東武ストア	1,000	3,930.00	3,930,000
平和堂	17,700	2,884.00	51,046,800
フジ	10,500	2,167.00	22,753,500
ヤオコー	9,900	6,250.00	61,875,000
ゼビオホールディングス	11,900	1,606.00	19,111,400
ケーズホールディングス	77,000	1,360.00	104,720,000
Olympicグループ	5,200	879.00	4,570,800
日産東京販売ホールディングス	12,900	346.00	4,463,400
Genky DrugStores	3,400	3,965.00	13,481,000
アインホールディングス	11,700	8,500.00	99,450,000
元気寿司	2,200	5,620.00	12,364,000
ヤマダ電機	298,500	549.00	163,876,500
アーランドサカモト	14,900	1,439.00	21,441,100
ニトリホールディングス	34,600	16,770.00	580,242,000
グルメ杵屋	6,000	1,224.00	7,344,000
愛眼	7,000	356.00	2,492,000
ケーユーホールディングス	4,500	879.00	3,955,500

吉野家ホールディングス	28,700	1,883.00	54,042,100
松屋フーズ	4,200	3,625.00	15,225,000
サガミチェーン	11,700	1,405.00	16,438,500
関西スーパーマーケット	6,600	1,139.00	7,517,400
王将フードサービス	6,400	7,200.00	46,080,000
プレナス	9,800	1,871.00	18,335,800
ミニストップ	6,500	2,072.00	13,468,000
アークス	16,400	2,706.00	44,378,400
パローホールディングス	20,300	2,365.00	48,009,500
藤久	800	1,303.00	1,042,400
ベルク	3,900	5,850.00	22,815,000
大庄	4,700	1,682.00	7,905,400
ファーストリテイリング	11,700	53,850.00	630,045,000
サンドラッグ	32,800	3,930.00	128,904,000
サックスパー ホールディングス	8,200	879.00	7,207,800
ヤマザワ	1,900	1,687.00	3,205,300
やまや	1,800	3,030.00	5,454,000
ベルーナ	21,400	1,180.00	25,252,000
島根銀行	1,800	1,225.00	2,205,000
じもとホールディングス	58,700	171.00	10,037,700
めぶきフィナンシャルグループ	454,100	377.00	171,195,700
東京きらぼしフィナンシャルグループ	11,800	2,448.00	28,886,400
九州フィナンシャルグループ	143,400	533.00	76,432,200
ゆうちょ銀行	247,600	1,283.00	317,670,800
富山第一銀行	22,100	444.00	9,812,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	521,800	506.00	264,030,800
西日本フィナンシャルホールディングス	56,000	1,241.00	69,496,000
関西みらいフィナンシャルグループ	38,100	971.00	36,995,100
三十三フィナンシャルグループ	7,400	2,169.00	16,050,600
新生銀行	71,300	1,671.00	119,142,300
あおぞら銀行	52,100	3,870.00	201,627,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,085,900	667.20	4,060,512,480
りそなホールディングス	959,000	604.00	579,236,000
三井住友トラスト・ホールディングス	171,800	4,365.00	749,907,000
三井住友フィナンシャルグループ	661,400	4,329.00	2,863,200,600
第四銀行	10,700	4,470.00	47,829,000
北越銀行	8,800	2,257.00	19,861,600
千葉銀行	309,500	691.00	213,864,500
群馬銀行	177,000	547.00	96,819,000
武蔵野銀行	13,900	3,110.00	43,229,000
千葉興業銀行	24,000	478.00	11,472,000
筑波銀行	36,100	267.00	9,638,700

七十七銀行	27,400	2,530.00	69,322,000
青森銀行	6,800	3,270.00	22,236,000
秋田銀行	5,600	2,783.00	15,584,800
山形銀行	9,800	2,450.00	24,010,000
岩手銀行	6,100	4,855.00	29,615,500
東邦銀行	78,100	422.00	32,958,200
東北銀行	4,400	1,340.00	5,896,000
みちのく銀行	5,600	1,794.00	10,046,400
ふくおかフィナンシャルグループ	355,000	604.00	214,420,000
静岡銀行	220,000	942.00	207,240,000
十六銀行	11,700	2,854.00	33,391,800
スルガ銀行	88,600	603.00	53,425,800
八十二銀行	158,200	478.00	75,619,600
山梨中央銀行	54,000	389.00	21,006,000
大垣共立銀行	13,800	2,781.00	38,377,800
福井銀行	7,500	2,224.00	16,680,000
北國銀行	9,900	4,235.00	41,926,500
清水銀行	3,500	2,101.00	7,353,500
富山銀行	1,700	3,965.00	6,740,500
滋賀銀行	82,000	551.00	45,182,000
南都銀行	10,200	2,783.00	28,386,600
百五銀行	83,700	447.00	37,413,900
京都銀行	33,400	5,440.00	181,696,000
紀陽銀行	32,900	1,679.00	55,239,100
ほくほくフィナンシャルグループ	58,200	1,511.00	87,940,200
広島銀行	129,000	760.00	98,040,000
山陰合同銀行	51,700	931.00	48,132,700
中国銀行	60,300	1,173.00	70,731,900
鳥取銀行	2,800	1,649.00	4,617,200
伊予銀行	124,700	713.00	88,911,100
百十四銀行	93,000	334.00	31,062,000
四国銀行	13,400	1,279.00	17,138,600
阿波銀行	70,000	712.00	49,840,000
大分銀行	5,000	3,715.00	18,575,000
宮崎銀行	5,800	3,115.00	18,067,000
佐賀銀行	5,300	2,283.00	12,099,900
十八銀行	54,000	352.00	19,008,000
沖縄銀行	8,500	4,145.00	35,232,500
琉球銀行	16,900	1,315.00	22,223,500
セブン銀行	328,000	353.00	115,784,000
みずほフィナンシャルグループ	11,874,400	193.20	2,294,134,080
高知銀行	3,200	1,087.00	3,478,400

山口フィナンシャルグループ	109,100	1,207.00	131,683,700
長野銀行	2,900	1,700.00	4,930,000
名古屋銀行	7,100	3,800.00	26,980,000
北洋銀行	131,400	370.00	48,618,000
愛知銀行	2,900	4,770.00	13,833,000
中京銀行	3,600	2,316.00	8,337,600
大光銀行	3,000	1,991.00	5,973,000
愛媛銀行	12,200	1,209.00	14,749,800
トマト銀行	3,400	1,417.00	4,817,800
京葉銀行	77,000	470.00	36,190,000
栃木銀行	45,000	367.00	16,515,000
北日本銀行	2,700	2,537.00	6,849,900
東和銀行	15,300	1,002.00	15,330,600
福島銀行	7,300	688.00	5,022,400
大東銀行	4,200	1,229.00	5,161,800
トモニホールディングス	71,900	458.00	32,930,200
フィデアホールディングス	84,300	170.00	14,331,000
池田泉州ホールディングス	92,800	388.00	36,006,400
F P G	28,000	1,164.00	32,592,000
マーキュリアインベストメント	3,400	941.00	3,199,400
S B Iホールディングス	98,900	3,045.00	301,150,500
ジャフコ	12,600	4,025.00	50,715,000
大和証券グループ本社	748,200	662.20	495,458,040
野村ホールディングス	1,503,700	511.70	769,443,290
岡三証券グループ	75,000	524.00	39,300,000
丸三証券	27,900	955.00	26,644,500
東洋証券	32,000	239.00	7,648,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	97,000	639.00	61,983,000
光世証券	2,200	1,167.00	2,567,400
水戸証券	25,500	376.00	9,588,000
いちよし証券	18,500	1,104.00	20,424,000
松井証券	42,800	1,170.00	50,076,000
だいこう証券ビジネス	4,300	552.00	2,373,600
マネックスグループ	89,100	522.00	46,510,200
カブドットコム証券	56,000	375.00	21,000,000
極東証券	11,800	1,421.00	16,767,800
岩井コスモホールディングス	9,000	1,462.00	13,158,000
藍澤證券	16,400	733.00	12,021,200
マネーパートナーズグループ	11,500	389.00	4,473,500
かんぽ生命保険	33,000	2,455.00	81,015,000
S O M P Oホールディングス	171,400	4,586.00	786,040,400
アニコム ホールディングス	6,000	3,635.00	21,810,000

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	228,500	3,311.00	756,563,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	71,800	2,174.00	156,093,200
第一生命ホールディングス	494,300	2,064.50	1,020,482,350
東京海上ホールディングス	329,200	5,200.00	1,711,840,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,700	1,010.00	2,727,000
T & Dホールディングス	270,300	1,643.00	444,102,900
アドバンスクリエイト	2,000	2,272.00	4,544,000
全国保証	24,600	4,435.00	109,101,000
ジェイリース	1,600	721.00	1,153,600
イントラスト	1,800	596.00	1,072,800
アルヒ	9,900	2,497.00	24,720,300
クレディセゾン	66,300	1,733.00	114,897,900
アクリーティブ	4,600	270.00	1,242,000
芙蓉総合リース	10,000	6,670.00	66,700,000
興銀リース	16,400	2,916.00	47,822,400
東京センチュリー	17,600	6,110.00	107,536,000
日本証券金融	35,700	611.00	21,812,700
アイフル	146,600	337.00	49,404,200
リコーリース	6,900	3,660.00	25,254,000
イオンフィナンシャルサービス	62,000	2,216.00	137,392,000
アコム	175,600	451.00	79,195,600
ジャックス	10,600	2,325.00	24,645,000
オリエントコーポレーション	188,600	157.00	29,610,200
日立キャピタル	24,000	3,035.00	72,840,000
アプラスフィナンシャル	41,200	106.00	4,367,200
オリックス	583,000	1,741.50	1,015,294,500
三菱UFJリース	221,800	610.00	135,298,000
九州リースサービス	3,600	713.00	2,566,800
日本取引所グループ	250,800	1,943.00	487,304,400
イー・ギャランティ	9,200	1,114.00	10,248,800
アサックス	3,500	598.00	2,093,000
NECキャピタルソリューション	3,600	1,863.00	6,706,800
いちご	125,100	436.00	54,543,600
日本駐車場開発	105,400	169.00	17,812,600
ヒューリック	182,500	1,020.00	186,150,000
三栄建築設計	3,500	1,618.00	5,663,000
スター・マイカ	4,000	1,976.00	7,904,000
野村不動産ホールディングス	58,200	2,306.00	134,209,200
三重交通グループホールディングス	17,800	529.00	9,416,200
サムティ	8,300	2,148.00	17,828,400
ディア・ライフ	10,600	580.00	6,148,000
コーセーアールイー	1,900	842.00	1,599,800

エー・ディー・ワークス	115,000	38.00	4,370,000	
日本商業開発	5,000	1,807.00	9,035,000	
プレサンスコーポレーション	12,100	1,518.00	18,367,800	
ユニゾホールディングス	12,000	2,062.00	24,744,000	
THEグローバル社	4,200	822.00	3,452,400	
日本管理センター	5,800	1,218.00	7,064,400	
サンセイランディック	2,500	1,245.00	3,112,500	
エストラスト	1,200	816.00	979,200	
フージャースホールディングス	21,200	675.00	14,310,000	
オープンハウス	14,200	5,740.00	81,508,000	
東急不動産ホールディングス	211,600	732.00	154,891,200	
飯田グループホールディングス	72,900	1,967.00	143,394,300	
イーランド	1,400	806.00	1,128,400	
ムゲンエステート	6,100	689.00	4,202,900	
ビーロッド	1,400	1,303.00	1,824,200	
ファーストブラザーズ	2,400	1,333.00	3,199,200	
ハウズドゥ	3,200	2,337.00	7,478,400	
シーアールイー	2,800	898.00	2,514,400	
ケイアイスター不動産	3,200	2,354.00	7,532,800	
グッドコムアセット	1,500	1,644.00	2,466,000	
ジェイ・エス・ビー	300	4,995.00	1,498,500	
パーク24	51,000	3,200.00	163,200,000	
パラカ	2,300	2,285.00	5,255,500	
三井不動産	436,400	2,453.00	1,070,489,200	
三菱地所	650,500	1,802.50	1,172,526,250	
平和不動産	15,500	1,901.00	29,465,500	
東京建物	95,500	1,311.00	125,200,500	
ダイビル	22,600	1,147.00	25,922,200	
京阪神ビルディング	14,600	813.00	11,869,800	
住友不動産	210,000	3,788.00	795,480,000	
大京	14,000	2,212.00	30,968,000	
テーオーシー	30,100	776.00	23,357,600	
東京楽天地	1,400	4,870.00	6,818,000	
レオパレス21	104,300	575.00	59,972,500	
スターツコーポレーション	11,900	2,377.00	28,286,300	
フジ住宅	11,200	870.00	9,744,000	
空港施設	8,900	620.00	5,518,000	
明和地所	4,900	654.00	3,204,600	
ゴールドクレスト	6,900	1,815.00	12,523,500	
日本エスリード	3,500	1,515.00	5,302,500	
日神不動産	11,700	563.00	6,587,100	
日本エスコン	15,900	774.00	12,306,600	

タカラレーベン	40,800	359.00	14,647,200
サンヨーハウジング名古屋	4,900	1,106.00	5,419,400
イオンモール	56,400	1,799.00	101,463,600
ファースト住建	3,300	1,359.00	4,484,700
カチタス	11,900	2,930.00	34,867,000
トーセイ	12,100	1,044.00	12,632,400
穴吹興産	1,000	3,060.00	3,060,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	54,400	1,204.00	65,497,600
サンフロンティア不動産	10,600	1,242.00	13,165,200
エフ・ジェー・ネクスト	6,600	892.00	5,887,200
インテリックス	2,400	818.00	1,963,200
ランドビジネス	4,200	343.00	1,440,600
グランディハウス	7,700	454.00	3,495,800
日本空港ビルデング	25,600	4,945.00	126,592,000
日本工営	5,700	2,795.00	15,931,500
L I F U L L	29,500	644.00	18,998,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	2,444.00	16,863,600
日本M&Aセンター	58,600	2,970.00	174,042,000
メンバーズ	2,900	1,320.00	3,828,000
中広	1,000	820.00	820,000
タケエイ	8,900	895.00	7,965,500
E・Jホールディングス	1,100	1,415.00	1,556,500
トラスト・テック	4,100	4,840.00	19,844,000
コシダカホールディングス	22,600	1,183.00	26,735,800
アルトナー	1,400	1,138.00	1,593,200
パソナグループ	8,100	1,736.00	14,061,600
C D S	2,300	1,420.00	3,266,000
リンクアンドモチベーション	15,600	1,307.00	20,389,200
G C A	9,400	907.00	8,525,800
エス・エム・エス	33,500	2,106.00	70,551,000
パーソルホールディングス	78,200	2,455.00	191,981,000
リニカル	5,500	1,702.00	9,361,000
クックパッド	26,700	456.00	12,175,200
エスクリ	3,000	768.00	2,304,000
アイ・ケイ・ケイ	4,900	771.00	3,777,900
学情	3,800	1,443.00	5,483,400
スタジオアリス	4,300	2,373.00	10,203,900
シミックホールディングス	4,700	2,425.00	11,397,500
N J S	2,000	1,721.00	3,442,000
総合警備保障	33,700	4,830.00	162,771,000
カカクコム	63,800	2,062.00	131,555,600
アイロムグループ	2,900	1,812.00	5,254,800

セントケア・ホールディング	3,600	657.00	2,365,200
サイネックス	1,300	798.00	1,037,400
ルネサンス	4,200	2,215.00	9,303,000
ディップ	12,000	2,632.00	31,584,000
オプトホールディング	5,700	3,000.00	17,100,000
ツクイ	19,900	1,049.00	20,875,100
キャリアデザインセンター	2,200	1,584.00	3,484,800
エムスリー	89,100	5,120.00	456,192,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	638.00	4,210,800
プラス	700	723.00	506,100
アウトソーシング	36,500	1,855.00	67,707,500
ウェルネット	8,500	1,027.00	8,729,500
ワールドホールディングス	2,700	3,245.00	8,761,500
ディー・エヌ・エー	45,700	1,924.00	87,926,800
博報堂D Yホールディングス	117,700	1,833.00	215,744,100
ぐるなび	13,400	912.00	12,220,800
エスアールジータカミヤ	10,200	640.00	6,528,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,600	1,098.00	7,246,800
ファンコミュニケーションズ	23,600	664.00	15,670,400
ライク	3,400	1,541.00	5,239,400
ビジネス・ブレークスルー	4,200	406.00	1,705,200
WDBホールディングス	3,900	3,975.00	15,502,500
ティア	4,000	969.00	3,876,000
C D G	800	1,732.00	1,385,600
バリューコマース	7,300	2,349.00	17,147,700
インフォマート	46,500	1,369.00	63,658,500
J Pホールディングス	26,800	312.00	8,361,600
エコナックホールディングス	16,500	122.00	2,013,000
E P Sホールディングス	12,800	2,268.00	29,030,400
レッグス	2,200	1,240.00	2,728,000
プレステージ・インターナショナル	17,700	1,253.00	22,178,100
アミューズ	5,700	3,335.00	19,009,500
ドリームインキュベータ	2,900	2,051.00	5,947,900
クイック	5,300	1,997.00	10,584,100
T A C	5,100	269.00	1,371,900
ケネディクス	79,300	700.00	55,510,000
電通	103,200	5,100.00	526,320,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,000	2,030.00	8,120,000
ぴあ	2,800	5,140.00	14,392,000
イオンファンタジー	2,700	3,785.00	10,219,500
シーティーエス	8,500	864.00	7,344,000
ネクシィーズグループ	2,600	1,631.00	4,240,600

みらかホールディングス	25,300	3,080.00	77,924,000
アルプス技研	7,500	2,584.00	19,380,000
ダイオーズ	1,700	1,335.00	2,269,500
日本空調サービス	8,900	786.00	6,995,400
オリエンタルランド	100,100	11,790.00	1,180,179,000
ダスキン	22,800	2,681.00	61,126,800
明光ネットワークジャパン	10,800	1,034.00	11,167,200
ファルコホールディングス	4,400	1,804.00	7,937,600
ラウンドワン	26,300	1,427.00	37,530,100
リゾートトラスト	35,900	1,781.00	63,937,900
ビー・エム・エル	10,900	3,090.00	33,681,000
ワタベウェディング	1,500	562.00	843,000
りらいあコミュニケーションズ	13,500	1,412.00	19,062,000
リソー教育	14,300	870.00	12,441,000
早稲田アカデミー	1,300	1,903.00	2,473,900
ユー・エス・エス	103,500	2,051.00	212,278,500
東京個別指導学院	3,100	1,686.00	5,226,600
サイバーエージェント	52,200	5,900.00	307,980,000
楽天	394,700	831.20	328,074,640
クリーク・アンド・リバー社	4,400	1,282.00	5,640,800
テー・オー・ダブリュー	8,100	749.00	6,066,900
セントラルスポーツ	3,200	4,095.00	13,104,000
フルキャストホールディングス	8,500	2,527.00	21,479,500
エン・ジャパン	7,200	5,140.00	37,008,000
リソルホールディングス	900	4,335.00	3,901,500
テクノプロ・ホールディングス	16,000	6,910.00	110,560,000
アトラ	1,800	965.00	1,737,000
インターワークス	1,900	839.00	1,594,100
Keeper 技研	2,700	1,113.00	3,005,100
ファーストロジック	1,700	634.00	1,077,800
三機サービス	1,300	2,304.00	2,995,200
Gunosy	5,200	1,780.00	9,256,000
デザインワン・ジャパン	1,700	846.00	1,438,200
イー・ガーディアン	4,000	2,780.00	11,120,000
リブセンス	5,400	356.00	1,922,400
ジャパンマテリアル	23,200	1,584.00	36,748,800
ベクトル	10,300	2,436.00	25,090,800
ウチヤマホールディングス	4,200	494.00	2,074,800
ライクキッズネクスト	1,400	1,132.00	1,584,800
キャリアリンク	2,800	511.00	1,430,800
I B J	6,700	636.00	4,261,200
アサンテ	3,100	2,313.00	7,170,300

N・フィールド	5,500	1,753.00	9,641,500
バリューHR	1,900	2,145.00	4,075,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	6,600.00	14,520,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,667.00	5,834,500
E R Iホールディングス	2,400	1,037.00	2,488,800
アビスト	1,300	4,130.00	5,369,000
シグマクシス	4,600	1,332.00	6,127,200
ウィルグループ	3,800	1,013.00	3,849,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,900	421.00	5,009,900
日本ビューホテル	2,800	1,357.00	3,799,600
リクルートホールディングス	653,200	3,410.00	2,227,412,000
エラン	2,900	2,732.00	7,922,800
土木管理総合試験所	3,700	624.00	2,308,800
日本郵政	480,500	1,310.00	629,455,000
ベルシステム24ホールディングス	14,200	1,810.00	25,702,000
鎌倉新書	6,400	1,141.00	7,302,400
一蔵	1,100	823.00	905,300
L I T A L I C O	2,000	2,405.00	4,810,000
グローバルグループ	1,100	2,073.00	2,280,300
エボラブルアジア	2,400	2,823.00	6,775,200
アトラエ	1,700	2,415.00	4,105,500
ストライク	2,200	3,835.00	8,437,000
ソラスト	15,500	1,293.00	20,041,500
セラク	2,100	687.00	1,442,700
インソース	2,800	2,453.00	6,868,400
アイモバイル	1,900	957.00	1,818,300
キャリアインデックス	2,400	1,268.00	3,043,200
M S - J a p a n	900	7,980.00	7,182,000
船場	1,600	1,004.00	1,606,400
フルテック	1,000	1,231.00	1,231,000
グリーンズ	1,900	1,338.00	2,542,200
ツナグ・ソリューションズ	800	1,156.00	924,800
日総工産	2,800	2,695.00	7,546,000
キュービーネットホールディングス	4,400	2,230.00	9,812,000
スプリックス	2,400	2,806.00	6,734,400
リログループ	46,300	3,045.00	140,983,500
東祥	5,300	4,345.00	23,028,500
エイチ・アイ・エス	15,100	3,570.00	53,907,000
ラックランド	1,700	2,716.00	4,617,200
共立メンテナンス	15,100	4,940.00	74,594,000
イチネンホールディングス	9,600	1,343.00	12,892,800
建設技術研究所	5,900	1,483.00	8,749,700

スペース	5,600	1,314.00	7,358,400	
長大	3,400	918.00	3,121,200	
燦ホールディングス	2,000	2,598.00	5,196,000	
スバル興業	600	5,860.00	3,516,000	
東京テアトル	3,600	1,402.00	5,047,200	
タナベ経営	1,700	1,716.00	2,917,200	
ナガワ	1,700	5,430.00	9,231,000	
よみうりランド	1,900	4,460.00	8,474,000	
東京都競馬	6,100	4,245.00	25,894,500	
カナモト	12,400	3,460.00	42,904,000	
東京ドーム	34,300	941.00	32,276,300	
西尾レントオール	8,600	3,555.00	30,573,000	
トランス・コスモス	9,400	2,684.00	25,229,600	
乃村工藝社	19,800	2,191.00	43,381,800	
藤田観光	3,400	3,390.00	11,526,000	
KNT-CTホールディングス	5,200	1,234.00	6,416,800	
日本管財	9,100	2,099.00	19,100,900	
トーカイ	8,200	2,502.00	20,516,400	
白洋舎	1,000	2,982.00	2,982,000	
セコム	89,900	9,013.00	810,268,700	
セントラル警備保障	4,100	3,975.00	16,297,500	
丹青社	17,400	1,243.00	21,628,200	
メイテック	9,900	5,300.00	52,470,000	
応用地質	9,200	1,428.00	13,137,600	
船井総研ホールディングス	17,600	2,359.00	41,518,400	
進学会ホールディングス	3,900	590.00	2,301,000	
オオバ	6,800	610.00	4,148,000	
いであ	1,700	1,108.00	1,883,600	
学究社	3,100	1,792.00	5,555,200	
ベネッセホールディングス	31,000	3,350.00	103,850,000	
イオンディライト	10,500	3,925.00	41,212,500	
ナック	5,800	1,213.00	7,035,400	
ニチイ学館	16,100	918.00	14,779,800	
ダイセキ	14,200	2,936.00	41,691,200	
ステップ	3,200	1,514.00	4,844,800	
合 計	106,494,610		215,570,566,010	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,640,127,674
コール・ローン	2,950,383,964
国債証券	251,469,302,829
派生商品評価勘定	12,535,246
未収入金	2,148,065,685
未収利息	1,692,188,825
前払金	1,035,848
前払費用	81,669,016
差入委託証拠金	130,581,628
流動資産合計	261,125,890,715
資産合計	261,125,890,715
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,882,354
未払金	4,578,622,723
未払解約金	120,032,132
未払利息	6,136
その他未払費用	409
流動負債合計	4,709,543,754
負債合計	4,709,543,754
純資産の部	
元本等	
元本	94,658,753,152
剰余金	
剰余金又は欠損金()	161,757,593,809
元本等合計	256,416,346,961
純資産合計	256,416,346,961
負債純資産合計	261,125,890,715

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2018年 9月 5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(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>(1)先物取引 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、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)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>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,658,753,152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 2.7088円 (1万口当たり純資産額) (27,088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 9月 5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 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月19日
期首元本額	92,591,686,808円
期中追加設定元本額	16,629,382,509円
期中一部解約元本額	14,562,316,165円
期末元本額	94,658,753,152円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,017,854,403円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	837,630,526円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	544,931,793円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,955,232,017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	6,125,082,603円
世界経済インデックスファンド	6,520,324,590円
D C マイセレクション 2 5	1,569,913,786円
D C マイセレクション 5 0	1,225,303,939円
D C マイセレクション 7 5	822,599,841円

区分	2018年 9月 5日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,744,816,725円
D C マイセクション S 2 5	628,723,966円
D C マイセクション S 5 0	484,378,852円
D C マイセクション S 7 5	235,958,273円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	51,044,333円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	60,185,727円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	28,237,175円
D C 世界経済インデックスファンド	5,278,571,679円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	586,130,520円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,344,965円
マイセクション 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）	61,670,846円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	168,655,282円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	258,574,044円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	192,782,156円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	600,967,635円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,542,062,976円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	701,393,362円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,488,942,813円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	962,589,425円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	111,580,416円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	716,334,681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）	461,839,144円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	270,799,431円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	346,892,433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）	968,492,697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	604,069,687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）	4,592,189,695円
分散投資コア戦略ファンド A	1,035,646,970円
分散投資コア戦略ファンド S	2,962,020,778円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	223,418,750円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,314,376,018円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,199,609,023円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,431,336円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	120,730,340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）	959,986,232円
S M T インデックスバランス・オープン	269,419,195円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	24,766,829,155円
S M T 世界経済インデックス・オープン	27,063,829円

区分	2018年 9月 5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)	84,823,505円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	108,495,751円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	517,913円
グローバル経済コア	1,097,681,867円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	2,941,574円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	36,685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)	991,611,586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)	7,582,007,906円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	359,279,545円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	706,521,406
合計	706,521,406

(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 9月 5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	2,413,426,589	-	2,412,390,741	1,035,848
	合計	2,413,426,589	-	2,412,390,741	1,035,848

(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場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2018年 9月 5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	3,421,915,830	-	3,424,605,498	2,689,668
	アメリカドル	1,608,288,443	-	1,612,536,800	4,248,357
	カナダドル	145,098,809	-	143,769,000	1,329,809
	ユーロ	1,399,441,172	-	1,399,019,400	421,772
	イギリスポンド	227,735,158	-	227,878,800	143,642
	マレーシアリンギット	41,352,248	-	41,401,498	49,250
	売建	7,514,098	-	7,515,026	928
	シンガポールドル	7,514,098	-	7,515,026	928
合計		3,429,429,928	-	3,432,120,524	2,688,740

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,256,091.92	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,903,950.36	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,379,913.88	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,778,827.85	
		T 1.125% 09/30/21	15,300,000.00	14,581,332.83	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,919,283.55	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,445,345.05	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,334,084.50	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,375,018.95	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,233,348.07	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,421,112.34	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,553,843.70	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,920,499.30	

T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,918,060.70	
T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,654,010.06	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,911,516.80	
T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,123,231.28	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	979,945.70	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,178,545.65	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,517,051.75	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,429,960.76	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,686,593.60	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,337,410.55	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,896,730.32	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,470,419.60	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,838,367.32	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,537,192.71	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,319,529.97	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,384,193.70	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,783,185.04	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,649,528.69	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,050,613.03	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,783,209.30	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	11,921,878.71	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,918,433.83	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,936,564.15	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,433,205.16	
T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,434,084.72	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,325,789.63	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,566,835.47	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,747,250.90	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,945,896.56	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,905,421.55	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,394,717.55	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,437,600.15	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,501,255.37	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,828,349.02	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,980,629.48	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,233,319.78	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,417,884.92	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,227,629.62	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,812,863.82	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,667,022.19	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,718,604.87	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,211,283.27	

T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,746,495.21
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,959,975.15
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,756,945.10
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,923,268.52
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,029,085.59
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,428,187.35
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,699,820.20
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,707,042.35
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,866,935.44
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,140,233.17
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,256,240.22
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,278,840.37
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,391,437.80
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,936,414.20
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,182,431.60
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,960,634.27
T 2.125% 02/29/24	15,750,000.00	15,215,102.28
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,143,098.56
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,477,165.27
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,380,998.55
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,052,534.68
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,620,366.38
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,997,433.74
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,434,514.84
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,964,567.68
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,691,032.64
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,935,710.44
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,412,792.38
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,528,156.87
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,016,095.95
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,459,231.58
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,961,006.18
T 2.25% 08/15/27	12,150,000.00	11,535,680.93
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,088,929.12
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,097,137.16
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,816,998.80
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,786,770.22
T 2.25% 11/15/27	10,650,000.00	10,096,670.29
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,946,529.62
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,120,199.19
T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,487,334.24
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,196,808.12
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,284,410.00

T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,903,498.25	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,658,468.98	
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,776,902.85	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,003,057.66	
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,853,246.69	
T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,282,395.29	
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,917,591.77	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,492,159.94	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,391,888.44	
T 2.625% 03/31/25	3,000,000.00	2,962,273.53	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,158,397.44	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,341,527.54	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,497,675.42	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,986,236.03	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,993,518.17	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,268,806.18	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,592,256.58	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,846,191.86	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	9,352,341.50	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,889,664.49	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,981,793.20	
T 2.75% 11/15/47	8,550,000.00	8,034,451.32	
T 2.875% 05/15/28	6,900,000.00	6,882,181.02	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	4,987,925.58	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,528,597.54	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,439,246.72	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,517,152.14	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	7,986,502.52	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,933,257.96	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,729,162.11	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,044,819.33	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,138,317.54	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,916,346.11	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,643,764.00	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,659,645.55	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,934,260.80	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,525,343.71	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,346,417.04	
T 2% 11/15/26	3,350,000.00	3,136,578.30	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,419,937.21	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,939,010.96	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,148,410.68	

T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,382,176.48	
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,058,837.85	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,357,198.13	
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,071,292.90	
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,295,369.35	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,925,830.71	
T 3.375% 11/15/19	8,750,000.00	8,835,411.11	
T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,232,735.98	
T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,730,452.77	
T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,100,483.88	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,341,378.71	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,500,263.35	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,197,126.02	
T 3.75% 11/15/43	7,050,000.00	7,903,433.93	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,579,038.72	
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,934,781.01	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,463,071.92	
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	7,660,015.36	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	5,986,703.49	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,073,073.90	
T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,376,612.73	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,206,111.33	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,308,156.19	
T 4.375% 05/15/41	4,150,000.00	5,060,384.96	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,276,911.18	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,229,235.10	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,226,045.17	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	307,929.49	
T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	4,889,128.33	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	3,774,690.22	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,421,318.31	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,512,826.77	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,567,620.15	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,007,036.44	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,468,405.00	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,060,150.23	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,826,916.74	
T 6.25% 05/15/30	400,000.00	531,452.79	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,914,365.45	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,972,761.03	
アメリカドル 小計	1,035,720,000.00	1,014,737,684.93 (113,163,546,623)	
カナダドル CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,934,320.50	

CAN 0.75% 03/01/21	5,000,000.00	4,840,575.00	
CAN 0.75% 09/01/20	2,470,000.00	2,407,570.75	
CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,567,530.25	
CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,474,225.00	
CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,054,982.00	
CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,330,436.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,184,390.50	
CAN 1.75% 03/01/23	1,050,000.00	1,032,585.75	
CAN 1.75% 09/01/19	2,600,000.00	2,595,905.00	
CAN 1% 06/01/27	2,570,000.00	2,322,149.20	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,436,077.50	
CAN 2.25% 06/01/25	2,050,000.00	2,056,888.00	
CAN 2.5% 06/01/24	2,610,000.00	2,655,870.75	
CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,608,191.00	
CAN 2.75% 12/01/48	1,750,000.00	1,938,921.25	
CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	715,284.70	
CAN 2% 06/01/28	1,000,000.00	980,265.00	
CAN 2% 12/01/51	400,000.00	376,600.00	
CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,196,061.95	
CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,845,216.00	
CAN 3.5% 12/01/45	2,500,000.00	3,122,987.50	
CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,609,750.00	
CAN 5.75% 06/01/29	1,900,000.00	2,532,082.50	
CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,297,072.00	
CAN 5% 06/01/37	1,710,000.00	2,417,931.45	
CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	524,667.60	
カナダドル 小計	58,200,000.00	61,058,537.15 (5,166,162,828)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	17,350,000.00	20,504,403.50
	MBONO 10% 12/05/24	46,000,000.00	50,620,930.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	21,750,000.00	19,084,646.25
	MBONO 5% 12/11/19	35,680,000.00	34,443,331.20
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,498,095.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,950,000.00	34,651,486.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,410,000.00	37,147,271.25
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	16,744,491.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	23,514,543.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,773,850.25
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,118,310.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,700,000.00	15,272,271.00
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,797,970.00
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	9,131,646.25

	MBONO 8% 12/07/23	6,400,000.00	6,408,704.00
	メキシコペソ 小計	366,040,000.00	364,711,948.70 (2,097,093,705)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,718,479.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,174,896.50
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,150,480.35
	BGB 0.8% 06/22/28	1,750,000.00	1,765,951.25
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	865,869.50
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	811,428.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,330,850.25
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,195,815.50
	BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,193,145.50
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,303,913.00
	BGB 2.15% 06/22/66	630,000.00	669,938.85
	BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,960,604.80
	BGB 2.25% 06/22/57	450,000.00	497,526.75
	BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,747,772.00
	BGB 3.75% 06/22/45	1,260,000.00	1,852,080.30
	BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,992,398.75
	BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,335,837.75
	BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,075,630.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	3,539,913.30
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,686,343.75
	BGB 4.25% 09/28/22	1,350,000.00	1,598,541.75
	BGB 4.5% 03/28/26	1,420,000.00	1,860,874.50
	BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,598,266.25
	BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,424,520.90
	BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,291,814.30
	BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,527,611.45
	BKO 0% 12/13/19	800,000.00	806,524.00
	BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,489,720.50
	BTPS 0.35% 06/15/20	4,350,000.00	4,289,817.75
	BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,640,077.00
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,357,720.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,193,432.50
	BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,528,679.75
	BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	1,984,560.00
BTPS 0.9% 08/01/22	500,000.00	477,407.50	
BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,228,006.00	
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,889,360.00	
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,359,961.50	
BTPS 1.25% 12/01/26	2,600,000.00	2,309,502.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,829,776.50	

BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	645,365.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,021,676.25	
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	2,958,336.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,467,808.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,590,515.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	1,922,550.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	2,965,232.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,524,537.50	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,950,000.00	2,779,991.50	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	1,793,641.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,170,923.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,349,664.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,600,000.00	2,224,131.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	762,749.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	950,000.00	921,286.25	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,450,000.00	1,333,427.25	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,517,010.00	
BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,233,271.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,463,269.75	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,860,000.00	1,793,728.20	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,210,000.00	3,282,626.25	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,050,000.00	4,261,693.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,261,634.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,218,600.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,275,140.75	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,706,437.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,741,729.75	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,730,437.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	5,450,000.00	5,973,554.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	4,729,315.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,265,371.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,653,348.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,282,195.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,760,000.00	3,147,186.60	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,813,976.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,700,000.00	3,987,712.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,418,461.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,250,000.00	3,884,773.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,334,448.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,824,983.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,883,371.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,412,125.00	

BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,297,450.00
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,009,313.50
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	4,175,412.50
BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,452,305.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,006,500.75
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	4,963,471.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,836,149.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,051,764.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,477,256.25
DBR 0.25% 08/15/28	1,800,000.00	1,781,928.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,316,608.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,512,761.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,332,636.85
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,120,943.00
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,080,249.50
DBR 1.25% 08/15/48	1,300,000.00	1,372,494.50
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,759,316.75
DBR 1.5% 05/15/23	2,050,000.00	2,224,209.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,507,366.80
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,013,514.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,350,000.00	1,493,464.50
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,333,540.00
DBR 1% 08/15/24	3,000,000.00	3,201,135.00
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,264,903.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,643,762.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,166,530.00
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,559,293.75
DBR 2.5% 07/04/44	3,200,000.00	4,330,208.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,390,000.00	4,639,859.10
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,573,850.50
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,336,596.50
DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,579,801.00
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,767,149.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,050,000.00	3,088,038.00
DBR 3% 07/04/20	5,340,000.00	5,695,911.00
DBR 4.0% 01/04/37	3,050,000.00	4,753,745.25
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,071,499.50
DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,345,234.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,205,188.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,749,403.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,300,000.00	3,689,522.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,993,480.00
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,691,480.00

DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,062,937.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,641,094.50
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,083,050.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,787,871.50
FRTR 0.5% 05/25/25	4,750,000.00	4,846,496.25
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,358,562.80
FRTR 0.5% 11/25/19	2,750,000.00	2,786,520.00
FRTR 0.75% 05/25/28	3,600,000.00	3,642,624.00
FRTR 0.75% 11/25/28	2,700,000.00	2,715,916.50
FRTR 0% 03/25/23	1,950,000.00	1,961,563.50
FRTR 0% 03/25/24	2,450,000.00	2,443,642.25
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,146,924.50
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,605,444.50
FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,379,787.75
FRTR 1.25% 05/25/36	4,400,000.00	4,427,456.00
FRTR 1.5% 05/25/31	5,850,000.00	6,267,514.50
FRTR 1.75% 05/25/23	4,800,000.00	5,225,880.00
FRTR 1.75% 05/25/66	1,200,000.00	1,185,504.00
FRTR 1.75% 06/25/39	2,150,000.00	2,317,162.50
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,334,861.25
FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,809,340.75
FRTR 1% 11/25/25	7,050,000.00	7,425,800.25
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,492,847.50
FRTR 2.25% 10/25/22	7,100,000.00	7,827,004.50
FRTR 2.5% 05/25/30	4,400,000.00	5,232,282.00
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,801,824.75
FRTR 2.75% 10/25/27	5,700,000.00	6,841,254.00
FRTR 2% 05/25/48	2,800,000.00	3,069,318.00
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,649,481.75
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,632,578.25
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,730,400.00
FRTR 3.5% 04/25/26	1,880,000.00	2,338,597.80
FRTR 3.75% 04/25/21	5,910,000.00	6,565,537.20
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,280,736.00
FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,137,540.00
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,645,281.25
FRTR 4.5% 04/25/41	4,020,000.00	6,496,480.80
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,683,915.00
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,348,582.75
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,761,134.75
FRTR 4% 10/25/38	3,800,000.00	5,675,433.00
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,060,906.00

FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,719,531.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,680,976.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,402,915.00
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,235,953.60
IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,003,275.85
IRISH 0.9% 05/15/28	600,000.00	602,367.00
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	515,795.80
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	773,793.75
IRISH 1% 05/15/26	1,650,000.00	1,703,913.75
IRISH 2.4% 05/15/30	1,450,000.00	1,662,591.75
IRISH 2% 02/18/45	1,060,000.00	1,127,887.70
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,354,395.25
IRISH 3.9% 03/20/23	1,120,000.00	1,319,869.60
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,248,220.00
IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,051,518.00
IRISH 5.9% 10/18/19	310,000.00	332,160.35
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	881,572.85
NETHER 0.25% 01/15/20	1,320,000.00	1,336,394.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,160,000.00	2,181,351.60
NETHER 0.5% 07/15/26	3,800,000.00	3,882,707.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,050,000.00	2,119,966.50
NETHER 0.75% 07/15/28	1,100,000.00	1,130,481.00
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,823,274.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	903,483.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,134,655.25
NETHER 2.25% 07/15/22	1,600,000.00	1,761,568.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,300,724.75
NETHER 2.75% 01/15/47	1,730,000.00	2,463,597.85
NETHER 2% 07/15/24	2,450,000.00	2,741,525.50
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,270,856.75
NETHER 3.5% 07/15/20	2,800,000.00	3,014,942.00
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,590,951.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,980,000.00	3,160,109.70
NETHER 4% 01/15/37	1,940,000.00	2,997,814.10
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,681,500.00
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	268,398.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,373,124.00
OBL 0.25% 10/16/20	4,600,000.00	4,684,157.00
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,813,502.70
OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,839,273.00
OBL 0% 10/07/22	3,600,000.00	3,653,514.00
OBL 0% 10/08/21	3,800,000.00	3,859,223.00
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,059,376.50

RAGB 0.5% 04/20/27	1,100,000.00	1,102,414.50	
RAGB 0.75% 02/20/28	600,000.00	610,371.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,420,000.00	3,519,385.20	
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	502,067.50	
RAGB 0% 09/20/22	670,000.00	676,304.70	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,850,000.00	1,974,902.75	
RAGB 1.5% 02/20/47	640,000.00	659,923.20	
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	373,162.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,750,000.00	1,919,251.25	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,531,124.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	570,802.50	
RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,131,924.50	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,030,000.00	1,458,310.05	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,731,262.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,428,468.70	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,258,433.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	817,473.35	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,894,410.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,733,102.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	672,202.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,280,601.50	
RFGB 0.375% 09/15/20	790,000.00	804,950.75	
RFGB 0.5% 04/15/26	550,000.00	558,431.50	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	350,945.00	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	539,006.40	
RFGB 0.875% 09/15/25	650,000.00	680,426.50	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	545,853.60	
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	763,245.20	
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	586,356.15	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	700,654.50	
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	829,005.10	
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	784,708.85	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	872,132.40	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	667,905.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	744,688.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	883,536.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,423,997.75	
SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,104,653.00	
SPGB 0.35% 07/30/23	480,000.00	478,730.40	
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,074,835.75	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,374,510.50	
SPGB 0.75% 07/30/21	2,400,000.00	2,458,080.00	

	SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,081,750.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	3,100,000.00	3,143,291.50	
	SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,419,118.00	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,220,000.00	2,227,636.80	
	SPGB 1.4% 07/30/28	1,530,000.00	1,526,442.75	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,636,192.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,118,060.75	
	SPGB 1.6% 04/30/25	2,900,000.00	3,053,047.50	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,149,656.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,250,000.00	2,324,565.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,853,897.75	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,200,000.00	2,318,360.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	950,000.00	976,229.50	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,598,832.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,100,000.00	2,268,094.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,399,794.55	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,648,793.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,680,000.00	3,560,406.80	
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,113,115.50	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,098,950.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,262,558.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,850,000.00	4,072,778.25	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,740,047.25	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,328,690.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,285,967.50	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,214,485.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,808,655.00	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,000,000.00	3,058,910.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,165,340.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,800,000.00	4,364,737.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,420,000.00	5,104,863.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,250,000.00	5,094,687.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,248,997.50	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,511,658.75	
	ユーロ 小計	691,650,000.00	780,789,981.20 (100,862,449,771)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,445,767.50	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,800,000.00	2,763,362.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,200,000.00	4,172,469.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	5,730,000.00	5,827,610.55	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,651,948.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,670,000.00	2,499,120.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,350,000.00	1,375,285.50	

UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	797,868.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,980,000.00	2,014,491.60	
UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,510,704.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,940,000.00	1,937,875.70	
UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,915,357.50	
UKT 2.5% 07/22/65	2,300,000.00	2,938,882.50	
UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,411,431.00	
UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,462,699.80	
UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,379,296.25	
UKT 3.25% 01/22/44	3,350,000.00	4,328,283.75	
UKT 3.5% 01/22/45	3,300,000.00	4,466,484.00	
UKT 3.5% 07/22/68	2,400,000.00	3,903,600.00	
UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,106,190.75	
UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	566,700.75	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	795,052.50	
UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,446,121.25	
UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,880,408.00	
UKT 4.25% 06/07/32	2,400,000.00	3,191,844.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,800,014.75	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	842,983.95	
UKT 4.25% 12/07/40	2,250,000.00	3,272,276.25	
UKT 4.25% 12/07/46	2,250,000.00	3,470,895.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,824,070.40	
UKT 4.25% 12/07/55	2,370,000.00	4,029,189.60	
UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,401,611.20	
UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,910,718.25	
UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,809,927.50	
UKT 4.75% 12/07/30	1,800,000.00	2,454,975.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,876,638.00	
UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,305,913.00	
UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,608,477.75	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,361,823.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,803,443.75	
UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,855,822.75	
イギリスポンド 小計	95,370,000.00	116,417,634.55 (16,690,796,265)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,650,000.00	7,816,234.50
	SGB 1.5% 11/13/23	11,500,000.00	12,415,112.50
	SGB 1% 11/12/26	9,300,000.00	9,799,968.00
	SGB 2.5% 05/12/25	8,150,000.00	9,421,114.75
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	8,277,896.25
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	16,054,925.25

	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,490,460.00
スウェーデンクローナ 小計		68,520,000.00	77,275,711.25 (948,945,734)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,610,000.00	4,567,311.40
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,670,553.00
	NGB 1.75% 03/13/25	5,350,000.00	5,416,286.50
	NGB 2% 04/26/28	2,930,000.00	2,992,584.80
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,892,156.75
	NGB 3.75% 05/25/21	11,320,000.00	12,103,287.40
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	5,997,191.25
ノルウェークローネ 小計		43,060,000.00	44,639,371.10 (592,810,848)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	3,500,000.00	3,562,037.50
	DGB 0.5% 11/15/27	6,800,000.00	6,919,952.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,300,000.00	7,933,056.00
	DGB 1.75% 11/15/25	13,090,000.00	14,685,278.30
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,884,115.50
	DGB 4.5% 11/15/39	17,850,000.00	30,823,737.00
	DGB 4% 11/15/19	12,590,000.00	13,292,081.35
デンマーククローネ 小計		71,830,000.00	89,100,257.65 (1,544,107,465)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,197,514.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,082,889.50
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,005,150.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,300,000.00	5,321,385.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,459,512.75
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,888,009.50
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,530,000.00	2,437,629.70
	POLGB 2% 04/25/21	6,760,000.00	6,793,563.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,751,778.40
	POLGB 4% 10/25/23	3,750,000.00	4,009,818.75
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,389,368.50
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,720,003.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	738,183.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,078,566.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,285,182.50
ポーランドズロチ 小計		51,170,000.00	52,158,554.50 (1,562,670,292)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,836,690.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,295,347.90
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	402,396.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	800,000.00	792,692.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,601,716.30

	ACGB 2.75% 05/21/41	440,000.00	423,007.20	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,250,000.00	1,238,206.25	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,100,000.00	2,118,217.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,614,361.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,105,662.50	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,650,000.00	1,681,284.00	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,397,722.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,850,000.00	4,058,920.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,470,000.00	2,630,364.75	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,200,000.00	1,259,514.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,690,492.50	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,586,248.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	5,020,733.50	
	ACGB 4.5% 04/15/20	4,090,000.00	4,252,966.05	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,551,752.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,522,248.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,589,740.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,338,225.75	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,489,561.55	
	オーストラリアドル 小計	62,520,000.00	66,498,070.50 (5,324,500,504)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	244,632.50	
	SIGB 1.625% 10/01/19	410,000.00	409,503.90	
	SIGB 1.75% 04/01/22	360,000.00	357,010.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	838,363.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	876,916.50	
	SIGB 2.25% 08/01/36	190,000.00	177,535.05	
	SIGB 2.375% 06/01/25	720,000.00	724,744.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	170,000.00	173,444.20	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	695,240.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	616,159.10	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	833,396.85	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	290,969.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	485,956.50	
	SIGB 2% 07/01/20	760,000.00	761,812.60	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,147,366.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,098,536.90	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	846,791.40	
	SIGB 3.5% 03/01/27	950,000.00	1,034,018.00	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	835,628.00	
	シンガポールドドル 小計	12,160,000.00	12,448,025.00 (1,008,787,946)	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,471,837.50	

マレーシア リンギット	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,667,357.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,002,850.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,277,240.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	960,000.00	962,462.40	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,154,462.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,263,912.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,102,634.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	400,000.00	399,776.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,065,756.75	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	756,195.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,513,410.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,105,529.85	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,680,857.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,077,767.25	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,908,037.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,389,948.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,676,177.25	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,950,000.00	2,981,565.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,230,000.00	2,174,673.70	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,328,985.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,226,048.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,829,214.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,657,796.25	
	MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	390,956.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,650,000.00	1,662,597.75	
MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,875,335.75		
MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	644,289.00		
マレーシアリンギット 小計		45,520,000.00	45,247,670.20	(1,217,614,805)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	27,500,000.00	29,537,750.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,715,322.40	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,636,926.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,070,999.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	5,350,000.00	5,309,393.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,390,958.00	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,423,522.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,552,910.80	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	14,516,087.75	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,848,325.10	
	SAGB 8.75% 02/28/48	16,450,000.00	14,431,585.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,672,714.75	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	13,994,430.50	

	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,315,311.75	
	南アフリカランド 小計	197,170,000.00	177,416,237.05 (1,289,816,043)	
	合計		251,469,302,829 (251,469,302,829)	

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 180銘柄	100.0%	45.0%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 286銘柄	100.0%	40.1%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 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git	国債証券 28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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,923,530,469
コール・ローン	92,222,008
株式	333,647,781,870
投資信託受益証券	257,716,333
投資証券	7,807,409,040
派生商品評価勘定	392,425,436
未収入金	306,507,177
未収配当金	717,333,885
差入委託証拠金	2,572,755,170
流動資産合計	355,717,681,388
資産合計	355,717,681,388
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,484,467
前受金	335,240,869
未払金	153,890,806
未払解約金	167,368,604
未払利息	191
その他未払費用	26
流動負債合計	713,984,963
負債合計	713,984,963
純資産の部	
元本等	
元本	136,773,118,514
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	218,230,577,911
元本等合計	355,003,696,425
純資産合計	355,003,696,425
負債純資産合計	355,717,681,388

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,773,118,514口

	2018年 9月 5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)	2,5956円 (25,956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 9月 5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 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月19日
期首元本額	133,932,387,001円
期中追加設定元本額	15,156,589,943円
期中一部解約元本額	12,315,858,430円
期末元本額	136,773,118,514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）	2,323,774,243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	26,176,237,167円
世界経済インデックスファンド	7,121,100,186円
外国株式インデックス・オープン	843,937,125円
D C マイセレクション 2 5	1,006,907,837円

区分	2018年 9月 5日現在
D Cマイセレクション5 0	4,706,507,870円
D Cマイセレクション7 5	5,103,109,469円
D C外国株式インデックス・オープン	7,734,327,574円
D CマイセレクションS 2 5	392,689,367円
D CマイセレクションS 5 0	1,880,011,472円
D CマイセレクションS 7 5	1,456,295,004円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	107,551,710円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	171,229,135円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	110,092,998円
D C世界経済インデックスファンド	5,743,862,898円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,651,352,637円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	14,025,838円
マイセレクション7 5 V A 1（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V A 1（適格機関投資家専用）	62,200,602円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	81,396,963円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	279,104,937円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	41,576,823円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	388,849,550円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	837,568,283円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	424,264,095円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,761,915,526円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	1,993,801,772円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	99,034,324円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	407,101,278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）	115,608,023円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	133,031,448円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,059,744,319円
F O F s用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,337,833,453円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,447,048,184円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,858,590,050円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,456,664,201円
分散投資コア戦略ファンドA	2,041,043,996円
分散投資コア戦略ファンドS	4,238,776,435円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	704,227,388円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	852,337,046円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,708,709,332円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	855,920,720円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,052,603円
S M T インデックスバランス・オープン	295,398,474円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,991,567,662円
外国株式S M T Bセレクション（SMA専用）	29,797,799,734円
S M T 世界経済インデックス・オープン	29,792,400円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	262,903,018円

区分	2018年 9月 5日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	39,599,031円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	570,000円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	26,776,228円
グローバル経済コア	1,266,601,730円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	3,368,117円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	180,989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）	1,545,508,481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）	1,320,794,254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）	394,692,531円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	12,103,961,975
投資信託受益証券	16,916,204
投資証券	460,985,631
合計	12,581,863,810

(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 9月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		(円)
市場取引	株価指数先物取引	13,156,455,230	-	13,491,696,099	335,240,869
	買建				
合計		13,156,455,230	-	13,491,696,099	335,240,869

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2018年 9月 5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	254,103,180	-	254,114,400	11,220
	アメリカドル	62,440,000	-	62,440,000	-
	ユーロ	72,336,880	-	72,340,800	3,920
	イギリスポンド	25,802,100	-	25,804,800	2,700
	スイスフラン	34,346,700	-	34,347,000	300
	スウェーデンクローナ	19,149,000	-	19,156,800	7,800
	オーストラリアドル	40,028,500	-	40,025,000	3,500
	売建	90,675,880	-	90,987,000	311,120
	アメリカドル	53,308,800	-	53,524,800	216,000
	ユーロ	37,367,080	-	37,462,200	95,120
合計		344,779,060	-	345,101,400	299,900

(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	63.96	2,838,544.80	
	ANDEAVOR	11,677	155.92	1,820,677.84	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	17.89	333,398.04	
	APACHE CORP	29,810	43.18	1,287,195.80	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	32.38	1,140,099.80	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	23.01	825,575.79	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	67.16	1,053,807.56	
	CHEVRON CORP	154,681	118.87	18,386,930.47	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	84.13	639,303.87	
	CONCHO RESOURCES INC	16,193	135.42	2,192,856.06	
	CONOCOPHILLIPS	96,082	73.11	7,024,555.02	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	64.73	494,990.31	

DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	42.35	1,838,837.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	120.32	991,316.48
EOG RESOURCES INC	46,520	117.68	5,474,473.60
EQT CORPORATION	22,120	49.30	1,090,516.00
EXXON MOBIL	342,921	80.29	27,533,127.09
HALLIBURTON CO	71,448	39.48	2,820,767.04
HELMERICH & PAYNE	8,315	65.85	547,542.75
HESS CORP	22,081	65.68	1,450,280.08
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	76.19	1,075,040.90
KINDER MORGAN INC	157,150	17.62	2,768,983.00
MARATHON OIL CORP	65,596	21.06	1,381,451.76
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	84.28	3,250,342.48
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	46.43	1,407,339.73
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	27.09	435,417.57
NOBLE ENERGY INC	38,291	29.14	1,115,799.74
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	79.27	4,937,490.49
ONEOK INC	33,743	65.70	2,216,915.10
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	27.15	555,896.25
PHILLIPS 66	36,131	118.96	4,298,143.76
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	171.10	2,301,295.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	25.63	253,480.70
SCHLUMBERGER	112,385	61.92	6,958,879.20
TARGA RESOURCES CORP	16,467	54.39	895,640.13
TECHNIPFMC PLC	36,005	30.22	1,088,071.10
VALERO ENERGY CORP	35,381	120.24	4,254,211.44
WILLIAMS COS	98,038	29.20	2,862,709.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	164.34	2,945,301.48
ALBEMARLE CORP	8,647	96.57	835,040.79
AVERY DENNISON CORP	7,457	103.98	775,378.86
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	29.91	526,595.46
BALL CORP	27,142	41.42	1,124,221.64
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	114.59	1,266,563.27
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	51.85	918,833.85
CHEMOURS CO/THE	15,493	43.84	679,213.12
CROWN HOLDINGS INC	10,321	41.91	432,553.11
DOWDUPONT INC	187,231	69.72	13,053,745.32
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	96.62	1,145,719.96
ECOLAB INC	20,812	150.64	3,135,119.68
FMC CORP	10,402	83.02	863,574.04
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	13.48	1,501,618.08
INT'L PAPER CO	30,605	50.95	1,559,324.75
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	129.59	786,611.30

LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	111.01	2,966,187.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	198.71	991,364.19
MOSAIC CO/THE	27,677	30.83	853,281.91
NEWMONT MINING CORP	42,952	30.09	1,292,425.68
NUCOR CORP	24,915	62.21	1,549,962.15
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	109.25	787,146.25
PPG INDUSTRIES INC	19,958	109.88	2,192,985.04
PRAXAIR INC	23,446	156.18	3,661,796.28
SEALED AIR CORP	14,689	39.52	580,509.28
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	459.35	3,184,214.20
STEEL DYNAMICS INC	18,273	45.55	832,335.15
VULCAN MATERIALS CO	10,740	110.68	1,188,703.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	92.80	320,624.00
WESTROCK CO	21,244	54.14	1,150,150.16
3 M COMPANY	48,314	208.60	10,078,300.40
ACUITY BRANDS INC	3,505	150.72	528,273.60
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	56.79	643,430.70
AGCO CORP	4,669	59.10	275,937.90
ALLEGION PLC	7,168	87.15	624,691.20
AMETEK INC	18,866	76.72	1,447,399.52
ARCONIC INC	36,550	22.09	807,389.50
BOEING CO	45,238	346.25	15,663,657.50
CATERPILLAR	48,537	138.24	6,709,754.88
CUMMINS INC	12,421	139.99	1,738,815.79
DEERE&CO	25,056	141.70	3,550,435.20
DOVER CORP	12,008	86.08	1,033,648.64
EATON CORP	35,279	82.77	2,920,042.83
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	76.40	3,890,822.80
FASTENAL CO	23,228	59.04	1,371,381.12
FLOWSERVE CORP	10,826	52.13	564,359.38
FLUOR CORP	11,267	56.55	637,148.85
FORTIVE CORP	25,813	83.46	2,154,352.98
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	52.92	677,905.20
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	192.61	3,864,141.82
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	12.67	8,923,303.62
GRAINGER (WW) INC	3,976	355.87	1,414,939.12
HARRIS CORP	9,793	162.37	1,590,089.41
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	45.02	685,474.52
HONEYWELL INTL INC	61,022	159.64	9,741,552.08
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	243.34	857,043.48
IDEX CORP	5,756	152.79	879,459.24
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	138.94	3,407,920.32

INGERSOLL-RAND PLC	20,249	101.82	2,061,753.18
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	72.05	698,380.65
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	62.60	1,039,160.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	36.12	595,980.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	37.77	2,813,411.76
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	211.43	1,293,317.31
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	224.40	647,394.00
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	321.91	6,723,734.17
MASCO CORP	24,547	37.76	926,894.72
MIDDLEBY CORP	4,364	122.26	533,542.64
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	297.65	4,012,024.35
OWENS CORNING	7,979	56.56	451,292.24
PACCAR INC	27,548	68.34	1,882,630.32
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	174.74	1,809,257.96
PENTAIR PLC	13,583	42.90	582,710.70
RAYTHEON COMPANY	23,492	198.34	4,659,403.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	181.75	1,910,374.25
ROCKWELL COLLIN	13,112	136.05	1,783,887.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	297.71	2,411,451.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	52.56	726,799.68
SMITH (A.O.) CORP	12,146	57.74	701,310.04
SNAP-ON INC	4,900	178.22	873,278.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	85.56	725,634.36
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	140.02	1,682,340.30
TEXTRON	21,877	69.47	1,519,795.19
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	351.52	1,431,389.44
UNITED RENTALS INC	6,446	158.10	1,019,112.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	131.90	8,024,927.90
WABCO HOLDINGS INC	3,841	122.31	469,792.71
WABTEC CORP	7,158	109.57	784,302.06
XYLEM INC	13,941	75.66	1,054,776.06
CINTAS CORP	7,034	215.54	1,516,108.36
COPART INC	17,540	64.90	1,138,346.00
COSTAR GROUP INC	3,008	446.72	1,343,733.76
EQUIFAX INC	9,276	134.62	1,248,735.12
IHS MARKIT LTD	32,775	55.70	1,825,567.50
MANPOWER GROUP	5,123	93.53	479,154.19
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	26.06	716,754.24
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	73.67	1,360,021.87
ROBERT HALF INTL INC	9,566	78.78	753,609.48
ROLLINS INC	7,031	60.50	425,375.50
STERICYCLE INC	6,767	62.14	420,501.38

TRANSUNION	15,344	76.30	1,170,747.20
VERISK ANALYTICS INC	12,301	120.46	1,481,778.46
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	79.85	1,629,578.80
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	91.12	3,182,912.72
AMERCO	602	367.00	220,934.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	40.77	404,438.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	96.09	1,100,038.32
CSX CORP	68,519	74.84	5,127,961.96
DELTA AIR LINES INC	15,095	58.88	888,793.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	73.24	1,010,931.72
FEDEX CORP	20,716	241.29	4,998,563.64
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	119.98	855,937.32
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	114.83	1,003,958.69
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	34.41	368,187.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	174.36	3,975,233.64
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	154.49	810,300.05
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	61.99	710,715.35
UNION PACIFIC CORP	63,871	151.27	9,661,766.17
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	88.30	530,064.90
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	124.34	6,865,060.08
XPO LOGISTICS INC	10,037	106.69	1,070,847.53
APTIV PLC	20,954	87.04	1,823,836.16
AUTOLIV INC	6,639	88.34	586,489.26
BORGWARNER INC	15,953	43.81	698,900.93
FORD MOTOR COMPANY	299,765	9.47	2,838,774.55
GENERAL MOTORS CO	101,158	35.60	3,601,224.80
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	22.35	483,363.45
HARLEY-DAVIDSON	14,677	42.89	629,496.53
LEAR CORP	5,287	160.48	848,457.76
TESLA INC	10,369	288.95	2,996,122.55
DR HORTON INC	28,586	44.68	1,277,222.48
GARMIN LTD	9,564	67.99	650,256.36
HANESBRANDS INC	31,136	17.61	548,304.96
HASBRO INC	9,007	99.29	894,305.03
LEGGETT & PLATT INC	10,594	45.27	479,590.38
LENNAR CORP-CL A	23,545	51.72	1,217,747.40
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	157.29	1,332,560.88
MATTEL INC	27,399	15.56	426,328.44
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	72.06	832,076.82
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	190.16	962,589.92
NEWELL BRANDS INC	37,563	21.37	802,721.31
NIKE B	105,293	79.60	8,381,322.80

NVR INC	264	2,638.06	696,447.84
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	108.70	509,911.70
PULTE GROUP INC	21,959	28.00	614,852.00
PVH CORP	5,820	136.43	794,022.60
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	130.88	599,168.64
TAPESTRY INC	22,032	50.86	1,120,547.52
TOLL BROTHERS INC	11,211	36.64	410,771.04
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	20.75	330,962.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	19.31	314,424.73
VF CORP	26,718	91.88	2,454,849.84
WHIRLPOOL CORP	5,324	124.00	660,176.00
ARAMARK	19,980	40.81	815,383.80
BLOCK H & R INC	16,984	26.72	453,812.48
CARNIVAL CORPORATION	35,126	61.20	2,149,711.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	477.49	943,042.75
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	117.27	1,176,335.37
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	296.60	1,024,159.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	77.16	1,815,034.68
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	64.50	2,085,994.50
MARRIOTT INTL A	25,016	126.55	3,165,774.80
MCDONALD'S CORP	63,834	161.72	10,323,234.48
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	23.56	416,116.72
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.96	1,248,581.76
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	53.02	945,770.76
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	121.15	1,682,167.75
STARBUCKS CORP	113,248	53.53	6,062,165.44
VAIL RESORTS INC	2,987	301.42	900,341.54
WYNN RESORTS LTD	8,052	143.03	1,151,677.56
YUM BRANDS INC	27,323	87.02	2,377,647.46
CBS CORP-CL B	28,628	52.59	1,505,546.52
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	312.99	4,266,679.68
COMCAST CORP-CL A	373,142	36.38	13,574,905.96
DISCOVERY INC - A	12,804	27.47	351,725.88
DISCOVERY INC-C	23,672	25.32	599,375.04
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	35.05	638,540.90
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.93	775,813.62
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	81.41	705,254.83
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.41	409,777.56
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	25.60	1,184,537.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	37.05	519,070.50
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	47.53	724,024.49
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	47.35	302,282.40

LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	50.31	635,767.47
NEWS CORP-CLASS A	33,479	12.92	432,548.68
OMNICOM GROUP	19,030	67.99	1,293,849.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	7.15	925,960.75
THE WALT DISNEY CO	121,890	110.85	13,511,506.50
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	45.31	3,902,776.85
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	44.87	1,635,915.33
VIACOM INC-CLASS B	26,755	29.39	786,329.45
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	169.48	1,048,403.28
AMAZON.COM	33,277	2,039.51	67,868,774.27
AUTOZONE INC	2,151	783.00	1,684,233.00
BEST BUY COMPANY INC	21,836	80.68	1,761,728.48
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	1,925.36	7,526,232.24
CARMAX INC	14,253	78.85	1,123,849.05
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	109.82	2,452,280.60
DOLLAR TREE INC	19,550	79.98	1,563,609.00
EXPEDIA GROUP INC	9,800	127.37	1,248,226.00
GAP	16,326	30.37	495,820.62
GENUINE PARTS CO	11,245	100.19	1,126,636.55
HOME DEPOT	94,571	205.08	19,394,620.68
KOHL'S CORP	12,602	82.05	1,033,994.10
L BRANDS INC	19,499	26.13	509,508.87
LKQ CORP	24,693	34.27	846,229.11
LOWES COMPANIES	66,782	109.93	7,341,345.26
MACY'S INC	25,926	36.39	943,447.14
NETFLIX INC	35,175	363.60	12,789,630.00
NORDSTROM INC	10,094	65.02	656,311.88
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	343.78	2,269,979.34
QURATE RETAIL INC	35,071	20.83	730,528.93
ROSS STORES INC	30,239	97.69	2,954,047.91
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	88.95	3,721,312.20
TIFFANY & CO	9,326	122.75	1,144,766.50
TJX COMPANIES INC	51,517	111.44	5,741,054.48
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	90.82	858,793.92
TRIPADVISOR INC	10,393	53.02	551,036.86
ULTA BEAUTY INC	4,911	274.37	1,347,431.07
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	234.68	8,371,974.32
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	9.17	310,863.00
KROGER CO	72,735	31.90	2,320,246.50
SYSCO CORP	40,229	75.35	3,031,255.15
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	67.62	4,584,433.14
WALMART INC	119,581	95.36	11,403,244.16

ALTRIA GROUP INC	152,862	59.11	9,035,672.82
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	50.08	2,231,915.36
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	52.75	1,162,610.00
BUNGE LIMITED	11,767	63.71	749,675.57
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	39.69	558,517.68
COCA-COLA CO	328,376	44.76	14,698,109.76
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	42.58	727,096.08
CONAGRA BRANDS INC	33,243	36.12	1,200,737.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	211.11	2,959,339.98
GENERAL MILLS INC	44,875	45.92	2,060,660.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	101.50	1,136,800.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	39.98	938,130.70
INGREDION INC	5,835	100.80	588,168.00
JM SMUCKER CO	9,442	103.69	979,040.98
KELLOGG CO	21,051	71.91	1,513,777.41
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	56.66	2,826,880.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	126.24	1,171,002.24
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	64.89	979,839.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	42.62	5,124,714.04
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	60.93	2,128,406.76
PEPSICO INC	115,115	111.00	12,777,765.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	77.64	9,781,863.60
TYSON FOODS INC	24,363	62.75	1,528,778.25
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	56.48	1,077,807.84
CLOROX COMPANY	10,045	146.12	1,467,775.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	65.23	4,421,550.32
COTY INC-CL A	39,000	12.04	469,560.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	138.15	2,462,109.30
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	113.68	3,181,903.20
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	82.70	16,772,056.20
ABBOTT LABORATORIES	142,028	67.11	9,531,499.08
ABIOMED INC	3,502	411.36	1,440,582.72
AETNA INC	26,686	199.30	5,318,519.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	385.33	2,413,707.12
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	89.17	1,145,566.99
ANTHEM INC	20,871	263.70	5,503,682.70
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	74.79	3,146,490.09
BECTON DICKINSON & CO	21,729	261.93	5,691,476.97
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	36.05	4,058,112.45
CARDINAL HEALTH	25,252	51.23	1,293,659.96
CENTENE CORP	16,736	146.21	2,446,970.56
CERNER CORP	23,088	64.58	1,491,023.04

CIGNA CORP	19,408	186.07	3,611,246.56
CVS HEALTH CORP	81,494	74.00	6,030,556.00
DANAHER CORP	50,460	103.55	5,225,133.00
DAVITA INC	11,875	67.68	803,700.00
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	38.67	689,640.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	142.40	2,388,902.40
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	86.95	4,016,133.55
HCA HEALTHCARE INC	23,027	134.03	3,086,308.81
HENRY SCHEIN INC	12,492	77.89	973,001.88
HOLOGIC INC	21,094	39.72	837,853.68
HUMANA INC	11,281	333.09	3,757,588.29
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	251.00	1,808,455.00
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	556.03	5,038,187.83
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	169.15	1,345,249.95
MCKESSON CORP	16,655	123.90	2,063,554.50
MEDTRONIC PLC	110,187	95.56	10,529,469.72
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	109.33	1,151,463.56
RESMED INC	10,895	111.85	1,218,605.75
STRYKER CORP	27,181	168.60	4,582,716.60
TELEFLEX INC	3,697	247.00	913,159.00
THE COOPER COS INC	4,135	256.68	1,061,371.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	268.51	21,082,868.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	128.14	928,758.72
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	111.50	783,399.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	104.25	1,017,584.25
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	121.97	1,959,204.11
ABBVIE INC	122,922	94.56	11,623,504.32
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	67.27	1,703,478.21
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	119.20	2,113,296.80
ALKERMES PLC	12,547	44.51	558,466.97
ALLERGAN PLC	26,330	190.11	5,005,596.30
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	119.12	881,368.88
AMGEN	54,777	196.73	10,776,279.21
BIOGEN INC	17,262	346.72	5,985,080.64
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	95.78	1,373,580.98
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	60.48	8,039,001.60
CELGENE CORP	61,389	91.61	5,623,846.29
GILEAD SCIENCES INC	106,635	74.29	7,921,914.15
ILLUMINA INC	12,043	353.01	4,251,299.43
INCYTE CORP	14,121	73.84	1,042,694.64
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	128.04	1,667,208.84
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	171.42	852,128.82

JOHNSON & JOHNSON	217,581	133.72	29,094,931.32
LILLY (ELI) & CO	79,730	104.62	8,341,352.60
MERCK & CO	218,364	67.95	14,837,833.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	580.45	1,164,382.70
MYLAN NV	42,644	39.16	1,669,939.04
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	68.49	925,094.43
PERRIGO CO PLC	11,333	76.42	866,067.86
PFIZER	483,121	41.37	19,986,715.77
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	403.93	2,645,741.50
SEATTLE GENETICS INC	9,601	77.06	739,853.06
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	22.70	1,831,663.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	236.05	7,609,779.90
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	119.45	387,854.15
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	183.31	3,812,664.69
WATERS CORP	6,513	188.26	1,226,137.38
ZOETIS INC	39,742	89.97	3,575,587.74
BANK OF AMERICA CORP	787,725	31.14	24,529,756.50
BB&T CORP	64,293	52.14	3,352,237.02
CIT GROUP INC	10,713	54.35	582,251.55
CITIGROUP	208,262	71.40	14,869,906.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	41.23	1,649,612.30
COMERICA INC	14,360	97.74	1,403,546.40
EAST WEST BANCORP INC	10,794	63.79	688,549.26
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	29.74	1,731,373.58
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	102.56	1,289,999.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	16.40	1,433,655.20
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	115.15	31,893,325.80
KEY CORP	87,033	21.21	1,845,969.93
M & T BANK CORP	11,745	179.35	2,106,465.75
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	10.84	423,789.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	18.54	507,699.36
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	143.93	5,454,803.07
REGIONS FINL CORP	96,209	19.64	1,889,544.76
SIGNATURE BANK	4,354	117.22	510,375.88
SUNTRUST BANKS	38,353	73.99	2,837,738.47
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	326.21	1,432,061.90
US BANCORP	127,580	54.24	6,919,939.20
WELLS FARGO & CO	378,753	58.80	22,270,676.40
ZIONS BANCORPORATION	15,186	53.92	818,829.12
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	144.85	642,120.05
ALLY FINANCIAL INC	36,028	27.07	975,277.96
AMERICAN EXPRESS	59,473	107.01	6,364,205.73

AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	143.12	1,695,972.00
BANK NEW YORK CO	81,361	52.40	4,263,316.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	210.05	21,720,010.20
BLACKROCK INC	9,812	475.78	4,668,353.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	99.83	3,963,450.66
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	104.01	984,974.70
CME GROUP INC	27,733	177.05	4,910,127.65
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	78.58	2,323,217.70
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	59.36	1,252,970.88
EATON VANCE CORP	10,061	52.32	526,391.52
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	31.26	814,948.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	237.66	6,970,092.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	77.34	3,627,710.04
INVESCO LTD	30,943	23.98	742,013.14
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	23.32	599,463.92
MOODY'S CORP	14,116	178.13	2,514,483.08
MORGAN STANLEY	108,682	48.71	5,293,900.22
MSCI INC	6,934	182.23	1,263,582.82
NASDAQ INC	9,070	96.74	877,431.80
NORTHERN TRUST CORP	17,320	108.31	1,875,929.20
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	115.16	2,310,800.56
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	93.50	928,642.00
S&P GLOBAL INC	20,491	207.76	4,257,210.16
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	51.32	5,060,305.96
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	63.50	685,927.00
STATE STREET CORP	29,345	87.60	2,570,622.00
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	31.88	1,923,862.36
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	58.55	1,370,304.20
VOYA FINANCIAL INC	14,081	50.06	704,894.86
AFLAC	61,894	46.57	2,882,403.58
ALLEGHANY CORP	1,276	636.08	811,638.08
ALLSTATE CORP	28,446	100.95	2,871,623.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	112.45	623,985.05
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	53.37	3,869,912.07
AON PLC	20,163	146.87	2,961,339.81
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	30.59	1,056,915.09
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	72.99	1,092,806.28
ASSURANT INC	4,769	102.16	487,201.04
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	49.40	659,341.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.17	417,455.34
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	40.75	276,937.00
CHUBB LTD	37,790	136.20	5,146,998.00

CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	77.18	958,035.34
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	221.56	742,890.68
FNF GROUP	20,786	40.48	841,417.28
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	50.44	1,445,711.28
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	65.85	1,171,471.50
LOEWS CORP	22,051	50.27	1,108,503.77
MARKEL CORP	1,132	1,199.91	1,358,298.12
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	84.78	3,462,245.64
METLIFE INC	71,520	46.13	3,299,217.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	55.71	1,289,965.05
PROGRESSIVE CORP	46,702	68.39	3,193,949.78
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	98.75	3,312,667.50
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	143.15	777,447.65
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	132.26	429,712.74
TORCHMARK CORP	8,473	88.23	747,572.79
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	132.13	2,881,887.43
UNUM GROUP	18,574	37.06	688,352.44
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	147.69	1,614,251.70
WR BERKLEY CORP	7,296	78.76	574,632.96
XL GROUP LTD	20,644	57.32	1,183,314.08
CBRE GROUP INC-A	26,855	47.50	1,275,612.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.90	681,030.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	149.94	550,729.62
WEYERHAEUSER CO	62,107	34.16	2,121,575.12
ACCENTURE PLC-CL A	52,076	169.50	8,826,882.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	72.98	4,227,439.48
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	266.68	10,515,192.40
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	74.74	1,059,663.72
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	236.90	951,390.40
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,211.31	29,261,615.67
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,197.00	30,499,560.00
ANSYS INC	6,865	187.32	1,285,951.80
AUTODESK INC	18,086	153.59	2,777,828.74
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	145.81	5,215,332.08
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	136.62	1,318,383.00
CA INC	26,520	43.81	1,161,841.20
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	46.64	1,006,724.40
CDK GLOBAL INC	10,687	61.93	661,845.91
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	116.61	1,259,504.61
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	113.42	1,287,543.84
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	75.64	3,632,232.80
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	96.15	1,521,766.05

DXC TECHNOLOGY CO	23,498	90.71	2,131,503.58
EBAY	78,686	34.80	2,738,272.80
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	113.52	2,845,946.40
FACEBOOK INC-A	193,825	171.16	33,175,087.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	107.87	2,925,973.75
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	25.81	1,013,248.98
FISERV INC	33,784	79.98	2,702,044.32
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	215.31	1,542,265.53
FORTINET INC	10,871	86.08	935,775.68
GARTNER INC	7,002	152.32	1,066,544.64
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	125.51	1,570,506.63
GODADDY INC - CLASS A	12,570	81.75	1,027,597.50
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	202.84	1,290,873.76
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	145.68	10,883,170.08
INTUIT INC	19,851	220.74	4,381,909.74
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	159.28	952,335.12
LEIDOS HOLDINGS	10,999	71.23	783,458.77
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	216.82	16,289,036.14
MERCADOLIBRE INC	3,264	342.27	1,117,169.28
MICROSOFT CORP	591,521	111.71	66,078,810.91
ORACLE CORP	250,503	48.58	12,169,435.74
PAYCHEX INC	25,506	73.08	1,863,978.48
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	93.07	8,525,863.49
RED HAT INC	13,963	149.49	2,087,328.87
SABRE CORP	17,243	26.00	448,318.00
SALESFORCE.COM INC	55,092	153.21	8,440,645.32
SERVICENOW INC	13,794	200.26	2,762,386.44
SPLUNK INC	11,773	128.64	1,514,478.72
SQUARE INC - A	22,319	91.25	2,036,608.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	59.00	1,043,179.00
SYMANTEC CORP	48,508	20.04	972,100.32
SYNOPSYS INC	12,264	101.82	1,248,720.48
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	134.53	1,285,030.56
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	98.12	1,237,293.20
TWITTER INC	55,701	34.84	1,940,622.84
VERISIGN INC	7,289	159.24	1,160,700.36
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	147.80	21,573,479.20
VMWARE INC-CLASS A	5,821	152.77	889,274.17
WESTERN UNION CO	38,757	18.86	730,957.02
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	156.69	1,675,172.79
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	98.58	2,308,546.44
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	47.69	475,087.78

AMPHENOL CORPORATION	24,215	94.53	2,289,043.95
APPLE INC	398,252	228.36	90,944,826.72
ARISTA NETWORKS INC	4,324	289.82	1,253,181.68
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	76.98	513,148.68
AVNET INC	10,936	48.22	527,333.92
CDW CORP/DE	12,482	87.71	1,094,796.22
CISCO SYSTEMS	390,187	47.73	18,623,625.51
COGNEX CORP	12,660	53.37	675,664.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	31.36	468,298.88
CORNING	71,752	33.42	2,397,951.84
F5 NETWORKS INC	5,350	190.84	1,020,994.00
FLEX LTD	40,465	13.78	557,607.70
FLIR SYSTEMS INC	11,686	63.31	739,840.66
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	16.67	2,162,699.12
HP INC	134,066	24.81	3,326,177.46
IPG PHOTONICS CORP	3,207	168.80	541,341.60
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	28.39	888,720.56
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	65.48	1,038,054.44
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	128.17	1,617,505.40
NETAPP INC	20,821	87.92	1,830,582.32
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	229.03	1,651,535.33
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	49.41	1,128,326.76
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	90.35	2,530,613.15
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	42.19	870,042.18
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	60.24	1,420,278.48
XEROX CORP	16,718	27.57	460,915.26
AT&T INC	587,152	31.86	18,706,662.72
CENTURYLINK INC	73,994	21.50	1,590,871.00
SPRINT CORP	64,825	6.10	395,432.50
T-MOBILE US INC	28,273	65.77	1,859,515.21
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	53.19	17,784,980.73
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.69	530,375.41
AES CORP	52,646	13.15	692,294.90
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	43.09	829,741.04
AMEREN CORPORATION	18,723	63.75	1,193,591.25
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	72.26	2,808,890.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	88.80	1,268,330.40
ATMOS ENERGY CORP	9,385	92.39	867,080.15
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	27.92	877,832.72
CMS ENERGY CORP	21,593	49.52	1,069,285.36
CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	79.56	2,034,428.76
DOMINION ENERGY INC	53,227	71.23	3,791,359.21

DTE ENERGY COMPANY	14,355	111.67	1,603,022.85
DUKE ENERGY CORP	57,060	81.42	4,645,825.20
EDISON INTL	26,184	66.75	1,747,782.00
ENERGY CORP	13,854	84.30	1,167,892.20
EVERGY INC	21,492	57.51	1,236,004.92
EVERSOURCE ENERGY	25,381	62.42	1,584,282.02
EXELON CORP	77,742	43.99	3,419,870.58
FIRSTENERGY CORP	39,519	37.57	1,484,728.83
NEXTERA ENERGY INC	37,780	170.03	6,423,733.40
NISOURCE INC	26,021	27.12	705,689.52
OGE ENERGY CORP	15,686	36.75	576,460.50
PG&E CORP	41,241	47.01	1,938,739.41
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	79.18	745,558.88
PPL CORPORATION	53,473	29.94	1,600,981.62
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	52.73	2,141,154.38
SCANA CORP	11,459	37.36	428,108.24
SEMPRA ENERGY	19,952	116.99	2,334,184.48
SOUTHERN CO	81,059	43.89	3,557,679.51
UGI CORP	13,950	54.16	755,532.00
VISTRA ENERGY CORP	29,561	23.21	686,110.81
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	68.26	1,726,090.62
XCEL ENERGY INC	40,763	48.50	1,977,005.50
ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	28.06	2,165,334.08
ANALOG DEVICES	30,277	98.11	2,970,476.47
APPLIED MATERIALS	84,218	42.62	3,589,371.16
BROADCOM INC	33,321	219.43	7,311,627.03
INTEL CORP	378,881	47.96	18,171,132.76
KLA-TENCOR CORP	12,266	118.19	1,449,718.54
LAM RESEARCH CORP	12,814	171.96	2,203,495.44
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	20.70	781,487.10
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	60.87	1,328,731.23
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	86.09	1,603,340.16
MICRON TECHNOLOGY	92,766	51.93	4,817,338.38
NVIDIA CORP	46,674	283.70	13,241,413.80
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	94.66	2,582,608.78
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.38	769,594.48
QORVO INC	10,609	80.28	851,690.52
QUALCOMM	107,270	69.98	7,506,754.60
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	90.00	1,305,900.00
TEXAS INSTRUMENTS	79,005	112.54	8,891,222.70
XILINX INC	20,299	78.79	1,599,358.21
	24,859,886		2,038,802,137.55

	アメリカドル 小計			(227,367,214,379)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	23.95	284,669.70
	ARC RESOURCES LTD	27,117	13.32	361,198.44
	CAMECO CORP	28,709	13.31	382,116.79
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	43.97	4,400,957.30
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	11.85	921,965.55
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	7.82	338,168.08
	ENBRIDGE	138,840	44.94	6,239,469.60
	ENCANA CORP	76,271	17.16	1,308,810.36
	HUSKY ENERGY INC	31,439	21.79	685,055.81
	IMPERIAL OIL	24,763	40.35	999,187.05
	INTER PIPELINE LTD	30,317	23.53	713,359.01
	KEYERA CORP	14,929	35.39	528,337.31
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	44.01	1,860,566.76
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	23.67	434,344.50
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	15.05	301,150.50
	SUNCOR ENERGY	134,041	52.73	7,067,981.93
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	20.48	408,883.20
	TRANSCANADA CORP	70,703	55.54	3,926,844.62
	VERMILION ENERGY INC	10,067	40.60	408,720.20
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	43.75	772,668.75
	BARRICK GOLD CORP	94,395	12.95	1,222,415.25
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.24	844,049.36
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	15.29	870,001.00
	FRANCO-NEVADA CORP	14,257	81.88	1,167,363.16
	GOLDCORP INC	68,688	13.46	924,540.48
	KINROSS GOLD CORP	107,615	3.71	399,251.65
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.15	382,794.45
	METHANEX CORP	7,099	94.95	674,050.05
	NUTRIEN LTD	51,428	72.91	3,749,615.48
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	29.35	1,340,619.95
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.02	214,420.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	85.44	369,698.88
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	21.60	795,700.80
	BOMBARDIER B	157,835	4.20	662,907.00
	CAE INC	18,372	26.02	478,039.44
	FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	30.57	359,625.48
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	51.90	763,604.70
	WSP GLOBAL INC	9,471	69.11	654,540.81
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	115.15	6,971,065.85
	CP RAILWAY LIMITED	11,959	273.90	3,275,570.10
	LINAMAR CORP	3,889	56.01	217,822.89

MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	70.31	1,967,133.18
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	38.19	674,397.21
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	74.91	1,376,246.52
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.50	916,648.50
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	161.18	871,822.62
DOLLARAMA INC	26,700	48.80	1,302,960.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	62.70	2,135,750.10
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	24.32	279,655.68
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	66.24	1,034,536.32
METRO INC	19,179	40.19	770,804.01
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	99.87	476,879.25
SAPUTO INC	20,412	38.77	791,373.24
AURORA CANNABIS INC	53,000	8.95	474,350.00
BANK MONTREAL	52,905	107.33	5,678,293.65
BANK NOVA SCOTIA	96,431	75.19	7,250,646.89
CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	122.36	4,324,814.20
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	64.68	1,825,787.04
ROYAL BANK OF CANADA	116,879	103.77	12,128,533.83
TORONTO-DOMINION BANK	148,256	78.76	11,676,642.56
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,319	56.13	3,834,745.47
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.98	391,717.58
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.24	278,504.40
ONEX CORP	6,603	92.09	608,070.27
THOMSON REUTERS CORP	22,284	58.41	1,301,608.44
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	707.63	1,631,087.15
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.14	740,758.32
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	53.56	440,798.80
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	102.84	1,076,323.44
MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	23.62	3,791,907.56
POWER CORP OF CANADA	29,774	28.64	852,727.36
POWER FINANCIAL CORP	20,740	29.83	618,674.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	51.51	2,551,599.36
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.29	252,914.85
BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.00	551,600.00
CGI GROUP INC - CL A	21,192	85.23	1,806,194.16
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	979.00	1,665,279.00
OPEN TEXT CORP	19,994	51.86	1,036,888.84
SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	192.57	1,413,848.94
BCE INC	12,539	52.57	659,175.23
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	67.04	1,936,182.24
TELUS CORP	16,454	48.17	792,589.18
ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.57	202,145.37

	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.47	324,896.28	
	EMERA INC	4,086	41.31	168,792.66	
	FORTIS INC	34,128	42.79	1,460,337.12	
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.08	414,837.36	
	カナダドル 小計	3,293,712		145,443,630.62 (12,305,985,586)	
ユーロ	ENAGAS	18,299	24.22	443,201.78	
	ENI	202,686	16.12	3,268,109.06	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	17.47	696,675.82	
	NESTE OIL OYJ	11,086	73.42	813,934.12	
	OMV AG	12,139	45.79	555,844.81	
	REPSOL SA	110,036	16.90	1,859,608.40	
	SNAM SPA	173,485	3.64	632,699.79	
	TENARIS SA	40,648	14.32	582,079.36	
	TOTAL SA	195,662	53.63	10,493,353.06	
	VOPAK	6,360	43.35	275,706.00	
	AIR LIQUIDE	34,556	106.55	3,681,941.80	
	AKZO NOBEL	19,791	80.00	1,583,280.00	
	ARCELORMITTAL	53,985	25.34	1,368,249.82	
	ARKEMA	5,335	105.55	563,109.25	
	BASF SE	73,727	78.27	5,770,612.29	
	COVESTRO AG	16,178	72.66	1,175,493.48	
	CRH PLC	71,124	28.48	2,025,611.52	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	31.58	424,877.32	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	49.68	286,256.16	
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	67.56	770,656.92	
	IMERYS SA	3,000	61.25	183,750.00	
	K+S AG	14,355	18.98	272,529.67	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	89.00	1,355,826.00	
	LANXESS	7,293	66.56	485,422.08	
	LINDE AG - TENDER	15,262	193.80	2,957,775.60	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	35.40	692,601.00	
	SOLVAY SA	5,511	112.40	619,436.40	
	STORA ENSO OYJ R	47,237	15.69	741,148.53	
	SYMRISE AG	9,083	79.14	718,828.62	
	THYSSEN KRUPP	33,044	19.87	656,584.28	
	UMICORE	17,605	47.25	831,836.25	
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	32.99	1,451,230.10	
	VOESTALPINE AG	8,140	38.26	311,436.40	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	35.36	728,097.76	
	AIRBUS SE	46,842	105.16	4,925,904.72	
	ALSTOM	13,816	37.78	521,968.48	

ANDRITZ AG	5,242	50.00	262,100.00
BOUYGUES ORD	16,815	36.03	605,844.45
BRENTAG AG	11,626	52.46	609,899.96
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	10.11	774,961.83
DASSAULT AVIATION SA	213	1,584.00	337,392.00
EIFFAGE	6,079	96.40	586,015.60
FERROVIAL SA	37,634	17.96	676,094.81
GEA GROUP AG	13,382	32.08	429,294.56
HOCHTIEF AG	1,354	137.60	186,310.40
KION GROUP AG	5,887	58.24	342,858.88
KONE OYJ-B	26,924	45.84	1,234,196.16
LEGRAND SA	21,312	64.10	1,366,099.20
LEONARDO SPA	35,425	9.74	345,252.05
MAN SE	3,262	93.40	304,670.80
METSO OYJ	9,561	29.57	282,718.77
MTU AERO ENGINES AG	3,907	185.70	725,529.90
OSRAM LICHT AG	7,440	38.32	285,100.80
PRYSMIAN SPA	14,715	21.69	319,168.35
REXEL SA	24,339	13.53	329,428.36
SAFRAN SA	27,252	110.15	3,001,807.80
SAINT-GOBAIN	39,044	36.18	1,412,807.14
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	68.88	3,086,788.32
SIEMENS	61,389	110.02	6,754,017.78
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.67	221,698.42
THALES SA	8,109	118.40	960,105.60
VINCI S.A.	40,049	81.10	3,247,973.90
WARTSILA OYJ	34,386	17.51	602,270.79
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.13	432,818.54
EDENRED	18,941	32.87	622,590.67
RANDSTAD NV	9,588	52.60	504,328.80
RELX NV	80,302	19.12	1,535,775.75
SOCIETE BIC SA	2,424	78.35	189,920.40
TELEPERFORMANCE	4,523	165.40	748,104.20
WOLTERS KLUWER	23,031	54.80	1,262,098.80
ADP	2,382	190.60	454,009.20
AENA SME SA	5,610	150.60	844,866.00
ATLANTIA SPA	42,039	17.55	737,784.45
BOLLORE	61,805	3.96	245,118.63
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	22.48	380,563.92
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	31.00	2,436,352.00
FRAPORT AG	3,561	76.90	273,840.90
GETLINK	36,478	10.70	390,314.60

INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.71	357,482.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	81.88	2,201,916.96
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.70	352,863.70
CONTINENTAL AG	8,828	155.15	1,369,664.20
DAIMLER AG	74,263	54.20	4,025,054.60
FAURECIA	5,945	51.12	303,908.40
FERRARI NV	9,947	111.90	1,113,069.30
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	14.90	1,290,183.04
MICHELIN	13,802	100.55	1,387,791.10
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	35.24	362,690.08
PEUGEOT SA	46,029	23.37	1,075,697.73
PIRELLI & C SPA	39,097	6.92	270,864.01
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	52.90	615,438.60
RENAULT SA	15,041	72.37	1,088,517.17
SCHAEFFLER AG	15,247	11.18	170,461.46
VALEO SA	19,350	38.00	735,300.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	136.20	2,013,036.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	134.20	348,114.80
ADIDAS AG	14,964	210.80	3,154,411.20
HERMES INTERNATIONAL	2,561	547.60	1,402,403.60
HUGO BOSS AG	4,852	67.66	328,286.32
KERING	6,060	451.90	2,738,514.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	56.96	758,650.24
LVMH	22,399	291.70	6,533,788.30
MONCLER SPA	15,736	38.50	605,836.00
PUMA AG	772	455.50	351,646.00
SEB SA	2,075	158.80	329,510.00
ACCOR	14,931	44.16	659,352.96
PADDY POWER PLC	7,143	77.90	556,439.70
SODEXO	7,035	90.66	637,793.10
AXEL SPRINGER SE	3,827	61.85	236,699.95
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	20.36	243,831.36
JC DECAUX SA	4,674	27.72	129,563.28
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	22.48	431,031.52
PUBLICIS GROUPE	17,601	53.24	937,077.24
RTL GROUP	3,513	63.40	222,724.20
SES	31,369	16.88	529,508.72
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	46.90	234,406.20
VIVENDI	83,098	22.27	1,850,592.46
INDITEX	86,470	25.25	2,183,367.50
ZALANDO SE	9,155	43.94	402,270.70
CARREFOUR	43,442	15.34	666,617.49

CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	27.41	101,060.67
COLRUYT SA	4,160	50.94	211,910.40
JERONIMO MARTINS	20,234	12.79	258,894.03
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	20.76	2,087,609.27
METRO AG	13,712	13.46	184,632.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	79.81	4,855,560.59
DANONE (GROUPE)	48,771	66.62	3,249,124.02
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.60	323,197.60
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	82.30	739,054.00
HEINEKEN NV	20,246	85.64	1,733,867.44
KERRY GROUP PLC-A	13,146	98.85	1,299,482.10
PERNOD-RICARD	17,495	136.25	2,383,693.75
REMY COINTREAU	1,575	120.40	189,630.00
BEIERSDORF AG	7,693	99.90	768,530.70
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	95.60	823,880.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	108.40	1,551,637.60
LOREAL	20,321	203.10	4,127,195.10
UNILEVER NV-CVA	125,731	48.92	6,150,760.52
BIOMERIEUX	3,246	74.30	241,177.80
ESSILOR INTERNATIONAL	17,239	123.90	2,135,912.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	87.00	1,565,652.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	65.58	2,219,883.00
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	37.98	2,827,990.80
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	152.10	493,716.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	39.00	487,500.00
BAYER	72,150	79.83	5,759,734.50
EUROFINS SCIENTIFIC	971	477.40	463,555.40
GRIFOLS SA	22,128	25.27	559,174.56
IPSEN	2,722	152.85	416,057.70
MERCK KGAA	10,480	90.30	946,344.00
ORION OYJ-CLASS B	7,975	30.64	244,354.00
QIAGEN N.V.	17,548	33.21	582,769.08
RECORDATI SPA	7,493	30.16	225,988.88
SANOFI	91,271	73.15	6,676,473.65
UCB (GROUPE)	10,465	78.04	816,688.60
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	23.57	782,264.73
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	5.36	2,907,410.79
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.33	592,903.29
BANCO SANTANDER SA	1,302,544	4.28	5,582,703.58
BANKIA SA	110,053	3.32	365,486.01
BANKINTER SA	58,881	7.77	457,740.89
BNP PARIBAS	90,844	50.88	4,622,142.72

CAIXABANK	277,342	4.05	1,123,512.44
COMMERZBANK AG	80,494	8.22	662,304.63
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	12.08	1,121,434.72
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	34.77	803,465.16
ING GROEP NV-CVA	314,846	11.54	3,635,211.91
INTESA SANPAOLO	1,163,318	2.28	2,656,436.65
KBC GROEP NV	20,232	61.40	1,242,244.80
MEDIOBANCA	53,990	8.48	457,943.18
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	24.68	308,253.20
SOCIETE GENERALE	63,719	35.70	2,274,768.30
UNICREDIT SPA	163,189	13.00	2,121,457.00
AMUNDI SA	4,764	61.90	294,891.60
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	9.83	1,585,613.88
DEUTSCHE BOERSE	15,552	118.85	1,848,355.20
EURAZEO SA	3,198	65.45	209,309.10
EXOR NV	7,813	56.48	441,278.24
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	89.32	557,982.04
NATIXIS	69,996	5.78	404,996.85
WENDEL	2,023	127.60	258,134.80
AEGON	133,499	5.20	694,728.79
AGEAS	16,065	44.86	720,675.90
ALLIANZ SE-REG	36,019	182.10	6,559,059.90
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.53	1,477,468.21
AXA	157,703	22.03	3,474,197.09
CNP ASSURANCES	11,830	19.84	234,707.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	119.80	563,778.80
MAPFRE SA	90,939	2.53	230,712.24
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	185.95	2,355,056.75
NN GROUP NV	23,899	37.49	895,973.51
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.92	318,654.27
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	43.87	1,588,664.31
SCOR SE	13,354	38.83	518,535.82
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	43.09	1,187,258.77
VONOVIA SE	40,469	43.40	1,756,354.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	80.30	2,905,735.80
ATOS SE	7,634	102.20	780,194.80
CAPGEMINI SA	13,238	109.90	1,454,856.20
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	135.90	1,422,737.10
DELIVERY HERO SE	8,671	46.10	399,733.10
SAP SE	78,835	102.40	8,072,704.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	90.06	615,109.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	45.15	429,511.95

	WIRECARD AG	9,864	193.20	1,905,724.80
	INGENICO GROUP	4,681	58.56	274,119.36
	NOKIA OYJ	458,694	4.76	2,187,052.99
	1&1 DRILLISCH AG	3,773	42.82	161,559.86
	DEUTSCHE TELEKOM	268,918	13.74	3,694,933.32
	ELISA A	11,722	37.09	434,768.98
	ILIAD SA	2,053	115.20	236,505.60
	KPN (KON.)	261,596	2.18	571,587.26
	ORANGE	164,543	13.84	2,277,275.12
	PROXIMUS	13,141	19.86	261,045.96
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.52	447,589.80
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.46	218,477.31
	TELEFONICA	377,880	6.92	2,617,196.88
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.53	236,460.47
	E.ON SE	183,255	9.05	1,659,557.28
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	13.97	694,811.92
	ENDESA	24,774	19.32	478,633.68
	ENEL	656,974	4.29	2,819,075.43
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.33	643,495.86
	ENGIE	151,158	12.59	1,903,079.22
	FORTUM OYJ	38,328	21.53	825,201.84
	IBERDROLA SA	476,207	6.39	3,045,819.97
	INNOGY SE	11,000	37.62	413,820.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	26,034	23.48	611,278.32
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.18	597,794.76
	RWE STAMM	42,828	21.70	929,367.60
	SUEZ	28,043	12.30	344,928.90
	TERNA SPA	105,905	4.68	495,635.40
	UNIPER SE	14,751	26.05	384,263.55
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	18.03	824,956.97
	ASML HOLDING NV	33,413	171.70	5,737,012.10
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	21.46	1,947,344.78
	STMICROELECTRONICS	57,598	17.26	994,429.47
	ユーロ 小計	15,526,826		314,833,098.23 (40,670,139,629)
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.52	8,939,801.39
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	25.36	9,461,537.04
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	25.79	7,845,782.22
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	7.26	392,364.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	15.47	1,353,179.62
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	7.94	284,840.06
	BHP BILLITTON PLC	168,203	16.35	2,750,119.05

CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	50.52	517,476.36
FRESNILLO PLC	17,743	8.70	154,435.07
GLENCORE PLC	943,407	3.11	2,933,995.77
JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	34.89	492,332.79
MONDI PLC	27,192	21.50	584,628.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	49.51	361,125.94
RIO TINTO PLC REG	96,058	35.74	3,433,112.92
ASHTED GROUP PLC	42,021	24.07	1,011,445.47
BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.06	1,556,717.04
BUNZL PLC	27,712	24.15	669,244.80
DCC PLC	7,320	69.60	509,472.00
FERGUSON PLC	19,208	62.45	1,199,539.60
MEGGITT PLC	66,268	5.40	358,112.27
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.24	918,685.01
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	10.00	1,338,130.00
SMITHS GROUP PLC	28,628	16.20	463,916.74
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	11.41	211,712.55
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	18.43	342,632.91
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.02	138,402.40
EXPERIAN PLC	75,041	19.18	1,439,661.58
G4S PLC	132,555	2.50	331,387.50
INTERTEK GROUP PLC	12,430	51.34	638,156.20
RELX PLC	82,063	17.24	1,414,766.12
EASYJET PLC	11,633	15.08	175,425.64
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.58	344,409.67
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.35	382,696.91
BURBERRY GROUP PLC	35,328	22.00	777,216.00
PERSIMMON PLC	26,389	23.58	622,252.62
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.64	444,589.22
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	35.10	372,024.90
CARNIVAL PLC	13,721	46.53	638,438.13
COMPASS GROUP PLC	126,022	16.71	2,105,827.62
GVC HOLDINGS PLC	42,500	10.96	465,800.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	47.21	659,240.44
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.78	246,200.63
TUI AG-DI	37,945	14.08	534,455.32
WHITBREAD PLC	14,664	47.00	689,208.00
INFORMA PLC	100,899	7.68	775,307.91
ITV PLC	295,435	1.61	475,650.35
PEARSON	66,305	9.17	608,016.85
SKY PLC	83,042	15.48	1,285,490.16
WPP PLC	98,371	11.96	1,177,009.01

KINGFISHER PLC	170,994	2.70	463,222.74
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.98	403,624.79
NEXT PLC	11,202	54.54	610,957.08
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.64	444,186.25
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.23	480,457.06
TESCO	786,019	2.43	1,913,956.26
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.43	646,993.35
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	37.43	6,977,663.17
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.59	477,556.40
DIAGEO	200,277	27.19	5,446,533.01
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	27.25	2,096,833.00
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	65.26	3,500,481.14
UNILEVER PLC	99,877	43.57	4,351,640.89
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.12	239,088.06
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	4.98	149,744.64
NMC HEALTH PLC	9,509	38.74	368,378.66
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.73	975,555.84
ASTRAZENECA	101,347	58.00	5,878,126.00
GLAXOSMITHKLINE	403,375	15.71	6,339,441.50
SHIRE PLC	74,526	44.91	3,347,335.29
BARCLAYS	1,365,547	1.81	2,471,913.17
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	6.77	11,069,594.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.60	3,578,734.48
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.46	728,466.66
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.33	1,478,175.27
3I GROUP PLC	79,251	9.09	720,391.59
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	22.05	451,341.45
INVESTEC PLC	54,280	4.98	270,422.96
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	46.81	1,230,915.76
SCHRODERS PLC	8,614	30.48	262,554.72
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.35	508,136.25
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.22	712,269.39
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.96	340,704.80
AVIVA PIC	318,261	4.90	1,561,388.46
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.30	375,373.21
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.55	1,237,818.45
PRUDENTIAL	212,799	17.27	3,676,102.72
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.32	546,920.16
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.31	345,563.19
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	13.16	461,073.76
SAGE GROUP PLC	89,321	5.90	527,708.46
BT GROUP PLC	663,615	2.20	1,462,275.65

	VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.64	3,577,671.93
	CENTRICA PLC	440,558	1.43	630,879.05
	NATIONAL GRID PLC	272,668	8.08	2,203,702.77
	SEVERN TRENT PLC	18,112	19.47	352,731.20
	SSE PLC	80,824	12.66	1,023,231.84
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.15	421,063.50
	イギリスボンド 小計	24,513,636		152,164,872.56 (21,815,877,778)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	23.76	413,376.48
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	606.00	407,232.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,337.00	1,729,380.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	46.17	1,862,220.78
	SIKA AG-BR	10,500	142.70	1,498,350.00
	ABB LTD	149,127	22.88	3,412,025.76
	GEBERIT AG-REG	3,021	442.20	1,335,886.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	222.40	328,929.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	227.80	680,894.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	58.38	772,017.12
	SGS SA	437	2,556.00	1,116,972.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	156.45	620,324.25
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	84.64	3,512,136.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	394.70	980,040.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	76.30	300,469.40
	DUFREY AG-REG	2,548	118.00	300,664.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,764.00	282,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,500.00	644,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,815.00	511,125.00
	NESTLE SA - REGISTERED	252,246	80.50	20,305,803.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	193.00	799,020.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	765.00	595,935.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	310.60	1,788,124.20
	NOVARTIS	180,510	80.68	14,563,546.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	240.60	13,723,102.20
	VIFOR PHARMA AG	3,601	175.70	632,695.70
	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	14.71	3,114,827.05
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	50.74	875,467.96
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	78.10	265,305.70
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	758.00	1,130,178.00
	UBS GROUP AG	317,371	15.23	4,835,147.18
	BALOISE HOLDING AG	3,877	149.50	579,611.50
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	352.90	1,040,702.10
	SWISS RE LTD	26,239	88.40	2,319,527.60

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	295.60	3,637,358.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	88.20	553,631.40	
	TEMENOS AG	5,252	171.80	902,293.60	
	SWISSCOM	2,064	431.80	891,235.20	
	スイスフラン 小計	1,408,816		93,261,795.88 (10,677,543,010)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	319.60	4,535,443.60	
	BOLIDEN AB	20,141	236.00	4,753,276.00	
	ALFA LAVAL AB	25,639	241.30	6,186,690.70	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	185.15	14,866,619.25	
	ATLAS COPCO A	53,833	261.15	14,058,487.95	
	ATLAS COPCO B	29,972	242.10	7,256,221.20	
	EPIROC AB-A	53,833	92.54	4,981,705.82	
	EPIROC AB-B	29,972	86.00	2,577,592.00	
	SANDVIK AB	87,313	157.45	13,747,431.85	
	SKANSKA B	28,530	168.40	4,804,452.00	
	SKF AB-B	28,335	173.20	4,907,622.00	
	VOLVO B	123,214	155.15	19,116,652.10	
	SECURITAS B	22,844	159.85	3,651,613.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	199.20	3,619,464.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	72.70	2,814,362.40	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	122.06	9,027,801.72	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	274.50	1,572,885.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	492.10	7,454,822.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	236.30	11,477,327.30	
	NORDEA BANK AB	244,135	97.06	23,695,743.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	97.24	13,488,160.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	110.25	13,249,514.25	
	SWEDBANK AB-A	71,353	213.30	15,219,594.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	192.80	2,466,297.60	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	413.10	15,182,251.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	298.70	5,407,664.80	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	302.20	2,200,016.00		
ERICSSON (LM) B	248,169	77.64	19,267,841.16		
HEXAGON AB-B SHS	21,504	537.40	11,556,249.60		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	526.00	3,258,044.00		
TELE2 AB-B SHS	33,266	113.35	3,770,701.10		
TELIA CO AB	235,437	40.43	9,518,717.91		
	スウェーデンクローナ 小計	1,992,279		279,691,267.21 (3,434,608,761)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	300.40	3,097,424.40	
	EQUINOR ASA	92,696	215.60	19,985,257.60	

	NORSK HYDRO	106,150	45.74	4,855,301.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	380.20	5,121,294.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	271.00	1,889,141.00	
	MARINE HARVEST	32,238	180.00	5,802,840.00	
	ORKLA	69,804	68.80	4,802,515.20	
	DNB ASA	80,217	169.45	13,592,770.65	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	139.70	2,594,787.80	
	TELENOR ASA	60,821	160.10	9,737,442.10	
	ノルウェークローネ 小計	491,252		71,478,773.75 (949,238,115)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	644.00	4,766,244.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	348.70	6,167,456.90	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	431.60	7,647,952.00	
	ISS A/S	14,253	221.70	3,159,890.10	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,770.00	2,622,230.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,332.00	4,740,656.00	
	DSV A/S	14,599	600.20	8,762,319.80	
	PANDORA A/S	8,431	385.30	3,248,464.30	
	CARLSBERG AS-B	8,236	784.00	6,457,024.00	
	COLOPLAST-B	9,476	681.40	6,456,946.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	266.20	1,975,204.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,087.00	4,904,544.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	373.10	1,817,370.10	
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	314.50	45,269,759.00	
	DANSKE BANK A/S	59,378	177.45	10,536,626.10	
TRYG A/S	9,828	156.60	1,539,064.80		
ORSTED A/S	15,908	402.20	6,398,197.60		
	デンマーククローネ 小計	344,469		126,469,949.10 (2,191,724,217)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	29.74	613,506.46	
	OIL SEARCH LTD	118,781	8.88	1,054,775.28	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	7.85	1,053,485.70	
	SANTOS	156,437	6.72	1,051,256.64	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	36.45	2,803,588.20	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.84	484,100.72	
	AMCOR	88,486	14.31	1,266,234.66	
	BHP BILLITON LTD	258,265	33.08	8,543,406.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	17.46	861,266.88	
	BORAL LIMITED	81,732	6.98	570,489.36	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	3.71	499,647.96	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.98	599,384.02	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	21.26	794,337.38	

NEWCREST MINING LIMITED	61,159	19.35	1,183,426.65
ORICA LTD	29,211	16.76	489,576.36
RIO TINTO LTD	32,522	71.40	2,322,070.80
SOUTH32 LTD	408,172	3.47	1,416,356.84
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	48.99	451,687.80
BRAMBLES LTD	129,297	10.95	1,415,802.15
SEEK LTD	26,358	22.52	593,582.16
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.22	673,035.14
TRANSURBAN GROUP	182,844	12.06	2,205,098.64
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	31.31	1,369,029.75
CROWN RESORTS LTD	30,328	13.98	423,985.44
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	53.46	295,259.58
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	58.67	191,440.21
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.85	809,203.10
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.49	157,618.87
WESFARMERS LTD	93,277	51.48	4,801,899.96
WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	28.48	2,928,342.08
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.47	436,851.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	19.69	1,149,403.75
COCHLEAR LIMITED	4,811	218.93	1,053,272.23
HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.15	301,599.85
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	56.15	687,725.20
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	26.30	835,735.10
CSL LIMITED	36,265	230.28	8,351,104.20
AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	28.80	6,764,284.80
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.42	406,552.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.07	469,744.38
COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	70.73	9,922,216.59
NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	28.22	6,279,881.26
WESTPAC BANKING	277,750	28.31	7,863,102.50
AMP LTD	244,230	3.34	815,728.20
ASX LTD	15,814	67.37	1,065,389.18
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	10.68	470,646.24
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	128.37	3,437,491.86
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.60	1,387,425.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.03	649,971.36
QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.00	1,244,023.00
SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	15.33	1,577,778.93
COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	19.00	618,716.00
REA GROUP LTD	3,593	90.30	324,447.90
TELSTRA CORP	342,339	3.04	1,040,710.56
TPG TELECOM LTD	31,475	8.35	262,816.25

	AGL ENERGY LTD	51,344	20.50	1,052,552.00
	AUSNET SERVICES	120,230	1.61	194,171.45
	オーストラリアドル 小計	5,815,961		100,586,236.48 (8,053,939,954)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.31	483,623.64
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.12	605,268.75
	A2 MILK CO LTD	66,854	12.82	857,068.28
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.62	710,834.96
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.75	499,358.75
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.01	583,250.49
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.26	360,926.16
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,100,331.03 (298,955,135)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	91.25	19,435,885.00
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	14.08	1,393,920.00
	MTR CORP	114,000	40.40	4,605,600.00
	MINTH GROUP LTD	46,000	30.40	1,398,400.00
	LI & FUNG	554,800	2.15	1,192,820.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	48.15	5,729,850.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	22.45	1,537,825.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	58.70	11,622,600.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	14.84	997,248.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	37.80	7,665,840.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.04	1,179,920.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.85	1,168,200.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	21.55	3,034,240.00
	WH GROUP LTD	699,000	6.08	4,249,920.00
	BANK EAST ASIA	109,160	29.00	3,165,640.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	38.25	11,857,500.00
	HANG SENG BANK	61,100	210.80	12,879,880.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	224.60	21,763,740.00
	AIA GROUP LTD	968,600	68.00	65,864,800.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	58.15	12,560,167.40
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	21.80	1,765,800.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.54	2,688,420.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	41.25	4,696,065.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	39.70	2,342,300.00
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	29.10	1,876,950.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.44	5,131,260.00
	SINO LAND CO	235,400	13.16	3,097,864.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	115.40	15,232,800.00	
SWIRE PACIFIC A	40,500	89.85	3,638,925.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	30.50	2,934,100.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	22.30	2,029,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	51.40	4,677,400.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	49.30	3,204,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.27	1,524,390.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	58.35	2,917,500.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	92.65	12,368,775.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	737,913	16.08	11,865,641.04	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	55.15	6,121,650.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	82.35	1,951,695.00	
	香港ドル 小計	7,660,909		283,369,330.44	(4,026,678,185)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.54	734,442.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.77	296,390.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.32	361,880.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.09	217,891.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.29	381,285.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.82	425,530.06	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.07	259,584.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.11	471,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.79	354,609.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	31.85	315,315.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.30	125,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.17	566,162.00	
	DBS GROUP	145,600	24.99	3,638,544.00	
	OCBC BANK	260,000	11.28	2,932,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	26.79	2,965,653.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.40	461,020.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.42	639,882.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.10	283,920.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.86	325,850.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.95	461,315.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.20	2,051,017.60		
	シンガポールドル 小計	3,459,876		18,270,539.66	(1,480,644,534)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	367.90	1,115,472.80	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	20.51	1,389,675.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	462.70	675,542.00	
	BANK HAPOALIM BM	84,067	26.27	2,208,440.09	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	23.72	2,746,633.68	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	64.35	527,670.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	187.70	811,427.10	

	NICE LTD	4,894	420.30	2,056,948.20	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.16	643,160.96	
	イスラエルシケル 小計	444,132		12,174,970.39 (375,232,587)	
	合 計	90,378,020		333,647,781,870 (333,647,781,870)	

(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	889,440.03	
		LENDLEASE GROUP	44,009	871,818.29	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	662,268.20	
		オーストラリアドル 小計	223,440	2,423,526.52 (194,051,768)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,757,385.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,722,880.00	
		香港ドル 小計	488,500	4,480,265.00 (63,664,565)	
	投資信託受益証券合計	711,940	257,716,333 (257,716,333)		
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	684,983.04	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,068,184.42	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	5,318,436.85	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	1,031,973.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,975,985.16	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,588,557.26	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,000	369,740.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	668,775.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,727,505.64	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	2,077,259.28	
		DUKE REALTY CORP	29,929	837,413.42	
		EQUINIX INC	6,496	2,782,821.44	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,924,747.38	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,238,229.53	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	927,454.80	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	779,429.12	
		HCP INC	36,011	955,731.94	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,260,213.36	
INVITATION HOMES INC	24,000	555,840.00			
IRON MOUNTAIN INC	20,489	744,775.15			

	KIMCO REALTY CORP	35,407	600,502.72	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	507,045.58	
	MACERICH CO/THE	10,128	581,245.92	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	897,835.16	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	504,275.20	
	PROLOGIS INC	50,653	3,354,748.19	
	PUBLIC STORAGE	12,835	2,735,138.50	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,266,103.67	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	762,776.70	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,460,346.72	
	SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,749,217.77	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	829,206.93	
	UDR INC	20,960	830,016.00	
	VENTAS INC	27,813	1,647,920.25	
	VEREIT INC	77,798	602,156.52	
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	1,003,107.75	
	WELLTOWER INC	29,615	1,961,401.45	
アメリカドル 小計		889,239	54,811,101.70	(6,112,534,061)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	190,140.05	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	391,587.20	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	173,547.42	
カナダドル 小計		30,576	755,274.67	(63,903,789)
ユーロ	COVIVIO	3,578	320,409.90	
	GECINA SA	3,549	520,638.30	
	ICADE	2,845	237,842.00	
	KLEPIERRE	17,225	521,056.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,790	1,889,544.80	
ユーロ 小計		37,987	3,489,491.25	(450,772,479)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	497,449.29	
	HAMMERSON PLC	61,184	280,222.72	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	532,805.00	
	SEGRO PLC	81,695	535,919.20	
イギリスポンド 小計		280,843	1,846,396.21	(264,717,824)
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	796,467.50	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,488,275.31	
	GPT GROUP	136,015	701,837.40	
	MIRVAC GROUP	306,089	762,161.61	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,774,918.08	

	STOCKLAND	207,412	860,759.80
	VICINITY CENTERS	291,115	806,388.55
オーストラリアドル 小計		1,581,655	7,190,808.25 (575,768,016)
香港ドル	LINK REIT	179,500	14,081,775.00
香港ドル 小計		179,500	14,081,775.00 (200,102,022)
シンガポールドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	539,175.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	427,680.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	430,645.00
	SUNTEC REIT	173,000	325,240.00
シンガポールドドル 小計		813,800	1,722,740.00 (139,610,849)
投資証券合計		3,813,600	7,807,409,040 (7,807,409,040)
合計			8,065,125,373 (8,065,125,373)

(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	97.4%			66.5%
	投資証券 37銘柄			2.6%	1.8%
カナダドル	株式 87銘柄	99.5%			3.6%
	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%			6.4%
	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%			2.4%
	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	93.9%			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	91.4%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,464,693,302
投資証券	102,306,944,700
派生商品評価勘定	50,905,650
未収入金	328,922,010
未収配当金	1,240,260,893
差入委託証拠金	39,960,000
流動資産合計	105,431,686,555
資産合計	105,431,686,555
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,059,520
前受金	49,846,130
未払金	432,154,247
未払解約金	10,182,292
未払利息	3,046
その他未払費用	198
流動負債合計	493,245,433
負債合計	493,245,433
純資産の部	
元本等	
元本	63,794,633,470
剰余金	
剰余金又は欠損金()	41,143,807,652

	2018年 9月 5日現在
項目	金額（円）
元本等合計	104,938,441,122
純資産合計	104,938,441,122
負債純資産合計	105,431,686,555

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	63,794,633,470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 1.6449円 (1万口当たり純資産額) (16,449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 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月19日
期首元本額	56,687,148,189円
期中追加設定元本額	13,038,624,566円
期中一部解約元本額	5,931,139,285円
期末元本額	63,794,633,470円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,760,571,919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	10,653,685,889円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	30,475,387,206円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,112,007,203円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,288,224,487円
分散投資コア戦略ファンドA	2,186,519,539円
分散投資コア戦略ファンドS	3,389,823,296円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,389,653,020円
SMT インデックスバランス・オープン	37,449,480円

区分	2018年 9月 5日現在
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	851,326円
グローバル経済コア	429,650,124円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,578,636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)	1,398,116,905円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	2,942,095,201円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	6,775,828,643	
合計	6,775,828,643	

(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 9月 5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	2,534,973,870	-	2,584,820,000	49,846,130
合計		2,534,973,870	-	2,584,820,000	49,846,130

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,019	2,045,671,000	
	MCUBS MidCity投資法人	13,630	1,149,009,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,871	1,961,359,400	
	産業ファンド投資法人	14,092	1,623,398,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,787	3,353,401,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,175	1,225,490,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,796	2,825,550,000	
	GLP投資法人	29,969	3,209,679,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,613	1,201,225,200	
	日本プロロジスリート投資法人	16,224	3,514,118,400	
	星野リゾート・リート投資法人	1,840	1,034,080,000	
	Oneリート投資法人	1,405	333,547,000	
	イオンリート投資法人	12,415	1,473,660,500	
	ヒューリックリート投資法人	8,723	1,413,998,300	
	日本リート投資法人	3,904	1,395,680,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	71,696	1,139,966,400	
	日本ヘルスケア投資法人	554	98,168,800	
	積水ハウス・リート投資法人	31,206	2,249,952,600	
	トーセイ・リート投資法人	1,944	215,978,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,433	1,059,487,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,602	179,744,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,421	220,311,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	35,849	5,470,557,400	
	いちごホテルリート投資法人	2,115	297,580,500	
	ラサールロジポート投資法人	9,124	930,648,000	
	スターアジア不動産投資法人	3,392	360,230,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,040	116,168,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,065	647,377,500	
	大江戸温泉リート投資法人	1,952	166,896,000	
	さくら総合リート投資法人	2,617	237,361,900	
	投資法人みらい	2,814	533,815,800	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,838	398,455,200	
	三菱地所物流リート投資法人	1,214	302,528,800	
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,211	130,424,700	
ザイマックス・リート投資法人	1,115	123,542,000		
タカラレーベン不動産投資法人	1,810	162,538,000		
日本ビルファンド投資法人	11,712	7,565,952,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,095	7,087,670,000		
日本リテールファンド投資法人	22,859	4,635,805,200		

オリックス不動産投資法人	24,099	4,161,897,300	
日本プライムリアルティ投資法人	7,656	3,070,056,000	
プレミア投資法人	11,499	1,306,286,400	
東急リアル・エステート投資法人	8,109	1,242,298,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,733	889,295,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,675	4,644,117,500	
森トラスト総合リート投資法人	8,644	1,408,107,600	
インヴィンシブル投資法人	42,325	2,001,972,500	
フロンティア不動産投資法人	4,114	1,836,901,000	
平和不動産リート投資法人	7,532	818,728,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,981	1,697,558,700	
福岡リート投資法人	6,255	1,065,226,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,742	2,585,722,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,034	917,107,600	
大和証券オフィス投資法人	2,792	1,915,312,000	
阪急阪神リート投資法人	5,018	700,011,000	
スタートプロシード投資法人	1,906	327,069,600	
大和ハウスリート投資法人	15,143	3,893,265,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,021	2,945,266,100	
日本賃貸住宅投資法人	13,604	1,225,720,400	
ジャパンエクセレント投資法人	10,831	1,563,996,400	
合計	639,854	102,306,944,700	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,046,079,743
コール・ローン	27,672,044
投資証券	67,679,883,169
派生商品評価勘定	76,500

	2018年 9月 5日現在
項目	金額（円）
未収入金	1,076,278
未収配当金	44,213,136
流動資産合計	68,799,000,870
資産合計	68,799,000,870
負債の部	
流動負債	
未払金	713,281,799
未払株式払込金	5,280,628
未払解約金	4,450,406
未払利息	57
その他未払費用	6
流動負債合計	723,012,896
負債合計	723,012,896
純資産の部	
元本等	
元本	37,634,708,275
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,441,279,699
元本等合計	68,075,987,974
純資産合計	68,075,987,974
負債純資産合計	68,799,000,870

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2018年 9月 5日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	37,634,708,275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 1.8089円 (1万口当たり純資産額) (18,089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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2018年 9月 5日現在
期首	2017年12月19日
期首元本額	35,089,217,430円
期中追加設定元本額	6,235,617,588円
期中一部解約元本額	3,690,126,743円
期末元本額	37,634,708,275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
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,712,520,191円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,209,216円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,574,059,460円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,653,049,040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	722,581,708円
分散投資コア戦略ファンドS	1,575,265,242円
コア投資戦略ファンド（切替型）	589,677,448円
SMT インデックスバランス・オープン	208,862,938円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	535,720,065円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	804,954円
グローバル経済コア	411,823,940円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,457,185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）	538,854,249円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	528,464,467円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	796,980,077
合計	796,980,077

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2018年 9月 5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 アメリカドル				
		80,205,200	-	80,281,700	76,500
		80,205,200	-	80,281,700	76,500
	合計	80,205,200	-	80,281,700	76,500

(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	1,136,149.40	
		AGREE REALTY CORP	17,490	989,934.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	38,120	877,141.20	
		ALEXANDER'S INC	2,050	731,850.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	54,060	6,810,478.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,370	868,627.10	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	72,140	2,996,695.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	137,010	3,140,269.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST	24,000	597,120.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	84,183	3,661,118.67	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	109,243	1,908,475.21	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	25,300	388,861.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	295,052.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,230	13,390,837.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	88,200.00	
		BOSTON PROPERTIES	81,900	10,575,747.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	166,315.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	89,498	1,487,456.76	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	163,350	2,945,200.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	49,180	4,637,674.00	
CARETRUST REIT INC	38,680	701,655.20			

CBL & ASSOCIATES PRTYS	86,840	376,017.20	
CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	145,692.00	
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	505,116.20	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	29,800	968,500.00	
CITY OFFICE REIT INC	20,000	254,800.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	86,870.00	
COLONY CAPITAL INC	248,970	1,523,696.40	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	64,270	1,527,055.20	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	297,790.00	
CORECIVIC INC	62,220	1,582,254.60	
CORESITRE REALTY CORP	19,430	2,232,118.40	
CORPORATE OFFICE PPTYS	55,120	1,659,663.20	
COUSINS PROPERTIES INC	212,193	1,969,151.04	
CUBESMART	98,310	2,967,978.90	
CYRUSONE INC	53,080	3,500,626.00	
DDR CORPORATION	84,059	1,152,448.89	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	105,350	1,236,809.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	109,130	13,474,281.10	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	85,940	3,293,220.80	
DUKE REALTY CORP	188,860	5,284,302.80	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	33,000	660,000.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	18,530	1,761,832.40	
EDUCATION REALTY TRUST INC	43,270	1,790,945.30	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	72,970	1,253,624.60	
EPR PROPERTIES	35,270	2,461,493.30	
EQUITY COMMONWEALTH	66,580	2,127,231.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	47,070	4,534,253.10	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	195,130	13,077,612.60	
ESSEX PROPERTY TRUST	35,260	8,599,561.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	66,290	6,092,051.00	
FARMLAND PARTNERS INC	13,000	89,830.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	38,750	5,009,600.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	65,170	2,074,361.10	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	143,060	3,586,514.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	31,500	844,830.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	454,072.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	105,260	3,747,256.00	
GEO GROUP INC/THE	61,800	1,554,888.00	
GETTY REALTY CORP	17,300	498,932.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	292,950.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	66,300.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	89,300.00	

GLOBAL NET LEASE INC	39,000	837,330.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	56,710	940,818.90	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	87,800	2,404,842.00	
HCP INC	246,750	6,548,745.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	68,650	2,082,154.50	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	110,530	3,103,682.40	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	412,870.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,710	2,653,982.10	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	87,160	2,495,390.80	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	395,850	8,399,937.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	82,820	2,753,765.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	514,000.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,000	237,000.00	
INFRAREIT INC	19,000	393,870.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	345,006.00	
INVITATION HOMES INC	150,470	3,484,885.20	
IRON MOUNTAIN INC	148,830	5,409,970.50	
ISTAR INC	35,000	386,750.00	
JBG SMITH PROPERTIES	49,300	1,824,100.00	
KILROY REALTY CORPORATION	52,840	3,803,423.20	
KIMCO REALTY CORP	227,110	3,851,785.60	
KITE REALTY GROUP TRUST	41,390	713,149.70	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	58,940	2,063,489.40	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	106,456	944,264.72	
LIBERTY PROPERTY TRUST	79,450	3,407,610.50	
LIFE STORAGE INC	25,370	2,445,668.00	
LTC PROPERTIES INC	19,700	896,941.00	
MACERICH CO/THE	57,130	3,278,690.70	
MACK-CALI REALTY CORP	47,270	993,615.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	650,080	546,067.20	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	18,500	193,510.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	196,820	2,938,522.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,830	6,163,088.30	
MONMOUTH REIT -CL A	42,460	720,970.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	82,270	3,764,675.20	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	875,557.80	
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,390	1,743,957.10	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	244,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	317,000.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	401,575.86	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	106,746	3,496,998.96	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	225,280.00	

PARAMOUNT GROUP INC	110,170	1,719,753.70	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	107,710	3,564,123.90	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35,900	1,367,790.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	319,700.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	95,870	1,648,005.30	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,350	1,358,566.50	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	17,500	302,400.00	
PROLOGIS INC	332,801	22,041,410.23	
PS BUSINESS PARKS INC	10,900	1,414,820.00	
PUBLIC STORAGE	79,320	16,903,092.00	
QTS REALTY TRUST INC	25,240	1,136,052.40	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	39,850	542,358.50	
REALTY INCOME CORP	151,800	8,860,566.00	
REGENCY CENTERS CORP	78,010	5,078,451.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,150	1,208,196.00	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	118,480	1,482,184.80	
RETAIL VALUE	8,405	291,233.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	49,590	1,561,093.20	
RLJ LODGING TRUST	91,870	1,991,741.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,930	2,328,098.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	97,490	2,277,366.40	
SAUL CENTERS INC	6,700	397,779.00	
SELECT INCOME REIT	36,490	731,989.40	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	124,370	2,324,475.30	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	14,500	732,975.00	
SIMON PROPERTY GROUP	163,650	29,756,479.50	
SL GREEN REALTY CORP	46,840	4,814,683.60	
SPIRIT MTA REIT	23,901	253,589.61	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	215,600	1,789,480.00	
STAG INDUSTRIAL INC	52,790	1,496,068.60	
STORE CAPITAL CORP	93,760	2,714,352.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	54,080	722,508.80	
SUN COMMUNITIES INC	42,510	4,374,279.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	117,150	1,925,946.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,110	1,151,138.40	
TAUBMAN CENTERS INC	32,640	2,065,785.60	
TERRENO REALTY CORP	30,340	1,130,165.00	
TIER REIT INC	26,300	620,943.00	
UDR INC	140,890	5,579,244.00	
UMH PROPERTIES INC	14,000	219,660.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	436,623.90	

	URBAN EDGE PROPERTIES	54,720	1,226,822.40
	URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	368,940.00
	VENTAS INC	188,990	11,197,657.50
	VEREIT INC	517,070	4,002,121.80
	VORNADO REALTY TRUST	90,850	6,854,632.50
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	788,322.50
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	42,580	1,332,754.00
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	61,770	1,887,073.50
	WELLTOWER INC	197,140	13,056,582.20
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	4,000	23,040.00
	WHITESTONE REIT	22,610	304,556.70
	WP CAREY INC	57,530	3,790,651.70
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,410	1,306,567.80
	アメリカドル 小計	12,096,491	439,135,322.00 (48,972,371,109)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	6,400	88,000.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	25,510	1,111,470.70
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	536,479.20
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,100	543,678.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	35,850	1,658,421.00
	CHOICE PROPERTIES REIT	74,430	919,954.80
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	640,770.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	286,676.37
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	192,282.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	50,000	721,500.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	21,000	212,310.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	460,901.80
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,940	659,685.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,130	1,530,974.30
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	26,000	294,580.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	284,220.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	129,080.40
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	168,392.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	401,968.42
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	23,000	258,290.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	82,320	2,081,049.60
	SLATE OFFICE REI	17,000	133,450.00

	SLATE RETAIL REIT	10,300	132,149.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	33,810	1,042,024.20	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,000	176,200.00	
	カナダドル 小計	732,240	14,664,506.79 (1,240,763,919)	
ユーロ	AEDIFICA	9,300	760,740.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	73,000	940,240.00	
	ALTAREA	2,000	402,000.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,800	636,800.00	
	BENI STABILI SPA	547,000	413,532.00	
	COFINIMMO	11,400	1,265,400.00	
	COVIVIO	28,470	2,549,488.50	
	EUROCOMMERCIAL	27,040	879,881.60	
	GECINA SA	25,400	3,726,180.00	
	GREEN REIT PLC	377,170	579,333.12	
	HAMBORNER REIT AG	44,000	410,520.00	
	HIBERNIA REIT PLC	332,550	498,825.00	
	ICADE	23,800	1,989,680.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	19,790	129,248.49	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	183,000	1,712,880.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	8,000	182,800.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	190,000	285,000.00	
	KLEPIERRE	111,820	3,382,555.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	46,392	410,105.28	
	MERCIALYS	28,020	390,038.40	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	176,470	2,086,757.75	
	NSI NV	9,200	317,860.00	
	RETAIL ESTATES	3,600	276,480.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	71,520	12,524,582.40	
	VASTNED RETAIL	8,500	293,675.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,600	1,049,200.00	
	WERELDHAVE NV	21,780	677,793.60	
	ユーロ 小計	2,400,622	38,771,596.14 (5,008,514,789)	
イギリスポンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	39,000	37,167.00	
	ASSURA PLC	1,167,980	630,709.20	
	BIG YELLOW GROUP PLC	77,290	730,390.50	
	BRITISH LAND CO PLC	530,380	3,322,300.32	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	130,210.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,000	103,390.00	
	DERWENT LONDON PLC	59,570	1,798,418.30	

	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	290,000	283,620.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	152,000	1,082,696.00	
	HAMMERSON PLC	426,770	1,954,606.60	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	193,580	193,580.00	
	INTU PROPERTIES PLC	471,100	726,671.75	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	394,850	3,593,135.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	378,110	690,050.75	
	LXI REIT PLC	100,000	112,000.00	
	NEWRIVER REIT PL	173,000	439,420.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	388,000	439,992.00	
	RDI REIT PLC	772,000	256,304.00	
	REGIONAL REIT LTD	170,000	162,860.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	108,990	580,916.70	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	159,500.00	
	SEGRE PLC	536,430	3,518,980.80	
	SHAFTESBURY PLC	132,430	1,217,693.85	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	738,900	1,120,172.40	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	354,000	317,892.00	
	UNITE GROUP PLC	138,000	1,213,020.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,420	769,100.40	
	イギリスポンド 小計	8,502,800	25,584,797.57 (3,668,092,427)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	159,010	559,715.20	
	ARENA REIT	141,000	328,530.00	
	BWP TRUST	247,960	813,308.80	
	CHARTER HALL GROUP	231,600	1,669,836.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	101,000	429,250.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	817,615.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	855,940	950,093.40	
	DEXUS	531,310	5,711,582.50	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	291,678.00	
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	363,855.00	
	GOODMAN GROUP	854,140	9,062,425.40	
	GPT GROUP	953,710	4,921,143.60	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	135,200	501,592.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	245,700.00	
	INDUSTRIA REIT	75,000	199,500.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,000	270,000.00	
	INVESTA OFFICE FUND	247,180	1,314,997.60	
	MIRVAC GROUP	1,978,730	4,927,037.70	
	NATIONAL STORAGE REIT	333,729	565,670.65	
	PROPERTYLINK GROUP	207,000	219,420.00	
RURAL FUNDS GROUP	158,600	345,748.00		

	SCENTRE GROUP	2,827,380	11,761,900.80	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	392,000	944,720.00	
	STOCKLAND	1,279,290	5,309,053.50	
	VICINITY CENTERS	1,726,080	4,781,241.60	
	VIVA ENERGY REIT	230,000	503,700.00	
	オーストラリアドル 小計	14,416,539	57,809,314.75 (4,628,791,832)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	454,425.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	500,000	755,000.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	102,000	157,080.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,076,400.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	530,000	763,200.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	174,000	337,560.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	391,791.40	
	ニュージーランドドル 小計	2,688,460	3,935,456.40 (286,934,126)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,133,000	6,526,080.00	
	FORTUNE REIT	739,000	7,042,670.00	
	LINK REIT	1,136,500	89,158,425.00	
	PROSPERITY REIT	592,000	1,858,880.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	483,000	1,647,030.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000	2,855,080.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	600,000	3,210,000.00	
	香港ドル 小計	5,204,500	112,298,165.00 (1,595,756,924)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	340,000	476,000.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	348,000	278,400.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,275,566	3,482,295.18	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	760,100.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	518,200	388,650.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,399,528	2,463,169.28	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,431,300	3,077,295.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	316,560	459,012.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	385,900	602,004.00	
	ESR REIT	804,679	402,339.50	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	309,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	432,640.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	293,800	672,802.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	504,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	824,020	906,422.00	

	KEPPEL DC REIT	519,460	706,465.60	
	KEPPEL REIT	955,300	1,155,913.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	267,120.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,024,530	1,659,738.60	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	645,760	1,297,977.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,212,652	1,552,194.56	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,181,900	1,359,185.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	590,000	445,450.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	534,600.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	200,986.80	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	200,750.00	
	SPH REIT	322,300	320,688.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	490,878.50	
	SUNTEC REIT	1,189,900	2,237,012.00	
	シンガポールドル 小計	20,106,395	27,643,689.12 (2,240,244,566)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	83,370	1,246,381.50	
	イスラエルシェケル 小計	83,370	1,246,381.50 (38,413,477)	
	合計	66,231,417	67,679,883,169 (67,679,883,169)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 159銘柄	100.0%	72.4%
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%	7.4%
イギリスポンド	投資証券 27銘柄	100.0%	5.4%
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%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2018年9月6日から2019年3月5日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2018年 9月 5日現在）	第2期中間計算期間 （2019年 3月 5日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	506,042	1,409,953
親投資信託受益証券	41,379,142	65,338,051
流動資産合計	41,885,184	66,748,004
資産合計	41,885,184	66,748,004
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	3,229
未払受託者報酬	4,507	13,961
未払委託者報酬	40,567	125,591
未払利息	1	2
その他未払費用	424	1,330
流動負債合計	45,499	144,113
負債合計	45,499	144,113
純資産の部		
元本等		
元本	41,952,087	66,459,206
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	112,402	144,685
（分配準備積立金）	360,571	320,045
元本等合計	41,839,685	66,603,891
純資産合計	41,839,685	66,603,891
負債純資産合計	41,885,184	66,748,004

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年12月19日 至 2018年 6月18日	第2期中間計算期間 自 2018年 9月 6日 至 2019年 3月 5日
営業収益		
有価証券売買等損益	45,873	930,174
営業収益合計	45,873	930,174
営業費用		
支払利息	78	252
受託者報酬	6,243	13,961
委託者報酬	56,095	125,591
その他費用	567	1,332
営業費用合計	62,983	141,136
営業利益又は営業損失（ ）	17,110	789,038
経常利益又は経常損失（ ）	17,110	789,038
中間純利益又は中間純損失（ ）	17,110	789,038
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	21,375	20,149
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	112,402
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,296	23,061
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,296	23,061
剰余金減少額又は欠損金増加額	275,673	534,863
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	275,673	534,863
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	270,112	144,685

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年 9月 5日現在)	第2期中間計算期間 (2019年 3月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,952,087口	66,459,206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 112,402円	元本の欠損 - 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 0.9973円 (1万口当たり純資産額) (9,973円)	1口当たり純資産額 1.0022円 (1万口当たり純資産額) (10,022円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第2期中間計算期間 (2019年 3月 5日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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

	第2期中間計算期間 (2019年 3月 5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>

（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12月19日 至 2018年 9月 5日	第2期中間計算期間 自 2018年 9月 6日 至 2019年 3月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	41,952,087円
期中追加設定元本額	44,009,649円	30,639,140円
期中一部解約元本額	2,557,562円	6,132,021円

（デリバティブ取引に関する注記）

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、中間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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,257,013,966
国債証券	370,380,547,850
地方債証券	24,673,290,052
特殊債券	31,130,496,813
社債券	18,073,468,350
未収利息	1,119,362,277
前払費用	56,532,938
流動資産合計	446,690,712,246
資産合計	446,690,712,246
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	324
未払金	695,064,500
未払解約金	137,850,081
未払利息	2,116
その他未払費用	21
流動負債合計	832,917,042
負債合計	832,917,042
純資産の部	
元本等	
元本	317,502,374,764
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	128,355,420,440
元本等合計	445,857,795,204
純資産合計	445,857,795,204
負債純資産合計	446,690,712,246

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2019年 3月 5日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	317,502,374,764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 101,361,000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 1.4043円 (1万口当たり純資産額) (14,043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）

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	293,713,040,447円
期中追加設定元本額	38,076,698,763円
期中一部解約元本額	14,287,364,446円
期末元本額	317,502,374,764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）	3,849,901,293円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,083,981円
S M T 国内債券インデックス・オープン	14,619,066,611円
世界経済インデックスファンド	1,841,038,176円
D C マイセレクション 2 5	19,782,785,887円
D C マイセレクション 5 0	21,697,651,353円
D C マイセレクション 7 5	5,824,159,189円
D C 日本債券インデックス・オープン	452,202,454円
D C 日本債券インデックス・オープン S	81,429,061,638円
D C 日本債券インデックス・オープン P	37,508,320,276円
D C マイセレクション S 2 5	7,921,456,946円
D C マイセレクション S 5 0	8,744,195,271円
D C マイセレクション S 7 5	1,692,027,263円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,154,399,738円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,229,571,013円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	409,588,489円
D C 世界経済インデックスファンド	1,543,000,111円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	88,895,046円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	7,759,987円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,298,500円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	14,273,337円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	232,588,422円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	348,017,443円

区分	2019年 3月 5日現在
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	67,124,797円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	173,746,104円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	4,587,554,331円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	988,418,779円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,716,232,974円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	846,160,847円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	116,939,769円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,335,861,486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）	78,877,499円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,508,832,727円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,930,487,080円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	171,944,898円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,432,200,301円
日本債券ファンド・シリーズ 1	10,069,683,041円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	62,839,450円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	740,998,675円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	60,708,946円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,809,489円
S M T インデックスバランス・オープン	67,567,957円
S M T 世界経済インデックス・オープン	7,928,396円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	11,425,732円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	20,128,239円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,661,034円
グローバル経済コア	245,305,023円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	8,547,195円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	347,590円
F O F s 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）	73,756,606,508円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 3月 5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	152,510,000	-	152,510,000	-
合計		152,510,000	-	152,510,000	-

(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。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,185,622,984
株式	274,657,946,770
派生商品評価勘定	8,231,220
未収入金	133,342,480
未収配当金	455,987,003
流動資産合計	278,441,130,457
資産合計	278,441,130,457
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	779,900
前受金	7,455,100
未払金	15,749,320
未払解約金	64,356,293
未払利息	5,364
その他未払費用	55
流動負債合計	88,346,032
負債合計	88,346,032
純資産の部	
元本等	
元本	188,985,235,186
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,367,549,239
元本等合計	278,352,784,425
純資産合計	278,352,784,425
負債純資産合計	278,441,130,457

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2019年 3月 5日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2019年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	188,985,235,186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 1.4729円 (1万口当たり純資産額) (14,729円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2019年 3月 5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>

	2019年 3月 5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>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	141,877,070,550円
期中追加設定元本額	55,776,299,624円
期中一部解約元本額	8,668,134,988円
期末元本額	188,985,235,186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）	637,805,103円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,924,471,634円
SBI資産設計オープン（分配型）	16,263,605円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,990,631,506円
世界経済インデックスファンド	2,038,027,625円
日本株式インデックス・オープン	5,619,909,197円
DCマイセレクション25	6,655,593,927円
DCマイセレクション50	18,951,556,424円
DCマイセレクション75	17,457,626,247円
DC日本株式インデックス・オープン	5,533,066,697円
DCマイセレクションS25	2,663,350,045円
DCマイセレクションS50	7,636,631,847円
DCマイセレクションS75	5,066,850,524円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,230,835,710円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	370,132,701円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	624,949,650円

区分	2019年 3月 5日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	408,706,487円
DC世界経済インデックスファンド	1,704,426,979円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,143,444,770円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	24,499,948円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	45,683,915円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	42,809,598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)	324,004,305円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,717,839円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	116,751,287円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	434,268,028円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	66,779,727円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	592,623,540円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,006,821,953円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	786,793,355円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,496,134,985円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	673,489,280円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	50,765,343円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	888,594,571円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	106,833,188円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	494,339,588円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	643,060,660円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	57,788,489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)	920,607,740円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,163,043,332円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,233,697,492円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	944,401,874円
分散投資コア戦略ファンドS	2,050,884,876円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	222,779,029円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	256,249,010円
コア投資戦略ファンド(切替型)	571,766,575円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	231,255,428円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,250,357円
SMT インデックスバランス・オープン	75,593,342円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	12,880,339,251円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	740,838,148円
SMT 世界経済インデックス・オープン	10,030,028円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	54,647,032円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	7,412,088円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,712,071円
グローバル経済コア	330,001,193円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,910,845円

区分	2019年 3月 5日現在
i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	40,255,401円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	768,333円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	65,407,914円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,030,423円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	50,074,365,350円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	692,448,571円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 3月 5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	3,580,489,900	-	3,587,945,000	7,455,100
	合計	3,580,489,900	-	3,587,945,000	7,455,100

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,086,187,040
コール・ローン	1,946,189,856
国債証券	279,470,436,589
派生商品評価勘定	11,624,025
未収入金	3,414,586,719
未収利息	1,732,697,737
前払金	3,321,641
前払費用	244,641,451
差入委託証拠金	146,712,786
流動資産合計	289,056,397,844
資産合計	289,056,397,844
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,944,620
前受収益	619,451
未払金	10,791,111,557

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
未払解約金	476,051,648
未払利息	3,277
その他未払費用	46
流動負債合計	11,272,730,599
負債合計	11,272,730,599
純資産の部	
元本等	
元本	101,005,136,771
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	176,778,530,474
元本等合計	277,783,667,245
純資産合計	277,783,667,245
負債純資産合計	289,056,397,844

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	2019年 3月 5日現在
	<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 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,005,136,771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) 2.7502円 (27,502円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 3月 5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>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	94,658,753,152円
期中追加設定元本額	17,988,213,745円
期中一部解約元本額	11,641,830,126円
期末元本額	101,005,136,771円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,869,856,299円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	763,472,046円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	511,607,997円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,028,525,207円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,388,778円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,216,834,898円
世界経済インデックスファンド	6,574,684,965円
DCマイセレクション25	1,636,330,277円
DCマイセレクション50	1,244,002,620円
DCマイセレクション75	796,884,464円
DC外国債券インデックス・オープン	1,808,504,116円
DCマイセレクションS25	654,648,869円
DCマイセレクションS50	503,954,215円
DCマイセレクションS75	231,413,598円
DCターゲット・イヤーフンド2025	49,466,672円
DCターゲット・イヤーフンド2035	63,310,240円
DCターゲット・イヤーフンド2045	30,056,994円
DC世界経済インデックスファンド	5,419,925,539円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	624,884,260円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,367,822円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,994,944円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,938,498円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	60,710,839円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	136,893,547円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	215,658,729円

区分	2019年 3月 5日現在
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	172,683,562円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	510,798,262円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,325,723,970円
バランス B (3 7 . 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	635,331,008円
バランス C (5 0) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,252,358,468円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	907,033,469円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	95,717,988円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	662,712,535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)	102,223,098円
バランス E (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	253,048,759円
バランス F (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	322,269,991円
F O F s 用 外国債券オープン (適格機関投資家専用)	1,052,023,205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)	958,462,227円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	886,613,594円
外国債券ファンド・シリーズ 1	453,677,449円
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,122,708,371円
コア投資戦略ファンド (成長型)	3,562,953,450円
分散投資コア戦略ファンド A	937,004,351円
分散投資コア戦略ファンド S	2,768,278,733円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	234,258,741円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	2,489,841,657円
コア投資戦略ファンド (切替型)	488,549,502円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	243,489,118円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	111,309,545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)	1,021,517,082円
S M T インデックスバランス・オープン	242,155,864円
外国債券 S M T B セレクション (S M A 専用)	22,378,094,153円
S M T 世界経済インデックス・オープン	49,026,735円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	88,813,548円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	113,713,906円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	894,363円
グローバル経済コア	1,028,106,591円
S B I 資産設計オープン (つみたて N I S A 対応型)	4,629,119円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	44,381円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	56,553,181円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	10,204,633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)	813,201,123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)	10,709,414,505円
外国債券インデックス・ファンド (適格機関投資家専用)	355,193,552円
外国債券インデックス・ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	9,085,186,549円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2019年 3月 5日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,249,297,037	-	1,245,975,396	3,321,641
	合計	1,249,297,037	-	1,245,975,396	3,321,641

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 3月 5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	7,073,283,338	-	7,083,189,317	9,905,979
	アメリカドル	3,404,933,831	-	3,412,128,747	7,194,916
	カナダドル	180,626,141	-	180,602,266	23,875
	メキシコペソ	45,307,465	-	45,252,778	54,687
	ユーロ	2,653,135,140	-	2,654,904,267	1,769,127
	イギリスポンド	497,364,361	-	498,475,779	1,111,418
	スウェーデンク ローナ	27,513,883	-	27,520,779	6,896
	ノルウェークロー ネ	13,028,576	-	13,019,507	9,069
	デンマーククロー ネ	28,355,932	-	28,359,269	3,337
	ポーランドズロチ	35,540,441	-	35,516,355	24,086
	オーストラリアド ル	117,570,662	-	117,567,817	2,845
	シンガポールドル	9,737,269	-	9,736,551	718
	マレーシアリン ギット	28,079,272	-	28,051,670	27,602
	南アフリカランド	32,090,365	-	32,053,532	36,833
	売建	86,796,480	-	86,701,413	95,067
	アメリカドル	68,608,202	-	68,540,825	67,377
	南アフリカランド	18,188,278	-	18,160,588	27,690
	合計	7,160,079,818	-	7,169,890,730	10,001,046

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,336,790,337
コール・ローン	258,888,688
株式	340,669,220,814
投資信託受益証券	258,789,356
投資証券	8,885,667,700
派生商品評価勘定	490,145,749
未収入金	2,039,615
未収配当金	677,167,499
差入委託証拠金	3,398,248,811
流動資産合計	358,976,958,569
資産合計	358,976,958,569
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	239,622
前受金	489,318,162
未払金	59,552,942
未払解約金	407,152,900
未払利息	435
その他未払費用	6
流動負債合計	956,264,067
負債合計	956,264,067
純資産の部	
元本等	
元本	140,677,191,492
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,343,503,010
元本等合計	358,020,694,502
純資産合計	358,020,694,502
負債純資産合計	358,976,958,569

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

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

	2019年 3月 5日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,677,191,492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 2.5450円 (1万口当たり純資産額) (25,450円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	136,773,118,514円
期中追加設定元本額	10,898,503,609円
期中一部解約元本額	6,994,430,631円
期末元本額	140,677,191,492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）	2,427,902,987円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,075,655円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,397,179,639円
世界経済インデックスファンド	7,613,218,324円
外国株式インデックス・オープン	1,049,907,565円
D C マイセレクション 2 5	1,066,362,172円
D C マイセレクション 5 0	4,910,264,959円
D C マイセレクション 7 5	5,183,443,985円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,207,761,731円
D C マイセレクション S 2 5	424,730,035円
D C マイセレクション S 5 0	1,970,094,859円
D C マイセレクション S 7 5	1,500,388,047円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	108,459,895円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	183,136,935円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	119,765,020円
D C 世界経済インデックスファンド	6,312,891,401円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,819,695,012円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	11,853,754円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,713,118円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	57,911,756円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	68,607,326円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	251,498,977円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	39,144,261円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	347,330,956円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	803,018,260円

区分	2019年 3月 5日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	403,327,925円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,650,222,525円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,958,157,943円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	88,561,616円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	395,676,820円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	25,207,741円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	132,093,803円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,084,566,379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）	2,267,385,649円
外国株式ファンド・シリーズ1	902,571,887円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,732,226,780円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,121,354,361円
分散投資コア戦略ファンドA	2,229,932,989円
分散投資コア戦略ファンドS	4,670,801,195円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	828,711,378円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	978,321,857円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,233,693,136円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	863,909,857円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,693,422円
SMT インデックスバランス・オープン	285,158,523円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,859,004,974円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	31,167,740,211円
SMT 世界経済インデックス・オープン	57,915,525円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	314,086,095円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	44,387,207円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,052,186円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	37,723,182円
グローバル経済コア	1,186,414,209円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,463,521円
DCターゲット・イヤーフンド2055	225,161円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	142,492,604円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,483,318円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,548,369,329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）	1,319,732,830円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,155,168,725円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 3月 5日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,409,537,969	-	7,898,856,131	489,318,162
	合計	7,409,537,969	-	7,898,856,131	489,318,162

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 3月 5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 売建	419,221,655	-	418,633,690	587,965
	アメリカドル	251,367,940	-	251,310,190	57,750
	ユーロ	59,609,160	-	59,614,800	5,640
	イギリスポンド	71,893,975	-	71,498,700	395,275
	デンマーククローネ	36,350,580	-	36,210,000	140,580
	合計	419,221,655	-	418,633,690	587,965

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,613,528,116
投資証券	105,789,459,480
派生商品評価勘定	99,166,000
未収入金	562,741,514

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
未収配当金	1,427,459,292
差入委託証拠金	47,782,500
流動資産合計	109,540,136,902
資産合計	109,540,136,902
負債の部	
流動負債	
前受金	99,166,000
未払金	902,764,870
未払解約金	70,411,903
未払利息	2,717
その他未払費用	30
流動負債合計	1,072,345,520
負債合計	1,072,345,520
純資産の部	
元本等	
元本	60,719,982,445
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,747,808,937
元本等合計	108,467,791,382
純資産合計	108,467,791,382
負債純資産合計	109,540,136,902

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2019年 3月 5日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	60,719,982,445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 1.7864円 (1万口当たり純資産額) (17,864円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	63,794,633,470円
期中追加設定元本額	4,938,760,576円
期中一部解約元本額	8,013,411,601円
期末元本額	60,719,982,445円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,649,079,250円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,820,750円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,182,042,880円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	29,645,829,112円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,601,763,434円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,422,371,829円
分散投資コア戦略ファンドA	2,140,714,592円
分散投資コア戦略ファンドS	3,427,230,601円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,142,254,720円
S M T インデックスバランス・オープン	33,173,922円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	676,436,513円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,418,364円
グローバル経済コア	353,386,444円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,694,119円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	133,568,961円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	24,030,670円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,204,145,953円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	1,081,860,029円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	990,160,302円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2019年 3月 5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	2,472,086,500	-	2,571,252,500	99,166,000

合計	2,472,086,500	-	2,571,252,500	99,166,000
----	---------------	---	---------------	------------

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	639,061,988
コール・ローン	92,082,249
投資証券	75,439,579,633
派生商品評価勘定	1,320
未収入金	1,449,874
未収配当金	83,766,813
流動資産合計	76,255,941,877
資産合計	76,255,941,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,810
未払金	234,201,862
未払解約金	55,485,486
未払利息	155
流動負債合計	289,724,313
負債合計	289,724,313
純資産の部	
元本等	
元本	40,648,706,567
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,317,510,997
元本等合計	75,966,217,564
純資産合計	75,966,217,564
負債純資産合計	76,255,941,877

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 3月 5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>

	2019年 3月 5日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,648,706,567口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8688円 (1万口当たり純資産額) (18,688円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 3月 5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

	2019年 3月 5日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)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>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	37,634,708,275円
期中追加設定元本額	5,709,446,760円
期中一部解約元本額	2,695,448,468円
期末元本額	40,648,706,567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)	151,639,194円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,668,155,372円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,919,299円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,714,154,767円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	20,242,799,978円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,191,545,701円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,670,638,018円

区分	2019年 3月 5日現在
分散投資コア戦略ファンドA	903,893,874円
分散投資コア戦略ファンドS	2,009,124,245円
コア投資戦略ファンド（切替型）	536,489,546円
SMT インデックスバランス・オープン	193,441,141円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	585,025,951円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,403,803円
グローバル経済コア	347,433,238円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,732,666円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	62,867,670円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,859,333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）	685,154,065円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	655,428,706円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 3月 5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	104,009,010	-	103,972,200	36,810
	アメリカドル	99,732,510	-	99,697,200	35,310
	香港ドル	4,276,500	-	4,275,000	1,500
	売建	52,306,320	-	52,305,000	1,320
	オーストラリアドル	52,306,320	-	52,305,000	1,320
合計		156,315,330	-	156,277,200	35,490

(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。

2【ファンドの現況】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

【純資産額計算書】

（2019年 3月29日現在）

資産総額	69,356,439円
負債総額	24,394円
純資産総額（ - ）	69,332,045円
発行済口数	68,736,940口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0087円
（1万口当たり純資産額）	（10,087円）

（参考）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 3月29日現在）

資産総額	459,871,406,296円
負債総額	5,675,116,877円
純資産総額（ - ）	454,196,289,419円
発行済口数	320,377,051,148口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4177円
（1万口当たり純資産額）	（14,177円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 3月29日現在）

資産総額	279,046,188,071円
負債総額	929,758,051円
純資産総額（ - ）	278,116,430,020円
発行済口数	190,024,445,566口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4636円
（1万口当たり純資産額）	（14,636円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 3月29日現在)

資産総額	286,731,076,403円
負債総額	110,582,328円
純資産総額（ - ）	286,620,494,075円
発行済口数	103,488,400,121口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7696円
（1万口当たり純資産額）	（27,696円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 3月29日現在)

資産総額	354,526,707,101円
負債総額	152,699,932円
純資産総額（ - ）	354,374,007,169円
発行済口数	139,639,048,167口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5378円
（1万口当たり純資産額）	（25,378円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 3月29日現在)

資産総額	114,340,166,990円
負債総額	1,044,001,192円
純資産総額（ - ）	113,296,165,798円
発行済口数	61,604,710,729口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8391円
（1万口当たり純資産額）	（18,391円）

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 3月29日現在)

資産総額	78,170,720,840円
負債総額	258,874,734円
純資産総額（ - ）	77,911,846,106円
発行済口数	40,662,936,606口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9160円
（1万口当たり純資産額）	（19,160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ます。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年 3月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2019年 6月 5日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年3月29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	523	11,941,892
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	393,318
単位型公社債投資信託	0	0
合計	610	12,335,210

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

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

(単位:千円)

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
建物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
その他	1,759	"	2,677	"
計	362,567	"	392,342	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
（2）未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
（3）投資有価証券 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主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

有形固定資産

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

無形固定資産

476,662

投資その他の資産

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

固定資産合計

920,589

資産合計

32,413,396

負債の部

流動負債

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

固定負債

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

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

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

中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

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

法人税等合計
中間純利益

730,051

1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

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

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

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

重要な会計方針

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

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

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

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

影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末
（2018年9月30日）

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

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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

(4)投資有価証券

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

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

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

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

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

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

（関連情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

（共通支配下の取引等）

1．取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2．実施する会計処理の概要

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

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年 6月 5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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年 6月 1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2018年11月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2017年12月19日から2018年9月5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、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2018年9月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年4月26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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2018年9月6日から2019年3月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2019年3月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年9月6日から2019年3月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの2018年9月5日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表について中間監査は実施されていない。

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。