

## 【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】	2018年10月22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3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界経済インデックスファンド（株式シフト型）
【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】

世界経済インデックスファンド（株式シフト型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

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

### （６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2018年10月23日から2019年4月19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、当該時間を過ぎても

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、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

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、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。



###### DR(預託証券)とは

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

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

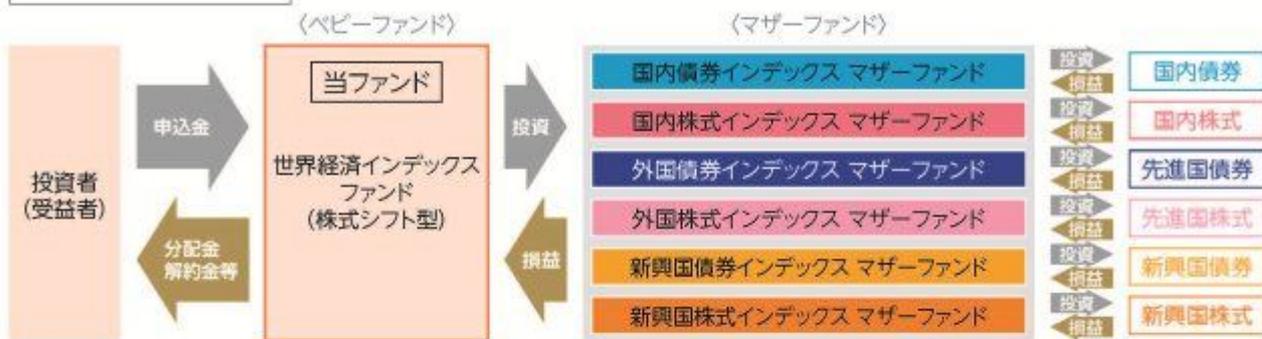
## &lt; ファンドの特色 &gt;

特色

## 1 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)への連動を目指す運用を行います。
- 原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



?

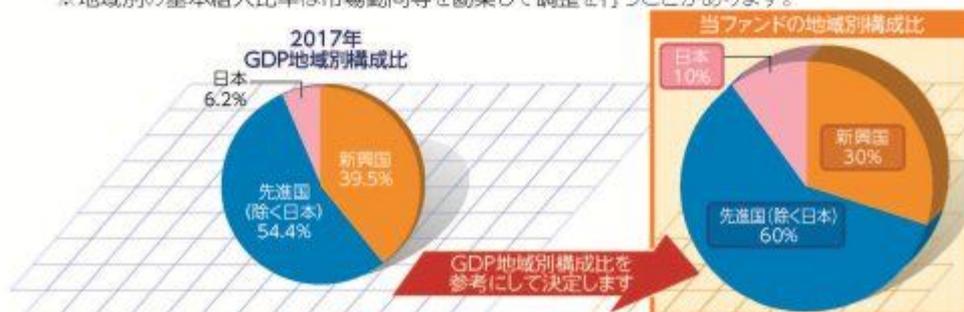
### ファミリーファンド方式とは

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。

特色

## 2 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定します。
- ※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。

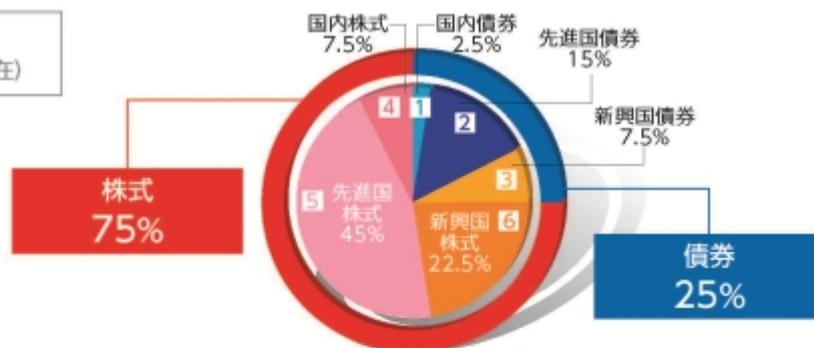


(出所)IMF[世界経済見通し2017年10月]のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%と異なる場合があります。

※上記のファンドの地域別構成比は、2018年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率  
(2018年8月末現在)

- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

資産

インデックス

① 国内債券	NOMURA-BPI総合 <sup>1</sup>
② 先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース） <sup>2</sup>
③ 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） <sup>3</sup>
④ 国内株式	TOPIX（東証株価指数） <sup>4</sup>
⑤ 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース） <sup>5</sup>
⑥ 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース） <sup>6</sup>

\* 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。

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

2「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。

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

4「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。

5「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。

6「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。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

### ポートフォリオ構築プロセス

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

#### 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。

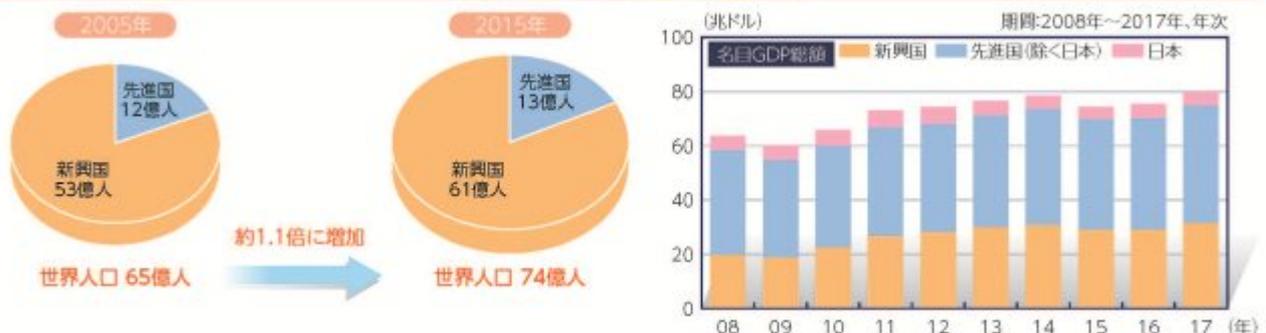
#### 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

#### 〈ご参考情報〉

##### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects (The 2017 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2018年4月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

- ※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。
- ※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
- ※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

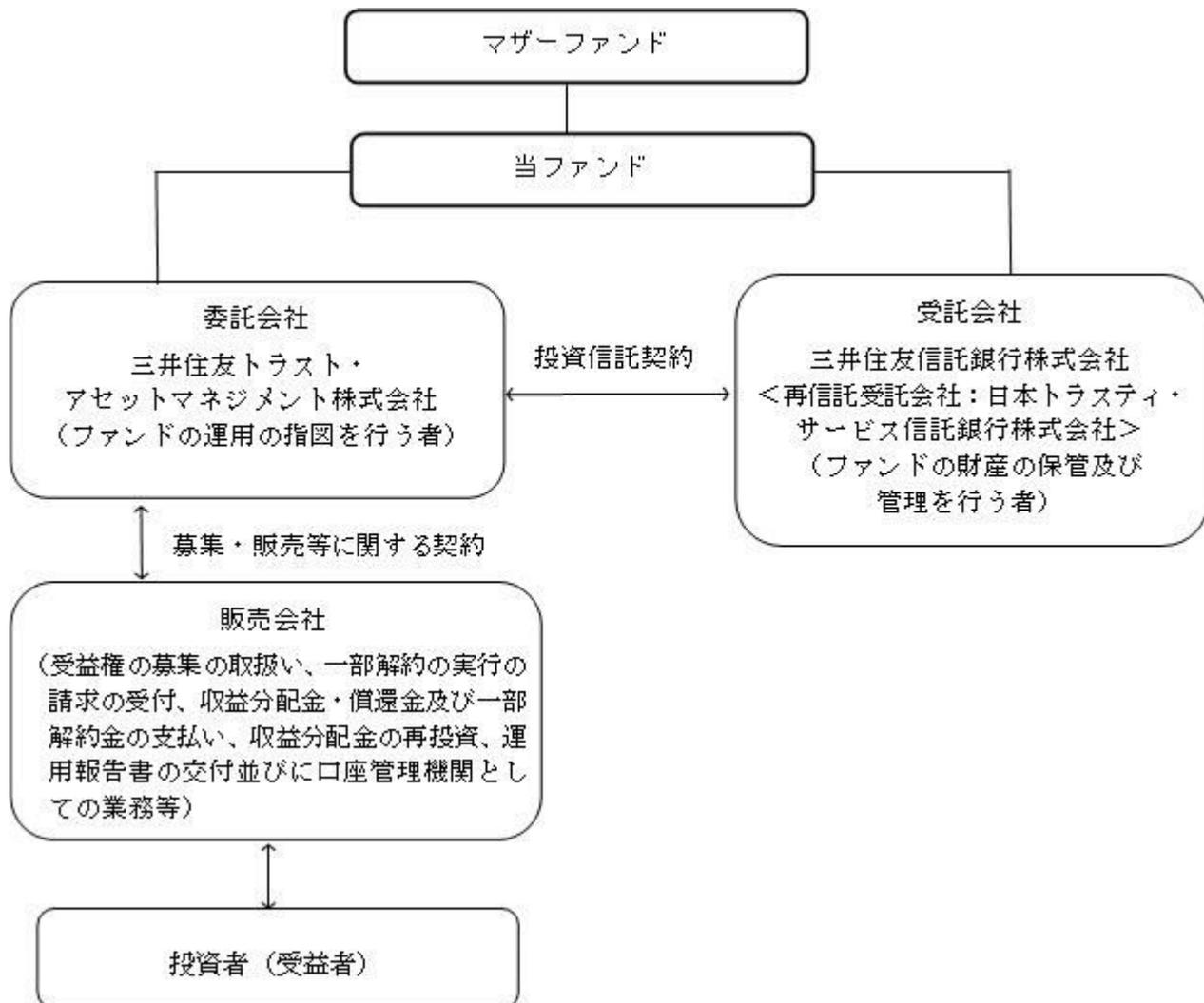
#### (2) 【ファンドの沿革】

2013年11月8日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2018年10月1日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### 基本方針

当ファンドは、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」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）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指して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への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。
- ロ．株式（DR（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式75%、債券25%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。
- ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ト．ただし、資金動向及び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21条、第22条及び第23条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7.から28.までの有価証券（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. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券又は新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 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。）
12. 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。）
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 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
18. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの
19. 証券投資信託又は外国証券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。）
20. 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。）
21. 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。）

22. 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。）
23. 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。）
24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
25. 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。）
26. 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。）
27. 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
28. 外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」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な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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目指して、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。

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

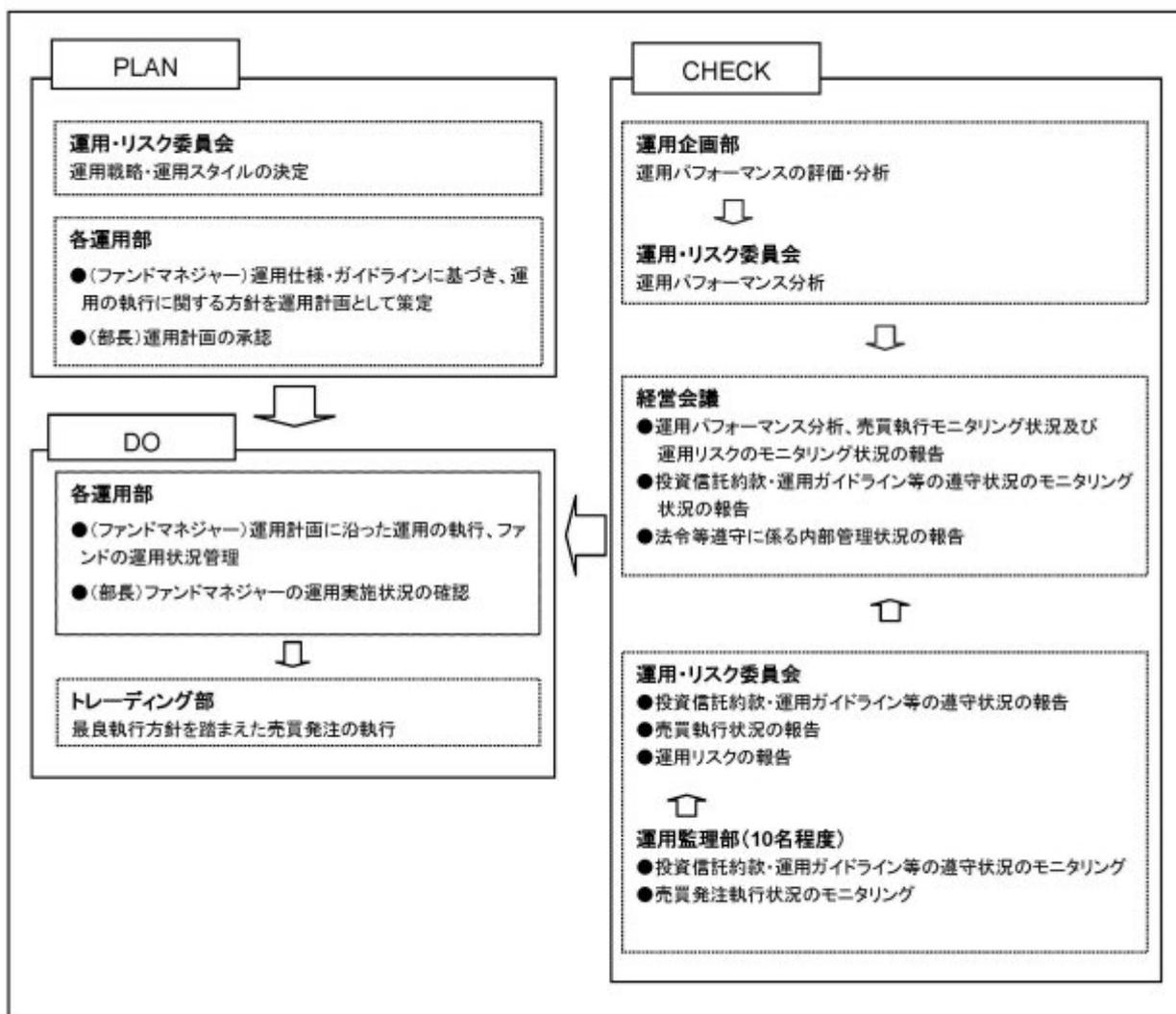
投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### <約款に定める投資制限>

- イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）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．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ．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、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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。前文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．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。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定め

るものを除きます。)の行使により取得可能な株券

- へ. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所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取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所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。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所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. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。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、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引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。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当ファンドの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。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ. 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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 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。
  2. 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。

- 又．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、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。
- ル．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。この指図は、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。
- ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ワ．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。また、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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ．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。
- ヨ．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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資

信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

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

##### カントリーリスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

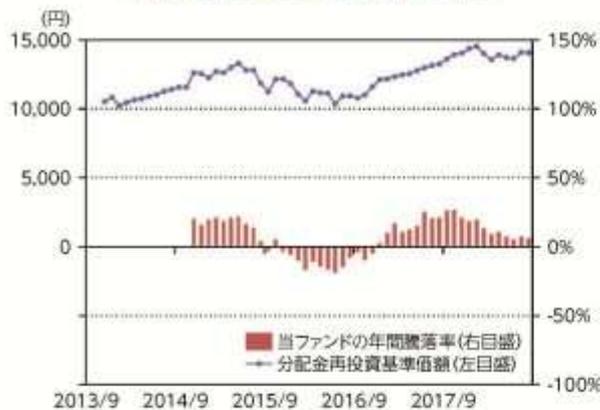
ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

## (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

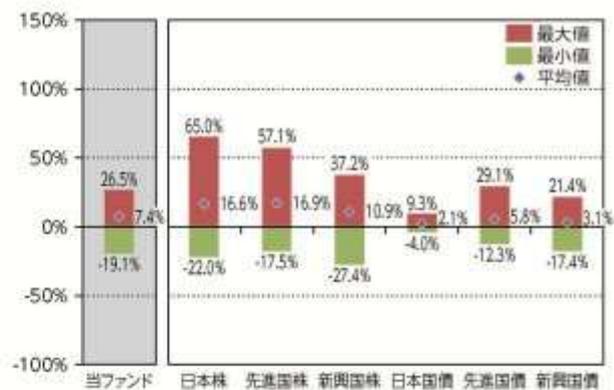
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*当ファンドについては2014年11月～2018年8月の3年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2013年9月～2018年8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)<sup>※1</sup>

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

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

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

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

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

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

※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買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

じ。 )。

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

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

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

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

## ( 2 ) 【換金 ( 解約 ) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.594% ( 税抜 0.55% ) 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 0.2376% ( 税抜 0.22% )	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 0.3024% ( 税抜 0.28% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% ( 税抜 0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離

課税を選択したものに限り、)及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

## ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

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

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

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

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2018年 8月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2018年 8月31日現在の状況について記載してあります。

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

## （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	4,725,915,650	99.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		46,685,876	0.98
合計（純資産総額）		4,772,601,526	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	857,374,045	2.5609	2,195,685,764	2.6050	2,233,459,387	46.80
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	370,798,742	3.2074	1,189,302,988	2.8262	1,047,951,404	21.96
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	263,879,318	2.7652	729,694,963	2.7096	715,007,400	14.98
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	221,067,539	1.6736	369,980,028	1.5619	345,285,389	7.23
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	190,512,353	1.7764	338,427,564	1.5530	295,865,684	6.20
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	63,824,871	1.3837	88,314,546	1.3842	88,346,386	1.85

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2014年 1月20日)	283,066,086	283,066,086	10,633	10,633
第2期計算期間末	(2015年 1月20日)	1,276,473,972	1,276,473,972	12,115	12,115
第3期計算期間末	(2016年 1月20日)	2,569,972,114	2,569,972,114	10,633	10,633
第4期計算期間末	(2017年 1月20日)	3,606,790,136	3,606,790,136	12,202	12,202
第5期計算期間末	(2018年 1月22日)	4,732,719,412	4,732,719,412	14,734	14,734
	2017年 8月末日	4,139,758,602		13,252	
	9月末日	4,277,311,371		13,625	
	10月末日	4,414,358,493		13,936	
	11月末日	4,447,438,920		14,041	
	12月末日	4,603,174,814		14,372	
	2018年 1月末日	4,678,926,207		14,543	
	2月末日	4,546,141,718		13,995	
	3月末日	4,450,048,331		13,572	
	4月末日	4,617,924,701		13,918	
	5月末日	4,596,405,015		13,726	
	6月末日	4,591,985,354		13,648	
	7月末日	4,772,745,505		14,100	
	8月末日	4,772,601,526		14,073	

#### 【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	2013年11月 8日～2014年 1月20日	0
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0

#### 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第1期計算期間	2013年11月 8日～2014年 1月20日	6.3
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	13.9
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	12.2
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	14.8
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	20.8
第6期中間計算期間	2018年 1月23日～2018年 7月22日	3.9

(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	2013年11月 8日～2014年 1月20日	280,722,826	14,505,786	266,217,040
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	1,026,539,215	239,100,858	1,053,655,397
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	2,010,163,370	646,934,428	2,416,884,339
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	1,194,172,622	655,117,548	2,955,939,413
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	1,109,479,703	853,384,626	3,212,034,490
第6期中間計算期間	2018年 1月23日～2018年 7月22日	410,209,907	246,614,334	3,375,630,063

(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	335,238,537,450	82.60
地方債証券	日本	22,806,795,770	5.62
特殊債券	日本	29,118,951,895	7.17
社債券	日本	14,758,729,560	3.64
	フランス	1,098,432,000	0.27
	オーストラリア	500,520,000	0.12
	オランダ	200,788,000	0.05
	アメリカ	107,149,000	0.03
	イギリス	100,550,000	0.02
	スウェーデン	100,190,000	0.02
	小計	16,866,358,560	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,827,770,565	0.45
合計(純資産総額)		405,858,414,240	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	日本	300,760,000	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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	8,360,000,000	101.04	8,447,373,200	100.82	8,428,552,000	0.100	2023/3/20	2.08
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	100.69	5,578,392,200	0.100	2022/3/20	1.37
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	4,920,000,000	100.66	4,952,847,100	100.09	4,924,624,800	0.100	2028/3/20	1.21
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	100.53	4,805,573,000	0.100	2021/3/20	1.18
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.95	4,785,172,200	100.75	4,775,597,400	0.100	2022/9/20	1.18
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	4,220,000,000	103.49	4,367,486,200	103.24	4,356,770,200	0.500	2024/9/20	1.07
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,000,000,000	100.87	4,035,056,800	100.72	4,028,920,000	0.100	2022/6/20	0.99
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	103.42	3,940,568,700	103.01	3,924,871,500	1.200	2020/12/20	0.97
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,740,000,000	103.26	3,861,924,000	102.82	3,845,542,800	0.400	2025/6/20	0.95
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.55	3,630,071,600	100.44	3,625,920,100	0.100	2020/9/20	0.89
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	103.50	3,550,255,800	0.600	2023/12/20	0.87
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	100.37	3,533,164,800	100.28	3,530,032,000	0.100	2019/12/20	0.87
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	3,430,000,000	100.91	3,461,474,900	100.86	3,459,703,800	0.100	2023/6/20	0.85
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,400,000,000	100.88	3,429,920,000	100.42	3,414,450,000	0.100	2027/3/20	0.84
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	100.61	3,219,552,000	0.100	2021/9/20	0.79
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	100.76	3,234,492,300	100.18	3,215,906,400	0.100	2027/12/20	0.79
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,130,000,000	102.65	3,213,009,500	102.15	3,197,326,300	0.300	2025/12/20	0.79

日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.00	3,201,953,600	100.79	3,195,264,900	0.100	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	3,060,000,000	104.08	3,185,081,200	103.65	3,171,904,200	1.200	2021/6/20	0.78
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	3,150,000,000	101.05	3,183,075,000	100.58	3,168,364,500	0.100	2026/6/20	0.78
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	3,070,000,000	103.33	3,172,507,300	102.85	3,157,617,800	0.400	2025/9/20	0.78
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.42	3,153,345,000	100.33	3,150,644,600	0.100	2020/3/20	0.78
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	2,980,000,000	102.31	3,048,912,600	102.08	3,042,013,800	0.300	2024/12/20	0.75
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	2,920,000,000	104.04	3,037,968,000	103.62	3,025,704,000	1.000	2021/12/20	0.75
日本	国債証券	第386回利付国債（2年）	2,990,000,000	100.44	3,003,283,500	100.33	3,000,046,400	0.100	2020/3/15	0.74
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	100.49	2,974,622,400	0.100	2020/12/20	0.73
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	104.13	2,905,478,100	103.71	2,893,704,300	0.600	2024/6/20	0.71
日本	国債証券	第391回利付国債（2年）	2,850,000,000	100.42	2,862,090,800	100.42	2,861,998,500	0.100	2020/8/1	0.71
日本	国債証券	第389回利付国債（2年）	2,780,000,000	100.41	2,791,630,400	100.38	2,790,675,200	0.100	2020/6/1	0.69
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,750,000,000	101.08	2,779,868,800	100.64	2,767,600,000	0.100	2026/3/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.60
地方債証券	5.62
特殊債券	7.17
社債券	4.16
合計	99.55

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	2円		300,740,648	300,760,000	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。

## 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	218,807,465,970	98.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,428,840,444	1.10
合計(純資産総額)		221,236,306,414	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	2,617,585,000	1.18

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

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

## 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	1,074,100	6,988.41	7,506,259,660	6,930.00	7,443,513,000	3.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,069,100	681.48	4,135,970,268	670.80	4,071,152,280	1.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	392,500	7,802.30	3,062,403,421	10,300.00	4,042,750,000	1.83
日本	株式	ソニー	電気機器	591,900	5,213.58	3,085,918,110	6,348.00	3,757,381,200	1.70
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	622,200	5,126.58	3,189,758,600	4,950.00	3,079,890,000	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	659,600	4,536.16	2,992,053,750	4,381.00	2,889,707,600	1.31
日本	株式	キーエンス	電気機器	43,400	66,023.01	2,865,398,903	62,890.00	2,729,426,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	795,100	3,516.70	2,796,131,970	3,292.00	2,617,469,200	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,841,700	193.18	2,287,591,040	195.10	2,310,315,670	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	764,100	2,951.37	2,255,142,364	2,941.00	2,247,218,100	1.02

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	651,400	2,992.70	1,949,445,187	3,387.00	2,206,291,800	1.00
日本	株式	任天堂	その他製品	54,400	41,914.52	2,280,150,212	40,160.00	2,184,704,000	0.99
日本	株式	三菱商事	卸売業	610,700	3,039.48	1,856,212,034	3,171.00	1,936,529,700	0.88
日本	株式	花王	化学	217,300	8,423.84	1,830,501,716	8,625.00	1,874,212,500	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	84,000	23,568.08	1,979,718,816	21,775.00	1,829,100,000	0.83
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	622,600	2,818.57	1,754,847,382	2,885.00	1,796,201,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	92,700	16,317.37	1,512,620,892	19,185.00	1,778,449,500	0.80
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	79,100	22,600.61	1,787,708,908	22,315.00	1,765,116,500	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	328,300	5,277.79	1,732,699,597	5,237.00	1,719,307,100	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	106,400	17,052.58	1,814,395,232	16,105.00	1,713,572,000	0.77
日本	株式	ダイキン工業	機械	120,600	12,726.41	1,534,805,152	14,170.00	1,708,902,000	0.77
日本	株式	キヤノン	電気機器	475,800	3,744.24	1,781,510,842	3,563.00	1,695,275,400	0.77
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	364,800	4,875.38	1,778,541,384	4,525.00	1,650,720,000	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	869,000	1,685.87	1,465,024,390	1,882.00	1,635,458,000	0.74
日本	株式	信越化学工業	化学	152,500	10,993.97	1,676,581,044	10,425.00	1,589,812,500	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	157,100	10,720.98	1,684,265,958	10,055.00	1,579,640,500	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,122,000	809.73	1,718,268,120	725.50	1,539,511,000	0.70
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	325,500	4,479.53	1,458,087,466	4,653.00	1,514,551,500	0.68
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	512,100	2,945.27	1,508,277,270	2,922.00	1,496,356,200	0.68
日本	株式	資生堂	化学	175,600	8,327.57	1,462,323,030	7,824.00	1,373,894,400	0.62

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	2.87
		食料品	3.95
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.45
		医薬品	4.87
		石油・石炭製品	0.84
		ゴム製品	0.72
		ガラス・土石製品	0.97
		鉄鋼	1.04
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.61
		機械	5.14
電気機器	13.69		

	輸送用機器	8.48
	精密機器	1.77
	その他製品	2.11
	電気・ガス業	1.68
	陸運業	4.17
	海運業	0.19
	空運業	0.56
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.85
	卸売業	4.74
	小売業	4.75
	銀行業	6.75
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.30
	その他金融業	1.19
	不動産業	2.30
	サービス業	4.69
	小計	98.90
合計		98.90

(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	151	円	2,613,864,840	2,617,585,000	1.18

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

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

#### 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	111,704,317,237	43.57
	フランス	26,042,534,216	10.16

イタリア	22,485,835,057	8.77
ドイツ	17,460,051,449	6.81
イギリス	16,687,636,470	6.51
スペイン	14,689,524,303	5.73
ベルギー	6,441,276,596	2.51
オーストラリア	5,275,493,233	2.06
カナダ	5,240,506,067	2.04
オランダ	5,231,592,019	2.04
オーストリア	3,832,276,140	1.49
メキシコ	2,091,421,815	0.82
アイルランド	2,018,576,096	0.79
デンマーク	1,535,970,123	0.60
ポーランド	1,529,978,538	0.60
フィンランド	1,521,168,039	0.59
南アフリカ	1,340,551,729	0.52
マレーシア	1,181,563,150	0.46
シンガポール	988,512,986	0.39
スウェーデン	929,646,999	0.36
ノルウェー	593,596,689	0.23
スイス	338,226,390	0.13
小計	249,160,255,341	97.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	7,243,184,651	2.82
合計(純資産総額)	256,403,439,992	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	1,336,468,302	0.52
	買建	ドイツ	1,771,441,490	0.69

(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		4,287,815,600	1.67

(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	10,584.14	1,852,225,772	10,616.00	1,857,801,040	1.750	2023/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/24	15,750,000	10,760.27	1,694,742,559	10,736.06	1,690,930,416	2.125	2024/2/29	0.66
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	9,887.81	1,631,488,899	10,044.20	1,657,293,968	2.500	2046/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.125% 09/30/21	15,300,000	10,554.41	1,614,825,760	10,585.41	1,619,568,039	1.125	2021/9/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,709.44	1,568,933,716	10,725.56	1,571,295,007	1.875	2022/10/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	11,076.01	1,545,103,925	11,080.46	1,545,724,461	2.500	2020/5/31	0.60
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000	13,963.13	1,535,944,812	13,825.54	1,520,809,613	3.500	2020/4/25	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.875% 12/15/20	12,500,000	10,918.73	1,364,841,300	10,909.42	1,363,678,169	1.875	2020/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	10,805.25	1,350,656,412	10,847.14	1,355,893,015	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	13,200,000	9,952.14	1,313,682,937	10,050.82	1,326,709,053	1.500	2026/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	10,461.45	1,286,759,356	10,529.03	1,295,071,110	2.000	2025/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	12,150,000	10,486.39	1,274,097,374	10,572.37	1,284,543,714	2.250	2027/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,950,000	10,615.61	1,268,566,207	10,701.48	1,278,827,622	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	12,000,000	10,589.31	1,270,718,058	10,635.48	1,276,257,637	2.125	2025/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	11,100,000	11,407.22	1,266,202,337	11,350.94	1,259,955,443	3.625	2021/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,000,000	11,123.78	1,223,616,647	11,093.92	1,220,331,249	2.625	2020/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 04/30/22	11,200,000	10,709.97	1,199,517,116	10,724.50	1,201,144,299	1.750	2022/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	10,670.17	1,163,048,882	10,827.28	1,180,173,561	2.875	2045/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	10,400,000	10,994.69	1,143,448,595	10,999.65	1,143,964,321	2.750	2028/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	11,900,000	9,352.11	1,112,901,505	9,511.44	1,131,862,027	2.250	2046/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	10,650,000	10,482.05	1,116,338,522	10,557.50	1,124,374,220	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 06/30/24	10,500,000	10,582.19	1,111,130,971	10,634.20	1,116,591,199	2.000	2024/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	10,703.32	1,086,387,181	10,753.85	1,091,516,277	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/20	10,000,000	10,864.57	1,086,457,156	10,864.93	1,086,493,539	1.500	2020/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	10,150,000	10,661.28	1,082,120,359	10,680.09	1,084,029,575	1.750	2022/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,592.94	1,059,294,423	10,611.72	1,061,172,636	1.250	2021/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/47	9,950,000	10,376.86	1,032,497,591	10,545.16	1,049,243,828	2.750	2047/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	9,620,000	10,891.80	1,047,791,535	10,904.49	1,049,012,542	1.250	2020/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,611.42	1,039,919,862	10,630.10	1,041,749,845	1.125	2021/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,720.30	1,023,789,165	10,732.91	1,024,993,385	1.750	2022/3/31	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	97.18
合計	97.18

(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	50	アメリカドル	5,661,426.77	628,758,058	5,664,844	629,137,575	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	29	アメリカドル	3,479,584.87	386,442,695	3,484,531.25	386,992,040	0.15
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	20	アメリカドル	2,874,580	319,250,854	2,884,375	320,338,687	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,799,480	362,700,629	2,799,750	362,735,610	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	28	ユーロ	3,697,312	479,023,743	3,701,880	479,615,573	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	44	ユーロ	7,150,236	926,384,576	7,171,120	929,090,307	0.36

(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	18,600,000.00	2,060,992,842	2,063,670,000	0.80
	カナダドル	買建	2,050,000.00	174,188,340	175,090,500	0.07
	ユーロ	買建	13,730,000.00	1,756,888,431	1,778,858,800	0.69
	イギリスポンド	買建	1,870,000.00	266,300,616	270,196,300	0.11

(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	216,534,749,332	60.71
	イギリス	21,417,359,084	6.00
	フランス	12,982,129,642	3.64
	カナダ	12,790,296,025	3.59
	ドイツ	12,505,781,428	3.51
	スイス	11,800,004,658	3.31
	オーストラリア	8,034,532,302	2.25
	オランダ	6,488,901,274	1.82
	アイルランド	4,980,445,398	1.40
	スペイン	3,836,033,539	1.08
	スウェーデン	3,418,260,287	0.96
	香港	3,086,656,647	0.87
	イタリア	2,380,638,811	0.67
	デンマーク	2,245,033,255	0.63
	バミューダ	1,554,302,984	0.44
	シンガポール	1,550,241,385	0.43
	ジャージー	1,541,405,569	0.43
	フィンランド	1,422,680,218	0.40
	ベルギー	1,368,156,015	0.38
	ノルウェー	959,972,276	0.27
	ケイマン	835,753,759	0.23
	キュラソー	803,058,301	0.23
	イスラエル	726,390,098	0.20
	ルクセンブルク	457,849,818	0.13
	ニュージーランド	305,781,975	0.09
	オーストリア	291,902,543	0.08
	パナマ	240,229,341	0.07
	ポルトガル	210,444,154	0.06
	リベリア	189,535,590	0.05
	英ヴァージン諸島	92,487,396	0.03
	パプアニューギニア	86,344,498	0.02
	マン島	68,196,180	0.02
モーリシャス	9,356,270	0.00	
	小計	335,214,910,052	93.98
投資信託受益証券	オーストラリア	196,098,749	0.05
	香港	63,208,545	0.02
	小計	259,307,294	0.07
投資証券	アメリカ	6,064,555,320	1.70
	オーストラリア	579,205,713	0.16
	フランス	464,675,439	0.13
	イギリス	270,528,496	0.08

	香港	197,987,153	0.06
	シンガポール	139,763,064	0.04
	カナダ	64,837,507	0.02
	小計	7,781,552,692	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,419,236,147	3.76
合計(純資産総額)		356,675,006,185	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,508,617,568	2.39
	買建	カナダ	549,096,886	0.15
	買建	ドイツ	2,258,751,068	0.63
	買建	イギリス	1,063,578,516	0.30
	買建	オーストラリア	611,581,392	0.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		337,540,200	0.09

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

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

#### 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	410,252	20,943.34	8,592,049,735	24,991.83	10,252,948,980	2.87
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	33,277	178,862.63	5,952,012,032	222,384.32	7,400,283,110	2.07

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	591,521	10,924.49	6,462,067,473	12,433.16	7,354,479,377	2.06
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	193,825	20,550.86	3,983,272,237	19,728.69	3,823,914,967	1.07
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	12,289.89	3,403,958,072	12,793.00	3,543,303,184	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,480	119,477.85	3,044,295,789	137,616.66	3,506,472,680	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,157	120,422.90	2,909,056,188	139,318.10	3,365,507,496	0.94
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	217,581	13,487.88	2,934,708,471	14,987.54	3,261,005,464	0.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	342,921	8,745.30	2,998,947,821	8,941.44	3,066,207,752	0.86
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	787,725	3,349.56	2,638,539,713	3,443.97	2,712,901,741	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	378,753	6,095.86	2,308,827,892	6,492.56	2,459,079,456	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	103,404	21,556.87	2,229,067,597	23,294.83	2,408,779,118	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,964	14,579.52	2,128,085,946	16,296.94	2,378,767,192	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	252,246	8,805.08	2,221,048,100	9,315.93	2,349,907,088	0.66
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,518	27,199.61	2,135,659,750	29,807.39	2,340,416,915	0.66
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	483,121	3,962.96	1,914,592,055	4,608.99	2,226,699,858	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	94,571	20,751.15	1,962,457,380	22,129.81	2,092,838,791	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	587,152	3,535.82	2,076,066,215	3,549.47	2,084,082,872	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	154,681	13,574.82	2,099,767,812	13,306.09	2,058,200,638	0.58
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	390,187	4,804.45	1,874,636,118	5,236.47	2,043,206,032	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	334,367	5,387.33	1,801,347,701	6,080.53	2,033,130,246	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	378,881	6,156.82	2,332,704,562	5,357.53	2,029,867,991	0.57
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	8,252.86	1,673,731,269	9,263.51	1,878,696,342	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	21,231.34	1,595,046,895	23,744.62	1,783,862,668	0.50
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	39,991.59	1,809,139,793	38,526.71	1,742,871,488	0.49
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	180,510	8,687.37	1,568,157,656	9,325.10	1,683,275,606	0.47
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	218,364	6,562.53	1,433,021,480	7,612.05	1,662,198,210	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	208,262	7,600.94	1,582,988,299	7,936.34	1,652,839,624	0.46

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	328,376	4,709.90	1,546,618,689	4,992.14	1,639,301,263	0.46
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,634,371	1,059.09	1,730,960,034	975.77	1,594,786,534	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.67
		素材	4.40
		資本財	6.88
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.23
		耐久消費財・アパレル	1.80
		消費者サービス	1.71
		メディア	1.92
		小売	4.88
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.49
		家庭用品・パーソナル用品	1.80
		ヘルスケア機器・サービス	4.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.00
		銀行	8.44
		各種金融	4.23
		保険	3.63
		不動産	0.58
		ソフトウェア・サービス	11.55
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.63		
電気通信サービス	2.22		
公益事業	2.85		
半導体・半導体製造装置	2.93		
	小計	93.98	
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.18
合計			96.24

(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	528	アメリカドル	73,371,156	8,148,600,585	76,612,800	8,508,617,568	2.39
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	33	カナダドル	6,341,860.5	542,038,816	6,424,440	549,096,886	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	64	スイスフラン	5,543,548	635,844,956	5,783,680	663,388,096	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	359	ユーロ	12,318,065.5	1,595,928,566	12,313,700	1,595,362,972	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	48	オーストラリアドル	7,296,336	588,011,718	7,588,800	611,581,392	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	98	イギリスポンド	7,426,532.5	1,073,579,538	7,357,350	1,063,578,516	0.30

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

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

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	売建	2,620,000.00	290,898,600	290,898,600	0.08
	ユーロ	売建	360,000.00	46,641,600	46,641,600	0.01

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	4,452,431,257	10.27
	ポーランド	4,136,996,192	9.54
	ブラジル	4,094,599,057	9.44
	インドネシア	4,066,644,396	9.38
	タイ	3,764,825,225	8.68
	南アフリカ	3,457,631,712	7.97
	コロンビア	3,424,468,825	7.90

	ロシア	3,099,219,256	7.15
	マレーシア	2,498,490,365	5.76
	チェコ	2,052,604,830	4.73
	ハンガリー	2,051,865,036	4.73
	トルコ	1,408,479,757	3.25
	ペルー	1,368,307,065	3.16
	チリ	1,134,969,928	2.62
	フィリピン	122,323,338	0.28
	ウルグアイ	104,557,809	0.24
	小計	41,238,414,048	95.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,123,802,618	4.90
合計(純資産総額)		43,362,216,666	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	38,600,000,000	4.61	1,782,782,110	4.56	1,760,659,213	9.850	2027/6/28	4.06
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	6,710,000,000	17.20	1,154,464,902	16.91	1,134,969,928	5.500	2020/8/5	2.62
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000	2,238.28	840,476,714	2,273.47	853,689,829	0.000	2020/7/1	1.97
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	22,100,000,000	3.88	857,958,076	3.83	846,658,028	7.750	2021/4/14	1.95
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.49	826,272,309	3.45	817,151,584	4.375	2023/3/21	1.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	74,050,000	824.75	610,734,251	818.74	606,283,209	10.500	2026/12/21	1.40
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	164,700,000	356.02	586,375,773	346.76	571,129,992	3.400	2036/6/17	1.32
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	98,400,000	568.53	559,434,965	561.37	552,397,556	6.500	2021/6/10	1.27
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	144,000,000	368.27	530,318,291	363.54	523,500,343	3.650	2031/6/20	1.21
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	20,050,000	2,744.51	550,275,739	2,556.61	512,602,001	10.000	2023/1/1	1.18
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	77,350,000	672.69	520,327,495	643.32	497,611,013	10.000	2024/12/5	1.15
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000	591.54	502,815,913	582.38	495,027,832	8.000	2020/6/11	1.14
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/20	18,550,000	2,254.09	418,135,282	2,392.78	443,860,833	0.000	2020/1/1	1.02
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	55,200,000,000	0.83	458,620,708	0.77	428,875,296	8.375	2024/3/15	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000	2,846.99	414,237,710	2,899.13	421,824,685	2.500	2026/7/25	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	75,600,000	564.78	426,978,164	555.50	419,960,128	6.500	2022/6/9	0.97

ポーランド	国債証券	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000	3,001.06	400,642,609	3,010.78	401,939,857	1.500	2020/4/25	0.93
ポーランド	国債証券	POLGB 1.75% 07/25/21	13,350,000	2,969.34	396,407,860	3,006.32	401,344,548	1.750	2021/7/25	0.93
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000	2,740.47	405,589,667	2,683.07	397,095,436	10.000	2021/1/1	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	58,650,000	683.76	401,027,901	674.75	395,741,491	8.750	2048/2/28	0.91
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	417.52	396,644,048	403.37	383,208,905	4.875	2029/6/22	0.88
タイ	国債証券	THAIGB 2% 12/17/22	112,000,000	340.43	381,290,984	336.36	376,733,683	2.000	2022/12/17	0.87
マレーシア	国債証券	MGS 3.62% 11/30/21	13,400,000	2,704.97	362,466,274	2,715.01	363,811,357	3.620	2021/11/30	0.84
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	110,000,000	331.72	364,895,937	327.36	360,105,801	2.125	2026/12/17	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	101,000,000	364.07	367,714,074	356.31	359,879,282	3.650	2021/12/17	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	12,500,000	2,827.86	353,483,391	2,870.31	358,789,924	2.500	2027/7/25	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	11,550,000	3,050.21	352,300,237	3,081.95	355,965,514	3.250	2025/7/25	0.82
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	62,700,000	586.77	367,907,827	566.01	354,892,038	7.500	2027/6/3	0.82
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.84	380,066,880	0.77	350,348,220	8.375	2026/9/15	0.81
マレーシア	国債証券	MGS 3.492% 03/31/20	12,750,000	2,711.38	345,701,918	2,705.83	344,994,197	3.492	2020/3/31	0.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.10
合計	95.10

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

#### 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。

#### 新興国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	8,194,538,178	16.06

	韓国	7,265,811,401	14.24
	台湾	6,046,648,924	11.85
	中国	5,158,763,280	10.11
	インド	4,720,381,180	9.25
	南アフリカ	2,916,975,283	5.72
	ブラジル	2,754,610,059	5.40
	香港	1,803,881,723	3.53
	ロシア	1,622,765,809	3.18
	メキシコ	1,482,268,594	2.90
	マレーシア	1,221,740,042	2.39
	タイ	1,173,672,907	2.30
	インドネシア	1,001,537,033	1.96
	ポーランド	606,804,294	1.19
	フィリピン	512,024,944	1.00
	チリ	511,410,475	1.00
	バミューダ	493,760,246	0.97
	カタール	457,850,375	0.90
	アラブ首長国連邦	335,493,272	0.66
	トルコ	233,080,497	0.46
	コロンビア	220,027,342	0.43
	アメリカ	168,522,804	0.33
	ギリシャ	162,111,972	0.32
	ハンガリー	150,476,755	0.29
	チェコ	90,211,917	0.18
	エジプト	66,939,069	0.13
	ルクセンブルク	36,840,279	0.07
	パキスタン	34,399,690	0.07
	マン島	31,992,234	0.06
	ペルー	23,653,492	0.05
	シンガポール	6,981,964	0.01
	小計	49,506,176,034	97.01
投資信託受益証券	ブラジル	67,597,012	0.13
投資証券	南アフリカ	141,232,511	0.28
	メキシコ	44,633,837	0.09
	トルコ	4,011,121	0.01
	小計	189,877,469	0.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,267,990,865	2.48
合計(純資産総額)		51,031,641,380	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,234,567,393	2.42

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

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

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		11,505,574	0.02
	売建		403,330	0.00

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	492,400	5,556.67	2,736,106,454	5,057.21	2,490,170,204	4.88
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,146,389	874.25	1,876,498,069	953.86	2,047,376,075	4.01
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	414,971	5,539.22	2,298,619,286	4,760.23	1,975,359,478	3.87
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	99,804	20,652.50	2,061,202,187	19,391.07	1,935,306,949	3.79
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	38,108	26,773.73	1,020,293,642	25,292.50	963,846,590	1.89
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,422,620	100.40	845,685,744	99.05	834,260,511	1.63
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	24,165	26,815.25	647,990,574	24,905.20	601,834,279	1.18
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	528,000	1,123.75	593,342,530	1,040.02	549,133,200	1.08
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	250,229	1,459.12	365,116,043	2,013.63	503,868,871	0.99
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,981,515	89.71	536,607,692	82.06	490,902,936	0.96
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	446,500	1,058.00	472,401,001	1,078.93	481,745,594	0.94
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	140,211	2,763.55	387,481,091	3,055.95	428,478,787	0.84

韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	51,320	8,253.27	423,557,946	8,261.73	423,991,984	0.83
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,395,311	380.22	530,533,545	292.85	408,627,989	0.80
ブラジル	株式	VALE SA	素材	267,478	933.76	249,760,471	1,459.20	390,304,379	0.76
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	54.85	406,409,853	50.51	374,228,927	0.73
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	148,301	1,537.13	227,957,968	2,237.59	331,837,724	0.65
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	271,721	1,126.87	306,194,447	1,115.05	302,984,675	0.59
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,538,000	158.81	244,255,641	195.83	301,195,768	0.59
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	76,736	4,507.57	345,893,052	3,906.08	299,737,722	0.59
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	37,814	6,406.36	242,250,273	7,685.35	290,613,901	0.57
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	81,948	2,231.57	182,873,494	3,290.19	269,624,654	0.53
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	225,496	1,788.44	403,286,864	1,187.23	267,715,932	0.52
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,812,440	96.64	271,809,907	94.23	265,039,283	0.52
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	2,175,400	85.01	184,932,377	111.21	241,945,813	0.47
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	487,161	497.18	242,210,299	477.55	232,647,633	0.46
韓国	株式	POSCO	素材	6,562	32,921.82	216,032,990	33,216.75	217,968,314	0.43
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	61,163	4,486.45	274,405,208	3,442.85	210,575,646	0.41
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	406,600	550.21	223,718,483	508.06	206,577,196	0.40
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	37,868	4,411.49	167,054,475	5,439.67	205,989,802	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.47
		素材	7.37
		資本財	3.41
		商業・専門サービス	0.13
		運輸	1.49
		自動車・自動車部品	2.71
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	1.19
		メディア	2.28
		小売	1.79
		食品・生活必需品小売り	1.62
		食品・飲料・タバコ	3.36
		家庭用品・パーソナル用品	1.27

	ヘルスケア機器・サービス	0.63
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.34
	銀行	16.34
	各種金融	2.47
	保険	3.44
	不動産	2.54
	ソフトウェア・サービス	13.45
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.02
	電気通信サービス	4.39
	公益事業	2.30
	半導体・半導体製造装置	5.88
	小計	97.01
投資信託受益証券		0.13
投資証券		0.37
合計		97.52

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	212	アメリカドル	11,363,594	1,262,040,749	11,116,220	1,234,567,393	2.42

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

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

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	103,625.82	11,513,419	11,505,574	0.02
	ブラジルリアル	売建	15,083.42	410,419	403,330	0.00

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

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

#### 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：2013年11月8日  
 作成基準日：2018年8月31日

**基準価額・純資産の推移**


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**分配の推移（1万口当たり、税引前）**

設定来分配金合計額：0円

決算期	2014年1月	2015年1月	2016年1月	2017年1月	2018年1月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	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	46.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/機器	-	-	1.3%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	1.0%
新興国株式 インデックス マザーファンド	22.0%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.1%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	0.9%
外国債券 インデックス マザーファンド	15.0%	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	国債	-	1.750%	2023/05/15	0.1%
		T 2.125% 02/29/24	アメリカ	国債	-	2.125%	2024/02/29	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	7.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	6.2%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.2%
国内債券 インデックス マザーファンド	1.9%	第135回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/03/20	0.0%
		第131回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2022/03/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**


※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2018年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

**第2【管理及び運営】**
**1【申込（販売）手続等】**

&lt; 申込手続 &gt;

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

とします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

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、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およ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 >

##### イ．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。

##### ロ．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

原則として計算日のわが国の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、外国上場投資証券（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。（2013年11月8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1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年11月8日から2014年1月20日までとします。

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

#### （５）【その他】

##### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

###### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、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5億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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

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

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

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

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

##### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

###### (1) 投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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5期計算期間(平成29年 1月21日から平成30年 1月22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】

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （平成29年 1月20日現在）	第5期 （平成30年 1月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	284,437	-
コール・ローン	61,062,857	86,306,902
親投資信託受益証券	3,562,408,841	4,677,781,119
未収入金	4,000,000	-
流動資産合計	3,627,756,135	4,764,088,021
資産合計	3,627,756,135	4,764,088,021
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,817,749	18,086,031
未払受託者報酬	914,255	1,196,629
未払委託者報酬	9,142,490	11,966,207
未払利息	131	143
その他未払費用	91,374	119,599
流動負債合計	20,965,999	31,368,609
負債合計	20,965,999	31,368,609
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,955,939,413	3,212,034,490
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	650,850,723	1,520,684,922
（分配準備積立金）	151,504,932	823,308,388
元本等合計	3,606,790,136	4,732,719,412
純資産合計	3,606,790,136	4,732,719,412
負債純資産合計	3,627,756,135	4,764,088,021

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日	自	平成29年 1月21日 至 平成30年 1月22日
営業収益				
受取利息		2,137		67
有価証券売買等損益		486,575,734		810,552,016
営業収益合計		486,577,871		810,552,083
営業費用				
支払利息		33,194		44,787
受託者報酬		1,687,192		2,206,358
委託者報酬		16,871,769		22,063,463
その他費用		172,455		220,845
営業費用合計		18,764,610		24,535,453
営業利益又は営業損失（ ）		467,813,261		786,016,630
経常利益又は経常損失（ ）		467,813,261		786,016,630
当期純利益又は当期純損失（ ）		467,813,261		786,016,630
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（ ）		44,727,596		77,143,975
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		153,087,775		650,850,723
剰余金増加額又は欠損金減少額		119,487,487		356,887,111
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		119,487,487		356,887,111
剰余金減少額又は欠損金増加額		44,810,204		195,925,567
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		44,810,204		195,925,567
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		650,850,723		1,520,684,922

## ( 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1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成29年 1月21日から平成30年 1月22日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第4期 (平成29年 1月20日現在)	第5期 (平成30年 1月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,955,939,413口	3,212,034,490口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2202円 (12,202円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4734円 (14,734円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第4期 自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日			第5期 自 平成29年 1月21日 至 平成30年 1月22日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	76,289,527円	費用控除後の配当等収益額	A	94,245,426円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	614,012,001円
収益調整金額	C	499,345,791円	収益調整金額	C	697,376,534円
分配準備積立金額	D	75,215,405円	分配準備積立金額	D	115,050,961円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	650,850,723円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,520,684,922円
当ファンドの期末残存口数	F	2,955,939,413口	当ファンドの期末残存口数	F	3,212,034,490口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,201円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,734円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 平成29年 1月21日 至 平成30年 1月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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5期 (平成30年 1月22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4期	第5期
	自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日	自 平成29年 1月21日 至 平成30年 1月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,416,884,339円	2,955,939,413円
期中追加設定元本額	1,194,172,622円	1,109,479,703円
期中一部解約元本額	655,117,548円	853,384,626円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第4期 (平成29年 1月20日現在)	第5期 (平成30年 1月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	441,828,750	786,237,102
合計	441,828,750	786,237,102

## （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	新興国株式インデックス マザーファンド	353,554,152	1,140,636,405	
	国内株式インデックス マザーファンド	219,963,837	370,111,152	
	外国株式インデックス マザーファンド	837,758,919	2,153,459,301	
	国内債券インデックス マザーファンド	64,543,101	89,308,288	
	外国債券インデックス マザーファンド	217,402,424	604,161,336	
	新興国債券インデックス マザーファンド	179,380,576	320,104,637	
合計		1,872,603,009	4,677,781,119	

(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

	平成30年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,357,730,746
国債証券	293,650,334,000
地方債証券	19,985,808,088
特殊債券	25,402,186,666
社債券	14,686,437,690
未収入金	100,954,704
未収利息	685,397,894
前払費用	30,075,160
流動資産合計	355,898,924,948
資産合計	355,898,924,948
負債の部	
流動負債	
未払金	901,024,800
未払解約金	193,157,794

	平成30年 1月22日現在
項目	金額（円）
未払利息	2,249
流動負債合計	1,094,184,843
負債合計	1,094,184,843
純資産の部	
元本等	
元本	256,411,785,507
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	98,392,954,598
元本等合計	354,804,740,105
純資産合計	354,804,740,105
負債純資産合計	355,898,924,948

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	256,411,785,507口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 103,801,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3837円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,837円)</p>

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

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	平成30年 1月22日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月22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。

	平成30年 1月22日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	231,388,249,721円
期中追加設定元本額	62,259,397,125円
期中一部解約元本額	37,235,861,339円
期末元本額	256,411,785,507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）	3,208,577,751円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,965,771円
S M T 国内債券インデックス・オープン	11,132,266,350円
世界経済インデックスファンド	1,396,359,550円
D Cマイセレクション25	18,530,610,923円
D Cマイセレクション50	21,476,208,055円
D Cマイセレクション75	5,872,526,439円
D C日本債券インデックス・オープン	442,626,977円
D C日本債券インデックス・オープンS	73,525,683,918円
D C日本債券インデックス・オープンP	32,893,975,141円
D CマイセレクションS25	7,074,637,311円
D CマイセレクションS50	8,281,894,640円
D CマイセレクションS75	1,659,495,163円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,274,699,365円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	1,022,412,207円

区分	平成30年 1月22日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	311,189,277円
DC世界経済インデックスファンド	1,059,494,505円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	126,961,180円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	8,822,690円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	102,519,910円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	18,951,956円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	973,098円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	348,637,603円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	522,418,003円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	96,480,714円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	225,288,486円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	5,802,249,876円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,196,836,486円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,665,194,122円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	972,211,337円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	240,761,191円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,599,293,865円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,637,810,506円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,754,605,070円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,280,045,869円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	192,163,197円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,954,142,747円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,537,348,322円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	39,617,800円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	524,277,039円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	64,543,101円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,214,192円
SMT インデックスバランス・オープン	85,997,604円
SMT 日米インデックスバランス・オープン	1,880,084円
SMT 世界経済インデックス・オープン	228,983円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	10,638,651円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	11,353,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	519,035円
グローバル経済コア	184,998,506円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,478,772円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	26,984,471,094円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	1,348,764,250
地方債証券	110,324,898
特殊債券	126,068,958
社債券	51,142,570
合計	1,636,300,676

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第373回利付国債(2年)	140,000,000	140,355,600	
	第374回利付国債(2年)	620,000,000	621,692,600	
	第375回利付国債(2年)	1,340,000,000	1,343,926,200	
	第376回利付国債(2年)	1,840,000,000	1,845,759,200	
	第377回利付国債(2年)	3,050,000,000	3,060,187,000	
	第378回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,685,930,400	
	第379回利付国債(2年)	2,600,000,000	2,609,724,000	
	第380回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,787,013,200	
	第381回利付国債(2年)	2,580,000,000	2,590,681,200	
	第382回利付国債(2年)	310,000,000	311,348,500	
	第383回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,305,902,000	
	第384回利付国債(2年)	830,000,000	833,942,500	
	第117回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,312,540,000	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,526,005,600	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,003,160,000	
	第120回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,573,772,800	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	632,349,900	
	第122回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,534,432,000	
	第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,154,538,200	

第124回利付国債（5年）	1,950,000,000	1,959,613,500	
第125回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,629,205,200	
第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,977,227,200	
第127回利付国債（5年）	3,790,000,000	3,813,346,400	
第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,620,432,800	
第129回利付国債（5年）	3,200,000,000	3,221,696,000	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,369,846,400	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,582,658,000	
第132回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,640,287,900	
第133回利付国債（5年）	4,740,000,000	4,782,091,200	
第134回利付国債（5年）	1,940,000,000	1,957,673,400	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	568,584,000	
第2回利付国債（40年）	420,000,000	576,689,400	
第3回利付国債（40年）	420,000,000	578,503,800	
第4回利付国債（40年）	700,000,000	966,910,000	
第5回利付国債（40年）	490,000,000	650,332,900	
第6回利付国債（40年）	390,000,000	507,000,000	
第7回利付国債（40年）	690,000,000	855,731,100	
第8回利付国債（40年）	720,000,000	824,817,600	
第9回利付国債（40年）	970,000,000	798,251,800	
第10回利付国債（40年）	1,400,000,000	1,370,236,000	
第299回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,260,422,800	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	845,587,400	
第301回利付国債（10年）	340,000,000	347,762,200	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	204,284,000	
第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,425,028,000	
第304回利付国債（10年）	480,000,000	491,299,200	
第305回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,961,570,000	
第306回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,208,212,200	
第307回利付国債（10年）	700,000,000	721,350,000	
第308回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,540,600,400	
第309回利付国債（10年）	2,340,000,000	2,408,211,000	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,451,468,100	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,106,017,200	
第312回利付国債（10年）	3,270,000,000	3,394,292,700	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,305,300,000	
第314回利付国債（10年）	310,000,000	321,755,200	
第315回利付国債（10年）	2,070,000,000	2,161,866,600	
第316回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,134,657,300	
第317回利付国債（10年）	710,000,000	741,112,200	
第318回利付国債（10年）	950,000,000	988,142,500	
第319回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,674,592,000	

第320回利付国債（10年）	1,720,000,000	1,793,444,000	
第321回利付国債（10年）	1,470,000,000	1,536,752,700	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	780,930,000	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,012,214,400	
第324回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,330,060,800	
第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,383,592,300	
第326回利付国債（10年）	860,000,000	893,024,000	
第327回利付国債（10年）	740,000,000	772,056,800	
第328回利付国債（10年）	2,320,000,000	2,400,968,000	
第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,356,155,000	
第330回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,510,257,600	
第331回利付国債（10年）	1,380,000,000	1,431,667,200	
第332回利付国債（10年）	2,630,000,000	2,732,017,700	
第333回利付国債（10年）	1,130,000,000	1,175,313,000	
第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	2,904,613,200	
第335回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,485,632,000	
第336回利付国債（10年）	610,000,000	632,143,000	
第337回利付国債（10年）	1,980,000,000	2,024,490,600	
第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,522,765,000	
第339回利付国債（10年）	3,680,000,000	3,790,363,200	
第340回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,008,242,400	
第341回利付国債（10年）	3,030,000,000	3,100,599,000	
第342回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,617,966,000	
第343回利付国債（10年）	2,530,000,000	2,545,888,400	
第344回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,679,352,000	
第345回利付国債（10年）	2,010,000,000	2,019,788,700	
第346回利付国債（10年）	4,060,000,000	4,076,605,400	
第347回利付国債（10年）	2,530,000,000	2,540,626,000	
第348回利付国債（10年）	1,230,000,000	1,234,710,900	
第349回利付国債（10年）	1,330,000,000	1,333,258,500	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	52,201,600	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	202,452,800	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	150,837,600	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	147,404,400	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	62,890,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	244,902,400	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	230,688,000	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	60,690,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	277,464,000	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	178,033,600	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	108,152,100	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	240,059,300	

第13回利付国債(30年)	290,000,000	362,360,800
第14回利付国債(30年)	300,000,000	394,011,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	452,689,600
第16回利付国債(30年)	370,000,000	493,635,500
第17回利付国債(30年)	330,000,000	435,880,500
第18回利付国債(30年)	345,000,000	450,204,300
第19回利付国債(30年)	280,000,000	365,960,000
第20回利付国債(30年)	420,000,000	564,047,400
第21回利付国債(30年)	270,000,000	353,640,600
第22回利付国債(30年)	400,000,000	538,500,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	579,812,000
第24回利付国債(30年)	260,000,000	351,124,800
第25回利付国債(30年)	290,000,000	381,805,300
第26回利付国債(30年)	410,000,000	547,579,600
第27回利付国債(30年)	600,000,000	814,020,000
第28回利付国債(30年)	930,000,000	1,264,707,000
第29回利付国債(30年)	920,000,000	1,239,129,600
第30回利付国債(30年)	720,000,000	958,723,200
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,183,905,000
第32回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,594,885,600
第33回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,421,343,900
第34回利付国債(30年)	875,000,000	1,160,757,500
第35回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,748,973,600
第36回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,468,912,800
第37回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,471,239,600
第38回利付国債(30年)	760,000,000	947,902,400
第39回利付国債(30年)	840,000,000	1,067,757,600
第40回利付国債(30年)	600,000,000	749,244,000
第41回利付国債(30年)	890,000,000	1,091,140,000
第42回利付国債(30年)	800,000,000	981,168,000
第43回利付国債(30年)	750,000,000	920,205,000
第44回利付国債(30年)	810,000,000	994,185,900
第45回利付国債(30年)	690,000,000	814,048,200
第46回利付国債(30年)	840,000,000	991,048,800
第47回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,350,204,800
第48回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,271,039,000
第49回利付国債(30年)	790,000,000	912,694,900
第50回利付国債(30年)	520,000,000	521,794,000
第51回利付国債(30年)	790,000,000	691,376,400
第52回利付国債(30年)	770,000,000	711,995,900
第53回利付国債(30年)	955,000,000	905,903,450
第54回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,348,393,500
第55回利付国債(30年)	970,000,000	967,691,400

第56回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,454,758,600	
第57回利付国債(30年)	370,000,000	368,220,300	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	336,217,200	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	82,521,600	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	147,022,400	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	179,582,900	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	305,723,800	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	179,503,000	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	95,553,900	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	139,913,800	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	149,798,600	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	234,003,000	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	107,175,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	118,861,600	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	86,864,000	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	217,942,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	152,198,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	163,821,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	261,052,800	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	327,828,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	217,580,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	375,595,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	253,404,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	335,187,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	220,342,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	355,686,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	245,476,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	366,257,100	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	145,639,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	216,373,900	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	441,729,600	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	462,648,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	228,756,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	719,478,900	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	410,414,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	229,392,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	149,627,400	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	306,900,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	331,710,700	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	193,981,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	310,086,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	254,293,600	

第81回利付国債(20年)	390,000,000	449,533,500
第82回利付国債(20年)	600,000,000	696,180,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	337,867,400
第84回利付国債(20年)	470,000,000	543,865,200
第85回利付国債(20年)	290,000,000	339,221,700
第86回利付国債(20年)	210,000,000	249,062,100
第87回利付国債(20年)	550,000,000	647,828,500
第88回利付国債(20年)	420,000,000	500,119,200
第89回利付国債(20年)	350,000,000	413,829,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	747,690,300
第91回利付国債(20年)	450,000,000	537,943,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,040,371,200
第93回利付国債(20年)	410,000,000	482,824,200
第94回利付国債(20年)	610,000,000	723,905,300
第95回利付国債(20年)	610,000,000	738,100,000
第96回利付国債(20年)	320,000,000	381,212,800
第97回利付国債(20年)	400,000,000	482,168,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	526,160,800
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,379,609,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	582,460,800
第101回利付国債(20年)	715,000,000	882,016,850
第102回利付国債(20年)	410,000,000	507,608,700
第103回利付国債(20年)	400,000,000	491,104,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	434,574,000
第105回利付国債(20年)	680,000,000	823,371,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	464,128,200
第107回利付国債(20年)	150,000,000	182,161,500
第108回利付国債(20年)	610,000,000	727,650,700
第109回利付国債(20年)	230,000,000	275,047,800
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,156,967,000
第111回利付国債(20年)	460,000,000	566,986,800
第112回利付国債(20年)	850,000,000	1,038,147,500
第113回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,616,683,200
第114回利付国債(20年)	810,000,000	994,720,500
第115回利付国債(20年)	590,000,000	731,452,500
第116回利付国債(20年)	760,000,000	944,224,000
第117回利付国債(20年)	770,000,000	947,477,300
第118回利付国債(20年)	690,000,000	842,862,600
第119回利付国債(20年)	270,000,000	323,260,200
第120回利付国債(20年)	790,000,000	926,654,200
第121回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,684,763,400
第122回利付国債(20年)	200,000,000	239,938,000
第123回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,239,780,000

第124回利付国債（20年）	390,000,000	478,608,000	
第125回利付国債（20年）	450,000,000	564,957,000	
第126回利付国債（20年）	610,000,000	750,208,500	
第127回利付国債（20年）	580,000,000	705,889,000	
第128回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,279,645,500	
第129回利付国債（20年）	160,000,000	192,910,400	
第130回利付国債（20年）	750,000,000	905,287,500	
第131回利付国債（20年）	380,000,000	453,651,600	
第132回利付国債（20年）	780,000,000	932,599,200	
第133回利付国債（20年）	790,000,000	955,173,200	
第134回利付国債（20年）	560,000,000	678,165,600	
第135回利付国債（20年）	490,000,000	586,299,700	
第136回利付国債（20年）	530,000,000	626,931,700	
第137回利付国債（20年）	450,000,000	539,208,000	
第138回利付国債（20年）	340,000,000	397,701,400	
第139回利付国債（20年）	510,000,000	604,033,800	
第140回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,931,822,900	
第141回利付国債（20年）	950,000,000	1,140,551,000	
第142回利付国債（20年）	460,000,000	558,835,600	
第143回利付国債（20年）	890,000,000	1,056,136,300	
第144回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,229,917,500	
第145回利付国債（20年）	1,570,000,000	1,886,653,300	
第146回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,708,302,600	
第147回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,639,867,800	
第148回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,489,837,000	
第149回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,901,604,600	
第150回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,702,186,500	
第151回利付国債（20年）	1,465,000,000	1,647,949,200	
第152回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,584,670,800	
第153回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,892,283,800	
第154回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,526,817,600	
第155回利付国債（20年）	1,840,000,000	2,002,692,800	
第156回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,258,688,000	
第157回利付国債（20年）	1,670,000,000	1,578,918,200	
第158回利付国債（20年）	1,730,000,000	1,722,647,500	
第159回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,617,840,000	
第160回利付国債（20年）	1,920,000,000	1,971,590,400	
第161回利付国債（20年）	1,110,000,000	1,116,793,200	
第162回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,386,085,800	
第163回利付国債（20年）	490,000,000	490,872,200	
国債証券合計	271,185,000,000	293,650,334,000	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,349,000

第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,414,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,167,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,392,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,224,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,252,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,534,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,044,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	103,686,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	103,943,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	103,611,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	207,846,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	103,551,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,956,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	104,394,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	103,412,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,880,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	207,628,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,710,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,359,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,226,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	134,147,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,068,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,770,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	205,642,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,606,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,312,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	236,120,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,577,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,363,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,799,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,655,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,208,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,718,000	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,731,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,540,000	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,750,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,016,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,866,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,083,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,064,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	106,315,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,006,000	

第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	104,536,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,386,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	103,186,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,102,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,284,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	113,927,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	107,275,961	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,694,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,154,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,815,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,046,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,905,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,840,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,400,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,929,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,698,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,964,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,551,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,740,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,172,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,434,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	121,391,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,136,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,651,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,343,217	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	199,450,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,706,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	200,455,590	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,248,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,927,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,436,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,457,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,102,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,437,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,815,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,674,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	120,504,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	207,846,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	126,790,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,418,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,199,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	102,949,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	123,303,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,286,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,137,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,042,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,822,000	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,391,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,563,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,636,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,863,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	371,599,920	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,816,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,443,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,994,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,245,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,635,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,550,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,259,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,458,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,175,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,467,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,370,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,044,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,395,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,268,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,014,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,647,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,966,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,142,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,261,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,822,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,829,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,739,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,822,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,768,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	207,120,000	

	平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,776,000	
	平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,855,000	
	第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,386,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,100,000	
	第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	132,367,000	
	第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	119,391,000	
	第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,666,000	
	第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,373,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	104,856,000	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,994,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,555,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,977,000	
	平成28年度第6回京都市公募公債	100,000,000	99,822,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,968,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,140,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	102,067,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,790,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,852,000	
	平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,778,000	
	平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	200,556,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,602,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,647,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,159,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	117,954,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,306,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	198,538,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	144,618,650	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,690,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,935,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,232,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,342,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,677,650	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	207,784,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,924,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,329,000	
	地方債証券合計	18,949,520,000	19,985,808,088	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,704,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,355,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,799,000	

第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,338,000	
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,735,000	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,870,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,964,000	
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	212,224,000	
第14回道路債券	100,000,000	109,056,000	
第17回道路債券	100,000,000	107,244,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	473,164,000	
第21回道路債券	100,000,000	132,663,000	
第28回道路債券	200,000,000	268,874,000	
第33回道路債券	200,000,000	272,678,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,939,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,111,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,642,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,811,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,282,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,904,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,672,000	
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	137,898,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,448,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,185,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,128,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,784,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	142,311,120	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,614,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,241,000	
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	102,685,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,503,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,540,000	

第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	205,314,000	
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	207,216,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,954,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,700,000	
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	104,334,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,942,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,194,000	
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	311,415,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,900,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	311,962,420	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,886,000	
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	103,991,000	
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	103,712,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,785,000	
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	117,175,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,138,000	
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	312,231,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,718,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,500,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,447,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,416,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	154,517,920	
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	103,698,000	
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	229,028,000	
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	105,945,360	
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	103,807,000	
	100,000,000	103,547,000	

第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,196,000	
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	102,766,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,241,000	
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	314,464,240	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,000,000	
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	299,862,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,804,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	322,164,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,223,900	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	109,104,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,653,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	133,468,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,183,200	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,909,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,074,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,292,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,624,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,649,230	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,561,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,879,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,196,550	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,307,650	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,524,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,162,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,648,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	517,435,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,582,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,080,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,738,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,121,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,525,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,528,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,700,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,734,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,223,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,314,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,764,000	

第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	151,000,000	150,930,540	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,093,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,047,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,789,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,439,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,099,000	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,093,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,698,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	103,397,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,224,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	107,704,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,057,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,048,000	19,007,070	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,740,000	18,794,997	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,118,000	19,316,868	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,957,000	20,122,097	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,410,000	20,599,638	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,609,000	16,234,452	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,660,000	34,613,068	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,852,000	19,904,318	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,233,000	18,250,091	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,035,000	21,236,899	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,202,000	18,224,658	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,738,000	20,820,431	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,872,000	22,530,565	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,202,000	22,844,303	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,885,000	29,056,232	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,674,000	29,998,616	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,953,000	32,515,778	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,494,000	35,921,645	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,577,000	38,093,361	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,580,000	39,047,686	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,064,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,226,000	82,407,864	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,920,000	18,730,521	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,067,000	42,484,642	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,037,000	18,841,269	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,855,000	

第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,684,000	18,757,241	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,628,000	46,431,535	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,465,000	17,407,785	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,939,000	46,875,882	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,313,000	44,125,175	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,168,000	19,326,755	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,730,000	86,503,032	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,449,000	47,074,157	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,686,000	19,772,217	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,939,000	58,850,624	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,599,000	56,394,723	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,419,000	56,249,672	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,734,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,526,000	120,080,511	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,832,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,914,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,881,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,484,000	127,449,501	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,738,000	64,147,634	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,663,000	64,636,389	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,385,000	66,523,191	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,800,000	59,433,816	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,020,000	60,231,722	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,093,000	66,367,526	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	181,527,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,226,000	59,468,686	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,771,000	67,162,345	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,998,000	68,480,184	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,406,000	67,657,928	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,618,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,666,000	144,414,644	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,493,000	72,569,723	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,050,000	148,201,936	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,070,000	82,093,368	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,904,000	85,720,521	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,849,000	85,113,263	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,294,000	174,443,923	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,843,000	86,228,333	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,623,000	91,190,408	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,010,000	94,781,025	

第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,250,000	94,770,892	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,631,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,596,000	95,558,717	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,065,000	96,569,341	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,497,000	96,824,124	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,040,000	98,205,687	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,538,000	98,825,730	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,845,000	98,804,473	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,157,000	99,102,463	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,483,000	99,478,025	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,654,000	199,284,640	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,894,000	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,338,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	126,399,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,263,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	118,178,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	113,681,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,224,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,849,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,034,000	
い第768号農林債	100,000,000	100,342,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,502,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,767,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,522,000	
第299回信金中金債（5年）	100,000,000	100,271,000	
第300回信金中金債（5年）	300,000,000	300,996,000	
第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,386,000	
第309回信金中金債（5年）	100,000,000	100,479,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	199,772,000	
第201号商工債（3年）	300,000,000	299,526,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,927,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	207,538,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,010,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,487,000	
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,244,000	

	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,205,000	
	特殊債券合計	23,970,145,000	25,402,186,666	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,855,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,458,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,391,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,856,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,302,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,529,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,976,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,247,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,304,000	
	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	100,224,000	
	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	100,925,000	
	第6回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,381,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,177,000	
	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	100,261,000	
	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	100,348,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,976,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,040,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,528,000	
	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	99,455,000	
	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	99,726,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,713,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,880,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,013,000	
	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	102,872,000	
	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	99,774,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,055,000		
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	198,912,000		

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	101,864,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,658,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,630,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,936,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,511,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,139,000	
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	100,858,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,431,000	
第5回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,842,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,466,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,846,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,527,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,582,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,380,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,307,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,079,000	
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	100,212,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,227,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,392,000	
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	100,409,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,317,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,143,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,521,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,190,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,892,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,267,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,649,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,397,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	125,317,000	
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	103,082,000	
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	104,466,000	
	100,000,000	118,610,000	

第 8 8 回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債			
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	102,054,000	
第 6 回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,926,000	
第 6 回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,595,000	
第 9 回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第 1 回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,672,000	
第 2 0 回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,029,000	
第 2 2 回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,264,000	
第 3 回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,632,000	
第 3 9 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,817,000	
第 6 6 回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,301,000	
第 2 3 回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,520,000	
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	100,563,000	
第 6 7 回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第 5 5 回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,236,000	
第 4 4 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,049,000	
第 4 8 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第 5 2 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,820,000	
第 5 6 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,810,000	
第 1 9 回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
第 4 0 回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,335,000	
第 4 3 回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,378,000	
第 1 2 0 回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,274,000	
第 9 7 回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,024,000	
第 1 1 回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,330,000	
第 1 3 回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	103,923,000	
第 1 0 5 回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,627,000	
第 6 3 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,791,000	
第 3 0 回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,486,000	
第 1 7 回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,915,000	

第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,235,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	243,518,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,327,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,724,250	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	121,245,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,037,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,801,200	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,053,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,498,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,673,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,603,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,948,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,603,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,776,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	121,753,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,261,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,397,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,021,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,383,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,790,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,940,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,269,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,850,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,985,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,032,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,754,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,807,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,911,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,876,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,720,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,594,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	132,477,660	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,413,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,174,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,451,000	
第449回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,866,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,452,380	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,132,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	112,254,000	

第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,055,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,038,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,634,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,128,000	
社債券合計	14,296,000,000	14,686,437,690	
合計		353,724,766,444	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成30年 1月22日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,402,691,981
株式	202,403,585,050
派生商品評価勘定	53,960,860
未収配当金	243,602,688
差入委託証拠金	57,034,000
流動資産合計	205,160,874,579
資産合計	205,160,874,579
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	149,320
前受金	53,829,900
未払金	7,370,967
未払解約金	151,313,858
未払利息	3,981
流動負債合計	212,668,026
負債合計	212,668,026
純資産の部	
元本等	
元本	121,805,661,791
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	83,142,544,762
元本等合計	204,948,206,553
純資産合計	204,948,206,553
負債純資産合計	205,160,874,579

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	121,805,661,791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 1.6826円 (1万口当たり純資産額) (16,826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

	平成30年 1月22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。

	平成30年 1月22日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月22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	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	117,889,777,095円
期中追加設定元本額	26,497,610,603円
期中一部解約元本額	22,581,725,907円
期末元本額	121,805,661,791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）	691,371,954円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,655,011,502円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,097,589円
S M T T O P I X インデックス・オープン	8,427,507,607円
世界経済インデックスファンド	1,771,398,571円
日本株式インデックス・オープン	6,209,082,102円
D C マイセレクション 2 5	5,575,571,256円
D C マイセレクション 5 0	16,170,513,193円
D C マイセレクション 7 5	15,295,344,011円
D C 日本株式インデックス・オープン	4,972,869,580円
D C マイセレクション S 2 5	2,133,488,863円
D C マイセレクション S 5 0	6,298,303,012円
D C マイセレクション S 7 5	4,254,320,721円
D C 日本株式インデックス・オープン S	4,768,426,670円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	418,673,896円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	583,832,229円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	349,342,895円
D C 世界経済インデックスファンド	1,367,307,327円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	330,515,465円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,370,408円

区分	平成30年 1月22日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	79,992,212円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	49,291,114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)	462,129,319円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,668,350円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	143,410,776円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	561,588,924円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	86,071,023円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	689,280,258円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,160,844,583円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	816,826,502円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,601,742,445円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	693,838,269円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	93,716,549円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	917,324,062円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,884,689,180円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	527,756,647円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	663,511,551円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,606,322円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,041,599,690円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,942,670,260円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,425,525,631円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	133,061,511円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	172,480,439円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	219,963,837円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,356,734円
SMT インデックスバランス・オープン	91,145,538円
SMT 世界経済インデックス・オープン	298,117円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	28,907,748円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	3,380,988円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	500,045円
グローバル経済コア	210,099,158円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,351,391円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	13,636,552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)	15,703,047,215円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	32,410,013,785
合計	32,410,013,785

(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

(平成30年 1月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,481,468,460	-	2,535,280,000	53,811,540
合計		2,481,468,460	-	2,535,280,000	53,811,540

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,300	4,190.00	13,827,000	
日本水産	94,900	588.00	55,801,200	
マルハニチロ	15,900	3,255.00	51,754,500	
カネコ種苗	2,900	1,715.00	4,973,500	
サカタのタネ	12,400	3,910.00	48,484,000	
ホクト	8,600	2,029.00	17,449,400	
ホクリヨウ	1,200	1,537.00	1,844,400	
住石ホールディングス	21,900	200.00	4,380,000	
日鉄鉱業	2,300	7,960.00	18,308,000	
三井松島産業	4,300	1,560.00	6,708,000	
国際石油開発帝石	408,400	1,505.50	614,846,200	
日本海洋掘削	2,800	3,190.00	8,932,000	
石油資源開発	13,300	3,155.00	41,961,500	
K&Oエナジーグループ	5,000	1,843.00	9,215,000	
ショーボンドホールディングス	7,900	8,580.00	67,782,000	
ミライト・ホールディングス	25,900	1,708.00	44,237,200	
タマホーム	6,300	1,159.00	7,301,700	
サンヨーホームズ	1,500	953.00	1,429,500	

ファーストコーポレーション	1,900	1,644.00	3,123,600	
ベストテラ	1,200	2,023.00	2,427,600	
インベスターズクラウド	7,500	1,725.00	12,937,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	1,315.00	2,630,000	
安藤・間	64,700	925.00	59,847,500	
東急建設	32,500	1,133.00	36,822,500	
コムシスホールディングス	29,500	3,190.00	94,105,000	
ミサワホーム	7,100	990.00	7,029,000	
ピーアールホールディングス	8,300	513.00	4,257,900	
高松コンストラクショングループ	5,400	3,110.00	16,794,000	
東建コーポレーション	3,100	13,360.00	41,416,000	
ソネック	1,000	827.00	827,000	
ヤマウラ	4,000	925.00	3,700,000	
大成建設	83,600	5,830.00	487,388,000	
大林組	251,900	1,399.00	352,408,100	
清水建設	257,000	1,188.00	305,316,000	
飛鳥建設	76,600	187.00	14,324,200	
長谷工コーポレーション	98,000	1,796.00	176,008,000	
松井建設	9,400	963.00	9,052,200	
銭高組	1,200	6,510.00	7,812,000	
鹿島建設	369,000	1,140.00	420,660,000	
不動テトラ	63,800	186.00	11,866,800	
大末建設	2,800	1,125.00	3,150,000	
鉄建建設	5,100	3,340.00	17,034,000	
西松建設	19,400	3,155.00	61,207,000	
三井住友建設	58,700	635.00	37,274,500	
大豊建設	31,000	549.00	17,019,000	
前田建設工業	59,900	1,562.00	93,563,800	
佐田建設	5,500	458.00	2,519,000	
ナカノフドー建設	6,500	686.00	4,459,000	
奥村組	13,800	4,770.00	65,826,000	
東鉄工業	10,100	3,615.00	36,511,500	
イチケン	1,600	2,417.00	3,867,200	
浅沼組	30,000	403.00	12,090,000	
戸田建設	98,000	892.00	87,416,000	
熊谷組	13,200	3,160.00	41,712,000	
青木あすなろ建設	5,600	1,026.00	5,745,600	
北野建設	18,000	413.00	7,434,000	
植木組	1,100	2,766.00	3,042,600	
三井ホーム	11,000	787.00	8,657,000	
矢作建設工業	11,500	915.00	10,522,500	
ピーエス三菱	10,000	966.00	9,660,000	

日本ハウスホールディングス	16,000	715.00	11,440,000	
大東建託	30,400	20,665.00	628,216,000	
新日本建設	10,100	1,019.00	10,291,900	
N I P P O	19,000	2,593.00	49,267,000	
東亜道路工業	1,700	4,450.00	7,565,000	
前田道路	26,000	2,527.00	65,702,000	
日本道路	2,300	6,170.00	14,191,000	
東亜建設工業	6,600	3,065.00	20,229,000	
若築建設	4,500	1,752.00	7,884,000	
東洋建設	26,500	646.00	17,119,000	
五洋建設	99,900	875.00	87,412,500	
世紀東急工業	11,300	650.00	7,345,000	
福田組	2,700	6,830.00	18,441,000	
住友林業	53,700	1,996.00	107,185,200	
日本基礎技術	9,300	415.00	3,859,500	
日成ビルド工業	12,500	1,405.00	17,562,500	
巴コーポレーション	10,500	607.00	6,373,500	
大和ハウス工業	248,100	4,530.00	1,123,893,000	
ライト工業	16,200	1,282.00	20,768,400	
積水ハウス	273,300	2,161.00	590,601,300	
日特建設	7,100	697.00	4,948,700	
北陸電気工事	4,700	1,152.00	5,414,400	
ユアテック	13,300	878.00	11,677,400	
西部電気工業	1,400	2,925.00	4,095,000	
四電工	1,300	2,884.00	3,749,200	
中電工	10,800	3,180.00	34,344,000	
関電工	33,600	1,212.00	40,723,200	
きんでん	55,900	1,882.00	105,203,800	
東京エネシス	9,600	1,254.00	12,038,400	
トーエネック	2,400	3,360.00	8,064,000	
住友電設	6,700	2,380.00	15,946,000	
日本電設工業	12,900	2,409.00	31,076,100	
協和エクシオ	30,200	2,948.00	89,029,600	
新日本空調	6,500	1,526.00	9,919,000	
N D S	1,300	4,070.00	5,291,000	
九電工	16,500	5,600.00	92,400,000	
三機工業	17,900	1,278.00	22,876,200	
日揮	72,400	2,370.00	171,588,000	
中外炉工業	2,600	2,505.00	6,513,000	
ヤマト	7,000	858.00	6,006,000	
太平電業	5,700	2,783.00	15,863,100	
高砂熱学工業	23,200	2,097.00	48,650,400	

三晃金属工業	900	4,170.00	3,753,000
朝日工業社	1,800	3,490.00	6,282,000
明星工業	15,200	833.00	12,661,600
大気社	11,100	3,820.00	42,402,000
ダイダン	5,600	2,906.00	16,273,600
日比谷総合設備	9,400	2,390.00	22,466,000
東芝プラントシステム	18,300	2,076.00	37,990,800
OSJBホールディングス	37,000	319.00	11,803,000
東洋エンジニアリング	10,000	1,292.00	12,920,000
千代田化工建設	54,800	874.00	47,895,200
新興プランテック	16,200	1,175.00	19,035,000
日本製粉	25,100	1,719.00	43,146,900
日清製粉グループ本社	92,100	2,217.00	204,185,700
日東富士製粉	500	4,905.00	2,452,500
昭和産業	6,900	2,847.00	19,644,300
鳥越製粉	6,700	999.00	6,693,300
中部飼料	9,200	2,378.00	21,877,600
フィード・ワン	50,500	259.00	13,079,500
東洋精糖	1,300	1,218.00	1,583,400
日本甜菜製糖	4,300	2,721.00	11,700,300
三井製糖	5,900	4,650.00	27,435,000
塩水港精糖	9,000	271.00	2,439,000
日新製糖	3,600	2,221.00	7,995,600
森永製菓	17,700	5,630.00	99,651,000
中村屋	1,900	4,995.00	9,490,500
江崎グリコ	21,000	5,590.00	117,390,000
名糖産業	3,600	1,529.00	5,504,400
不二家	4,800	2,541.00	12,196,800
山崎製パン	61,500	2,188.00	134,562,000
第一屋製パン	1,300	1,206.00	1,567,800
モロゾフ	1,300	7,490.00	9,737,000
亀田製菓	4,700	5,470.00	25,709,000
寿スピリッツ	7,200	6,440.00	46,368,000
カルビー	34,300	3,890.00	133,427,000
森永乳業	15,100	5,330.00	80,483,000
六甲バター	3,700	2,928.00	10,833,600
ヤクルト本社	45,000	8,760.00	394,200,000
明治ホールディングス	49,800	9,430.00	469,614,000
雪印メグミルク	18,100	3,290.00	59,549,000
プリマハム	53,000	798.00	42,294,000
日本ハム	65,000	2,641.00	171,665,000
林兼産業	2,700	878.00	2,370,600

丸大食品	40,000	503.00	20,120,000
S Foods	5,300	4,895.00	25,943,500
伊藤ハム米久ホールディングス	48,600	1,035.00	50,301,000
サッポロホールディングス	27,500	3,330.00	91,575,000
アサヒグループホールディングス	157,600	5,702.00	898,635,200
キリンホールディングス	361,700	2,781.50	1,006,068,550
宝ホールディングス	60,800	1,384.00	84,147,200
オエノンホールディングス	21,400	399.00	8,538,600
養命酒製造	2,300	2,592.00	5,961,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	52,800	4,180.00	220,704,000
サントリー食品インターナショナル	57,500	5,120.00	294,400,000
ダイトーグループホールディングス	3,900	5,940.00	23,166,000
伊藤園	24,900	4,430.00	110,307,000
キーコーヒー	7,400	2,164.00	16,013,600
ユニカフェ	2,300	1,216.00	2,796,800
ジャパンフーズ	1,100	1,588.00	1,746,800
日清オイリオグループ	8,900	3,395.00	30,215,500
不二製油グループ本社	20,400	3,295.00	67,218,000
かどや製油	800	6,960.00	5,568,000
J - オイルミルズ	3,900	3,940.00	15,366,000
キッコーマン	58,800	4,580.00	269,304,000
味の素	173,000	2,098.00	362,954,000
キューピー	41,900	2,900.00	121,510,000
ハウス食品グループ本社	28,700	3,660.00	105,042,000
カゴメ	30,100	4,090.00	123,109,000
焼津水産化学工業	3,700	1,240.00	4,588,000
アリアケジャパン	6,900	9,500.00	65,550,000
ピエトロ	1,000	1,654.00	1,654,000
エバラ食品工業	1,700	2,164.00	3,678,800
ニチレイ	35,800	3,015.00	107,937,000
東洋水産	41,300	4,780.00	197,414,000
イトアンド	2,100	2,345.00	4,924,500
大冷	800	2,254.00	1,803,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	11,410.00	2,282,000
日清食品ホールディングス	32,800	8,110.00	266,008,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,483.00	11,864,000
一正蒲鉾	2,900	1,310.00	3,799,000
フジッコ	8,100	2,516.00	20,379,600
ロック・フィールド	8,100	2,331.00	18,881,100
日本たばこ産業	465,500	3,653.00	1,700,471,500
ケンコーマヨネーズ	5,000	3,970.00	19,850,000
わらべや日洋ホールディングス	4,900	2,910.00	14,259,000

なとり	4,200	2,029.00	8,521,800
イフジ産業	1,300	797.00	1,036,100
ピクルスコーポレーション	1,100	2,033.00	2,236,300
北の達人コーポレーション	7,300	2,910.00	21,243,000
ユーグレナ	29,100	1,093.00	31,806,300
ミヨシ油脂	2,900	1,458.00	4,228,200
理研ビタミン	2,800	4,290.00	12,012,000
片倉工業	9,100	1,618.00	14,723,800
グンゼ	5,900	6,740.00	39,766,000
東洋紡	29,200	2,059.00	60,122,800
ユニチカ	22,900	805.00	18,434,500
富士紡ホールディングス	4,400	3,780.00	16,632,000
倉敷紡績	79,000	370.00	29,230,000
シキボウ	4,000	1,399.00	5,596,000
日本毛織	22,300	1,180.00	26,314,000
トーア紡コーポレーション	3,300	605.00	1,996,500
ダイドーリミテッド	9,000	469.00	4,221,000
帝国繊維	8,300	2,633.00	21,853,900
帝人	64,200	2,492.00	159,986,400
東レ	569,700	1,122.50	639,488,250
サカイオーベックス	2,000	2,617.00	5,234,000
住江織物	2,100	3,255.00	6,835,500
日本フェルト	4,300	519.00	2,231,700
イチカワ	5,000	392.00	1,960,000
日東製網	900	1,875.00	1,687,500
アツギ	5,400	1,303.00	7,036,200
ダイニック	3,000	1,158.00	3,474,000
セーレン	18,200	2,304.00	41,932,800
ソトー	3,100	1,136.00	3,521,600
東海染工	1,300	1,551.00	2,016,300
小松精練	12,300	917.00	11,279,100
ワコールホールディングス	21,800	3,470.00	75,646,000
ホギメディカル	5,000	8,520.00	42,600,000
レナウン	21,200	200.00	4,240,000
クラウドシアホールディングス	2,200	616.00	1,355,200
T S Iホールディングス	29,900	749.00	22,395,100
三陽商会	4,200	2,095.00	8,799,000
オンワードホールディングス	47,300	919.00	43,468,700
ルックホールディングス	14,000	389.00	5,446,000
ゴールドウイン	2,200	11,160.00	24,552,000
デサント	18,100	1,975.00	35,747,500
キング	4,200	636.00	2,671,200

ヤマトインターナショナル	5,700	473.00	2,696,100
特種東海製紙	4,300	4,325.00	18,597,500
王子ホールディングス	331,000	777.00	257,187,000
日本製紙	35,300	2,065.00	72,894,500
三菱製紙	11,200	728.00	8,153,600
北越紀州製紙	44,000	720.00	31,680,000
中越パルプ工業	3,100	2,037.00	6,314,700
巴川製紙所	12,000	318.00	3,816,000
大王製紙	31,400	1,515.00	47,571,000
阿波製紙	1,900	719.00	1,366,100
レンゴー	76,000	868.00	65,968,000
トーモク	4,500	2,282.00	10,269,000
ザ・パック	5,600	3,910.00	21,896,000
クラレ	132,200	2,099.00	277,487,800
旭化成	489,700	1,483.50	726,469,950
共和レザー	4,600	998.00	4,590,800
昭和電工	52,300	5,080.00	265,684,000
住友化学	578,000	859.00	496,502,000
住友精化	3,300	5,970.00	19,701,000
日産化学工業	45,700	4,620.00	211,134,000
ラサ工業	2,800	2,688.00	7,526,400
クレハ	6,700	8,030.00	53,801,000
多木化学	1,100	5,760.00	6,336,000
テイカ	6,000	3,330.00	19,980,000
石原産業	14,200	2,076.00	29,479,200
片倉コープアグリ	1,900	1,376.00	2,614,400
日東エフシー	4,700	815.00	3,830,500
日本曹達	54,000	763.00	41,202,000
東ソー	113,500	2,502.00	283,977,000
トクヤマ	22,800	3,660.00	83,448,000
セントラル硝子	16,100	2,417.00	38,913,700
東亜合成	46,100	1,447.00	66,706,700
大阪ソーダ	7,000	2,931.00	20,517,000
関東電化工業	18,800	1,291.00	24,270,800
デンカ	28,900	4,410.00	127,449,000
信越化学工業	130,700	12,500.00	1,633,750,000
日本カーバイド工業	2,500	2,156.00	5,390,000
堺化学工業	5,400	3,040.00	16,416,000
エア・ウォーター	64,700	2,424.00	156,832,800
大陽日酸	60,500	1,706.00	103,213,000
日本化学工業	2,900	2,737.00	7,937,300
東邦アセチレン	1,100	1,611.00	1,772,100

日本パーカライジング	40,100	2,014.00	80,761,400
高压ガス工業	11,700	957.00	11,196,900
チタン工業	800	2,965.00	2,372,000
四国化成工業	11,400	1,850.00	21,090,000
戸田工業	1,600	4,625.00	7,400,000
ステラ ケミファ	4,000	3,830.00	15,320,000
保土谷化学工業	2,500	6,290.00	15,725,000
日本触媒	12,300	7,790.00	95,817,000
大日精化工業	6,100	5,500.00	33,550,000
カネカ	106,000	1,033.00	109,498,000
三菱瓦斯化学	64,700	3,230.00	208,981,000
三井化学	71,400	3,520.00	251,328,000
J S R	78,900	2,270.00	179,103,000
東京応化工業	13,600	5,370.00	73,032,000
大阪有機化学工業	5,100	1,795.00	9,154,500
三菱ケミカルホールディングス	525,900	1,217.50	640,283,250
K Hネオケム	12,000	2,943.00	35,316,000
ダイセル	105,900	1,327.00	140,529,300
住友ベークライト	63,000	974.00	61,362,000
積水化学工業	163,100	2,306.00	376,108,600
日本ゼオン	66,200	1,662.00	110,024,400
アイカ工業	22,000	4,215.00	92,730,000
宇部興産	39,500	3,305.00	130,547,500
積水樹脂	12,200	2,391.00	29,170,200
タキロンシーアイ	16,000	792.00	12,672,000
旭有機材	4,600	2,091.00	9,618,600
日立化成	38,800	2,997.00	116,283,600
ニチバン	3,900	2,966.00	11,567,400
リケンテクノス	16,900	611.00	10,325,900
大倉工業	19,000	677.00	12,863,000
積水化成成品工業	9,900	1,448.00	14,335,200
群栄化学工業	1,900	3,965.00	7,533,500
タイガースポリマー	3,900	846.00	3,299,400
ミライアル	2,600	2,512.00	6,531,200
ダイキアクシス	2,600	1,513.00	3,933,800
ダイキョーニシカワ	15,600	1,843.00	28,750,800
竹本容器	900	2,437.00	2,193,300
日本化薬	51,000	1,653.00	84,303,000
カーリットホールディングス	7,400	1,302.00	9,634,800
日本精化	6,500	1,196.00	7,774,000
扶桑化学工業	5,600	3,165.00	17,724,000
A D E K A	33,900	1,925.00	65,257,500

日油	30,300	3,060.00	92,718,000
ハリマ化成グループ	6,100	910.00	5,551,000
花王	184,300	7,689.00	1,417,082,700
第一工業製薬	15,000	926.00	13,890,000
日華化学	2,500	1,250.00	3,125,000
ニイタカ	1,200	1,852.00	2,222,400
三洋化成工業	4,900	5,710.00	27,979,000
有機合成薬品工業	5,300	308.00	1,632,400
大日本塗料	9,000	1,793.00	16,137,000
日本ペイントホールディングス	60,600	4,110.00	249,066,000
関西ペイント	82,500	2,819.00	232,567,500
神東塗料	6,000	266.00	1,596,000
中国塗料	22,600	964.00	21,786,400
日本特殊塗料	5,000	2,357.00	11,785,000
藤倉化成	9,900	743.00	7,355,700
太陽ホールディングス	6,000	5,250.00	31,500,000
D I C	31,000	4,295.00	133,145,000
サカタインクス	16,100	1,873.00	30,155,300
東洋インキＳＣホールディングス	78,000	661.00	51,558,000
T & K T O K A	5,300	1,498.00	7,939,400
富士フィルムホールディングス	155,700	4,800.00	747,360,000
資生堂	139,700	5,752.00	803,554,400
ライオン	104,500	2,093.00	218,718,500
高砂香料工業	4,700	3,555.00	16,708,500
マンダム	14,600	3,785.00	55,261,000
ミルボン	10,000	3,705.00	37,050,000
ファンケル	18,200	3,465.00	63,063,000
コーセー	12,700	19,100.00	242,570,000
コタ	3,300	1,725.00	5,692,500
シーズ・ホールディングス	10,200	5,860.00	59,772,000
シーボン	900	3,850.00	3,465,000
ポーラ・オルビスホールディングス	32,000	4,380.00	140,160,000
ノエビアホールディングス	4,800	8,900.00	42,720,000
アジュバンコスメジャパン	1,700	1,112.00	1,890,400
エステー	5,400	2,829.00	15,276,600
アグロ カネショウ	3,100	2,138.00	6,627,800
コニシ	12,400	2,094.00	25,965,600
長谷川香料	10,000	2,308.00	23,080,000
星光P M C	4,400	1,271.00	5,592,400
小林製薬	21,000	7,580.00	159,180,000
荒川化学工業	6,800	2,221.00	15,102,800
メック	5,200	2,499.00	12,994,800

日本高純度化学	2,100	2,704.00	5,678,400
タカラバイオ	19,700	1,779.00	35,046,300
J C U	4,600	5,590.00	25,714,000
新田ゼラチン	5,200	849.00	4,414,800
O A T アグリオ	1,200	2,876.00	3,451,200
デクセリアルズ	19,300	1,570.00	30,301,000
アース製薬	5,700	5,560.00	31,692,000
北興化学工業	7,700	768.00	5,913,600
大成ラミック	2,300	3,300.00	7,590,000
クミアイ化学工業	34,100	720.00	24,552,000
日本農薬	19,500	643.00	12,538,500
アキレス	5,700	2,356.00	13,429,200
有沢製作所	12,600	1,227.00	15,460,200
日東電工	56,600	10,000.00	566,000,000
レック	4,500	3,200.00	14,400,000
きもと	12,900	317.00	4,089,300
藤森工業	6,300	4,070.00	25,641,000
前澤化成工業	5,100	1,229.00	6,267,900
J S P	4,400	3,830.00	16,852,000
エフピコ	6,200	5,900.00	36,580,000
天馬	5,900	2,322.00	13,699,800
信越ポリマー	15,400	1,320.00	20,328,000
東リ	18,800	445.00	8,366,000
ニフコ	13,800	7,660.00	105,708,000
日本バルカー工業	6,100	3,365.00	20,526,500
ユニ・チャーム	159,000	3,037.00	482,883,000
協和発酵キリン	93,900	2,181.00	204,795,900
武田薬品工業	276,200	6,491.00	1,792,814,200
アステラス製薬	770,400	1,396.50	1,075,863,600
大日本住友製薬	55,600	1,600.00	88,960,000
塩野義製薬	107,300	6,213.00	666,654,900
田辺三菱製薬	91,500	2,279.00	208,528,500
わかもと製薬	9,000	281.00	2,529,000
あすか製薬	8,600	2,096.00	18,025,600
日本新薬	19,600	8,050.00	157,780,000
バイオフェルミン製薬	1,300	3,075.00	3,997,500
中外製薬	78,200	5,880.00	459,816,000
科研製薬	13,500	5,850.00	78,975,000
エーザイ	89,700	6,337.00	568,428,900
ロート製薬	41,200	3,050.00	125,660,000
小野薬品工業	177,100	2,691.50	476,664,650
久光製薬	22,100	7,480.00	165,308,000

持田製薬	5,300	8,540.00	45,262,000
参天製薬	141,900	1,775.00	251,872,500
扶桑薬品工業	2,600	2,905.00	7,553,000
日本ケミファ	1,000	4,815.00	4,815,000
ツムラ	26,800	3,725.00	99,830,000
日医工	19,800	1,713.00	33,917,400
キッセイ薬品工業	13,900	3,170.00	44,063,000
生化学工業	14,600	1,738.00	25,374,800
栄研化学	6,100	5,170.00	31,537,000
日水製薬	3,200	1,518.00	4,857,600
鳥居薬品	4,700	3,020.00	14,194,000
JCRファーマ	5,300	5,540.00	29,362,000
東和薬品	3,600	6,260.00	22,536,000
富士製薬工業	2,500	4,220.00	10,550,000
沢井製薬	15,100	4,975.00	75,122,500
ゼリア新薬工業	16,100	2,294.00	36,933,400
第一三共	214,500	3,468.00	743,886,000
キョーリン製薬ホールディングス	21,000	2,073.00	43,533,000
大幸薬品	4,000	2,496.00	9,984,000
ダイト	4,700	3,540.00	16,638,000
大塚ホールディングス	155,800	4,897.00	762,952,600
大正製薬ホールディングス	16,800	9,090.00	152,712,000
ペプチドリーム	30,800	4,505.00	138,754,000
日本コークス工業	63,300	128.00	8,102,400
昭和シェル石油	70,200	1,630.00	114,426,000
ニチレキ	9,600	1,359.00	13,046,400
ユシロ化学工業	4,200	1,736.00	7,291,200
ビーピー・カストロール	3,200	2,126.00	6,803,200
富士石油	18,200	596.00	10,847,200
MORESCO	2,700	2,108.00	5,691,600
出光興産	62,900	4,360.00	274,244,000
JXTGホールディングス	1,196,400	766.90	917,519,160
コスモエネルギーホールディングス	21,700	4,600.00	99,820,000
横浜ゴム	43,400	2,837.00	123,125,800
東洋ゴム工業	44,400	2,381.00	105,716,400
ブリヂストン	265,000	5,502.00	1,458,030,000
住友ゴム工業	77,100	2,161.00	166,613,100
藤倉ゴム工業	6,600	932.00	6,151,200
オカモト	26,000	1,235.00	32,110,000
フコク	3,300	1,088.00	3,590,400
ニッタ	7,800	4,780.00	37,284,000
住友理工	14,600	1,271.00	18,556,600

三ツ星ベルト	18,000	1,521.00	27,378,000
バンドー化学	14,300	1,373.00	19,633,900
日東紡績	11,200	3,250.00	36,400,000
旭硝子	76,600	4,995.00	382,617,000
日本板硝子	36,700	1,005.00	36,883,500
石塚硝子	1,000	3,070.00	3,070,000
日本山村硝子	31,000	191.00	5,921,000
日本電気硝子	32,400	4,590.00	148,716,000
オハラ	3,000	4,050.00	12,150,000
住友大阪セメント	146,000	534.00	77,964,000
太平洋セメント	47,400	4,735.00	224,439,000
日本ヒューム	7,500	808.00	6,060,000
日本コンクリート工業	16,200	488.00	7,905,600
三谷セキサン	3,900	2,677.00	10,440,300
アジアパイルホールディングス	9,700	723.00	7,013,100
東海カーボン	68,100	1,607.00	109,436,700
日本カーボン	3,900	5,150.00	20,085,000
東洋炭素	4,900	3,785.00	18,546,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	5,840.00	25,696,000
TOTO	57,700	6,500.00	375,050,000
日本碍子	91,500	2,263.00	207,064,500
日本特殊陶業	64,300	2,903.00	186,662,900
MARUWA	2,600	8,110.00	21,086,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,280.00	6,560,000
黒崎播磨	1,500	4,730.00	7,095,000
ヨータイ	4,500	617.00	2,776,500
イソライト工業	3,900	1,162.00	4,531,800
東京窯業	9,600	446.00	4,281,600
ニッカトー	2,600	1,025.00	2,665,000
フジミインコーポレーテッド	6,700	2,367.00	15,858,900
エーアンドエーマテリアル	1,600	1,401.00	2,241,600
ニチアス	41,000	1,551.00	63,591,000
ニチハ	11,300	4,850.00	54,805,000
新日鐵住金	331,800	2,870.50	952,431,900
神戸製鋼所	135,600	1,100.00	149,160,000
中山製鋼所	10,300	735.00	7,570,500
合同製鐵	4,000	2,195.00	8,780,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	200,200	2,658.50	532,231,700
日新製鋼	20,500	1,874.00	38,417,000
東京製鐵	39,900	975.00	38,902,500
共英製鋼	8,400	2,114.00	17,757,600
大和工業	15,800	3,350.00	52,930,000

東京鐵鋼	3,100	2,022.00	6,268,200
大阪製鐵	4,900	2,402.00	11,769,800
淀川製鋼所	10,800	3,370.00	36,396,000
東洋鋼鈹	18,800	475.00	8,930,000
丸一鋼管	26,300	3,310.00	87,053,000
モリ工業	2,400	3,790.00	9,096,000
大同特殊鋼	13,100	6,720.00	88,032,000
日本高周波鋼業	2,700	944.00	2,548,800
日本冶金工業	61,300	320.00	19,616,000
山陽特殊製鋼	8,600	2,819.00	24,243,400
愛知製鋼	4,200	4,415.00	18,543,000
日立金属	79,900	1,637.00	130,796,300
日本金属	1,900	2,775.00	5,272,500
大平洋金属	4,600	3,370.00	15,502,000
新日本電工	44,400	514.00	22,821,600
栗本鐵工所	3,800	2,602.00	9,887,600
虹技	1,100	2,188.00	2,406,800
日本鑄鉄管	8,000	181.00	1,448,000
三菱製鋼	5,500	2,806.00	15,433,000
日亜鋼業	10,800	362.00	3,909,600
日本精線	1,200	5,570.00	6,684,000
シンニッタン	5,800	827.00	4,796,600
新家工業	1,700	2,249.00	3,823,300
大紀アルミニウム工業所	12,300	890.00	10,947,000
日本輕金属ホールディングス	216,900	307.00	66,588,300
三井金属鉱業	20,000	6,630.00	132,600,000
東邦亜鉛	4,100	6,550.00	26,855,000
三菱マテリアル	49,000	4,060.00	198,940,000
住友金属鉱山	94,800	5,191.00	492,106,800
D O W Aホールディングス	18,800	4,560.00	85,728,000
古河機械金属	12,300	2,554.00	31,414,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,800	2,424.00	18,907,200
東邦チタニウム	13,400	1,345.00	18,023,000
U A C J	11,300	2,940.00	33,222,000
古河電気工業	24,700	6,260.00	154,622,000
住友電気工業	277,300	1,951.50	541,150,950
フジクラ	89,700	1,164.00	104,410,800
昭和電線ホールディングス	9,400	964.00	9,061,600
東京特殊電線	1,000	2,843.00	2,843,000
タツタ電線	14,800	945.00	13,986,000
カナレ電気	1,300	2,507.00	3,259,100
平河ヒューテック	3,800	1,345.00	5,111,000

リョービ	9,200	3,280.00	30,176,000
アーレスティ	9,200	918.00	8,445,600
アサヒホールディングス	12,800	2,134.00	27,315,200
稲葉製作所	4,200	1,423.00	5,976,600
宮地エンジニアリンググループ	2,100	2,688.00	5,644,800
トーカロ	5,200	5,670.00	29,484,000
アルファC o	2,600	2,290.00	5,954,000
SUMCO	68,300	3,305.00	225,731,500
川田テクノロジーズ	1,500	6,170.00	9,255,000
RS Technologies	1,000	6,890.00	6,890,000
東洋製罐グループホールディングス	50,700	1,805.00	91,513,500
ホッカカンホールディングス	19,000	431.00	8,189,000
コロナ	4,100	1,439.00	5,899,900
横河ブリッジホールディングス	13,800	2,630.00	36,294,000
駒井ハルテック	1,600	2,613.00	4,180,800
高田機工	700	3,385.00	2,369,500
三和ホールディングス	71,100	1,561.00	110,987,100
文化シャッター	22,000	1,012.00	22,264,000
三協立山	10,300	1,542.00	15,882,600
アルインコ	5,400	1,274.00	6,879,600
東洋シャッター	2,000	628.00	1,256,000
LIXILグループ	109,300	3,225.00	352,492,500
日本フィルコン	5,700	748.00	4,263,600
ノーリツ	16,600	2,179.00	36,171,400
長府製作所	8,400	2,574.00	21,621,600
リンナイ	13,200	10,270.00	135,564,000
ダイニチ工業	4,000	856.00	3,424,000
日東精工	10,300	680.00	7,004,000
三洋工業	900	2,191.00	1,971,900
岡部	15,100	1,092.00	16,489,200
ジーテクト	8,200	2,270.00	18,614,000
東プレ	13,800	3,260.00	44,988,000
高周波熱錬	14,300	1,247.00	17,832,100
東京製綱	5,300	1,809.00	9,587,700
サンコール	4,200	733.00	3,078,600
モリテック スチール	4,400	1,193.00	5,249,200
パイオラックス	11,000	3,355.00	36,905,000
エイチワン	5,500	1,789.00	9,839,500
日本発條	73,900	1,234.00	91,192,600
中央発條	900	3,690.00	3,321,000
アドバネクス	1,200	3,765.00	4,518,000
立川ブラインド工業	3,300	1,544.00	5,095,200

三益半導体工業	6,600	2,278.00	15,034,800
日本ドライケミカル	1,000	2,581.00	2,581,000
日本製鋼所	24,300	3,675.00	89,302,500
三浦工業	32,200	3,215.00	103,523,000
タクマ	25,400	1,500.00	38,100,000
ツガミ	20,000	1,771.00	35,420,000
オークマ	8,700	8,040.00	69,948,000
東芝機械	42,000	911.00	38,262,000
アマダホールディングス	114,600	1,660.00	190,236,000
アイダエンジニアリング	19,200	1,528.00	29,337,600
滝澤鉄工所	2,300	2,433.00	5,595,900
富士機械製造	22,300	2,398.00	53,475,400
牧野フライス製作所	37,000	1,254.00	46,398,000
オーエスジー	34,300	2,872.00	98,509,600
ダイジェット工業	1,100	1,935.00	2,128,500
旭ダイヤモンド工業	22,400	1,375.00	30,800,000
D M G 森精機	41,300	2,697.00	111,386,100
ソディック	16,200	1,583.00	25,644,600
ディスコ	10,000	27,420.00	274,200,000
日東工器	4,600	2,979.00	13,703,400
日進工具	2,000	2,856.00	5,712,000
パンチ工業	6,200	1,504.00	9,324,800
富士ダイス	2,800	1,144.00	3,203,200
豊和工業	4,300	1,524.00	6,553,200
O K K	3,100	1,379.00	4,274,900
東洋機械金属	5,800	1,008.00	5,846,400
島精機製作所	9,400	8,050.00	75,670,000
N C ホールディングス	2,400	815.00	1,956,000
フリュー	5,300	1,115.00	5,909,500
ヤマシンフィルタ	10,200	1,485.00	15,147,000
日阪製作所	10,700	1,188.00	12,711,600
やまびこ	14,400	1,855.00	26,712,000
平田機工	2,100	12,650.00	26,565,000
ペガサスミシン製造	6,900	809.00	5,582,100
ナプテスコ	40,800	5,360.00	218,688,000
三井海洋開発	7,900	3,005.00	23,739,500
レオン自動機	6,600	2,290.00	15,114,000
S M C	23,500	55,270.00	1,298,845,000
新川	5,900	1,331.00	7,852,900
ホソカワミクロン	2,800	8,440.00	23,632,000
ユニオンツール	3,400	4,410.00	14,994,000
オイレス工業	9,600	2,303.00	22,108,800

日精エー・エス・ピー機械	2,500	7,610.00	19,025,000
サトーホールディングス	9,800	3,715.00	36,407,000
技研製作所	3,800	2,898.00	11,012,400
日本エアージェット	2,500	961.00	2,402,500
日精樹脂工業	6,400	1,835.00	11,744,000
オカダアイヨン	2,200	2,179.00	4,793,800
ワイエイシーホールディングス	2,500	1,155.00	2,887,500
小松製作所	362,000	4,290.00	1,552,980,000
住友重機械工業	43,000	4,955.00	213,065,000
日立建機	35,100	4,385.00	153,913,500
日工	2,300	2,538.00	5,837,400
巴工業	3,200	2,053.00	6,569,600
井関農機	7,600	2,852.00	21,675,200
TOWA	5,800	2,313.00	13,415,400
丸山製作所	1,800	2,021.00	3,637,800
北川鉄工所	3,700	3,165.00	11,710,500
ローツェ	3,700	2,801.00	10,363,700
タカキタ	2,600	1,150.00	2,990,000
クボタ	404,600	2,302.00	931,389,200
荏原実業	2,300	1,905.00	4,381,500
三菱化工機	2,700	2,369.00	6,396,300
月島機械	15,100	1,434.00	21,653,400
帝国電機製作所	5,200	1,620.00	8,424,000
新東工業	18,100	1,477.00	26,733,700
澁谷工業	6,600	4,915.00	32,439,000
アイチ コーポレーション	13,300	827.00	10,999,100
小森コーポレーション	19,100	1,604.00	30,636,400
鶴見製作所	6,500	2,154.00	14,001,000
住友精密工業	12,000	405.00	4,860,000
酒井重工業	1,500	4,210.00	6,315,000
荏原製作所	30,900	4,670.00	144,303,000
石井鐵工所	1,300	1,988.00	2,584,400
西島製作所	7,900	1,154.00	9,116,600
北越工業	8,500	1,233.00	10,480,500
ダイキン工業	102,300	13,890.00	1,420,947,000
オルガノ	2,800	3,825.00	10,710,000
トーヨーカネツ	3,200	4,430.00	14,176,000
栗田工業	40,600	3,765.00	152,859,000
椿本チエイン	45,000	946.00	42,570,000
大同工業	3,000	1,795.00	5,385,000
木村化工機	6,700	594.00	3,979,800
アネスト岩田	12,700	1,317.00	16,725,900

ダイフク	38,200	7,720.00	294,904,000
サムコ	2,100	1,427.00	2,996,700
加藤製作所	3,600	3,360.00	12,096,000
油研工業	1,600	2,839.00	4,542,400
タダノ	36,300	1,935.00	70,240,500
フジテック	24,100	1,526.00	36,776,600
C K D	20,900	2,934.00	61,320,600
キトー	5,700	1,846.00	10,522,200
平和	23,300	2,133.00	49,698,900
理想科学工業	7,500	2,123.00	15,922,500
S A N K Y O	18,800	3,465.00	65,142,000
日本金銭機械	6,900	1,185.00	8,176,500
マースエンジニアリング	4,800	2,471.00	11,860,800
福島工業	4,600	5,020.00	23,092,000
オーイズミ	3,100	553.00	1,714,300
ダイコク電機	3,500	1,769.00	6,191,500
竹内製作所	12,500	2,891.00	36,137,500
アマノ	23,200	3,110.00	72,152,000
J U K I	11,200	2,000.00	22,400,000
サンデンホールディングス	9,200	2,282.00	20,994,400
蛇の目マシン工業	6,800	844.00	5,739,200
マックス	11,600	1,610.00	18,676,000
グローリー	22,400	4,340.00	97,216,000
新晃工業	7,600	2,135.00	16,226,000
大和冷機工業	12,100	1,515.00	18,331,500
セガサミーホールディングス	74,400	1,429.00	106,317,600
日本ピストンリング	2,700	2,255.00	6,088,500
リケン	3,500	6,360.00	22,260,000
T P R	8,400	3,630.00	30,492,000
ツバキ・ナカシマ	7,500	3,015.00	22,612,500
ホシザキ	23,600	10,350.00	244,260,000
大豊工業	6,100	1,687.00	10,290,700
日本精工	154,000	1,877.00	289,058,000
N T N	173,500	579.00	100,456,500
ジェイテクト	79,900	2,039.00	162,916,100
不二越	70,000	831.00	58,170,000
日本トムソン	24,100	870.00	20,967,000
T H K	46,700	4,760.00	222,292,000
ユーシン精機	3,300	3,675.00	12,127,500
前澤給装工業	2,900	1,998.00	5,794,200
イーグル工業	9,300	2,190.00	20,367,000
前澤工業	5,000	439.00	2,195,000

日本ピラー工業	7,600	1,951.00	14,827,600
キット	33,400	947.00	31,629,800
マキタ	97,800	5,100.00	498,780,000
日立造船	60,200	613.00	36,902,600
三菱重工業	125,700	4,255.00	534,853,500
I H I	57,700	3,805.00	219,548,500
スター精密	12,100	2,427.00	29,366,700
日清紡ホールディングス	45,800	1,554.00	71,173,200
イビデン	46,100	1,713.00	78,969,300
コニカミノルタ	175,600	1,119.00	196,496,400
ブラザー工業	91,600	2,975.00	272,510,000
ミネベアミツミ	139,200	2,599.00	361,780,800
日立製作所	1,800,000	932.90	1,679,220,000
三菱電機	749,700	2,124.50	1,592,737,650
富士電機	226,000	948.00	214,248,000
東洋電機製造	3,200	1,887.00	6,038,400
安川電機	86,900	5,980.00	519,662,000
シンフォニアテクノロジー	49,000	471.00	23,079,000
明電舎	64,000	468.00	29,952,000
オリジン電気	2,200	1,865.00	4,103,000
山洋電気	3,600	9,450.00	34,020,000
デンヨー	6,900	1,990.00	13,731,000
東芝テック	54,000	697.00	37,638,000
芝浦メカトロニクス	11,000	477.00	5,247,000
マブチモーター	20,900	6,600.00	137,940,000
日本電産	90,200	17,825.00	1,607,815,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,800	2,999.00	8,397,200
東光高岳	3,900	1,900.00	7,410,000
ダブル・スコープ	11,000	2,197.00	24,167,000
ダイヘン	41,000	1,095.00	44,895,000
ヤーマン	9,600	1,916.00	18,393,600
JVCケンウッド	55,500	409.00	22,699,500
ミマキエンジニアリング	6,800	1,179.00	8,017,200
第一精工	3,500	3,225.00	11,287,500
日新電機	17,600	1,321.00	23,249,600
大崎電気工業	16,000	852.00	13,632,000
オムロン	79,700	7,600.00	605,720,000
日東工業	12,100	1,822.00	22,046,200
I D E C	9,600	3,285.00	31,536,000
不二電機工業	900	1,438.00	1,294,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	135,000	589.00	79,515,000
サクサホールディングス	1,900	2,150.00	4,085,000

メルコホールディングス	3,600	4,165.00	14,994,000
テクノメディカ	1,800	1,954.00	3,517,200
日本電気	97,000	3,145.00	305,065,000
富士通	771,000	808.50	623,353,500
沖電気工業	30,600	1,587.00	48,562,200
岩崎通信機	3,300	847.00	2,795,100
電気興業	4,300	3,200.00	13,760,000
サンケン電気	44,000	817.00	35,948,000
ナカヨ	1,500	2,136.00	3,204,000
アイホン	4,300	2,018.00	8,677,400
ルネサスエレクトロニクス	39,000	1,323.00	51,597,000
セイコーエプソン	111,600	2,760.00	308,016,000
ワコム	58,500	637.00	37,264,500
アルバック	12,600	7,980.00	100,548,000
アクセル	3,200	832.00	2,662,400
E I Z O	6,900	5,540.00	38,226,000
ジャパンディスプレイ	153,800	238.00	36,604,400
日本信号	20,800	1,163.00	24,190,400
京三製作所	18,000	795.00	14,310,000
能美防災	10,000	2,049.00	20,490,000
ホーチキ	5,500	2,500.00	13,750,000
エレコム	6,500	2,635.00	17,127,500
パナソニック	856,400	1,700.00	1,455,880,000
アンリツ	54,700	1,373.00	75,103,100
富士通ゼネラル	22,900	2,378.00	54,456,200
日立国際電気	12,200	3,110.00	37,942,000
ソニー	500,600	5,572.00	2,789,343,200
T D K	39,200	10,480.00	410,816,000
帝国通信工業	3,400	1,362.00	4,630,800
タムラ製作所	28,900	909.00	26,270,100
アルプス電気	64,600	3,265.00	210,919,000
池上通信機	24,000	178.00	4,272,000
パイオニア	125,400	244.00	30,597,600
日本電波工業	6,900	793.00	5,471,700
鈴木	3,000	1,247.00	3,741,000
日本トリム	1,600	5,760.00	9,216,000
ローランド ディー . ジー .	3,900	3,165.00	12,343,500
フォスター電機	8,800	2,916.00	25,660,800
クラリオン	39,000	407.00	15,873,000
S M K	19,000	625.00	11,875,000
ヨコオ	4,900	2,241.00	10,980,900
ホシデン	19,000	1,804.00	34,276,000

ヒロセ電機	12,100	17,190.00	207,999,000
日本航空電子工業	19,000	1,908.00	36,252,000
TOA	8,100	1,505.00	12,190,500
マクセルホールディングス	14,900	2,570.00	38,293,000
古野電気	9,000	839.00	7,551,000
ユニデンホールディングス	21,000	335.00	7,035,000
アルパイン	17,900	2,386.00	42,709,400
スミダコーポレーション	7,700	2,089.00	16,085,300
アイコム	4,100	2,691.00	11,033,100
リオン	3,200	2,559.00	8,188,800
本多通信工業	5,900	1,473.00	8,690,700
船井電機	7,300	862.00	6,292,600
横河電機	75,000	2,243.00	168,225,000
新電元工業	2,600	10,240.00	26,624,000
アズビル	22,500	5,240.00	117,900,000
東亜ディーケーケー	3,800	1,142.00	4,339,600
日本光電工業	31,400	2,591.00	81,357,400
チノー	2,600	1,835.00	4,771,000
共和電業	8,500	465.00	3,952,500
日本電子材料	3,000	611.00	1,833,000
堀場製作所	14,800	7,340.00	108,632,000
アドバンテスト	41,800	2,303.00	96,265,400
小野測器	3,300	789.00	2,603,700
エスペック	6,700	2,925.00	19,597,500
キーエンス	36,800	71,510.00	2,631,568,000
日置電機	3,900	3,270.00	12,753,000
シスメックス	58,300	9,100.00	530,530,000
日本マイクロニクス	13,200	1,245.00	16,434,000
メガチップス	5,900	3,850.00	22,715,000
O B A R A G R O U P	4,400	8,200.00	36,080,000
澤藤電機	800	2,215.00	1,772,000
コーセル	10,500	1,926.00	20,223,000
イリソ電子工業	6,300	7,350.00	46,305,000
新日本無線	4,600	1,019.00	4,687,400
オブテックスグループ	6,100	6,610.00	40,321,000
千代田インテグレ	3,700	2,612.00	9,664,400
アイ・オー・データ機器	3,200	1,111.00	3,555,200
レーザーテック	16,500	4,025.00	66,412,500
スタンレー電気	57,400	4,650.00	266,910,000
岩崎電気	3,000	1,686.00	5,058,000
ウシオ電機	45,700	1,691.00	77,278,700
岡谷電機産業	4,100	713.00	2,923,300

ヘリオス テクノ ホールディング	6,500	1,156.00	7,514,000
日本セラミック	7,600	3,160.00	24,016,000
遠藤照明	3,900	1,323.00	5,159,700
古河電池	5,400	1,165.00	6,291,000
双信電機	3,400	783.00	2,662,200
山一電機	5,500	2,343.00	12,886,500
図研	4,900	1,922.00	9,417,800
日本電子	27,000	684.00	18,468,000
カシオ計算機	60,300	1,682.00	101,424,600
ファナック	71,200	31,990.00	2,277,688,000
日本シイエムケイ	13,400	1,070.00	14,338,000
エンプラス	3,400	4,875.00	16,575,000
大真空	2,800	1,716.00	4,804,800
ローム	33,700	12,970.00	437,089,000
浜松ホトニクス	54,600	4,190.00	228,774,000
三井ハイテック	10,000	2,110.00	21,100,000
新光電気工業	28,400	930.00	26,412,000
京セラ	123,100	7,581.00	933,221,100
太陽誘電	33,800	1,927.00	65,132,600
村田製作所	78,700	16,165.00	1,272,185,500
ユーシン	11,200	738.00	8,265,600
双葉電子工業	12,300	2,413.00	29,679,900
北陸電気工業	3,100	1,879.00	5,824,900
ニチコン	23,800	1,533.00	36,485,400
日本ケミコン	6,100	3,720.00	22,692,000
K O A	10,400	2,482.00	25,812,800
市光工業	11,300	954.00	10,780,200
小糸製作所	44,900	8,200.00	368,180,000
ミツバ	13,900	1,649.00	22,921,100
S C R E E Nホールディングス	14,200	9,800.00	139,160,000
キャノン電子	6,900	2,508.00	17,305,200
キャノン	403,600	4,359.00	1,759,292,400
リコー	225,400	1,077.00	242,755,800
M U T O Hホールディングス	1,100	2,504.00	2,754,400
東京エレクトロン	50,000	22,785.00	1,139,250,000
トヨタ紡織	21,900	2,441.00	53,457,900
芦森工業	1,600	2,996.00	4,793,600
ユニプレス	14,500	3,055.00	44,297,500
豊田自動織機	60,700	7,360.00	446,752,000
モリタホールディングス	12,100	2,152.00	26,039,200
三櫻工業	9,500	882.00	8,379,000
デンソー	166,300	7,048.00	1,172,082,400

東海理化電機製作所	19,800	2,430.00	48,114,000
三井造船	27,500	2,008.00	55,220,000
川崎重工業	58,500	4,450.00	260,325,000
名村造船所	22,500	756.00	17,010,000
サノヤホールディングス	9,100	302.00	2,748,200
三菱ロジスネクスト	9,500	1,061.00	10,079,500
近畿車輛	1,100	3,145.00	3,459,500
日産自動車	884,700	1,163.00	1,028,906,100
いすゞ自動車	217,500	1,918.00	417,165,000
トヨタ自動車	911,400	7,679.00	6,998,640,600
日野自動車	107,400	1,519.00	163,140,600
三菱自動車工業	278,200	878.00	244,259,600
エフテック	4,800	1,657.00	7,953,600
レシップホールディングス	2,700	935.00	2,524,500
G M B	1,200	2,207.00	2,648,400
ファルテック	1,300	1,455.00	1,891,500
武蔵精密工業	8,000	3,640.00	29,120,000
日産車体	29,900	1,169.00	34,953,100
新明和工業	33,300	1,071.00	35,664,300
極東開発工業	14,300	1,952.00	27,913,600
日信工業	15,300	2,195.00	33,583,500
トピー工業	6,200	3,425.00	21,235,000
ティラド	2,700	4,000.00	10,800,000
曙ブレーキ工業	34,800	318.00	11,066,400
タチエス	12,800	2,056.00	26,316,800
N O K	40,300	2,699.00	108,769,700
フタバ産業	23,000	1,091.00	25,093,000
K Y B	7,800	6,770.00	52,806,000
大同メタル工業	9,500	1,093.00	10,383,500
プレス工業	40,000	694.00	27,760,000
ミクニ	9,500	805.00	7,647,500
太平洋工業	15,700	1,719.00	26,988,300
ケーヒン	17,300	2,312.00	39,997,600
河西工業	9,200	1,774.00	16,320,800
アイシン精機	61,700	6,670.00	411,539,000
マツダ	235,700	1,582.00	372,877,400
今仙電機製作所	7,000	1,342.00	9,394,000
本田技研工業	674,700	3,980.00	2,685,306,000
スズキ	148,700	6,522.00	969,821,400
S U B A R U	232,900	3,775.00	879,197,500
安永	3,600	2,833.00	10,198,800
ヤマハ発動機	106,000	3,785.00	401,210,000

ショーワ	19,500	1,420.00	27,690,000
T B K	8,900	552.00	4,912,800
エクセディ	9,000	3,425.00	30,825,000
豊田合成	27,200	2,960.00	80,512,000
愛三工業	13,200	1,322.00	17,450,400
盟和産業	1,100	1,393.00	1,532,300
ヨロズ	7,600	2,404.00	18,270,400
エフ・シー・シー	12,300	2,996.00	36,850,800
シマノ	30,200	15,750.00	475,650,000
テイ・エス テック	17,400	4,865.00	84,651,000
ジャムコ	3,800	2,894.00	10,997,200
テルモ	114,900	5,410.00	621,609,000
クリエートメディック	2,500	1,275.00	3,187,500
日機装	26,100	1,285.00	33,538,500
島津製作所	89,600	2,786.00	249,625,600
J M S	7,000	633.00	4,431,000
長野計器	5,900	1,322.00	7,799,800
ブイ・テクノロジー	1,800	21,590.00	38,862,000
東京計器	4,800	1,408.00	6,758,400
愛知時計電機	1,000	4,720.00	4,720,000
インターアクション	2,800	1,119.00	3,133,200
オーバル	7,400	319.00	2,360,600
東京精密	13,600	4,945.00	67,252,000
マニー	9,100	3,755.00	34,170,500
ニコン	130,600	2,217.00	289,540,200
トプコン	40,300	2,644.00	106,553,200
オリンパス	111,700	4,215.00	470,815,500
理研計器	7,200	2,585.00	18,612,000
タムロン	6,100	2,441.00	14,890,100
H O Y A	152,600	5,682.00	867,073,200
シード	800	5,430.00	4,344,000
ノーリツ鋼機	7,600	2,782.00	21,143,200
エー・アンド・デイ	6,900	823.00	5,678,700
シチズン時計	89,500	853.00	76,343,500
リズム時計工業	2,900	2,328.00	6,751,200
大研医器	6,700	770.00	5,159,000
メニコン	10,300	3,035.00	31,260,500
松風	3,700	1,453.00	5,376,100
セイコーホールディングス	11,600	3,230.00	37,468,000
ニプロ	51,900	1,703.00	88,385,700
中本パックス	700	4,665.00	3,265,500
スノーピーク	2,300	1,492.00	3,431,600

パラマウントベッドホールディングス	7,900	5,680.00	44,872,000
トランザクション	3,400	1,114.00	3,787,600
S H O - B I	2,500	436.00	1,090,000
ニホンフラッシュ	3,500	2,814.00	9,849,000
前田工織	7,500	2,076.00	15,570,000
永大産業	10,000	587.00	5,870,000
アートネイチャー	8,000	767.00	6,136,000
バンダイナムコホールディングス	77,500	3,690.00	285,975,000
アイフィスジャパン	1,700	622.00	1,057,400
共立印刷	12,400	385.00	4,774,000
S H O E I	3,400	5,060.00	17,204,000
フランスベッドホールディングス	8,900	1,066.00	9,487,400
パイロットコーポレーション	13,100	5,570.00	72,967,000
萩原工業	4,200	1,984.00	8,332,800
トッパン・フォームズ	16,100	1,262.00	20,318,200
フジシールインターナショナル	16,800	3,930.00	66,024,000
タカラトミー	31,500	1,686.00	53,109,000
廣済堂	7,000	484.00	3,388,000
A s - m e エステール	2,200	957.00	2,105,400
アーク	31,500	142.00	4,473,000
タカノ	3,300	1,157.00	3,818,100
プロネクサス	7,000	1,520.00	10,640,000
ホクシン	5,300	199.00	1,054,700
ウッドワン	2,500	1,703.00	4,257,500
大建工業	5,900	2,920.00	17,228,000
凸版印刷	212,000	1,029.00	218,148,000
大日本印刷	98,100	2,536.00	248,781,600
図書印刷	5,000	1,022.00	5,110,000
共同印刷	2,300	3,590.00	8,257,000
N I S S H A	15,400	3,110.00	47,894,000
光村印刷	700	2,412.00	1,688,400
宝印刷	3,900	1,782.00	6,949,800
アシックス	74,500	1,822.00	135,739,000
ツツミ	2,300	2,189.00	5,034,700
小松ウオール工業	2,500	2,404.00	6,010,000
ヤマハ	50,500	4,500.00	227,250,000
河合楽器製作所	2,500	3,285.00	8,212,500
クリナップ	7,000	908.00	6,356,000
ピジョン	45,300	4,400.00	199,320,000
兼松サステック	600	2,199.00	1,319,400
キングジム	6,300	1,015.00	6,394,500
リンテック	17,800	3,200.00	56,960,000

イトーキ	15,800	801.00	12,655,800
任天堂	46,200	48,450.00	2,238,390,000
三菱鉛筆	12,300	2,584.00	31,783,200
タカスタンダード	15,600	1,850.00	28,860,000
コクヨ	36,100	2,114.00	76,315,400
ナカバヤシ	7,400	734.00	5,431,600
グロープライド	3,400	2,399.00	8,156,600
岡村製作所	26,300	1,584.00	41,659,200
美津濃	7,400	3,275.00	24,235,000
東京電力ホールディングス	598,500	456.00	272,916,000
中部電力	229,400	1,367.50	313,704,500
関西電力	305,900	1,377.50	421,377,250
中国電力	103,600	1,219.00	126,288,400
北陸電力	73,400	893.00	65,546,200
東北電力	175,600	1,448.00	254,268,800
四国電力	67,500	1,238.00	83,565,000
九州電力	165,600	1,203.00	199,216,800
北海道電力	75,500	717.00	54,133,500
沖縄電力	12,100	2,756.00	33,347,600
電源開発	59,600	3,135.00	186,846,000
エフオン	3,800	1,343.00	5,103,400
イーレックス	11,800	1,096.00	12,932,800
東京瓦斯	159,900	2,637.00	421,656,300
大阪瓦斯	145,500	2,214.50	322,209,750
東邦瓦斯	37,100	3,055.00	113,340,500
北海道瓦斯	20,000	300.00	6,000,000
広島ガス	15,400	377.00	5,805,800
西部瓦斯	9,100	2,785.00	25,343,500
静岡ガス	21,400	1,012.00	21,656,800
メタウォーター	4,200	3,010.00	12,642,000
SBSホールディングス	7,400	1,158.00	8,569,200
東武鉄道	80,100	3,815.00	305,581,500
相鉄ホールディングス	24,000	3,050.00	73,200,000
東京急行電鉄	203,600	1,853.00	377,270,800
京浜急行電鉄	102,700	2,211.00	227,069,700
小田急電鉄	111,500	2,478.00	276,297,000
京王電鉄	41,900	5,270.00	220,813,000
京成電鉄	52,200	3,760.00	196,272,000
富士急行	10,200	3,270.00	33,354,000
新京成電鉄	1,900	2,175.00	4,132,500
東日本旅客鉄道	134,600	11,425.00	1,537,805,000
西日本旅客鉄道	67,600	8,390.00	567,164,000

東海旅客鉄道	67,100	20,810.00	1,396,351,000
西武ホールディングス	95,600	2,217.00	211,945,200
鴻池運輸	10,600	2,010.00	21,306,000
西日本鉄道	20,800	3,120.00	64,896,000
ハマキョウレックス	5,300	3,265.00	17,304,500
サカイ引越センター	3,900	5,990.00	23,361,000
近鉄グループホールディングス	71,000	4,465.00	317,015,000
阪急阪神ホールディングス	94,700	4,570.00	432,779,000
南海電気鉄道	33,700	2,904.00	97,864,800
京阪ホールディングス	31,600	3,550.00	112,180,000
神戸電鉄	1,700	4,015.00	6,825,500
名古屋鉄道	54,800	2,947.00	161,495,600
山陽電気鉄道	5,500	2,826.00	15,543,000
日本通運	27,900	7,690.00	214,551,000
ヤマトホールディングス	124,500	2,567.00	319,591,500
山九	18,200	4,865.00	88,543,000
丸運	4,000	381.00	1,524,000
丸全昭和運輸	25,000	519.00	12,975,000
センコーグループホールディングス	42,900	787.00	33,762,300
トナミホールディングス	1,700	5,730.00	9,741,000
ニッコンホールディングス	27,000	3,055.00	82,485,000
日本石油輸送	900	3,995.00	3,595,500
福山通運	10,400	4,145.00	43,108,000
セイノーホールディングス	53,200	1,832.00	97,462,400
神奈川中央交通	1,800	3,700.00	6,660,000
日立物流	15,600	2,896.00	45,177,600
丸和運輸機関	3,700	3,705.00	13,708,500
C & F ロジホールディングス	7,800	1,627.00	12,690,600
九州旅客鉄道	59,600	3,550.00	211,580,000
日本郵船	59,600	2,863.00	170,634,800
商船三井	45,100	3,955.00	178,370,500
川崎汽船	33,000	2,941.00	97,053,000
N S ユナイテッド海運	3,600	2,703.00	9,730,800
飯野海運	37,100	648.00	24,040,800
共栄タンカー	800	2,116.00	1,692,800
乾汽船	5,500	837.00	4,603,500
日本航空	131,700	4,320.00	568,944,000
A N A ホールディングス	139,100	4,706.00	654,604,600
パスコ	7,000	340.00	2,380,000
トランコム	2,000	8,090.00	16,180,000
日新	6,100	3,075.00	18,757,500
三菱倉庫	24,600	2,880.00	70,848,000

三井倉庫ホールディングス	41,000	385.00	15,785,000
住友倉庫	49,000	810.00	39,690,000
澁澤倉庫	3,900	2,064.00	8,049,600
東陽倉庫	12,800	341.00	4,364,800
日本トランスシティ	17,000	509.00	8,653,000
ケイヒン	1,400	1,727.00	2,417,800
中央倉庫	4,300	1,192.00	5,125,600
川西倉庫	1,400	2,281.00	3,193,400
安田倉庫	6,400	1,012.00	6,476,800
東洋埠頭	2,200	1,882.00	4,140,400
宇徳	6,100	527.00	3,214,700
上組	44,700	2,443.00	109,202,100
サンリツ	1,800	887.00	1,596,600
キムラユニティー	1,900	1,193.00	2,266,700
キューソー流通システム	2,100	2,980.00	6,258,000
近鉄エクスプレス	13,500	2,517.00	33,979,500
東海運	4,000	427.00	1,708,000
エーアイティー	5,100	1,287.00	6,563,700
内外トランスライン	2,500	2,097.00	5,242,500
日本コンセプト	1,400	1,405.00	1,967,000
N E C ネットズエスアイ	8,200	2,961.00	24,280,200
システナ	5,900	3,815.00	22,508,500
デジタルアーツ	3,600	4,600.00	16,560,000
新日鉄住金ソリューションズ	11,600	3,120.00	36,192,000
キューブシステム	4,400	845.00	3,718,000
コア	3,200	1,511.00	4,835,200
ソリトンシステムズ	2,500	1,772.00	4,430,000
ソフトクリエイトホールディングス	3,600	1,516.00	5,457,600
T I S	24,500	4,065.00	99,592,500
ネオス	2,400	442.00	1,060,800
電算システム	2,600	2,147.00	5,582,200
グリー	45,400	707.00	32,097,800
コーエーテクモホールディングス	12,600	2,482.00	31,273,200
三菱総合研究所	3,200	3,985.00	12,752,000
ボルテージ	1,500	1,036.00	1,554,000
電算	900	2,602.00	2,341,800
A G S	4,300	888.00	3,818,400
ファインデックス	6,200	792.00	4,910,400
ヒト・コミュニケーションズ	1,700	2,337.00	3,972,900
ブレインパッド	1,700	1,430.00	2,431,000
K L a b	14,300	1,883.00	26,926,900
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,400	2,255.00	12,177,000

イーブックイニシアティブジャパン	1,300	1,227.00	1,595,100
ネクソン	82,600	3,445.00	284,557,000
アイスタイル	17,000	1,066.00	18,122,000
エムアップ	2,500	1,243.00	3,107,500
エイチーム	5,100	2,819.00	14,376,900
テクノスジャパン	6,800	937.00	6,371,600
コロプラ	23,900	974.00	23,278,600
モバイルクリエイト	6,200	364.00	2,256,800
ブロードリーフ	18,400	1,131.00	20,810,400
ハーツユナイテッドグループ	4,000	1,804.00	7,216,000
メディアドゥホールディングス	2,400	2,308.00	5,539,200
サイバーリンクス	1,200	1,345.00	1,614,000
フィックスターズ	1,300	6,880.00	8,944,000
VOYAGE GROUP	3,800	1,456.00	5,532,800
オブティム	1,300	2,675.00	3,477,500
セレス	2,300	2,040.00	4,692,000
ペリサーブ	1,000	3,865.00	3,865,000
ティーガイア	7,400	2,682.00	19,846,800
セック	800	2,610.00	2,088,000
日本アジアグループ	7,700	509.00	3,919,300
豆蔵ホールディングス	5,600	1,378.00	7,716,800
テクマトリックス	4,100	2,218.00	9,093,800
プロシップ	1,100	2,333.00	2,566,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	199,800	328.00	65,534,400
GMOペイメントゲートウェイ	5,200	9,790.00	50,908,000
ザッパラス	4,100	422.00	1,730,200
システムリサーチ	800	2,121.00	1,696,800
インターネットイニシアティブ	12,100	2,130.00	25,773,000
さくらインターネット	8,900	858.00	7,636,200
ヴァンクス	900	1,302.00	1,171,800
GMOクラウド	1,700	2,387.00	4,057,900
SRAホールディングス	3,900	4,005.00	15,619,500
Minor iソリューションズ	1,500	1,428.00	2,142,000
朝日ネット	6,900	526.00	3,629,400
アドソル日進	2,900	1,287.00	3,732,300
フリービット	5,600	1,001.00	5,605,600
コムチュア	3,800	3,465.00	13,167,000
サイバーコム	1,400	1,400.00	1,960,000
メディカル・データ・ビジョン	2,900	2,383.00	6,910,700
gumi	8,600	1,067.00	9,176,200
ショーケース・ティービー	1,500	1,531.00	2,296,500
モバイルファクトリー	1,500	1,466.00	2,199,000

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	3,125.00	3,437,500
P C Iホールディングス	1,300	3,765.00	4,894,500
パイプドHD	1,200	1,226.00	1,471,200
アイビーシー	900	1,360.00	1,224,000
オープンドア	1,000	8,150.00	8,150,000
アカツキ	1,500	6,920.00	10,380,000
L I N E	21,000	5,000.00	105,000,000
シンクロ・フード	600	3,215.00	1,929,000
オークネット	2,400	1,488.00	3,571,200
A O I T Y O H o l d i n g s	6,100	1,358.00	8,283,800
マクロミル	9,600	2,761.00	26,505,600
ソルクシーズ	2,900	1,514.00	4,390,600
フェイス	2,700	1,344.00	3,628,800
ハイマックス	1,000	1,926.00	1,926,000
野村総合研究所	49,200	5,370.00	264,204,000
サイバネットシステム	6,200	723.00	4,482,600
C Eホールディングス	2,200	880.00	1,936,000
日本システム技術	1,000	1,363.00	1,363,000
インテージホールディングス	8,500	1,425.00	12,112,500
東邦システムサイエンス	2,600	848.00	2,204,800
ソースネクスト	5,300	1,553.00	8,230,900
フォーカスシステムズ	4,300	921.00	3,960,300
クレスコ	1,700	4,565.00	7,760,500
フジ・メディア・ホールディングス	77,100	1,753.00	135,156,300
オービック	23,200	8,930.00	207,176,000
ジャストシステム	12,100	2,085.00	25,228,500
T D Cソフト	3,300	1,249.00	4,121,700
ヤフー	530,600	529.00	280,687,400
トレンドマイクロ	35,900	6,090.00	218,631,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,400	1,346.00	3,230,400
日本オラクル	11,900	9,170.00	109,123,000
アルファシステムズ	2,500	2,511.00	6,277,500
フューチャー	10,100	1,153.00	11,645,300
C A C H o l d i n g s	5,700	1,078.00	6,144,600
ソフトバンク・テクノロジー	3,100	2,060.00	6,386,000
トーセ	2,100	1,982.00	4,162,200
オービックビジネスコンサルタント	3,800	6,400.00	24,320,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,800	4,985.00	83,748,000
アイティフォー	9,000	984.00	8,856,000
東計電算	1,300	3,215.00	4,179,500
エクスネット	1,300	923.00	1,199,900
大塚商会	22,100	9,330.00	206,193,000

サイボウズ	10,000	588.00	5,880,000
ソフトブレーン	6,100	419.00	2,555,900
電通国際情報サービス	4,600	2,900.00	13,340,000
デジタルガレージ	13,200	3,800.00	50,160,000
E Mシステムズ	2,600	2,554.00	6,640,400
ウェザーニューズ	2,500	3,400.00	8,500,000
C I J	6,400	737.00	4,716,800
東洋ビジネスエンジニアリング	800	1,817.00	1,453,600
日本エンタープライズ	8,100	244.00	1,976,400
WOWOW	3,600	3,290.00	11,844,000
スカラ	5,300	792.00	4,197,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,300	1,334.00	8,404,200
ネットワンシステムズ	30,200	1,670.00	50,434,000
システムソフト	18,200	146.00	2,657,200
アルゴグラフィックス	3,400	3,450.00	11,730,000
マーベラス	12,600	1,051.00	13,242,600
エイベックス	13,800	1,563.00	21,569,400
日本ユニシス	20,600	2,370.00	48,822,000
兼松エレクトロニクス	4,700	3,555.00	16,708,500
東京放送ホールディングス	44,400	2,659.00	118,059,600
日本テレビホールディングス	67,600	1,908.00	128,980,800
朝日放送	7,400	900.00	6,660,000
テレビ朝日ホールディングス	20,300	2,254.00	45,756,200
スカパーJ S A Tホールディングス	56,600	515.00	29,149,000
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,428.00	14,810,800
日本BS放送	2,600	1,425.00	3,705,000
ビジョン	1,900	2,991.00	5,682,900
ワイヤレスゲート	3,500	1,326.00	4,641,000
コネクシオ	5,300	2,475.00	13,117,500
クロップス	1,700	1,086.00	1,846,200
日本電信電話	527,900	5,241.00	2,766,723,900
K D D I	662,400	2,755.00	1,824,912,000
光通信	8,900	16,290.00	144,981,000
N T T ドコモ	544,600	2,717.50	1,479,950,500
エムティーアイ	10,100	664.00	6,706,400
G M O インターネット	26,800	2,063.00	55,288,400
アйдママーケティングコミュニケーション	1,300	743.00	965,900
カドカワ	21,600	1,374.00	29,678,400
学研ホールディングス	2,500	6,010.00	15,025,000
ゼンリン	8,900	4,075.00	36,267,500
昭文社	3,500	772.00	2,702,000
インプレスホールディングス	6,100	179.00	1,091,900

アイネット	4,200	1,727.00	7,253,400
松竹	4,900	17,020.00	83,398,000
東宝	48,400	3,745.00	181,258,000
東映	2,800	11,350.00	31,780,000
エヌ・ティ・ティ・データ	228,600	1,359.00	310,667,400
ピー・シー・エー	1,100	1,851.00	2,036,100
ビジネスブレイン太田昭和	1,300	1,684.00	2,189,200
D T S	7,700	3,845.00	29,606,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,200	5,390.00	184,338,000
シーイーシー	4,400	3,175.00	13,970,000
カブコン	15,800	3,710.00	58,618,000
アイ・エス・ピー	1,500	1,341.00	2,011,500
ジャステック	4,400	1,360.00	5,984,000
S C S K	17,000	5,200.00	88,400,000
日本システムウエア	2,500	2,705.00	6,762,500
アイネス	9,500	1,168.00	11,096,000
T K C	6,900	4,055.00	27,979,500
富士ソフト	10,200	3,595.00	36,669,000
N S D	12,200	2,418.00	29,499,600
コナミホールディングス	30,100	6,150.00	185,115,000
福井コンピュータホールディングス	2,200	3,110.00	6,842,000
J B C Cホールディングス	5,900	1,181.00	6,967,900
ミロク情報サービス	6,500	3,510.00	22,815,000
ソフトバンクグループ	333,000	9,271.00	3,087,243,000
ハウスイ	600	1,196.00	717,600
高千穂交易	2,900	1,204.00	3,491,600
伊藤忠食品	1,800	6,670.00	12,006,000
エレマテック	3,500	2,717.00	9,509,500
J A L U X	2,100	2,989.00	6,276,900
あらた	3,700	5,640.00	20,868,000
トーメンデバイス	1,100	3,460.00	3,806,000
東京エレクトロン デバイス	2,700	2,141.00	5,780,700
フィールズ	5,700	1,215.00	6,925,500
双日	436,900	362.00	158,157,800
アルフレッサ ホールディングス	82,100	2,709.00	222,408,900
横浜冷凍	17,600	1,132.00	19,923,200
神栄	1,000	1,541.00	1,541,000
ラサ商事	3,300	994.00	3,280,200
ラクーン	4,800	791.00	3,796,800
アルコニックス	7,900	2,569.00	20,295,100
神戸物産	4,800	4,480.00	21,504,000
ペッパーフードサービス	4,000	4,805.00	19,220,000

あい ホールディングス	10,500	2,937.00	30,838,500
ディーブイエックス	2,700	1,354.00	3,655,800
ダイワボウホールディングス	6,300	4,995.00	31,468,500
マクニカ・富士エレホールディングス	13,700	2,506.00	34,332,200
ラクト・ジャパン	1,000	4,440.00	4,440,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	990.00	13,860,000
八洲電機	5,700	988.00	5,631,600
メディアスホールディングス	1,100	2,611.00	2,872,100
U K Cホールディングス	4,800	2,345.00	11,256,000
ジューテックホールディングス	1,700	1,386.00	2,356,200
大光	1,700	939.00	1,596,300
O C H Iホールディングス	2,200	1,507.00	3,315,400
T O K A Iホールディングス	39,200	1,016.00	39,827,200
大阪工機	1,100	1,240.00	1,364,000
三洋貿易	4,100	2,813.00	11,533,300
ビューティガレージ	1,000	2,258.00	2,258,000
ウイン・パートナーズ	5,400	1,562.00	8,434,800
ミタチ産業	1,700	1,921.00	3,265,700
シップヘルスケアホールディングス	15,400	3,580.00	55,132,000
明治電機工業	2,500	1,922.00	4,805,000
デリカフーズホールディングス	1,400	1,512.00	2,116,800
スターティア	1,700	1,174.00	1,995,800
コメダホールディングス	13,700	2,133.00	29,222,100
富士興産	2,900	620.00	1,798,000
協栄産業	900	2,207.00	1,986,300
小野建	6,500	2,017.00	13,110,500
佐島電機	5,500	1,226.00	6,743,000
エコートレーディング	1,700	789.00	1,341,300
伯東	4,500	1,996.00	8,982,000
コンドーテック	5,900	1,073.00	6,330,700
中山福	4,300	800.00	3,440,000
ナガイレーベン	9,800	2,906.00	28,478,800
三菱食品	8,100	3,280.00	26,568,000
松田産業	5,400	1,998.00	10,789,200
第一興商	11,000	5,920.00	65,120,000
メディバルホールディングス	74,000	2,177.00	161,098,000
S P K	1,600	3,215.00	5,144,000
萩原電気	2,500	3,990.00	9,975,000
アズワン	5,800	7,180.00	41,644,000
スズデン	2,600	1,782.00	4,633,200
尾家産業	2,200	1,400.00	3,080,000
シモジマ	4,600	1,245.00	5,727,000

ドウシシャ	7,800	2,665.00	20,787,000
小津産業	1,600	2,196.00	3,513,600
高速	4,400	1,391.00	6,120,400
たけびし	2,600	1,884.00	4,898,400
リックス	1,700	1,931.00	3,282,700
丸文	6,600	1,142.00	7,537,200
ハピネット	5,100	2,062.00	10,516,200
橋本総業ホールディングス	1,500	1,866.00	2,799,000
日本ライフライン	21,100	2,600.00	54,860,000
エクセル	2,900	2,717.00	7,879,300
マルカキカイ	2,400	2,411.00	5,786,400
I D O M	22,400	770.00	17,248,000
日本エム・ディ・エム	4,900	905.00	4,434,500
進和	4,400	2,529.00	11,127,600
エスケイジャパン	1,800	573.00	1,031,400
ダイトロン	3,400	2,400.00	8,160,000
シークス	4,700	5,090.00	23,923,000
田中商事	2,300	865.00	1,989,500
オーハシテクニカ	4,200	1,766.00	7,417,200
白銅	2,600	2,568.00	6,676,800
伊藤忠商事	541,900	2,233.00	1,210,062,700
丸紅	606,800	852.90	517,539,720
高島	1,300	2,344.00	3,047,200
長瀬産業	44,500	2,042.00	90,869,000
蝶理	4,700	2,086.00	9,804,200
豊田通商	82,400	4,590.00	378,216,000
三共生興	12,600	496.00	6,249,600
兼松	31,600	1,556.00	49,169,600
ツカモトコーポレーション	1,300	1,427.00	1,855,100
三井物産	627,200	1,921.00	1,204,851,200
日本紙パルプ商事	3,900	4,420.00	17,238,000
日立ハイテクノロジーズ	25,700	5,260.00	135,182,000
カメイ	9,700	1,913.00	18,556,100
東都水産	1,100	2,031.00	2,234,100
O U G ホールディングス	1,200	2,670.00	3,204,000
スターゼン	2,900	5,540.00	16,066,000
山善	29,000	1,362.00	39,498,000
椿本興業	1,700	3,260.00	5,542,000
住友商事	465,700	1,941.00	903,923,700
内田洋行	3,400	3,410.00	11,594,000
三菱商事	518,100	3,169.00	1,641,858,900
第一実業	3,400	3,575.00	12,155,000

キヤノンマーケティングジャパン	21,100	3,010.00	63,511,000
西華産業	4,600	3,040.00	13,984,000
佐藤商事	6,600	1,296.00	8,553,600
菱洋エレクトロ	6,900	1,988.00	13,717,200
東京産業	7,400	581.00	4,299,400
ユアサ商事	7,000	4,020.00	28,140,000
神鋼商事	1,700	3,500.00	5,950,000
小林産業	4,900	379.00	1,857,100
阪和興業	13,800	5,320.00	73,416,000
正栄食品工業	4,100	4,660.00	19,106,000
カナデン	7,100	1,567.00	11,125,700
菱電商事	5,300	1,941.00	10,287,300
フルサト工業	4,100	1,903.00	7,802,300
岩谷産業	16,400	3,890.00	63,796,000
すてきナイスグループ	3,200	1,543.00	4,937,600
昭光通商	25,000	139.00	3,475,000
ニチモウ	1,200	1,990.00	2,388,000
極東貿易	11,000	500.00	5,500,000
イワキ	10,000	521.00	5,210,000
三愛石油	19,900	1,725.00	34,327,500
稲畑産業	17,800	1,687.00	30,028,600
G S Iクレオス	2,000	1,576.00	3,152,000
明和産業	6,800	487.00	3,311,600
ワキタ	15,800	1,349.00	21,314,200
東邦ホールディングス	21,900	2,564.00	56,151,600
サンゲツ	25,100	2,202.00	55,270,200
ミツウロコグループホールディングス	10,700	861.00	9,212,700
シナネンホールディングス	3,500	2,767.00	9,684,500
伊藤忠エネクス	16,400	1,079.00	17,695,600
サンリオ	20,800	1,901.00	39,540,800
サンワテクノス	4,400	2,616.00	11,510,400
リョーサン	9,300	4,410.00	41,013,000
新光商事	8,100	2,186.00	17,706,600
トーヨー	3,300	2,729.00	9,005,700
三信電気	6,900	1,989.00	13,724,100
東陽テクニカ	8,600	1,008.00	8,668,800
モスフードサービス	9,700	3,330.00	32,301,000
加賀電子	6,700	3,080.00	20,636,000
ソーダニッカ	7,600	627.00	4,765,200
立花エレテック	5,000	2,200.00	11,000,000
フォーバル	3,200	885.00	2,832,000
P A L T A C	10,400	5,070.00	52,728,000

三谷産業	8,000	466.00	3,728,000
西本Wismettacホールディングス	1,500	4,615.00	6,922,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	1,608.00	964,800
ヤマタネ	3,700	2,155.00	7,973,500
丸紅建材リース	7,000	250.00	1,750,000
日鉄住金物産	5,800	6,490.00	37,642,000
泉州電業	2,500	3,265.00	8,162,500
トラスコ中山	15,400	3,235.00	49,819,000
オートバックスセブン	29,500	2,184.00	64,428,000
モリト	6,000	1,011.00	6,066,000
加藤産業	11,500	4,050.00	46,575,000
イノテック	6,400	1,106.00	7,078,400
イエローハット	7,000	3,420.00	23,940,000
J Kホールディングス	7,500	950.00	7,125,000
日伝	6,200	2,282.00	14,148,400
北沢産業	6,200	294.00	1,822,800
杉本商事	4,000	1,956.00	7,824,000
因幡電機産業	9,700	5,300.00	51,410,000
バイテックホールディングス	3,400	1,858.00	6,317,200
ミスミグループ本社	85,700	3,640.00	311,948,000
アルテック	6,300	360.00	2,268,000
タキヒヨー	2,500	2,342.00	5,855,000
蔵王産業	1,200	2,002.00	2,402,400
スズケン	33,700	4,690.00	158,053,000
ジェコス	5,100	1,365.00	6,961,500
ルネサスイーストン	6,800	741.00	5,038,800
ローソン	18,700	7,210.00	134,827,000
サンエー	5,600	5,460.00	30,576,000
カワチ薬品	5,800	2,765.00	16,037,000
エービーシー・マート	13,500	6,890.00	93,015,000
ハードオフコーポレーション	3,400	1,269.00	4,314,600
アスクル	7,800	3,365.00	26,247,000
ゲオホールディングス	13,600	2,184.00	29,702,400
アダストリア	11,500	2,267.00	26,070,500
ジーフット	4,600	798.00	3,670,800
くらコーポレーション	4,400	6,520.00	28,688,000
キャンドウ	3,600	1,800.00	6,480,000
パルグループホールディングス	3,800	3,240.00	12,312,000
エディオン	28,900	1,364.00	39,419,600
サーラコーポレーション	12,800	695.00	8,896,000
ワッツ	3,000	1,178.00	3,534,000
ハローズ	2,800	2,586.00	7,240,800

あみやき亭	1,600	5,260.00	8,416,000	
ひらまつ	10,400	590.00	6,136,000	
大黒天物産	1,800	4,935.00	8,883,000	
ハニーズホールディングス	7,300	1,151.00	8,402,300	
ファーマライズホールディングス	1,900	615.00	1,168,500	
アルペン	5,700	2,461.00	14,027,700	
クオール	8,200	2,127.00	17,441,400	
ジーンズ	5,000	4,920.00	24,600,000	
ビックカメラ	42,700	1,670.00	71,309,000	
D C Mホールディングス	40,100	1,077.00	43,187,700	
MonotaRO	26,300	3,795.00	99,808,500	
東京一番フーズ	2,000	736.00	1,472,000	
DDホールディングス	1,600	4,265.00	6,824,000	
きちり	2,100	768.00	1,612,800	
アークランドサービスホールディングス	6,200	2,561.00	15,878,200	
J.フロント リテイリング	88,200	2,078.00	183,279,600	
ドトール・日レスホールディングス	13,000	2,643.00	34,359,000	
マツモトキヨシホールディングス	30,500	4,560.00	139,080,000	
ブロンコピラー	3,900	3,215.00	12,538,500	
スタートトゥデイ	72,600	3,280.00	238,128,000	
トレジャー・ファクトリー	2,300	966.00	2,221,800	
物語コーポレーション	2,100	10,270.00	21,567,000	
ココカラファイン	7,700	6,760.00	52,052,000	
三越伊勢丹ホールディングス	138,100	1,342.00	185,330,200	
Hamee	2,300	1,941.00	4,464,300	
ウエルシアホールディングス	19,500	4,595.00	89,602,500	
クリエイティブSDホールディングス	10,900	2,685.00	29,266,500	
丸善CHIホールディングス	8,600	346.00	2,975,600	
ミサワ	1,600	515.00	824,000	
ティーライフ	1,100	1,329.00	1,461,900	
エー・ピーカンパニー	1,500	836.00	1,254,000	
チムニー	2,300	2,897.00	6,663,100	
シュッピン	4,600	1,482.00	6,817,200	
ネクステージ	7,900	850.00	6,715,000	
ジョイフル本田	12,000	3,535.00	42,420,000	
鳥貴族	2,700	3,455.00	9,328,500	
麒麟堂ホールディングス	2,700	1,905.00	5,143,500	
ホットランド	4,400	1,421.00	6,252,400	
すかいらーく	45,900	1,594.00	73,164,600	
綿半ホールディングス	2,800	4,020.00	11,256,000	
ヨシックス	1,200	3,450.00	4,140,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	24,700	1,148.00	28,355,600	

ブックオフコーポレーション	4,200	834.00	3,502,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,100	1,101.00	3,413,100
B E E N O S	1,200	1,826.00	2,191,200
あさひ	5,600	1,410.00	7,896,000
日本調剤	2,600	3,375.00	8,775,000
コスモス薬品	3,700	19,670.00	72,779,000
トーエル	3,700	1,088.00	4,025,600
一六堂	1,800	498.00	896,400
オンリー	1,200	982.00	1,178,400
セブン&アイ・ホールディングス	309,500	4,575.00	1,415,962,500
薬王堂	3,300	3,325.00	10,972,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	20,000	1,219.00	24,380,000
ツルハホールディングス	14,800	15,160.00	224,368,000
サンマルクホールディングス	5,300	3,110.00	16,483,000
フェリシモ	2,000	1,328.00	2,656,000
トリドールホールディングス	9,100	4,010.00	36,491,000
T O K Y O B A S E	1,500	4,405.00	6,607,500
サツドラホールディングス	1,000	2,558.00	2,558,000
ダイユー・リックホールディングス	3,600	1,512.00	5,443,200
パロックジャパンリミテッド	6,000	1,084.00	6,504,000
クスリのアオキホールディングス	5,900	5,690.00	33,571,000
スシローグローバルホールディングス	7,100	4,500.00	31,950,000
L I X I L ビバ	7,100	2,020.00	14,342,000
メディカルシステムネットワーク	8,500	603.00	5,125,500
総合メディカル	3,200	6,060.00	19,392,000
はるやまホールディングス	3,600	1,120.00	4,032,000
ノジマ	13,000	2,712.00	35,256,000
カッパ・クリエイト	9,200	1,267.00	11,656,400
ライトオン	6,400	954.00	6,105,600
良品計画	9,800	35,750.00	350,350,000
三城ホールディングス	9,400	498.00	4,681,200
アドヴァン	7,700	1,038.00	7,992,600
アルビス	1,700	3,720.00	6,324,000
コナカ	9,600	631.00	6,057,600
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,826.00	1,826,000
G - 7ホールディングス	2,200	2,460.00	5,412,000
イオン北海道	7,500	852.00	6,390,000
コジマ	13,000	372.00	4,836,000
ヒマラヤ	2,100	1,329.00	2,790,900
コーナン商事	10,500	2,724.00	28,602,000
エコス	3,100	1,277.00	3,958,700
マルシェ	2,100	819.00	1,719,900

ドンキホーテホールディングス	47,900	6,170.00	295,543,000
西松屋チェーン	16,400	1,266.00	20,762,400
ゼンショーホールディングス	38,500	1,940.00	74,690,000
幸楽苑ホールディングス	4,800	1,807.00	8,673,600
ハークスレイ	1,900	1,190.00	2,261,000
サイゼリヤ	11,000	3,220.00	35,420,000
V Tホールディングス	25,200	571.00	14,389,200
魚力	2,200	1,208.00	2,657,600
ポブラ	1,900	774.00	1,470,600
フジ・コーポレーション	1,300	2,530.00	3,289,000
ユナイテッドアローズ	9,200	4,650.00	42,780,000
ハイデイ日高	8,100	3,515.00	28,471,500
京都きもの友禅	4,800	765.00	3,672,000
コロワイド	24,700	2,238.00	55,278,600
ピーシーデポコーポレーション	11,200	794.00	8,892,800
壱番屋	5,200	4,525.00	23,530,000
トップカルチャー	2,900	497.00	1,441,300
P L A N T	1,800	1,399.00	2,518,200
スギホールディングス	16,200	5,660.00	91,692,000
ヴィア・ホールディングス	6,500	743.00	4,829,500
スクロール	11,600	531.00	6,159,600
ヨンドシーホールディングス	7,500	2,768.00	20,760,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	23,600	7,330.00	172,988,000
木曾路	9,100	2,708.00	24,642,800
S R Sホールディングス	8,800	945.00	8,316,000
タカキュー	6,200	235.00	1,457,000
ケーヨー	13,800	660.00	9,108,000
上新電機	8,700	3,700.00	32,190,000
日本瓦斯	13,600	4,410.00	59,976,000
ロイヤルホールディングス	13,100	2,980.00	39,038,000
いなげや	8,300	1,857.00	15,413,100
島忠	17,900	3,365.00	60,233,500
チヨダ	8,800	2,805.00	24,684,000
ライフコーポレーション	5,600	2,833.00	15,864,800
リンガーハット	9,100	2,429.00	22,103,900
M r M a x H D	9,300	789.00	7,337,700
テンアライド	6,800	478.00	3,250,400
A O K Iホールディングス	14,900	1,620.00	24,138,000
オークワ	11,000	1,148.00	12,628,000
コメリ	11,400	3,395.00	38,703,000
青山商事	14,200	4,260.00	60,492,000
しまむら	8,600	12,270.00	105,522,000

はせがわ	4,100	510.00	2,091,000
高島屋	116,000	1,165.00	135,140,000
松屋	15,000	1,630.00	24,450,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,000	2,362.00	82,670,000
近鉄百貨店	2,900	3,975.00	11,527,500
パルコ	7,200	1,557.00	11,210,400
丸井グループ	70,700	2,039.00	144,157,300
アクシアル リテイリング	6,200	4,045.00	25,079,000
イオン	284,200	1,877.50	533,585,500
イズミ	13,400	7,200.00	96,480,000
東武ストア	900	3,060.00	2,754,000
平和堂	15,100	2,400.00	36,240,000
フジ	8,900	2,371.00	21,101,900
ヤオコー	8,400	5,420.00	45,528,000
ゼビオホールディングス	10,100	2,267.00	22,896,700
ケーズホールディングス	31,300	3,120.00	97,656,000
Olympicグループ	4,500	618.00	2,781,000
日産東京販売ホールディングス	11,100	408.00	4,528,800
Genky DrugStores	3,200	3,590.00	11,488,000
アインホールディングス	10,500	6,780.00	71,190,000
元気寿司	1,900	3,440.00	6,536,000
ヤマダ電機	247,600	638.00	157,968,800
アークランドサカモト	12,600	1,888.00	23,788,800
ニトリホールディングス	29,300	16,910.00	495,463,000
グルメ杵屋	5,000	1,160.00	5,800,000
愛眼	5,900	554.00	3,268,600
ケーユーホールディングス	4,000	1,189.00	4,756,000
吉野家ホールディングス	24,400	1,915.00	46,726,000
松屋フーズ	3,600	4,010.00	14,436,000
サガミチェーン	10,000	1,402.00	14,020,000
関西スーパーマーケット	5,700	1,255.00	7,153,500
王将フードサービス	5,400	5,400.00	29,160,000
プレナス	8,300	2,186.00	18,143,800
ミニストップ	5,500	2,278.00	12,529,000
アークス	13,900	2,474.00	34,388,600
バローホールディングス	17,200	2,624.00	45,132,800
藤久	700	1,729.00	1,210,300
ベルク	3,300	6,360.00	20,988,000
大庄	4,000	1,717.00	6,868,000
ファーストリテイリング	12,300	49,920.00	614,016,000
サンドラッグ	31,300	4,760.00	148,988,000
サクスパー ホールディングス	7,100	1,357.00	9,634,700

ヤマザワ	1,600	1,771.00	2,833,600
やまや	1,500	3,295.00	4,942,500
ペルーナ	18,300	1,355.00	24,796,500
島根銀行	1,600	1,389.00	2,222,400
じもとホールディングス	49,900	193.00	9,630,700
めぶきフィナンシャルグループ	384,200	504.00	193,636,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	10,000	3,175.00	31,750,000
九州フィナンシャルグループ	121,300	674.00	81,756,200
ゆうちょ銀行	209,500	1,518.00	318,021,000
富山第一銀行	18,800	518.00	9,738,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	449,500	675.00	303,412,500
西日本フィナンシャルホールディングス	50,200	1,409.00	70,731,800
新生銀行	64,000	1,969.00	126,016,000
あおぞら銀行	44,100	4,450.00	196,245,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,224,000	878.90	4,591,373,600
りそなホールディングス	811,400	710.30	576,337,420
三井住友トラスト・ホールディングス	145,400	4,755.00	691,377,000
三井住友フィナンシャルグループ	561,100	5,261.00	2,951,947,100
第四銀行	9,100	5,260.00	47,866,000
北越銀行	7,400	2,565.00	18,981,000
千葉銀行	265,000	983.00	260,495,000
群馬銀行	150,200	671.00	100,784,200
武蔵野銀行	11,800	3,900.00	46,020,000
千葉興業銀行	20,300	565.00	11,469,500
筑波銀行	30,700	396.00	12,157,200
七十七銀行	23,200	2,913.00	67,581,600
青森銀行	5,700	3,545.00	20,206,500
秋田銀行	4,700	3,050.00	14,335,000
山形銀行	8,300	2,419.00	20,077,700
岩手銀行	5,200	4,540.00	23,608,000
東邦銀行	66,400	399.00	26,493,600
東北銀行	3,800	1,503.00	5,711,400
みちのく銀行	4,800	1,849.00	8,875,200
ふくおかフィナンシャルグループ	300,000	658.00	197,400,000
静岡銀行	195,000	1,180.00	230,100,000
十六銀行	9,900	3,180.00	31,482,000
スルガ銀行	75,600	2,364.00	178,718,400
八十二銀行	133,800	661.00	88,441,800
山梨中央銀行	46,000	468.00	21,528,000
大垣共立銀行	11,700	2,843.00	33,263,100
福井銀行	6,300	2,674.00	16,846,200
北國銀行	8,400	4,615.00	38,766,000

清水銀行	2,500	3,245.00	8,112,500
富山銀行	1,400	4,315.00	6,041,000
滋賀銀行	70,000	599.00	41,930,000
南都銀行	8,600	3,085.00	26,531,000
百五銀行	71,300	554.00	39,500,200
京都銀行	28,200	6,490.00	183,018,000
紀陽銀行	27,900	1,838.00	51,280,200
三重銀行	3,300	2,524.00	8,329,200
ほくほくフィナンシャルグループ	49,200	1,665.00	81,918,000
広島銀行	109,100	958.00	104,517,800
山陰合同銀行	44,000	1,129.00	49,676,000
中国銀行	51,100	1,504.00	76,854,400
鳥取銀行	2,400	1,821.00	4,370,400
伊予銀行	105,500	917.00	96,743,500
百十四銀行	79,000	379.00	29,941,000
四国銀行	11,400	1,656.00	18,878,400
阿波銀行	59,000	741.00	43,719,000
大分銀行	4,300	4,300.00	18,490,000
宮崎銀行	4,900	3,650.00	17,885,000
佐賀銀行	4,500	2,599.00	11,695,500
十八銀行	45,000	303.00	13,635,000
沖縄銀行	7,200	4,430.00	31,896,000
琉球銀行	14,400	1,701.00	24,494,400
セブン銀行	277,300	411.00	113,970,300
みずほフィナンシャルグループ	10,046,200	214.90	2,158,928,380
高知銀行	2,700	1,317.00	3,555,900
山口フィナンシャルグループ	69,000	1,320.00	91,080,000
長野銀行	2,400	1,922.00	4,612,800
名古屋銀行	6,000	4,320.00	25,920,000
北洋銀行	111,900	384.00	42,969,600
愛知銀行	2,500	5,510.00	13,775,000
第三銀行	4,200	1,775.00	7,455,000
中京銀行	3,000	2,318.00	6,954,000
大光銀行	2,500	2,542.00	6,355,000
愛媛銀行	10,300	1,378.00	14,193,400
トマト銀行	2,900	1,558.00	4,518,200
みなと銀行	6,500	2,113.00	13,734,500
京葉銀行	65,000	518.00	33,670,000
関西アーバン銀行	10,000	1,454.00	14,540,000
栃木銀行	38,200	450.00	17,190,000
北日本銀行	2,300	3,085.00	7,095,500
東和銀行	13,000	1,551.00	20,163,000

福島銀行	7,000	895.00	6,265,000
大東銀行	3,600	1,636.00	5,889,600
トモニホールディングス	61,200	568.00	34,761,600
フィデアホールディングス	71,700	202.00	14,483,400
池田泉州ホールディングス	78,800	420.00	33,096,000
F P G	25,900	1,563.00	40,481,700
S B Iホールディングス	83,700	2,599.00	217,536,300
ジャフコ	10,600	7,020.00	74,412,000
大和証券グループ本社	633,000	795.70	503,678,100
野村ホールディングス	1,334,800	739.50	987,084,600
岡三証券グループ	63,000	814.00	51,282,000
丸三証券	23,800	1,090.00	25,942,000
東洋証券	27,000	371.00	10,017,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,100	816.00	66,993,600
光世証券	1,900	1,573.00	2,988,700
水戸証券	23,300	452.00	10,531,600
いちよし証券	15,700	1,486.00	23,330,200
松井証券	36,500	1,010.00	36,865,000
だいこう証券ビジネス	3,800	769.00	2,922,200
マネックスグループ	79,200	337.00	26,690,400
カブドットコム証券	48,000	372.00	17,856,000
極東証券	10,100	1,747.00	17,644,700
岩井コスモホールディングス	7,700	1,542.00	11,873,400
藍澤證券	14,000	801.00	11,214,000
マネーパートナーズグループ	9,800	424.00	4,155,200
かんぽ生命保険	27,900	2,889.00	80,603,100
S O M P Oホールディングス	145,000	4,659.00	675,555,000
アニコム ホールディングス	5,000	3,455.00	17,275,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	193,300	3,876.00	749,230,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,800	2,147.00	130,537,600
第一生命ホールディングス	418,300	2,464.00	1,030,691,200
東京海上ホールディングス	278,600	5,326.00	1,483,823,600
T & Dホールディングス	228,700	2,067.50	472,837,250
アドバンスクリエイト	1,700	1,975.00	3,357,500
全国保証	20,800	5,420.00	112,736,000
クレディセゾン	56,100	2,123.00	119,100,300
アクリーティブ	4,000	378.00	1,512,000
芙蓉総合リース	8,500	8,000.00	68,000,000
興銀リース	13,900	2,938.00	40,838,200
東京センチュリー	14,900	5,890.00	87,761,000
日本証券金融	30,400	659.00	20,033,600
アイフル	124,600	402.00	50,089,200

リコーリース	5,800	4,050.00	23,490,000
イオンフィナンシャルサービス	52,500	2,874.00	150,885,000
アコム	148,600	479.00	71,179,400
ジャックス	9,000	2,804.00	25,236,000
オリエントコーポレーション	160,600	183.00	29,389,800
日立キャピタル	20,300	3,120.00	63,336,000
アプラスフィナンシャル	35,400	117.00	4,141,800
オリックス	493,200	2,171.50	1,070,983,800
三菱UFJリース	187,700	705.00	132,328,500
日本取引所グループ	217,300	2,066.00	448,941,800
イー・ギャランティ	2,000	3,760.00	7,520,000
アサックス	1,000	1,954.00	1,954,000
NECキャピタルソリューション	3,000	2,307.00	6,921,000
いちご	106,200	480.00	50,976,000
日本駐車場開発	89,800	198.00	17,780,400
ヒューリック	154,400	1,381.00	213,226,400
三栄建築設計	3,000	2,326.00	6,978,000
スター・マイカ	2,700	1,779.00	4,803,300
野村不動産ホールディングス	49,200	2,747.00	135,152,400
三重交通グループホールディングス	15,100	488.00	7,368,800
サムティ	6,300	1,915.00	12,064,500
ディア・ライフ	7,500	697.00	5,227,500
コーセーアールイー	1,300	1,335.00	1,735,500
エー・ディー・ワークス	98,900	46.00	4,549,400
日本商業開発	4,200	1,835.00	7,707,000
プレサンスコーポレーション	10,200	1,571.00	16,024,200
ユニゾホールディングス	8,600	3,130.00	26,918,000
THEグローバル社	3,500	1,179.00	4,126,500
日本管理センター	4,900	1,701.00	8,334,900
サンセイランディック	2,200	1,288.00	2,833,600
エストラスト	1,000	1,087.00	1,087,000
フージャースホールディングス	9,600	1,041.00	9,993,600
オープンハウス	12,000	6,660.00	79,920,000
東急不動産ホールディングス	179,000	875.00	156,625,000
飯田グループホールディングス	61,700	2,227.00	137,405,900
ムゲンエステート	4,600	1,232.00	5,667,200
ファーストブラザーズ	2,100	1,609.00	3,378,900
ハウスドゥ	1,200	2,874.00	3,448,800
シーアールイー	1,200	1,594.00	1,912,800
ケイアイスター不動産	2,700	3,115.00	8,410,500
パーク24	41,000	2,715.00	111,315,000
パラカ	2,400	2,582.00	6,196,800

三井不動産	369,200	2,834.00	1,046,312,800
三菱地所	550,400	2,105.00	1,158,592,000
平和不動産	13,100	2,095.00	27,444,500
東京建物	80,800	1,759.00	142,127,200
ダイビル	19,100	1,401.00	26,759,100
京阪神ビルディング	12,300	947.00	11,648,100
住友不動産	177,000	4,195.00	742,515,000
大京	11,800	2,235.00	26,373,000
テオオーシー	25,600	982.00	25,139,200
東京楽天地	1,200	5,930.00	7,116,000
レオパレス21	88,300	856.00	75,584,800
スターツコーポレーション	10,100	3,055.00	30,855,500
フジ住宅	9,500	928.00	8,816,000
空港施設	7,700	658.00	5,066,600
明和地所	4,100	899.00	3,685,900
ゴールドクレスト	5,900	2,390.00	14,101,000
日本エスリード	2,900	2,548.00	7,389,200
日神不動産	9,900	975.00	9,652,500
日本エスコン	13,100	717.00	9,392,700
タカラレーベン	34,900	526.00	18,357,400
サンヨーハウジング名古屋	3,900	1,238.00	4,828,200
イオンモール	47,700	2,370.00	113,049,000
ファースト住建	2,800	1,766.00	4,944,800
トーセイ	9,100	1,366.00	12,430,600
穴吹興産	800	3,230.00	2,584,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	46,000	1,392.00	64,032,000
サンフロンティア不動産	9,000	1,377.00	12,393,000
エフ・ジェー・ネクスト	5,700	976.00	5,563,200
インテリックス	2,300	1,201.00	2,762,300
ランドビジネス	4,400	333.00	1,465,200
グランディハウス	6,500	567.00	3,685,500
日本空港ビルデング	21,600	4,385.00	94,716,000
日本工営	4,800	3,580.00	17,184,000
LIFULL	25,100	929.00	23,317,900
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,345.00	13,601,000
日本M&Aセンター	24,800	6,230.00	154,504,000
メンバーズ	1,900	755.00	1,434,500
中広	900	768.00	691,200
タケエイ	7,500	1,419.00	10,642,500
トラスト・テック	3,200	3,275.00	10,480,000
コシダカホールディングス	3,800	5,670.00	21,546,000
パソナグループ	5,900	2,255.00	13,304,500

C D S	2,000	1,360.00	2,720,000
リンクアンドモチベーション	13,300	970.00	12,901,000
G C A	8,300	1,130.00	9,379,000
エス・エム・エス	14,200	3,600.00	51,120,000
パーソルホールディングス	66,100	2,797.00	184,881,700
リニカル	4,700	1,568.00	7,369,600
クックパッド	22,600	639.00	14,441,400
エスクリ	2,600	1,050.00	2,730,000
アイ・ケイ・ケイ	4,300	810.00	3,483,000
学情	3,300	1,772.00	5,847,600
スタジオアリス	3,600	2,806.00	10,101,600
シミックホールディングス	4,000	2,199.00	8,796,000
N J S	1,800	1,538.00	2,768,400
総合警備保障	28,500	6,210.00	176,985,000
カカクコム	55,100	1,901.00	104,745,100
アイロムグループ	2,400	1,906.00	4,574,400
セントケア・ホールディング	3,200	819.00	2,620,800
サイネックス	1,200	946.00	1,135,200
ルネサンス	3,600	1,890.00	6,804,000
ディップ	10,100	3,385.00	34,188,500
オプトホールディング	5,100	1,350.00	6,885,000
ツクイ	17,000	1,009.00	17,153,000
キャリアデザインセンター	1,700	2,394.00	4,069,800
エムスリー	75,400	3,980.00	300,092,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	649.00	3,829,100
プラス	500	1,060.00	530,000
アウトソーシング	21,500	2,075.00	44,612,500
ウェルネット	6,000	1,216.00	7,296,000
ワールドホールディングス	2,400	3,730.00	8,952,000
ディー・エヌ・エー	38,800	2,400.00	93,120,000
博報堂D Yホールディングス	99,600	1,691.00	168,423,600
ぐるなび	11,500	1,387.00	15,950,500
エスアールジータカミヤ	8,600	707.00	6,080,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	929.00	8,268,100
ファンコミュニケーションズ	20,000	887.00	17,740,000
ライク	2,800	2,245.00	6,286,000
ビジネス・ブレークスルー	3,500	555.00	1,942,500
W D Bホールディングス	3,300	3,785.00	12,490,500
ティア	3,900	1,117.00	4,356,300
C D G	700	1,866.00	1,306,200
バリューコマース	6,600	789.00	5,207,400
インフォマート	36,400	691.00	25,152,400

J Pホールディングス	22,800	325.00	7,410,000
E P Sホールディングス	10,800	2,744.00	29,635,200
レグス	1,900	853.00	1,620,700
プレステージ・インターナショナル	15,000	1,421.00	21,315,000
アミューズ	4,800	3,370.00	16,176,000
ドリームインキュベータ	2,400	2,466.00	5,918,400
クイック	4,500	1,743.00	7,843,500
T A C	4,600	357.00	1,642,200
ケネディクス	99,500	696.00	69,252,000
電通	87,300	4,920.00	429,516,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,075.00	3,655,000
ぴあ	2,400	6,910.00	16,584,000
イオンファンタジー	2,300	5,300.00	12,190,000
シーティーエス	7,400	881.00	6,519,400
ネクシィーズグループ	2,900	1,921.00	5,570,900
みらかホールディングス	21,400	4,915.00	105,181,000
アルプス技研	6,400	2,259.00	14,457,600
ダイオーズ	1,500	1,445.00	2,167,500
日本空調サービス	7,600	803.00	6,102,800
オリエンタルランド	84,700	10,845.00	918,571,500
ダスキン	19,300	2,955.00	57,031,500
明光ネットワークジャパン	9,200	1,285.00	11,822,000
ファルコホールディングス	3,700	1,783.00	6,597,100
ラウンドワン	22,400	1,972.00	44,172,800
リゾートトラスト	30,300	2,578.00	78,113,400
ビー・エム・エル	9,300	2,932.00	27,267,600
ワタベウェディング	1,300	665.00	864,500
りらいあコミュニケーションズ	11,500	1,327.00	15,260,500
リソー教育	12,200	833.00	10,162,600
早稲田アカデミー	1,100	1,725.00	1,897,500
ユー・エス・エス	87,500	2,468.00	215,950,000
東京個別指導学院	2,600	1,058.00	2,750,800
サイバーエージェント	47,100	4,350.00	204,885,000
楽天	367,400	966.30	355,018,620
クリーク・アンド・リバー社	3,800	1,075.00	4,085,000
テー・オー・ダブリュー	6,400	955.00	6,112,000
セントラルスポーツ	2,700	4,175.00	11,272,500
フルキャストホールディングス	6,300	2,521.00	15,882,300
リソルホールディングス	800	4,610.00	3,688,000
テクノプロ・ホールディングス	12,800	6,410.00	82,048,000
アトラ	1,400	706.00	988,400
インターワークス	1,700	1,314.00	2,233,800

Keepers 技研	2,400	1,410.00	3,384,000
ファーストロジック	1,200	987.00	1,184,400
三機サービス	900	1,688.00	1,519,200
デザインワン・ジャパン	1,500	1,289.00	1,933,500
イー・ガーディアン	3,700	2,705.00	10,008,500
リブセンス	4,800	626.00	3,004,800
ジャパンマテリアル	6,600	4,305.00	28,413,000
ベクトル	8,700	2,138.00	18,600,600
ウチヤマホールディングス	3,700	595.00	2,201,500
ライクキッズネクスト	700	2,160.00	1,512,000
キャリアリンク	2,500	591.00	1,477,500
I B J	5,800	1,002.00	5,811,600
アサンテ	2,700	1,902.00	5,135,400
N・フィールド	4,100	1,638.00	6,715,800
バリューHR	1,700	2,285.00	3,884,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	8,890.00	13,335,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,000	1,037.00	3,111,000
E R Iホールディングス	2,100	1,006.00	2,112,600
アビスト	1,000	5,310.00	5,310,000
シグマクシス	3,000	1,485.00	4,455,000
ウィルグループ	3,200	1,752.00	5,606,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	10,000	525.00	5,250,000
日本ビューホテル	1,700	1,492.00	2,536,400
リクルートホールディングス	552,700	2,797.50	1,546,178,250
エラン	1,800	1,548.00	2,786,400
土木管理総合試験所	2,200	687.00	1,511,400
日本郵政	406,600	1,323.00	537,931,800
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,505.00	18,210,500
鎌倉新書	1,000	2,163.00	2,163,000
一蔵	1,000	1,160.00	1,160,000
L I T A L I C O	1,300	1,965.00	2,554,500
グローバルグループ	800	1,678.00	1,342,400
エボラブルアジア	1,500	2,480.00	3,720,000
ストライク	700	6,510.00	4,557,000
ソラスト	4,300	2,824.00	12,143,200
セラク	1,300	830.00	1,079,000
インソース	900	4,510.00	4,059,000
リログループ	39,200	3,235.00	126,812,000
東祥	4,500	3,705.00	16,672,500
エイチ・アイ・エス	11,200	3,990.00	44,688,000
ラックランド	1,400	2,183.00	3,056,200
共立メンテナンス	12,800	4,690.00	60,032,000

イチネンホールディングス	8,100	1,755.00	14,215,500
建設技術研究所	5,100	1,210.00	6,171,000
スペース	4,700	1,585.00	7,449,500
長大	2,300	899.00	2,067,700
燦ホールディングス	1,700	2,924.00	4,970,800
スバル興業	500	7,530.00	3,765,000
東京テアトル	3,100	1,494.00	4,631,400
タナベ経営	1,400	1,805.00	2,527,000
ナガワ	1,400	4,815.00	6,741,000
よみうりランド	1,600	5,020.00	8,032,000
東京都競馬	5,400	4,500.00	24,300,000
カナモト	11,000	3,455.00	38,005,000
東京ドーム	29,200	1,099.00	32,090,800
西尾レントオール	6,300	3,595.00	22,648,500
トランス・コスモス	8,000	2,933.00	23,464,000
乃村工藝社	16,800	2,381.00	40,000,800
藤田観光	2,900	3,550.00	10,295,000
KNT-CTホールディングス	4,500	1,748.00	7,866,000
日本管財	7,800	2,070.00	16,146,000
トーカイ	7,000	2,734.00	19,138,000
白洋舎	800	4,305.00	3,444,000
セコム	76,000	8,573.00	651,548,000
セントラル警備保障	3,500	2,669.00	9,341,500
丹青社	14,800	1,234.00	18,263,200
メイテック	8,400	6,020.00	50,568,000
応用地質	8,200	1,415.00	11,603,000
船井総研ホールディングス	14,900	2,553.00	38,039,700
進学会ホールディングス	3,400	657.00	2,233,800
オオバ	6,300	544.00	3,427,200
いであ	1,500	1,166.00	1,749,000
学究社	2,000	1,647.00	3,294,000
ベネッセホールディングス	26,300	4,225.00	111,117,500
イオンディライト	8,800	4,050.00	35,640,000
ナック	4,900	993.00	4,865,700
ニチイ学館	13,700	1,446.00	19,810,200
ダイセキ	12,000	3,320.00	39,840,000
ステップ	2,700	1,914.00	5,167,800
合 計	90,198,800		202,403,585,050

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成30年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	106,747,102
コール・ローン	3,807,925,522
国債証券	256,525,591,507
派生商品評価勘定	15,610,819
未収利息	2,122,722,286
前払金	14,313,523
前払費用	131,149,751
差入委託証拠金	115,556,890
流動資産合計	262,839,617,400
資産合計	262,839,617,400
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,571,958
未払解約金	176,549,207
未払利息	6,309
流動負債合計	198,127,474
負債合計	198,127,474
純資産の部	
元本等	
元本	94,509,771,464
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	168,131,718,462
元本等合計	262,641,489,926
純資産合計	262,641,489,926
負債純資産合計	262,839,617,400

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	平成30年 1月22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)

	平成30年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,509,771,464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 2.7790円 (1万口当たり純資産額) (27,790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

	平成30年 1月22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コンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月22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。

	平成30年 1月22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	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	82,975,491,740円
期中追加設定元本額	23,876,856,720円
期中一部解約元本額	12,342,576,996円
期末元本額	94,509,771,464円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,164,920,191円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	910,637,442円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	587,455,728円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,942,983,756円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,404,111円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,749,253,052円
世界経済インデックスファンド	5,534,122,857円
D C マイセレクション 2 5	1,519,724,095円
D C マイセレクション 5 0	1,331,139,573円
D C マイセレクション 7 5	877,538,338円

区分	平成30年 1月22日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,684,831,592円
D C マイセクション S 2 5	574,531,723円
D C マイセクション S 5 0	512,258,120円
D C マイセクション S 7 5	244,553,808円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	54,506,523円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	54,486,079円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	24,095,400円
D C 世界経済インデックスファンド	4,294,542,028円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	600,814,536円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	54,822,158円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,331,141円
マイセクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,763,571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）	66,328,175円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	199,726,755円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	310,077,668円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	236,925,728円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	632,170,170円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,832,810,753円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	740,718,427円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,727,485,346円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	994,722,588円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	188,050,107円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	772,205,825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）	2,011,027,854円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	279,830,949円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	369,249,798円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,259,063,441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）	988,563,001円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	933,184,912円
外国債券ファンド・シリーズ 1	638,555,277円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,822,241,407円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,018,176,826円
分散投資コア戦略ファンド A	1,007,992,410円
分散投資コア戦略ファンド S	2,347,848,799円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	135,177,623円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,615,748,783円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,020,041,582円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	217,402,424円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	114,332,033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）	804,595,552円
S M T インデックスバランス・オープン	269,514,761円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	21,965,974,428円
S M T 世界経済インデックス・オープン	1,563,953円

区分	平成30年 1月22日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	48,408,097円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	51,686,377円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	280,658円
グローバル経済コア	732,245,574円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	1,393,769円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,060,930,454円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	3,784,325,332円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	7,573,478,026円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,109,754,989
合計		4,109,754,989

(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

（平成30年 1月22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	2,713,484,533	-	2,699,171,010	14,313,523
	合計	2,713,484,533	-	2,699,171,010	14,313,523

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成30年 1月22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	
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	3,792,397,016	-	3,800,749,400	8,352,384
	アメリカドル	1,791,134,282	-	1,786,190,000	4,944,282
	カナダドル	167,861,590	-	167,491,800	369,790
	ユーロ	1,546,906,006	-	1,556,688,000	9,781,994
	イギリスポンド	286,495,138	-	290,379,600	3,884,462
合計		3,792,397,016	-	3,800,749,400	8,352,384

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 04/15/19	10,000,000.00	9,871,413.10	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,408,488.80	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,757,984.10	
		T 1.125% 01/31/19	2,850,000.00	2,827,937.77	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,911,906.88	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,429,575.87	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,803,483.65	
		T 1.125% 12/31/19	7,050,000.00	6,924,908.74	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	894,224.88	
		T 1.25% 01/31/20	1,320,000.00	1,298,454.90	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,341,283.29	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,393,409.07	
		T 1.25% 06/30/19	11,500,000.00	11,381,826.00	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,258,588.33	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,424,513.27	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,614,711.50	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,933,387.10	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,931,130.25	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,682,118.04	

T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,087,645.02	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,925,852.45	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,804,004.49	
T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	983,428.42	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,237,820.14	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,523,006.73	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,479,474.54	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,718,115.80	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,353,343.75	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,918,005.04	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,523,015.20	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,871,339.18	
T 1.375% 12/15/19	7,650,000.00	7,552,718.85	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	2,986,698.27	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	1,992,074.88	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,353,357.69	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	1,990,979.00	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,289,887.37	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,377,741.58	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,812,331.12	
T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,673,215.42	
T 1.5% 05/31/19	3,250,000.00	3,229,711.03	
T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,088,568.76	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,839,687.50	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,047,393.16	
T 1.5% 10/31/19	7,000,000.00	6,933,210.40	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,949,136.80	
T 1.5% 12/31/18	2,550,000.00	2,541,506.71	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,510,169.66	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	2,989,152.84	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	4,979,674.30	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,647,763.46	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,786,342.60	
T 1.625% 06/30/19	10,000,000.00	9,949,138.00	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,963,209.62	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,936,104.20	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,416,232.37	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,452,754.87	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,576,125.83	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,890,999.25	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,002,638.22	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,300,466.76	

T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,441,267.27
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,314,875.94
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,916,975.55
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,703,285.85
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,871,257.02
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,297,594.45
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,808,566.94
T 1.75% 09/30/19	5,000,000.00	4,976,429.75
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,847,072.94
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,954,898.64
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,095,555.53
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,451,853.17
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,726,140.10
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,793,949.86
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,906,106.40
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,289,729.68
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,313,038.45
T 1.875% 12/15/20	12,500,000.00	12,391,143.75
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,875,860.66
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,380,225.00
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,931,988.00
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,180,204.87
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,992,649.70
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,222,847.40
T 2.125% 05/15/25	8,700,000.00	8,427,445.79
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,462,191.15
T 2.125% 06/30/22	800,000.00	790,924.92
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,673,876.97
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,064,458.41
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,495,109.01
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,986,289.54
T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,957,705.08
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,463,863.96
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,661,932.79
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,050,679.75
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,500,371.49
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,995,801.62
T 2.25% 08/15/27	10,750,000.00	10,384,704.34
T 2.25% 08/15/46	11,900,000.00	10,344,401.53
T 2.25% 10/31/24	3,300,000.00	3,233,609.01
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,942,210.62
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	2,824,329.66
T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,969,980.58

T 2.375% 05/15/27	11,950,000.00	11,678,406.37	
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,356,342.50	
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,312,037.67	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,803,877.64	
T 2.5% 02/15/46	17,050,000.00	15,662,024.29	
T 2.5% 05/15/24	16,900,000.00	16,846,430.54	
T 2.5% 05/15/46	1,050,000.00	963,764.46	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,553,628.85	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,564,204.74	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,130,192.15	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,641,078.50	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,035,824.47	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,923,716.57	
T 2.75% 08/15/47	5,100,000.00	4,919,908.38	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,992,690.46	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,089,275.31	
T 2.875% 05/15/43	17,150,000.00	17,055,124.99	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,805,185.47	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,467,136.80	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,544,089.08	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,081,003.44	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,973,088.28	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,767,965.54	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,152,371.35	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,181,547.43	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,948,603.01	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,788,857.26	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,727,983.30	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,979,031.05	
T 2% 10/31/21	400,000.00	395,321.04	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,373,171.79	
T 2% 11/15/26	6,750,000.00	6,407,034.39	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,471,917.49	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,960,564.88	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,171,314.20	
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,448,113.91	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,039,678.22	
T 3.125% 05/15/19	30,000,000.00	30,448,547.70	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,445,569.05	
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	12,472,583.28	
T 3.125% 11/15/41	2,400,000.00	2,501,450.47	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,088,596.33	

T	3.375%	11/15/19	8,750,000.00	8,957,244.01	
T	3.5%	02/15/39	3,000,000.00	3,322,913.13	
T	3.625%	02/15/20	7,000,000.00	7,218,601.32	
T	3.625%	02/15/21	5,500,000.00	5,728,189.33	
T	3.625%	02/15/44	5,000,000.00	5,653,082.25	
T	3.625%	08/15/19	2,700,000.00	2,766,444.05	
T	3.625%	08/15/43	2,000,000.00	2,259,056.40	
T	3.75%	08/15/41	3,900,000.00	4,485,633.90	
T	3.75%	11/15/43	2,300,000.00	2,651,063.72	
T	3.875%	08/15/40	1,650,000.00	1,930,070.88	
T	3%	05/15/42	1,950,000.00	1,988,744.51	
T	3%	05/15/45	3,500,000.00	3,554,831.70	
T	3%	05/15/47	4,600,000.00	4,665,875.71	
T	3%	11/15/44	2,300,000.00	2,336,783.39	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	1,105,196.55	
T	4.25%	11/15/40	1,150,000.00	1,418,160.80	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,241,498.95	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	2,379,511.45	
T	4.375%	05/15/41	4,150,000.00	5,215,768.01	
T	4.375%	11/15/39	2,700,000.00	3,376,050.27	
T	4.5%	02/15/36	1,840,000.00	2,301,516.69	
T	4.5%	05/15/38	1,000,000.00	1,262,704.71	
T	4.5%	08/15/39	250,000.00	317,458.89	
T	4.625%	02/15/40	3,900,000.00	5,041,352.66	
T	5.0%	05/15/37	1,100,000.00	1,465,615.60	
T	5.25%	02/15/29	1,250,000.00	1,559,303.18	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,615,406.92	
T	5.375%	02/15/31	1,600,000.00	2,076,492.99	
T	5.5%	08/15/28	1,200,000.00	1,513,481.25	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	2,120,665.93	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	1,885,732.26	
T	6.25%	05/15/30	400,000.00	549,949.56	
T	6.25%	08/15/23	1,650,000.00	1,974,289.87	
T	8.0%	11/15/21	1,700,000.00	2,052,346.25	
T	8.125%	08/15/19	2,100,000.00	2,296,480.80	
アメリカドル 小計			984,920,000.00	977,943,560.50 (108,307,249,325)	
カナダドル	CAN	0.5%	02/01/19	3,200,000.00	3,164,000.00
	CAN	0.5%	03/01/22	3,100,000.00	2,919,688.50
	CAN	0.75%	03/01/21	1,850,000.00	1,785,287.00
	CAN	0.75%	08/01/19	2,770,000.00	2,728,519.25
	CAN	0.75%	09/01/20	2,700,000.00	2,624,535.00
	CAN	0.75%	09/01/21	1,630,000.00	1,562,941.80

	CAN 1.25% 02/01/20	2,500,000.00	2,472,812.50
	CAN 1.5% 03/01/20	3,900,000.00	3,875,937.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,331,252.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,174,397.00
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,401,911.00
	CAN 1.75% 09/01/19	2,600,000.00	2,599,883.00
	CAN 1% 06/01/27	1,890,000.00	1,694,120.40
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,432,477.50
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,557,099.00
	CAN 2.5% 06/01/24	2,350,000.00	2,401,888.00
	CAN 2.75% 06/01/22	2,550,000.00	2,630,847.75
	CAN 2.75% 12/01/48	1,450,000.00	1,568,711.50
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	691,234.90
	CAN 3.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,658,052.00
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,868,940.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,750,000.00	3,370,262.50
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,287,136.00
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,834,722.00
	CAN 5.75% 06/01/29	2,100,000.00	2,828,458.50
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,310,168.00
	CAN 5% 06/01/37	1,700,000.00	2,398,581.00
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	534,391.20
	カナダドル 小計	59,560,000.00	62,708,254.30 (5,563,476,321)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	14,950,000.00	18,287,213.75
	MBONO 10% 12/05/24	40,000,000.00	45,399,800.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	17,350,000.00	15,483,313.50
	MBONO 5% 12/11/19	40,650,000.00	38,890,058.25
	MBONO 6.5% 06/09/22	38,000,000.00	36,604,260.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	28,600,000.00	27,766,167.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	20,000,000.00	19,910,500.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	17,190,288.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	24,392,420.25
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,850,000.00	4,866,853.75
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	16,643,718.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,200,000.00	17,422,452.00
	MBONO 8% 06/11/20	28,100,000.00	28,415,282.00
	MBONO 8% 11/07/47	5,250,000.00	5,374,293.75
	MBONO 8% 12/07/23	19,450,000.00	19,925,066.25
	メキシコペソ 小計	330,550,000.00	336,571,686.50 (2,002,601,534)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	1,700,000.00	1,705,652.50

BGB 0.8% 06/22/25	2,650,000.00	2,726,969.25
BGB 0.8% 06/22/27	1,710,000.00	1,725,501.15
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	807,220.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,250,000.00	1,216,981.25
BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,192,911.50
BGB 1% 06/22/26	2,100,000.00	2,178,004.50
BGB 1% 06/22/31	2,000,000.00	1,982,510.00
BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	368,324.25
BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,679,160.00
BGB 2.25% 06/22/57	400,000.00	438,122.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,400,000.00	2,763,336.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,260,000.00	1,859,961.60
BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	3,055,827.50
BGB 3% 06/22/34	1,850,000.00	2,339,103.00
BGB 3% 09/28/19	2,000,000.00	2,118,890.00
BGB 4.0% 03/28/19	1,290,000.00	1,359,524.55
BGB 4.25% 03/28/41	2,130,000.00	3,299,018.55
BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,449,282.50
BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,707,661.25
BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,460,277.50
BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,646,438.75
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,432,117.15
BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,329,624.10
BGB 5% 03/28/35	1,610,000.00	2,562,798.00
BKO 0% 12/13/19	800,000.00	809,264.00
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,005,240.00
BTPS 0.35% 06/15/20	2,550,000.00	2,571,139.50
BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,798,803.00
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,410,143.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,274,487.50
BTPS 0.65% 11/01/20	4,450,000.00	4,519,175.25
BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,033,590.00
BTPS 0.9% 08/01/22	2,100,000.00	2,122,974.00
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,508,677.50
BTPS 1.05% 12/01/19	4,350,000.00	4,448,397.00
BTPS 1.25% 12/01/26	2,100,000.00	2,008,387.50
BTPS 1.35% 04/15/22	1,550,000.00	1,600,654.00
BTPS 1.45% 09/15/22	3,950,000.00	4,088,526.50
BTPS 1.5% 06/01/25	3,200,000.00	3,200,944.00
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,464,272.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,586,120.00
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,830,300.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,078,580.00

BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	3,229,136.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,665,875.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,800,000.00	1,845,036.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,100,000.00	1,967,637.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,300,000.00	1,287,058.50	
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,590,025.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	3,300,000.00	3,543,853.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,220,000.00	2,061,991.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	800,000.00	706,760.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,300,000.00	3,394,512.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,610,550.75	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,350,000.00	1,426,153.50	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,760,000.00	3,110,409.60	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,250,000.00	3,609,352.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,727,041.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,483,200.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,850,000.00	3,292,790.25	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	3,980,785.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	4,913,752.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,841,343.25	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,805,108.25	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,791,828.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,650,000.00	4,368,338.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,250,000.00	5,171,676.25	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,626,433.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	5,065,956.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,575,146.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,450,000.00	4,317,692.25	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	3,132,624.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,000,000.00	4,753,620.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,300,000.00	2,537,130.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,818,259.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,797,669.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,145,960.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,350,000.00	2,876,129.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,700,000.00	3,798,009.00	
BTPS 5% 03/01/22	2,600,000.00	3,075,397.00	
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,291,074.75	
BTPS 5% 08/01/34	2,950,000.00	3,907,732.25	
BTPS 5% 09/01/40	3,200,000.00	4,257,536.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,425,025.50	
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,520,781.50	

BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,025,254.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,155,248.00	
DBR 0.25% 02/15/27	4,450,000.00	4,377,220.25	
DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,268,944.00	
DBR 0.5% 02/15/26	4,450,000.00	4,520,332.25	
DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,048,932.50	
DBR 0% 08/15/26	2,100,000.00	2,034,112.50	
DBR 1.25% 08/15/48	550,000.00	540,344.75	
DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,756,511.75	
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,193,670.00	
DBR 1.5% 05/15/24	1,690,000.00	1,839,750.90	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,563,237.75	
DBR 1.75% 02/15/24	450,000.00	496,116.00	
DBR 1.75% 07/04/22	4,000,000.00	4,351,640.00	
DBR 1% 08/15/24	3,580,000.00	3,784,256.90	
DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,222,980.75	
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,682,575.00	
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,189,190.00	
DBR 2.5% 01/04/21	4,250,000.00	4,624,340.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,900,000.00	3,723,614.50	
DBR 2.5% 08/15/46	3,100,000.00	4,013,880.00	
DBR 2% 01/04/22	5,200,000.00	5,671,614.00	
DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,334,822.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,000,000.00	2,152,190.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,829,216.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	3,027,171.00	
DBR 3.5% 07/04/19	5,800,000.00	6,153,626.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,327,246.50	
DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,805,585.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,150,000.00	4,771,179.00	
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	2,972,367.25	
DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,474,480.10	
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	4,123,314.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,624,705.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,150,000.00	3,414,146.25	
DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,990,080.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,600,000.00	3,558,750.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,450,000.00	2,380,878.25	
DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	1,868,502.00	
FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,558,590.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,702,535.75	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,550,000.00	5,599,311.75	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,580,000.00	5,568,644.70	

FRTR 0.5% 11/25/19	5,950,000.00	6,062,782.25	
FRTR 0.75% 05/25/28	2,150,000.00	2,130,961.75	
FRTR 0% 05/25/21	3,000,000.00	3,024,900.00	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,568,481.50	
FRTR 1.25% 05/25/36	3,350,000.00	3,274,139.25	
FRTR 1.5% 05/25/31	4,800,000.00	5,045,784.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,650,000.00	6,156,776.75	
FRTR 1.75% 05/25/66	950,000.00	900,908.75	
FRTR 1.75% 06/25/39	1,650,000.00	1,731,774.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,314,621.25	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,317,778.75	
FRTR 1% 05/25/27	2,750,000.00	2,826,903.75	
FRTR 1% 11/25/25	4,250,000.00	4,431,708.75	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,950,000.00	5,584,441.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,544,747.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,250,000.00	4,991,476.25	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,884,446.75	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,500,000.00	6,550,417.50	
FRTR 2% 05/25/48	2,100,000.00	2,212,234.50	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,511,595.75	
FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,745,569.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	11,000,000.00	11,988,955.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,274,661.95	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,950,000.00	4,472,960.25	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,080,000.00	4,390,263.60	
FRTR 3% 04/25/22	4,800,000.00	5,440,656.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,250,000.00	5,568,832.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,374,541.25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,210,000.00	6,694,552.55	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,250,000.00	5,021,152.50	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	3,241,716.25	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,675,862.75	
FRTR 4% 10/25/38	3,500,000.00	5,135,620.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,068,783.25	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,690,749.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,720,420.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,444,910.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,299,379.20	
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	778,361.25	
IRISH 1.7% 05/15/37	540,000.00	554,121.00	
IRISH 1% 05/15/26	1,550,000.00	1,590,710.75	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,560,000.00	1,789,912.80	

IRISH 2% 02/18/45	1,110,000.00	1,166,548.95
IRISH 3.4% 03/18/24	1,150,000.00	1,369,667.25
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,077,016.50
IRISH 4.4% 06/18/19	1,050,000.00	1,122,696.75
IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,313,864.80
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,885,534.00
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	889,288.00
IRISH 5% 10/18/20	790,000.00	908,199.80
NETHER 0.25% 01/15/20	1,950,000.00	1,982,097.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,679,023.45
NETHER 0.5% 07/15/26	3,250,000.00	3,260,367.50
NETHER 0.75% 07/15/27	1,290,000.00	1,307,363.40
NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,814,382.00
NETHER 0% 01/15/24	900,000.00	892,224.00
NETHER 1.25% 01/15/19	1,400,000.00	1,425,613.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,650,000.00	1,805,702.25
NETHER 2.25% 07/15/22	2,970,000.00	3,290,656.05
NETHER 2.5% 01/15/33	1,850,000.00	2,251,496.25
NETHER 2.75% 01/15/47	1,780,000.00	2,393,147.70
NETHER 2% 07/15/24	2,100,000.00	2,345,280.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,307,182.75
NETHER 3.5% 07/15/20	3,270,000.00	3,596,002.65
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,618,605.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,020,000.00	3,100,912.10
NETHER 4% 01/15/37	1,940,000.00	2,929,021.70
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,175,674.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,343,326.10
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	275,229.00
OBL 0.25% 10/11/19	2,350,000.00	2,386,213.50
OBL 0.25% 10/16/20	4,050,000.00	4,132,620.00
OBL 0.5% 04/12/19	4,740,000.00	4,808,658.90
OBL 0% 04/17/20	1,600,000.00	1,620,312.00
OBL 0% 10/07/22	2,600,000.00	2,617,589.00
OBL 0% 10/08/21	2,350,000.00	2,377,224.75
OBL 1% 02/22/19	1,450,000.00	1,476,687.25
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,064,616.00
RAGB 0.5% 04/20/27	700,000.00	690,560.50
RAGB 0.75% 10/20/26	2,900,000.00	2,945,602.50
RAGB 0% 07/15/23	500,000.00	497,067.50
RAGB 0% 09/20/22	560,000.00	562,240.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,600,000.00	1,696,704.00
RAGB 1.5% 02/20/47	410,000.00	406,562.15
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	170,697.00

RAGB 1.65% 10/21/24	1,200,000.00	1,312,194.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,915,191.25	
RAGB 1.95% 06/18/19	950,000.00	983,321.25	
RAGB 2.1% 09/20/17	600,000.00	622,905.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	980,000.00	1,164,132.20	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,180,000.00	1,630,352.90	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,300,000.00	1,517,626.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,469,264.70	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,276,979.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	780,348.05	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,550,000.00	1,716,291.75	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,600,000.00	2,406,032.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,100,000.00	2,218,020.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	850,000.00	1,155,056.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,297,427.25	
RFGB 0.375% 09/15/20	650,000.00	663,477.75	
RFGB 0.5% 04/15/26	900,000.00	902,241.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	344,394.75	
RFGB 0.75% 04/15/31	540,000.00	526,721.40	
RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	570,165.75	
RFGB 0% 04/15/22	540,000.00	542,624.40	
RFGB 0% 09/15/23	600,000.00	595,872.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	900,000.00	968,382.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	720,000.00	776,926.80	
RFGB 2.625% 07/04/42	610,000.00	790,489.85	
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	868,899.60	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	666,786.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	759,675.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	740,000.00	830,849.80	
RFGB 4.375% 07/04/19	920,000.00	986,000.80	
RFGB 4% 07/04/25	900,000.00	1,140,075.00	
SPGB 0.25% 01/31/19	2,950,000.00	2,970,399.25	
SPGB 0.4% 04/30/22	2,050,000.00	2,069,013.75	
SPGB 0.45% 10/31/22	1,050,000.00	1,057,056.00	
SPGB 0.75% 07/30/21	4,400,000.00	4,512,200.00	
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,098,760.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,550,000.00	2,564,841.00	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,438,906.60	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,300,000.00	2,302,990.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,095,170.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,950,000.00	2,047,851.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	3,450,000.00	3,669,213.00	

	SPGB 1.95% 07/30/30	3,050,000.00	3,111,411.75
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,550,000.00	3,843,070.25
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,050,000.00	1,090,834.50
	SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,340,326.25
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,613,888.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,800,000.00	1,893,420.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,000,000.00	1,120,000.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,100,000.00	3,690,395.00
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	3,671,332.00
	SPGB 4.3% 10/31/19	3,900,000.00	4,219,488.00
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,131,963.75
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,260,219.40
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,297,125.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,150,000.00	3,027,823.50
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,805,408.75
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,388,834.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,450,000.00	3,516,877.00
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,286,905.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,300,000.00	5,818,244.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,750,000.00	2,620,625.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,000,000.00	3,749,865.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,300,000.00	3,891,970.50
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,950,000.00	4,401,754.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,750,000.00	4,612,800.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,292,194.50
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,518,111.00
	ユーロ 小計	686,750,000.00	788,881,448.65 (106,964,435,622)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,500,000.00	3,445,295.00
	UKT 0.75% 07/22/23	1,350,000.00	1,332,591.75
	UKT 1.25% 07/22/27	3,200,000.00	3,164,464.00
	UKT 1.5% 01/22/21	4,430,000.00	4,535,965.60
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,653,339.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,750,000.00	1,613,710.00
	UKT 1.75% 07/22/19	5,470,000.00	5,567,037.80
	UKT 1.75% 07/22/57	2,000,000.00	2,035,270.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,964,684.00
	UKT 1.75% 09/07/37	1,200,000.00	1,184,586.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,750,000.00	2,942,857.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,250,000.00	2,895,007.50
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,437,864.00
	UKT 2% 07/22/20	5,600,000.00	5,790,204.00
	UKT 2% 09/07/25	3,100,000.00	3,292,773.50

UKT 3.25% 01/22/44	3,350,000.00	4,293,728.50	
UKT 3.5% 01/22/45	4,500,000.00	6,047,122.50	
UKT 3.5% 07/22/68	2,350,000.00	3,863,353.00	
UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,104,673.75	
UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	578,264.50	
UKT 3.75% 09/07/20	750,000.00	810,708.75	
UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,216,110.00	
UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,673,244.50	
UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,604,644.25	
UKT 4.25% 09/07/39	1,950,000.00	2,789,660.25	
UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,826,769.60	
UKT 4.25% 12/07/40	2,530,000.00	3,662,934.00	
UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,218,103.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,670,000.00	2,656,018.10	
UKT 4.25% 12/07/55	2,050,000.00	3,502,937.50	
UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,401,844.00	
UKT 4.5% 09/07/34	3,050,000.00	4,274,971.50	
UKT 4.5% 12/07/42	2,550,000.00	3,890,458.50	
UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,882,524.25	
UKT 4.75% 12/07/30	2,100,000.00	2,885,347.50	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,869,703.00	
UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,324,428.25	
UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,639,573.00	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,406,986.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,827,768.75	
UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,926,239.25	
イギリスポンド 小計	98,790,000.00	121,033,766.35 (18,606,520,900)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	430,930.00
	SWISS 2% 04/28/21	1,000,000.00	1,089,235.00
	SWISS 3% 05/12/19	540,000.00	569,025.00
	SWISS 4% 02/11/23	710,000.00	872,721.35
	SWISS 4% 04/08/28	640,000.00	903,126.40
スイスフラン 小計	3,290,000.00	3,865,037.75 (445,020,446)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	5,600,000.00	5,541,340.00
	SGB 1.5% 11/13/23	11,250,000.00	12,067,650.00
	SGB 1% 11/12/26	8,350,000.00	8,600,959.25
	SGB 2.5% 05/12/25	9,130,000.00	10,472,657.80
	SGB 3.5% 03/30/39	6,100,000.00	8,243,174.00
	SGB 3.5% 06/01/22	13,670,000.00	15,772,377.65
	SGB 4.25% 03/12/19	13,300,000.00	14,065,082.50

	SGB 5% 12/01/20	12,800,000.00	14,769,600.00	
スウェーデンクローナ 小計		80,200,000.00	89,532,841.20	(1,235,553,208)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,660,000.00	5,628,643.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,500,000.00	3,525,865.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,000,000.00	6,115,470.00	
	NGB 2% 05/24/23	10,350,000.00	10,750,079.25	
	NGB 3.75% 05/25/21	10,900,000.00	11,900,020.50	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,092,512.50	
	NGB 4.5% 05/22/19	10,850,000.00	11,427,545.50	
ノルウェークローネ 小計		52,810,000.00	55,440,136.35	(781,151,521)
デンマーククローネ	DGB 0.5% 11/15/27	5,000,000.00	4,962,150.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	6,600,000.00	7,145,358.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	14,190,000.00	15,758,775.45	
	DGB 3% 11/15/21	9,900,000.00	11,128,540.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,450,000.00	29,115,761.25	
	DGB 4% 11/15/19	14,340,000.00	15,528,714.30	
デンマーククローネ 小計		67,480,000.00	83,639,299.50	(1,523,071,643)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	4,200,000.00	4,176,900.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,023,525.50	
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,750,000.00	3,723,356.25	
	POLGB 2.5% 01/25/23	2,700,000.00	2,684,151.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,407,828.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	3,831,675.50	
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,485,860.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	4,570,000.00	4,688,957.10	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,680,000.00	3,724,417.60	
	POLGB 4% 10/25/23	3,400,000.00	3,625,284.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,430,000.00	3,736,213.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,775,929.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	950,000.00	1,177,297.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,114,278.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,295,751.00	
ポーランドズロチ 小計		51,380,000.00	52,471,423.20	(1,704,796,539)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,812,636.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,380,000.00	3,198,730.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,340,000.00	4,370,814.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,000,000.00	942,095.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,450,000.00	2,483,944.75	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,350,000.00	3,329,280.25	

	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,014,132.00	
	ACGB 2% 12/21/21	3,400,000.00	3,352,502.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,350,000.00	3,469,377.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,150,000.00	2,222,745.25	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,050,000.00	1,040,555.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,610,872.50	
	ACGB 3% 03/21/47	1,300,000.00	1,187,296.50	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,460,000.00	4,944,868.90	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,970,000.00	4,175,904.05	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,850,000.00	2,174,286.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,350,000.00	5,033,754.75	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,200,000.00	3,325,232.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,300,000.00	3,783,054.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,950,000.00	4,384,381.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,502,946.75	
	オーストラリアドル 小計	61,320,000.00	64,359,410.30 (5,697,738,593)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	246,005.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	290,000.00	290,913.50	
	SIGB 1.75% 04/01/22	560,000.00	560,252.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	250,782.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	886,416.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	511,390.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,400,000.00	1,421,084.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	440,000.00	454,229.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	642,068.90	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	845,121.60	
	SIGB 2.875% 07/01/29	380,000.00	404,131.90	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	498,554.85	
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	404,444.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	762,778.80	
	SIGB 3.25% 09/01/20	590,000.00	615,072.05	
	SIGB 3.375% 09/01/33	780,000.00	878,026.50	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,150,000.00	1,279,432.50	
SIGB 3% 09/01/24	960,000.00	1,019,400.00		
	シンガポールドル 小計	11,440,000.00	11,970,104.60 (1,004,291,775)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,469,175.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,665,575.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,008,300.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,750,000.00	1,654,283.75	
	MGS 3.654% 10/31/19	3,100,000.00	3,119,468.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	800,000.00	806,676.00	

	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,269,268.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,105,654.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,079,275.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,518,810.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,102,541.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,090,000.00	3,086,554.65	
	MGS 4.048% 09/30/21	3,100,000.00	3,149,941.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,450,000.00	1,396,458.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,685,978.25	
	MGS 4.181% 07/15/24	2,350,000.00	2,382,900.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	650,000.00	640,510.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	900,000.00	864,315.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,200,000.00	2,247,025.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,834,380.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,250,000.00	1,259,643.75	
	MGS 4.736% 03/15/46	400,000.00	394,288.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,300,000.00	1,325,038.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,850,000.00	1,882,560.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,054,574.50	
	マレーシアリングット 小計	42,920,000.00	43,003,192.65 (1,208,819,745)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	28,558,109.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,999,319.60	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,883,090.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,167,906.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,550,000.00	7,568,195.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,700,000.00	9,686,420.00	
	SAGB 7% 02/28/31	12,900,000.00	10,847,739.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	8,710,000.00	8,040,941.35	
	SAGB 8.5% 01/31/37	16,550,000.00	15,088,386.75	
	SAGB 8.75% 01/31/44	18,250,000.00	16,748,572.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,850,000.00	12,710,560.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	8,900,000.00	8,469,373.50	
	SAGB 8% 01/31/30	15,700,000.00	14,531,606.00	
	SAGB 9% 01/31/40	9,900,000.00	9,366,192.00	
	南アフリカランド 小計	172,530,000.00	161,666,412.20 (1,480,864,335)	
	合計		256,525,591,507 (256,525,591,507)	

- 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 181銘柄	100.0%	42.2%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 282銘柄	100.0%	41.7%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	7.3%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 25銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成30年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,000,348,852
コール・ローン	571,716,658
株式	326,580,028,108
投資信託受益証券	258,037,041
投資証券	7,447,083,619
派生商品評価勘定	316,814,125
未収入金	13,279,659

	平成30年 1月22日現在
項目	金額（円）
未収配当金	252,362,179
差入委託証拠金	2,492,888,677
流動資産合計	343,932,558,918
資産合計	343,932,558,918
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,822,717
前受金	312,481,928
未払解約金	686,611,463
未払利息	947
流動負債合計	1,002,917,055
負債合計	1,002,917,055
純資産の部	
元本等	
元本	133,409,705,614
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	209,519,936,249
元本等合計	342,929,641,863
純資産合計	342,929,641,863
負債純資産合計	343,932,558,918

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成30年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

平成30年 1月22日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 1月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,409,705,614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 2.5705円 (1万口当たり純資産額) (25,705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

	平成30年 1月22日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月22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。

	平成30年 1月22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	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	142,760,709,644円
期中追加設定元本額	18,564,360,937円
期中一部解約元本額	27,915,364,967円
期末元本額	133,409,705,614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）	2,376,376,740円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,303,266円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,575,811,845円
世界経済インデックスファンド	6,557,275,334円
外国株式インデックス・オープン	804,835,526円
D C マイセレクション 2 5	986,544,437円
D C マイセレクション 5 0	4,565,071,493円
D C マイセレクション 7 5	5,016,976,301円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,264,589,680円
D C マイセレクション S 2 5	376,964,427円

区分	平成30年 1月22日現在
DCマイセレクションS50	1,764,988,111円
DCマイセレクションS75	1,402,189,116円
DCターゲット・イヤーフンド2025	132,316,615円
DCターゲット・イヤーフンド2035	186,212,555円
DCターゲット・イヤーフンド2045	111,435,472円
DC世界経済インデックスファンド	5,146,076,973円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,623,010,385円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	21,791,616円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,913,172円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	63,241,171円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	98,093,343円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	366,999,333円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,468,538円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	444,006,581円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	973,989,112円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	461,273,502円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,026,337,141円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,241,724,534円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	181,576,299円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	447,850,642円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	495,726,029円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	155,835,756円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,161,705,290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）	2,668,252,162円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,472,605,279円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,309,090,376円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,619,177,999円
分散投資コア戦略ファンドA	1,857,347,631円
分散投資コア戦略ファンドS	3,660,222,745円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	504,555,904円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	662,052,959円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,550,141,119円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	837,758,919円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	46,011,143円
SMT インデックスバランス・オープン	342,060,854円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,018,576,802円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,558,173,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,776,575円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	172,307,462円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	20,035,401円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	320,277円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	9,634,364円
グローバル経済コア	820,592,931円

区分	平成30年 1月22日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	1,538,803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）	1,744,632,182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）	420,329,773円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	36,135,193,728
投資信託受益証券	22,377,858
投資証券	155,197,980
合計	35,957,617,890

(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

（平成30年 1月22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	10,306,752,094	-	10,619,234,022	312,481,928
合計		10,306,752,094	-	10,619,234,022	312,481,928

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成30年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,047,187,380	-	2,047,226,500	39,120
	アメリカドル	1,301,077,500	-	1,301,077,500	-
	カナダドル	70,965,600	-	70,968,000	2,400

	ユーロ	279,290,680	-	279,315,400	24,720
	イギリスポンド	227,483,400	-	227,505,600	22,200
	スイスフラン	69,076,800	-	69,084,000	7,200
	スウェーデンク ローナ	20,694,000	-	20,700,000	6,000
	オーストラリアド ル	53,104,200	-	53,106,000	1,800
	香港ドル	25,495,200	-	25,470,000	25,200
	売建	141,195,560	-	140,725,200	470,360
	アメリカドル	73,312,800	-	73,088,400	224,400
	イギリスポンド	67,882,760	-	67,636,800	245,960
	合計	2,188,382,940	-	2,187,951,700	509,480

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	58.20	2,582,916.00	
	ANDEAVOR	11,677	118.35	1,381,972.95	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	18.74	349,238.64	
	APACHE CORP	29,810	46.05	1,372,750.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	31,676	34.74	1,100,424.24	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	27.51	987,031.29	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	55.46	870,222.86	
	CHEVRON CORP	147,685	131.30	19,391,040.50	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	124.04	942,579.96	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	156.19	1,841,948.67	
	CONOCOPHILLIPS	93,911	59.75	5,611,182.25	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	55.17	421,884.99	
	DEVON ENERGY CORPORATION	40,715	42.85	1,744,637.75	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,758	127.57	862,118.06	
	EOG RESOURCES INC	45,301	114.37	5,181,075.37	
	EQT CORPORATION	18,637	56.03	1,044,231.11	
	EXXON MOBIL	330,663	87.15	28,817,280.45	

HALLIBURTON CO	69,072	53.01	3,661,506.72
HELMERICH & PAYNE	8,315	71.13	591,445.95
HESS CORP	22,081	52.61	1,161,681.41
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	50.94	634,101.12
KINDER MORGAN INC	157,150	19.01	2,987,421.50
MARATHON OIL CORP	65,596	18.58	1,218,773.68
MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	71.89	2,772,509.74
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	37.98	1,151,211.78
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	33.32	535,552.36
NOBLE ENERGY INC	38,291	31.69	1,213,441.79
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,953	75.55	4,529,449.15
ONEOK INC	30,874	58.32	1,800,571.68
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	29.20	471,112.80
PHILLIPS 66	34,624	105.63	3,657,333.12
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	183.17	2,463,636.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	22.78	225,294.20
RANGE RESOURCES CORP	20,891	16.08	335,927.28
SCHLUMBERGER	109,215	76.42	8,346,210.30
TARGA RESOURCES CORP	16,467	50.73	835,370.91
TECHNIPFMC PLC	36,005	33.50	1,206,167.50
VALERO ENERGY CORP	33,775	97.26	3,284,956.50
WILLIAMS COS	67,038	32.30	2,165,327.40
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,986	167.80	2,850,250.80
ALBEMARLE CORP	8,647	116.01	1,003,138.47
AVERY DENNISON CORP	7,457	121.34	904,832.38
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	31.66	557,405.96
BALL CORP	27,142	38.72	1,050,938.24
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	112.96	1,248,546.88
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	40.39	715,751.19
CHEMOURS CO/THE	13,243	54.02	715,386.86
CROWN HOLDINGS INC	10,321	57.89	597,482.69
DOWDUPONT INC	183,235	76.01	13,927,692.35
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	98.13	1,163,625.54
ECOLAB INC	20,812	139.75	2,908,477.00
FMC CORP	10,402	89.86	934,723.72
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,396	19.96	2,223,464.16
INT'L PAPER CO	30,605	63.50	1,943,417.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	155.19	942,003.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	119.92	3,204,262.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	226.98	1,132,403.22
MONSANTO CO	33,823	120.66	4,081,083.18
MOSAIC CO/THE	27,677	26.53	734,270.81

NEWMONT MINING CORP	42,952	39.47	1,695,315.44
NUCOR CORP	24,915	68.72	1,712,158.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	127.56	919,069.80
PPG INDUSTRIES INC	19,958	118.44	2,363,825.52
PRAXAIR INC	22,656	161.88	3,667,553.28
SEALED AIR CORP	14,689	49.10	721,229.90
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,536	430.80	2,815,708.80
STEEL DYNAMICS INC	18,273	46.42	848,232.66
VULCAN MATERIALS CO	10,740	135.03	1,450,222.20
WESTROCK CO	19,364	69.16	1,339,214.24
WR GRACE & CO	5,635	73.71	415,355.85
3 M COMPANY	46,888	248.18	11,636,663.84
ACUITY BRANDS INC	3,505	163.15	571,840.75
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	54.11	613,066.30
AGCO CORP	4,669	73.77	344,432.13
ALLEGION PLC	7,168	86.23	618,096.64
AMETEK INC	18,866	76.98	1,452,304.68
ARCONIC INC	30,141	30.22	910,861.02
BOEING CO	43,686	337.73	14,754,072.78
CATERPILLAR	46,181	170.41	7,869,704.21
CUMMINS INC	12,421	189.08	2,348,562.68
DEERE&CO	21,115	170.32	3,596,306.80
DOVER CORP	12,008	104.41	1,253,755.28
EATON CORP	35,279	83.95	2,961,672.05
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	73.14	3,724,800.78
FASTENAL CO	23,228	53.74	1,248,388.86
FLOWSERVE CORP	10,826	43.71	473,204.46
FLUOR CORP	11,267	60.43	680,864.81
FORTIVE CORP	24,294	74.56	1,811,360.64
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	72.64	930,518.40
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	209.10	4,194,964.20
GENERAL ELECTRIC CO	673,775	16.26	10,955,581.50
GRAINGER (WW) INC	4,253	230.05	978,402.65
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	39.02	594,118.52
HONEYWELL INTL INC	56,821	158.69	9,016,924.49
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	242.12	852,746.64
IDEX CORP	5,756	138.35	796,342.60
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	172.42	4,229,117.76
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	90.93	1,841,241.57
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	69.95	678,025.35
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	62.50	1,037,500.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	39.84	657,360.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	74,488	38.90	2,897,583.20
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	210.73	1,289,035.41
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	216.48	624,544.80
LOCKHEED MARTIN CORP	20,422	332.00	6,780,104.00
MASCO CORP	24,547	45.90	1,126,707.30
MIDDLEBY CORP	4,364	137.75	601,141.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,972	316.37	4,103,951.64
OWENS CORNING	7,979	96.03	766,223.37
PACCAR INC	27,548	77.51	2,135,245.48
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	210.94	2,184,072.76
PENTAIR PLC	13,583	73.98	1,004,870.34
RAYTHEON COMPANY	22,777	196.68	4,479,780.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,714	203.51	1,976,896.14
ROCKWELL COLLIN	13,112	137.67	1,805,129.04
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	275.69	2,233,089.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	54.88	758,880.64
SMITH (A.O.) CORP	12,146	67.04	814,267.84
SNAP-ON INC	4,900	182.79	895,671.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	98.61	836,311.41
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	175.91	2,113,558.65
TEXTRON	21,877	58.90	1,288,555.30
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	299.17	1,218,220.24
UNITED RENTALS INC	6,446	183.67	1,183,936.82
UNITED TECHNOLOGIES CORP	59,694	135.90	8,112,414.60
WABCO HOLDINGS INC	3,841	161.00	618,401.00
WABTEC CORP	7,158	82.80	592,682.40
XYLEM INC	13,941	71.91	1,002,497.31
CINTAS CORP	7,034	164.06	1,153,998.04
EQUIFAX INC	9,276	124.53	1,155,140.28
IHS MARKIT LTD	29,783	48.87	1,455,495.21
MANPOWER GROUP	5,123	133.04	681,563.92
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	36.71	1,009,671.84
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	68.20	1,259,040.20
ROBERT HALF INTL INC	9,566	57.02	545,453.32
ROLLINS INC	7,031	47.88	336,644.28
STERICYCLE INC	6,767	72.00	487,224.00
TRANSUNION	10,936	59.35	649,051.60
VERISK ANALYTICS INC	12,301	98.90	1,216,568.90
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	72.00	1,469,376.00
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	88.06	3,076,023.86
AMERCO	602	371.67	223,745.34
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	58.06	575,955.20

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	95.16	1,089,391.68
CSX CORP	70,208	57.49	4,036,257.92
DELTA AIR LINES INC	15,095	60.01	905,850.95
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	66.40	916,519.20
FEDEX CORP	20,171	274.32	5,533,308.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	123.61	881,833.74
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	110.00	961,730.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	46.53	497,871.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	64.16	372,705.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	151.40	3,451,768.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,317	147.97	638,786.49
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	65.05	745,798.25
UNION PACIFIC CORP	62,068	141.25	8,767,105.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	76.50	459,229.50
UNITED PARCEL SERVICE B	53,987	133.08	7,184,589.96
APTIV PLC	20,954	93.52	1,959,618.08
AUTOLIV INC	6,639	136.44	905,825.16
BORGWARNER INC	15,953	56.94	908,363.82
FORD MOTOR COMPANY	287,888	12.00	3,454,656.00
GENERAL MOTORS CO	101,158	43.15	4,364,967.70
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	34.99	756,728.73
HARLEY-DAVIDSON	14,677	53.00	777,881.00
LEAR CORP	5,287	191.18	1,010,768.66
TESLA INC	10,212	350.02	3,574,404.24
DR HORTON INC	28,586	51.48	1,471,607.28
GARMIN LTD	9,564	63.87	610,852.68
HANESBRANDS INC	31,136	23.20	722,355.20
HASBRO INC	9,007	92.56	833,687.92
LEGGETT & PLATT INC	10,594	48.25	511,160.50
LENNAR CORP-CL A	16,492	71.82	1,184,455.44
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	79.34	672,168.48
MATTEL INC	27,399	16.14	442,219.86
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	65.86	760,485.42
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	279.14	1,413,006.68
NEWELL BRANDS INC	37,563	31.22	1,172,716.86
NIKE B	103,264	67.21	6,940,373.44
NVR INC	264	3,700.00	976,800.00
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	134.70	631,877.70
PULTE GROUP INC	21,959	34.60	759,781.40
PVH CORP	5,820	147.07	855,947.40
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	112.78	516,306.84
TAPESTRY INC	22,032	47.76	1,052,248.32

TOLL BROTHERS INC	11,211	51.88	581,626.68
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	14.21	226,649.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	12.85	209,236.55
VF CORP	26,718	79.79	2,131,829.22
WHIRLPOOL CORP	5,324	167.53	891,929.72
ARAMARK	19,980	45.38	906,692.40
BLOCK H & R INC	16,984	26.28	446,339.52
CARNIVAL CORPORATION	27,162	68.56	1,862,226.72
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	343.87	679,143.25
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	99.04	993,470.24
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	213.54	872,951.52
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,983	85.49	1,280,896.67
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	74.51	2,298,260.95
MARRIOTT INTL A	25,016	144.07	3,604,055.12
MCDONALD'S CORP	62,987	176.12	11,093,270.44
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	29.17	515,200.54
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	36.35	1,313,834.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	14,813	59.43	880,336.59
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	128.97	1,790,748.45
STARBUCKS CORP	113,248	61.26	6,937,572.48
VAIL RESORTS INC	2,987	231.46	691,371.02
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	126.99	1,008,681.57
WYNN RESORTS LTD	6,619	179.64	1,189,037.16
YUM BRANDS INC	25,546	83.81	2,141,010.26
CBS CORP-CL B	25,905	57.75	1,496,013.75
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,932	366.05	5,465,858.60
COMCAST CORP-CL A	366,191	42.50	15,563,117.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	25.71	329,190.84
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	24.43	413,966.35
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	45.26	824,546.68
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	21.35	722,355.90
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	93.29	808,171.27
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	37.18	576,884.88
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	35.26	1,631,515.46
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	36.48	511,084.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.70	635,216.10
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.71	266,276.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	9,899	43.70	432,586.30
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.22	576,508.38
OMNICOM GROUP	17,139	74.96	1,284,739.44
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	88.50	562,506.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.60	725,228.00

THE WALT DISNEY CO	120,117	110.59	13,283,739.03
TIME WARNER INC	60,604	93.36	5,657,989.44
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	36.65	3,048,766.90
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	33,111	36.26	1,200,604.86
VIACOM INC-CLASS B	26,755	33.36	892,546.80
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	117.02	723,885.72
AMAZON.COM	31,930	1,294.58	41,335,939.40
AUTONATION INC	5,015	58.93	295,533.95
AUTOZONE INC	2,151	793.80	1,707,463.80
BEST BUY COMPANY INC	21,836	76.86	1,678,314.96
CARMAX INC	14,253	70.58	1,005,976.74
DOLLAR GENERAL CORP	21,092	101.98	2,150,962.16
DOLLAR TREE INC	18,300	114.73	2,099,559.00
EXPEDIA INC	9,800	126.27	1,237,446.00
GAP	16,326	34.81	568,308.06
GENUINE PARTS CO	11,245	104.14	1,171,054.30
HOME DEPOT	91,849	201.33	18,491,959.17
KOHL'S CORP	12,602	67.54	851,139.08
L BRANDS INC	19,499	50.69	988,404.31
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	26.77	938,850.67
LKQ CORP	24,693	42.96	1,060,811.28
LOWES COMPANIES	64,686	104.95	6,788,795.70
MACY'S INC	25,926	27.01	700,261.26
NETFLIX INC	33,711	220.46	7,431,927.06
NORDSTROM INC	10,094	52.00	524,888.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	273.02	1,802,751.06
PRICELINE GROUP INC/THE	3,843	1,910.21	7,340,937.03
ROSS STORES INC	30,239	83.76	2,532,818.64
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,455	78.10	3,081,435.50
TIFFANY & CO	10,306	107.77	1,110,677.62
TJX COMPANIES INC	50,039	78.89	3,947,576.71
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	82.39	779,079.84
TRIPADVISOR INC	10,393	35.45	368,431.85
ULTA BEAUTY INC	4,911	244.13	1,198,922.43
COSTCO WHOLESALE CORP	34,368	192.29	6,608,622.72
CVS HEALTH CORP	78,635	79.86	6,279,791.10
KROGER CO	67,460	29.72	2,004,911.20
SYSCO CORP	38,085	63.21	2,407,352.85
WAL-MART STORES	116,172	104.59	12,150,429.48
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71,948	76.47	5,501,863.56
ALTRIA GROUP INC	149,111	71.12	10,604,774.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	40.96	1,825,464.32

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,638	67.50	1,055,565.00
BUNGE LIMITED	11,767	77.56	912,648.52
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	47.39	666,872.08
COCA-COLA CO	315,568	47.16	14,882,186.88
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	39.64	676,892.64
CONAGRA BRANDS INC	33,243	37.77	1,255,588.11
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,382	218.28	2,921,022.96
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	96.35	1,431,279.25
GENERAL MILLS INC	44,875	59.11	2,652,561.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	109.37	1,224,944.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	34.76	815,643.40
INGREDION INC	5,835	137.13	800,153.55
JM SMUCKER CO	8,310	127.53	1,059,774.30
KELLOGG CO	21,051	66.62	1,402,417.62
KRAFT HEINZ CO/THE	47,604	79.66	3,792,134.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	99.19	920,086.44
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	83.77	1,264,927.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,424	44.14	5,138,955.36
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	66.86	2,078,877.98
PEPSICO INC	110,960	120.17	13,334,063.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,970	108.92	13,284,972.40
TYSON FOODS INC	22,220	80.19	1,781,821.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	49.91	952,432.53
CLOROX COMPANY	10,045	143.86	1,445,073.70
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,693	77.50	5,091,207.50
COTY INC-CL A	39,000	20.53	800,670.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	134.45	2,396,167.90
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	115.49	3,232,565.10
PROCTER & GAMBLE CO	198,756	91.07	18,100,708.92
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	121.34	229,817.96
ABBOTT LABORATORIES	136,305	59.31	8,084,249.55
AETNA INC	26,005	187.80	4,883,739.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,723	269.46	1,542,119.58
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	100.06	1,285,470.82
ANTHEM INC	20,286	250.06	5,072,717.16
BAXTER INTERNATIONAL	38,194	70.01	2,673,961.94
BECTON DICKINSON & CO	20,791	234.51	4,875,697.41
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	27.65	2,982,716.10
CARDINAL HEALTH	25,252	71.91	1,815,871.32
CENTENE CORP	13,787	110.67	1,525,807.29
CERNER CORP	23,088	68.91	1,590,994.08
CIGNA CORP	19,408	220.15	4,272,671.20

DANAHER CORP	48,308	100.56	4,857,852.48
DAVITA INC	11,875	78.61	933,493.75
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	61.95	1,104,816.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	123.91	2,078,714.16
ENVISION HEALTHCARE	9,978	35.83	357,511.74
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	44,207	80.22	3,546,285.54
HCA HEALTHCARE INC	21,820	93.01	2,029,478.20
HENRY SCHEIN INC	12,492	75.96	948,892.32
HOLOGIC INC	21,094	43.46	916,745.24
HUMANA INC	11,281	279.30	3,150,783.30
IDEXX LABORATORIES INC	6,423	180.63	1,160,186.49
INTUITIVE SURGICAL INC	8,650	433.23	3,747,439.50
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	174.39	1,386,923.67
MCKESSON CORP	16,655	170.36	2,837,345.80
MEDTRONIC PLC	105,675	86.68	9,159,909.00
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	103.06	1,085,427.92
RESMED INC	10,895	88.68	966,168.60
STRYKER CORP	26,357	161.28	4,250,856.96
TELEFLEX INC	3,697	276.42	1,021,924.74
THE COOPER COS INC	3,563	240.65	857,435.95
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,819	243.35	18,450,553.65
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	118.09	855,916.32
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	110.32	775,108.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,988	58.53	467,537.64
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	123.48	1,983,459.24
ABBVIE INC	125,153	104.64	13,096,009.92
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	73.07	1,850,351.61
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	121.05	2,146,095.45
ALKERMES PLC	12,547	57.03	715,555.41
ALLERGAN PLC	26,330	181.33	4,774,418.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,438	124.83	803,655.54
AMGEN	56,798	189.28	10,750,725.44
BIOGEN INC	16,758	342.41	5,738,106.78
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	89.12	1,278,069.92
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	129,430	62.28	8,060,900.40
CELGENE CORP	61,297	102.65	6,292,137.05
GILEAD SCIENCES INC	102,643	80.98	8,312,030.14
ILLUMINA INC	11,395	243.55	2,775,252.25
INCYTE CORP	14,121	93.16	1,315,512.36
IQVIA HOLDINGS INC	10,874	103.00	1,120,022.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	148.70	739,187.70
JOHNSON & JOHNSON	209,855	147.36	30,924,232.80

LILLY (ELI) & CO	77,966	85.49	6,665,313.34
MERCK & CO	212,539	61.28	13,024,389.92
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	666.69	1,337,380.14
MYLAN NV	36,548	46.73	1,707,888.04
PERRIGO CO PLC	9,792	91.88	899,688.96
PFIZER	464,230	36.94	17,148,656.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,112	371.53	2,270,791.36
SEATTLE GENETICS INC	7,471	53.48	399,549.08
TESARO INC	2,771	63.91	177,094.61
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	20.70	1,487,833.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,031	213.51	6,625,428.81
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	139.51	452,988.97
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	157.97	3,141,075.48
WATERS CORP	6,513	210.72	1,372,419.36
ZOETIS INC	38,334	76.62	2,937,151.08
BANK OF AMERICA CORP	782,115	31.72	24,808,687.80
BB&T CORP	64,293	54.80	3,523,256.40
CIT GROUP INC	10,713	52.10	558,147.30
CITIGROUP	212,257	78.30	16,619,723.10
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	46.82	1,873,268.20
COMERICA INC	12,963	94.99	1,231,355.37
EAST WEST BANCORP INC	10,794	67.98	733,776.12
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	32.50	1,892,052.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	89.93	1,131,139.54
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	15.81	1,382,078.58
JPMORGAN CHASE & CO	274,639	113.01	31,036,953.39
KEY CORP	87,033	21.16	1,841,618.28
M & T BANK CORP	10,792	188.78	2,037,313.76
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	13.90	543,420.50
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	20.08	549,870.72
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	155.25	5,883,819.75
REGIONS FINL CORP	96,209	18.67	1,796,222.03
SIGNATURE BANK	4,354	159.83	695,899.82
SUNTRUST BANKS	38,353	68.58	2,630,248.74
SVB FINANCIAL GROUP	3,954	256.32	1,013,489.28
US BANCORP	129,638	56.46	7,319,361.48
WELLS FARGO & CO	367,734	64.22	23,615,877.48
ZIONS BANCORPORATION	15,186	53.73	815,943.78
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	212.00	939,796.00
ALLY FINANCIAL INC	36,028	30.45	1,097,052.60
AMERICAN EXPRESS	58,101	98.03	5,695,641.03
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	178.81	2,118,898.50

BANK NEW YORK CO	81,361	56.61	4,605,846.21
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	98,775	213.25	21,063,768.75
BLACKROCK INC	9,490	590.26	5,601,567.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	104.38	3,995,144.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,588	133.88	1,015,881.44
CME GROUP INC	27,024	154.28	4,169,262.72
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	78.32	2,315,530.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	54.28	1,145,742.24
EATON VANCE CORP	10,061	60.69	610,602.09
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	44.89	1,170,282.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,481	256.12	7,294,553.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	45,106	75.60	3,410,013.60
INVESCO LTD	30,943	38.13	1,179,856.59
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	28.01	720,025.06
MOODY'S CORP	13,385	159.18	2,130,624.30
MORGAN STANLEY	108,682	57.46	6,244,867.72
MSCI INC	6,934	138.25	958,625.50
NASDAQ INC	9,070	80.07	726,234.90
NORTHERN TRUST CORP	17,320	106.49	1,844,406.80
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	117.35	2,228,711.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	96.19	955,359.08
S&P GLOBAL INC	20,491	181.14	3,711,739.74
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	55.48	5,284,414.52
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	77.23	834,238.46
STATE STREET CORP	29,345	107.61	3,157,815.45
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	38.47	2,321,549.09
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,297	55.17	1,119,785.49
VOYA FINANCIAL INC	14,081	54.43	766,428.83
AFLAC	30,947	86.82	2,686,818.54
ALLEGHANY CORP	1,276	591.76	755,085.76
ALLSTATE CORP	28,446	103.70	2,949,850.20
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	110.30	612,054.70
AMERICAN INT'L GROUP	69,592	61.55	4,283,387.60
AON PLC	20,775	135.18	2,808,364.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	91.15	920,797.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	64.29	962,549.88
ASSURANT INC	4,769	94.08	448,667.52
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,893	51.59	458,789.87
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	48.62	355,023.24
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	64.19	436,235.24
CHUBB LTD	36,582	148.20	5,421,452.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	75.16	932,961.08

EVEREST RE GROUP LTD	3,353	224.60	753,083.80
FNF GROUP	20,786	41.50	862,619.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	55.96	1,603,925.52
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	83.17	1,479,594.30
LOEWS CORP	22,051	52.51	1,157,898.01
MARKEL CORP	1,132	1,122.00	1,270,104.00
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	82.08	3,351,983.04
METLIFE INC	71,520	53.40	3,819,168.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	74.05	1,714,627.75
PROGRESSIVE CORP	46,702	57.66	2,692,837.32
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	124.13	4,164,064.98
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	162.45	882,265.95
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	122.85	399,139.65
TORCHMARK CORP	8,473	92.15	780,786.95
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	137.85	3,006,646.35
UNUM GROUP	18,574	55.99	1,039,958.26
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,962	153.89	1,533,052.18
WR BERKLEY CORP	7,296	70.73	516,046.08
XL GROUP LTD	20,644	35.45	731,829.80
CBRE GROUP INC-A	24,306	45.88	1,115,159.28
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.12	702,744.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	155.17	569,939.41
WEYERHAEUSER CO	58,857	35.80	2,107,080.60
ACCENTURE PLC-CL A	48,671	161.75	7,872,534.25
ACTIVISION BLIZZARD INC	56,005	70.57	3,952,272.85
ADOBE SYSTEMS INC	38,830	195.73	7,600,195.90
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	65.63	930,502.14
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	261.82	1,051,469.12
ALPHABET INC-CL A	23,276	1,143.50	26,616,106.00
ALPHABET INC-CL C	24,569	1,137.51	27,947,483.19
ANSYS INC	6,865	161.54	1,108,972.10
AUTODESK INC	15,592	115.29	1,797,601.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,215	121.44	4,155,069.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	95.93	925,724.50
CA INC	26,520	34.07	903,536.40
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	45.60	984,276.00
CDK GLOBAL INC	10,687	73.38	784,212.06
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	104.48	1,128,488.48
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	92.72	1,160,019.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,074	77.29	3,561,059.46
COSTAR GROUP INC	2,453	341.20	836,963.60
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	88.49	1,400,531.23

DXC TECHNOLOGY CO	22,050	100.98	2,226,609.00
EBAY	81,500	38.43	3,132,045.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,208	116.18	2,812,485.44
FACEBOOK INC-A	185,241	181.29	33,582,340.89
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	25,779	98.47	2,538,458.13
FIRST DATA CORP- CLASS A	29,535	18.00	531,630.00
FISERV INC	16,892	138.11	2,332,954.12
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	206.65	1,480,233.95
FORTINET INC	10,871	46.01	500,174.71
GARTNER INC	7,002	137.35	961,724.70
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	108.01	1,351,529.13
IAC/INTERACTIVECORP	5,310	137.20	728,532.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,899	162.37	11,187,130.63
INTUIT INC	19,275	167.74	3,233,188.50
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	125.15	748,271.85
LEIDOS HOLDINGS	10,999	67.14	738,472.86
MASTERCARD INC-CLASS A	73,517	166.83	12,264,841.11
MERCADOLIBRE INC	3,264	345.31	1,127,091.84
MICROSOFT CORP	572,164	90.00	51,494,760.00
ORACLE CORP	242,564	50.58	12,268,887.12
PAYCHEX INC	25,506	69.49	1,772,411.94
PAYPAL HOLDINGS INC	89,558	83.84	7,508,542.72
RED HAT INC	13,963	125.94	1,758,500.22
SABRE CORP	17,243	20.67	356,412.81
SALESFORCE.COM INC	53,057	111.93	5,938,670.01
SERVICENOW INC	13,794	142.27	1,962,472.38
SPLUNK INC	10,741	89.94	966,045.54
SQUARE INC - A	18,207	42.56	774,889.92
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	49.98	661,685.22
SYMANTEC CORP	48,508	27.46	1,332,029.68
SYNOPSIS INC	12,264	92.61	1,135,769.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,735	118.05	913,116.75
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	83.25	1,049,782.50
TWITTER INC	47,756	23.66	1,129,906.96
VERISIGN INC	7,289	114.48	834,444.72
VISA INC-CLASS A SHARES	142,669	122.70	17,505,486.30
VMWARE INC-CLASS A	5,821	136.04	791,888.84
WESTERN UNION CO	38,757	20.24	784,441.68
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	114.11	1,219,950.01
WORLDPAY INC-CLASS A	12,864	78.73	1,012,782.72
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	42.58	331,527.88
AMPHENOL CORPORATION	24,215	93.13	2,255,142.95

APPLE INC	404,059	178.46	72,108,369.14
ARISTA NETWORKS INC	3,532	270.84	956,606.88
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	86.94	579,542.04
AVNET INC	10,936	43.28	473,310.08
CDW CORP/DE	12,482	75.21	938,771.22
CISCO SYSTEMS	393,079	41.29	16,230,231.91
COGNEX CORP	12,660	69.06	874,299.60
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	38.65	577,160.45
CORNING	71,752	34.66	2,486,924.32
F5 NETWORKS INC	5,350	138.76	742,366.00
FLEX LTD	40,465	19.61	793,518.65
FLIR SYSTEMS INC	11,686	52.40	612,346.40
HARRIS CORP	8,930	145.89	1,302,797.70
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	122,533	16.08	1,970,330.64
HP INC	128,828	23.70	3,053,223.60
IPG PHOTONICS CORP	2,683	263.05	705,763.15
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.85	871,816.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	97.80	1,234,236.00
NETAPP INC	20,821	63.09	1,313,596.89
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	157.22	1,133,713.42
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	52.62	1,201,630.32
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	100.73	2,821,346.57
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	44.59	919,534.98
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	85.60	2,018,191.20
XEROX CORP	16,718	31.80	531,632.40
AT&T INC	478,488	37.21	17,804,538.48
CENTURYLINK INC	73,994	17.31	1,280,836.14
SPRINT CORP	64,825	5.47	354,592.75
T-MOBILE US INC	22,516	63.71	1,434,494.36
VERIZON COMMUNICATIONS	320,438	51.91	16,633,936.58
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	35.98	550,098.22
AES CORP	52,646	11.75	618,590.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	39.41	758,878.96
AMEREN CORPORATION	18,723	55.16	1,032,760.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	67.76	2,633,966.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	83.01	1,185,631.83
ATMOS ENERGY CORP	8,018	80.83	648,094.94
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	27.80	874,059.80
CMS ENERGY CORP	21,593	44.05	951,171.65
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	78.27	1,873,940.34
DOMINION ENERGY INC	50,217	74.99	3,765,772.83
DTE ENERGY COMPANY	14,355	103.15	1,480,718.25

DUKE ENERGY CORP	54,806	76.82	4,210,196.92	
EDISON INTL	26,184	62.12	1,626,550.08	
ENTERGY CORP	13,854	76.99	1,066,619.46	
EVERSOURCE ENERGY	25,381	60.79	1,542,910.99	
EXELON CORP	73,029	37.97	2,772,911.13	
FIRSTENERGY CORP	35,696	29.40	1,049,462.40	
NEXTERA ENERGY INC	36,685	150.16	5,508,619.60	
NISOURCE INC	26,021	23.94	622,942.74	
OGE ENERGY CORP	15,686	31.42	492,854.12	
PG&E CORP	41,241	44.39	1,830,687.99	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	79.08	744,617.28	
PPL CORPORATION	53,473	31.59	1,689,212.07	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	49.80	2,022,178.80	
SCANA CORP	11,459	43.35	496,747.65	
SEMPRA ENERGY	18,704	105.99	1,982,436.96	
SOUTHERN CO	77,804	44.44	3,457,609.76	
UGI CORP	13,950	45.72	637,794.00	
VISTRA ENERGY CORP	16,718	19.49	325,833.82	
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	63.11	1,595,862.57	
WESTAR ENERGY INC	11,492	50.95	585,517.40	
XCEL ENERGY INC	40,763	45.13	1,839,634.19	
ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	12.59	761,229.17	
ANALOG DEVICES	28,935	96.14	2,781,810.90	
APPLIED MATERIALS	84,218	57.40	4,834,113.20	
BROADCOM LTD	31,522	266.39	8,397,145.58	
INTEL CORP	366,486	44.82	16,425,902.52	
KLA-TENCOR CORP	12,266	115.02	1,410,835.32	
LAM RESEARCH CORP	12,814	207.53	2,659,289.42	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,459	23.68	721,269.12	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	56.58	1,235,084.82	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	97.45	1,814,908.80	
MICRON TECHNOLOGY	82,240	42.75	3,515,760.00	
NVIDIA CORP	46,747	230.11	10,756,952.17	
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	120.45	3,286,237.35	
QORVO INC	10,609	68.40	725,655.60	
QUALCOMM	115,987	68.04	7,891,755.48	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	99.20	1,439,392.00	
TEXAS INSTRUMENTS	76,871	116.83	8,980,838.93	
XILINX INC	20,299	75.71	1,536,837.29	
アメリカドル 小計	24,011,165		1,928,644,174.49 (213,597,342,324)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	29.03	345,050.58

ARC RESOURCES LTD	27,117	13.30	360,656.10
CAMECO CORP	28,709	12.05	345,943.45
CANADIAN NATURAL RESOURCES	83,342	45.18	3,765,391.56
CENOVUS ENERGY INC	77,803	12.79	995,100.37
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	10.59	457,953.96
ENBRIDGE	127,899	49.25	6,299,025.75
ENCANA CORP	76,271	16.89	1,288,217.19
HUSKY ENERGY INC	31,439	17.91	563,072.49
IMPERIAL OIL	24,763	39.55	979,376.65
INTER PIPELINE LTD	30,317	25.65	777,631.05
KEYERA CORP	14,929	36.22	540,728.38
PEMBINA PIPELINE CORP	37,784	43.75	1,653,050.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	31.85	584,447.50
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	18.60	372,186.00
SUNCOR ENERGY	130,278	46.22	6,021,449.16
TOURMALINE OIL CORP	19,965	20.62	411,678.30
TRANSCANADA CORP	66,646	59.82	3,986,763.72
VERMILION ENERGY INC	10,067	49.00	493,283.00
AGNICO EAGLE MINES	17,661	57.84	1,021,512.24
BARRICK GOLD CORP	94,395	17.99	1,698,166.05
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	59.93	629,265.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	19.22	1,093,618.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	97.86	1,395,190.02
GOLDCORP INC	68,688	17.91	1,230,202.08
KINROSS GOLD CORP	107,615	5.25	564,978.75
LUNDIN MINING CORP	40,933	8.81	360,619.73
METHANEX CORP	7,099	74.21	526,816.79
NUTRIEN LTD	51,428	66.18	3,403,505.04
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	36.79	1,680,456.83
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	4.19	297,490.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	85.74	370,996.98
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	27.52	1,013,781.76
BOMBARDIER B	157,835	3.13	494,023.55
CAE INC	18,372	23.24	426,965.28
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	33.99	399,858.36
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	56.95	837,905.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,879	101.00	5,946,779.00
CP RAILWAY LIMITED	11,263	233.40	2,628,784.20
LINAMAR CORP	3,889	73.80	287,008.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	72.90	2,039,596.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	41.89	739,735.51
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	77.00	1,414,644.00

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.00	970,569.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	172.09	930,834.81
DOLLARAMA INC	7,784	160.00	1,245,440.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	65.99	2,247,817.37
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	25.50	293,224.50
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	24.30	133,990.20
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	68.80	1,074,518.40
METRO INC	19,179	40.77	781,927.83
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	109.68	523,722.00
SAPUTO INC	15,941	42.90	683,868.90
BANK MONTREAL	50,677	104.44	5,292,705.88
BANK NOVA SCOTIA	93,824	81.99	7,692,629.76
CANADIAN IMPERIAL BANK	33,314	122.53	4,081,964.42
NATIONAL BANK OF CANADA	25,201	65.08	1,640,081.08
ROYAL BANK OF CANADA	114,007	107.72	12,280,834.04
TORONTO-DOMINION BANK	144,182	74.08	10,681,002.56
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	63,915	53.42	3,414,339.30
CI FINANCIAL CORP	18,671	29.57	552,101.47
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	8.79	254,786.94
IGM FINANCIAL INC	7,685	43.85	336,987.25
ONEX CORP	6,603	90.82	599,684.46
THOMSON REUTERS CORP	22,284	54.58	1,216,260.72
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	659.14	1,519,317.70
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	35.26	838,764.88
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	61.69	507,708.70
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	101.55	1,062,822.30
MANULIFE FINANCIAL CORP	153,175	27.48	4,209,249.00
POWER CORP OF CANADA	29,774	32.27	960,806.98
POWER FINANCIAL CORP	20,740	34.73	720,300.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	55.10	2,729,433.60
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.81	259,396.65
CGI GROUP INC - CL A	17,309	67.55	1,169,222.95
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	788.32	1,201,399.68
OPEN TEXT CORP	19,994	42.06	840,947.64
SHOPIFY INC - CLASS A	6,105	144.47	881,989.35
BCE INC	12,539	58.06	728,014.34
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	62.51	1,805,351.31
TELUS CORP	16,454	46.91	771,857.14
ATCO LTD -CLASS I	5,241	43.86	229,870.26
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.56	367,121.44
EMERA INC	4,086	46.12	188,446.32
FORTIS INC	34,128	43.84	1,496,171.52

	HYDRO ONE LTD	21,742	21.92	476,584.64
	カナダドル 小計	3,102,745		140,636,971.62 (12,477,312,122)
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.52	430,392.48
	ENI	202,686	14.83	3,005,833.38
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	16.16	644,250.72
	NESTE OIL OYJ	9,229	58.34	538,419.86
	OMV AG	12,139	54.90	666,431.10
	REPSOL SA	98,275	15.58	1,531,124.50
	SNAM SPA	173,485	4.07	706,777.89
	TENARIS SA	40,648	14.24	578,827.52
	TOTAL SA	184,716	47.29	8,735,219.64
	VOPAK	6,360	36.90	234,684.00
	AIR LIQUIDE	33,410	109.00	3,641,690.00
	AKZO NOBEL	19,791	74.82	1,480,762.62
	ARCELORMITTAL	53,985	30.10	1,624,948.50
	ARKEMA	5,335	107.35	572,712.25
	BASF SE	71,827	97.67	7,015,343.09
	COVESTRO AG	9,162	95.00	870,390.00
	CRH PLC	67,624	30.29	2,048,330.96
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	31.97	430,124.38
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	44.90	258,713.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	92.56	1,055,831.92
	IMERYS SA	3,000	83.40	250,200.00
	K+S AG	14,355	22.16	318,106.80
	KONINKLIJKE DSM NV	13,812	84.60	1,168,495.20
	LANXESS	7,293	73.84	538,515.12
	LINDE AG - TENDER	14,602	204.10	2,980,268.20
	SOLVAY SA	5,511	119.45	658,288.95
	STORA ENSO OYJ R	40,237	14.53	584,844.79
	SYMRISE AG	9,083	69.50	631,268.50
	THYSSEN KRUPP	33,044	26.30	869,057.20
	UMICORE	13,905	42.73	594,230.17
	UPM KYMMENE OYJ	40,376	27.41	1,106,706.16
	VOESTALPINE AG	8,140	54.60	444,444.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,813	33.75	668,688.75
	AIRBUS SE	45,442	92.79	4,216,563.18
	ALSTOM	11,216	36.68	411,402.88
	ANDRITZ AG	5,242	48.54	254,446.68
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	31.56	263,115.72
	BOUYGUES ORD	16,815	45.61	766,932.15
	BRENTAG AG	11,626	54.48	633,384.48

CNH INDUSTRIAL NV	76,653	12.15	931,333.95
DASSAULT AVIATION SA	213	1,372.00	292,236.00
EIFFAGE	6,079	96.86	588,811.94
FERROVIAL SA	36,974	18.94	700,472.43
GEA GROUP AG	13,382	40.00	535,280.00
HOCHTIEF AG	1,354	147.00	199,038.00
KION GROUP AG	5,887	77.00	453,299.00
KONE OYJ-B	26,924	45.33	1,220,464.92
LEGRAND SA	21,312	66.76	1,422,789.12
LEONARDO SPA	35,425	11.25	398,531.25
MAN SE	3,262	96.15	313,641.30
METSO OYJ	9,561	28.09	268,568.49
MTU AERO ENGINES AG	3,907	153.00	597,771.00
OSRAM LICHT AG	7,440	76.50	569,160.00
PRYSMIAN SPA	14,715	29.12	428,500.80
REXEL SA	24,339	14.69	357,539.91
SAFRAN SA	26,102	91.26	2,382,068.52
SAINT-GOBAIN	39,044	48.10	1,878,211.62
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	75.64	3,389,730.96
SIEMENS	59,846	123.70	7,402,950.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.70	222,135.70
THALES SA	8,109	91.26	740,027.34
VINCI S.A.	40,049	87.76	3,514,700.24
WARTSILA OYJ	11,462	55.60	637,287.20
ZODIAC AEROSPACE	17,832	25.03	446,334.96
BUREAU VERITAS SA	19,558	23.99	469,196.42
EDENRED	18,941	26.55	502,883.55
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	56.02	537,119.76
RELX NV	73,802	18.48	1,364,229.97
SOCIETE BIC SA	2,424	97.50	236,340.00
TELEPERFORMANCE	4,523	125.20	566,279.60
WOLTERS KLUWER	23,031	43.08	992,175.48
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	53,260	18.95	1,009,543.30
ADP	2,382	163.70	389,933.40
AENA SME SA	5,610	177.10	993,531.00
ATLANTIA SPA	37,004	27.22	1,007,248.88
BOLLORE	61,805	4.64	287,146.03
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	29.63	501,606.27
DEUTSCHE POST AG-REG	75,335	40.96	3,085,721.60
FRAPORT AG	3,561	96.58	343,921.38
GETLINK	36,478	11.13	406,182.53
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.46	345,804.00

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,618	94.68	2,425,512.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	80.00	399,280.00
CONTINENTAL AG	8,828	250.10	2,207,882.80
DAIMLER AG	74,980	75.01	5,624,249.80
FAURECIA	5,945	74.00	439,930.00
FERRARI NV	9,947	98.65	981,271.55
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	19.55	1,691,915.65
MICHELIN	13,802	129.50	1,787,359.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	40.05	412,194.60
PEUGEOT SA	46,029	18.47	850,155.63
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	77.90	906,288.60
RENAULT SA	15,041	90.29	1,358,051.89
SCHAEFFLER AG	15,247	16.53	252,032.91
VALEO SA	19,350	65.38	1,265,103.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	183.72	2,715,381.60
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	185.80	481,965.20
ADIDAS AG	14,964	182.80	2,735,419.20
HERMES INTERNATIONAL	2,561	445.10	1,139,901.10
HUGO BOSS AG	4,852	76.48	371,080.96
KERING	6,060	412.10	2,497,326.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	51.05	679,934.95
LVMH	21,748	240.95	5,240,180.60
SEB SA	2,075	171.20	355,240.00
ACCOR	14,931	45.99	686,676.69
PADDY POWER PLC	7,143	95.25	680,370.75
SODEXO	7,035	109.70	771,739.50
ALTICE NV -A	38,810	8.98	348,513.80
AXEL SPRINGER SE	3,827	70.85	271,142.95
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	18.99	227,424.24
JC DECAUX SA	4,674	36.48	170,507.52
LAGADERE S.C.A	9,057	25.97	235,210.29
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	29.91	573,494.34
PUBLICIS GROUPE	15,618	58.10	907,405.80
RTL GROUP	3,513	70.50	247,666.50
SES	31,369	13.04	409,208.60
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	61.05	305,127.90
VIVENDI	83,098	23.64	1,964,436.72
INDITEX	86,470	28.56	2,469,583.20
ZALANDO SE	9,155	47.92	438,707.60
CARREFOUR	43,442	18.36	797,595.12
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	47.54	175,279.98
COLRUYT SA	4,160	44.47	184,995.20

JERONIMO MARTINS	20,234	17.56	355,309.04
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	18.82	1,892,269.77
METRO AG	13,712	16.60	227,619.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	59,539	94.36	5,618,100.04
DANONE (GROUPE)	46,629	70.39	3,282,215.31
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	6.30	267,913.80
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	83.70	751,626.00
HEINEKEN NV	20,246	88.74	1,796,630.04
KERRY GROUP PLC-A	13,146	89.00	1,169,994.00
PERNOD-RICARD	16,613	130.00	2,159,690.00
REMY COINTREAU	1,575	108.00	170,100.00
BEIERSDORF AG	7,693	97.54	750,375.22
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	104.00	896,272.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	113.65	1,626,786.10
LOREAL	19,570	185.80	3,636,106.00
UNILEVER NV-CVA	127,303	47.07	5,992,152.21
BIOMERIEUX	3,246	77.60	251,889.60
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	112.05	1,815,546.15
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,573	91.06	1,509,137.38
FRESENIUS SE&CO KGAA	32,066	67.14	2,152,911.24
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	33.58	2,500,739.10
BAYER	64,692	104.08	6,733,143.36
EUROFINS SCIENTIFIC	971	532.50	517,057.50
GRIFOLS SA	22,128	26.26	581,081.28
IPSEN	2,722	113.35	308,538.70
MERCK KGAA	10,480	89.66	939,636.80
ORION OYJ-CLASS B	7,975	32.99	263,095.25
QIAGEN N.V.	17,548	26.79	470,110.92
RECORDATI SPA	7,493	38.56	288,930.08
SANOFI	88,672	72.95	6,468,622.40
UCB (GROUPE)	10,465	70.00	732,550.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	27.70	919,335.30
BANCO BILBAO VIZCAYA	520,674	7.40	3,852,987.60
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.86	824,128.94
BANCO SANTANDER SA	1,268,017	5.93	7,519,340.81
BANKIA SA	78,000	4.14	322,920.00
BANKINTER SA	58,881	8.63	508,614.07
BNP PARIBAS	87,969	66.95	5,889,524.55
CAIXABANK	277,342	4.30	1,194,511.99
COMMERZBANK AG	80,494	13.35	1,074,594.90
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	15.20	1,411,540.97
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	39.69	917,156.52

ING GROEP NV-CVA	304,071	16.45	5,001,967.95
INTESA SANPAOLO	1,054,307	3.08	3,255,700.01
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.99	194,350.00
KBC GROEP NV	20,232	75.66	1,530,753.12
MEDIOBANCA	41,923	9.95	417,343.46
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	34.02	424,909.80
SOCIETE GENERALE	60,408	45.33	2,738,294.64
UNICREDIT SPA	155,580	17.40	2,707,092.00
AMUNDI SA	4,764	72.92	347,390.88
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	15.33	2,471,166.10
DEUTSCHE BOERSE	15,552	98.62	1,533,738.24
EURAZEO SA	3,046	84.55	257,539.30
EXOR NV	7,813	62.00	484,406.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	95.00	593,465.00
NATIXIS	69,996	7.23	506,351.06
WENDEL	2,023	147.70	298,797.10
AEGON	133,499	5.68	758,808.31
AGEAS	16,065	43.34	696,257.10
ALLIANZ SE-REG	35,263	205.45	7,244,783.35
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	16.17	1,643,664.33
AXA	151,617	27.33	4,144,450.69
CNP ASSURANCES	11,830	20.34	240,622.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	112.50	529,425.00
MAPFRE SA	90,939	2.86	260,722.11
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,028	192.25	2,312,383.00
NN GROUP NV	23,899	38.18	912,463.82
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.72	309,585.37
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	48.12	1,742,569.56
SCOR SE	13,354	36.60	488,756.40
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.05	195,294.32
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	36.50	1,005,684.50
VONOVIA SE	37,270	41.55	1,548,568.50
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	34,225	62.98	2,155,490.50
ATOS SE	7,634	128.35	979,823.90
CAPGEMINI SA	12,238	108.45	1,327,211.10
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	94.12	985,342.28
SAP SE	76,896	92.30	7,097,500.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,939	69.06	341,087.34
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	58.10	552,705.30
WIRECARD AG	8,914	110.00	980,540.00
INGENICO GROUP	4,681	91.06	426,251.86
NOKIA OYJ	458,694	3.97	1,822,849.95

	1&1 DRILLISCH	3,773	69.70	262,978.10
	DEUTSCHE TELEKOM	259,113	14.43	3,739,000.59
	ELISA A	11,722	31.90	373,931.80
	ILIAD SA	2,053	205.90	422,712.70
	KPN (KON.)	261,596	2.83	740,578.27
	ORANGE	156,887	14.45	2,267,017.15
	PROXIMUS	13,141	27.38	359,800.58
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.72	614,689.99
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.60	286,319.52
	TELEFONICA	359,839	8.25	2,971,550.46
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.05	271,417.25
	E.ON SE	169,727	8.92	1,513,964.84
	ELECTRICITE DE FRANCE	40,498	10.92	442,238.16
	ENDESA	24,774	18.54	459,309.96
	ENEL	632,101	5.39	3,407,024.39
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.88	557,309.92
	ENGIE	142,903	14.42	2,060,661.26
	FORTUM OYJ	32,675	17.84	583,085.37
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	20.37	530,312.58
	IBERDROLA SA	454,702	6.67	3,036,499.95
	INNOGY SE	11,000	33.26	365,860.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	17.80	585,299.60
	RWE STAMM	42,828	17.55	751,631.40
	SUEZ	28,043	13.79	386,712.97
	TERNA SPA	105,905	4.91	520,840.79
	UNIPER SE	14,751	25.04	369,365.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	21.06	775,408.14
	ASML HOLDING NV	30,360	166.90	5,067,084.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	25.36	2,301,242.48
	STMICROELECTRONICS	48,144	20.43	983,581.92
	ユーロ 小計	15,201,524		326,076,599.11 (44,212,726,073)
イギリスポンド	BP PLC	1,540,944	5.09	7,857,273.45
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	348,594	25.17	8,774,110.98
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	293,127	25.60	7,504,051.20
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	6.64	358,560.00
	ANGLO AMERICAN PLC	102,395	17.56	1,798,056.20
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.93	356,336.92
	BHP BILLITTON PLC	168,203	16.13	2,714,460.01
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	45.34	464,417.62
	FRESNILLO PLC	17,743	14.03	249,023.00
	GLENCORE PLC	952,174	4.07	3,876,776.44

JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	32.52	458,889.72
MONDI PLC	27,192	19.71	536,090.28
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	71.72	523,125.68
RIO TINTO PLC REG	96,058	40.16	3,858,169.57
ASSTEAD GROUP PLC	37,298	21.36	796,685.28
BAE SYSTEMS PLC	256,884	5.87	1,509,450.38
BUNZL PLC	27,712	20.28	561,999.36
COBHAM PLC	197,992	1.35	268,180.16
DCC PLC	7,320	75.45	552,294.00
FERGUSON PLC	20,276	56.24	1,140,322.24
IMI PLC	23,923	14.07	336,596.61
MEGGITT PLC	66,268	4.88	323,387.84
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	8.92	1,194,682.46
SMITHS GROUP PLC	28,628	16.73	479,089.58
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	14.92	276,840.60
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	21.46	398,855.56
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.14	140,608.02
CAPITA GROUP PLC	53,334	3.63	193,709.08
EXPERIAN PLC	66,378	16.68	1,107,185.04
G4S PLC	132,555	2.91	386,132.71
INTERTEK GROUP PLC	12,430	52.74	655,558.20
RELX PLC	82,063	16.46	1,351,167.29
EASYJET PLC	11,633	15.84	184,324.88
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.64	348,767.38
NEW GKN	148,431	4.39	652,205.81
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	6.15	439,572.70
BURBERRY GROUP PLC	35,328	15.96	564,011.52
PERSIMMON PLC	22,676	26.34	597,285.84
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.97	535,644.78
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	42.21	447,383.79
CARNIVAL PLC	13,721	49.75	682,619.75
COMPASS GROUP PLC	117,022	15.27	1,786,925.94
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	49.28	688,145.92
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.50	228,233.58
TUI AG-DI	31,155	16.31	508,293.82
WHITBREAD PLC	14,664	40.05	587,293.20
ITV PLC	295,435	1.64	487,320.03
PEARSON	66,305	6.88	456,178.40
SKY PLC	83,042	10.02	832,080.84
WPP PLC	98,371	13.83	1,360,962.78
KINGFISHER PLC	138,994	3.36	467,158.83
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.04	411,199.52

NEXT PLC	11,202	48.98	548,673.96
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.29	385,006.25
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.58	382,704.30
TESCO	656,079	2.07	1,363,332.16
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	27.50	793,237.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	180,173	50.62	9,120,357.26
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	24.24	339,335.76
DIAGEO	196,556	26.21	5,152,715.54
IMPERIAL BRANDS PLC	71,731	30.16	2,163,406.96
RECKITT BENCKISER PLC	51,949	69.13	3,591,234.37
UNILEVER PLC	99,877	41.08	4,102,947.16
CONVATEC GROUP PLC	112,565	1.87	210,496.55
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	6.07	182,263.89
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	12.45	884,286.15
ASTRAZENECA	98,816	50.43	4,983,290.88
GLAXOSMITHKLINE	384,044	13.58	5,215,317.52
SHIRE PLC	72,022	34.61	2,492,681.42
BARCLAYS	1,365,547	2.00	2,737,921.73
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,577,916	7.88	12,440,289.74
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,608,978	0.71	4,009,297.47
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.97	878,592.85
STANDARD CHARTERED PLC	258,738	8.19	2,119,064.22
3I GROUP PLC	79,251	9.34	740,204.34
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	19.28	394,642.32
INVESTEC PLC	54,280	5.44	295,500.32
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,018	37.51	900,915.18
SCHRODERS PLC	8,614	37.23	320,699.22
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	12.70	568,548.75
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	4.37	967,899.14
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	18.78	305,268.90
AVIVA PIC	318,261	5.34	1,702,059.82
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.73	424,611.81
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.76	1,340,727.27
OLD MUTUAL PLC	397,509	2.37	944,083.87
PRUDENTIAL	202,092	19.81	4,003,442.52
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.26	541,900.95
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.49	279,954.99
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	21.54	754,675.44
SAGE GROUP PLC	89,321	8.18	731,181.70
WORLDPAY INC-CL A	10,554	56.80	599,467.20
BT GROUP PLC	663,615	2.64	1,752,607.21
VODAFONE GROUP PLC	2,076,853	2.25	4,689,534.07

	CENTRICA PLC	440,558	1.39	612,595.89
	NATIONAL GRID PLC	255,848	8.30	2,124,817.64
	SEVERN TRENT PLC	18,112	20.24	366,586.88
	SSE PLC	80,824	12.91	1,043,437.84
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.68	452,392.98
	イギリス債券 小計	23,974,524		154,221,904.68 (23,708,533,406)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	29.32	510,109.36
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	695.00	467,040.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,295.00	1,698,300.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	59.58	2,180,866.32
	SIKA AG-BR	175	8,340.00	1,459,500.00
	ABB LTD	143,348	26.98	3,867,529.04
	GEBERIT AG-REG	3,021	463.00	1,398,723.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	229.60	339,578.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	236.60	707,197.40
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	78.90	1,043,373.60
	SGS SA	437	2,635.00	1,151,495.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	176.60	700,219.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	90.10	3,738,699.50
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	407.90	1,012,815.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	77.15	303,816.70
	DUFREY AG-REG	2,548	147.85	376,721.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,951.00	312,160.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	70,100.00	560,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,835.00	437,625.00
	NESTLE SA - REGISTERED	243,211	82.28	20,011,401.08
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	151.50	627,210.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	722.50	562,827.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	270.20	1,555,541.40
	NOVARTIS	174,408	83.38	14,542,139.04
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,064	234.50	12,912,508.00
	VIFOR PHARMA AG	3,601	134.75	485,234.75
	CREDIT SUISSE GROUP AG	188,727	18.28	3,449,929.56
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	63.86	1,101,840.44
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	87.50	297,237.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,299	731.00	949,569.00
	UBS GROUP AG	286,036	19.32	5,527,645.70
	BALOISE HOLDING AG	3,877	159.40	617,993.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	358.80	881,212.80
	SWISS RE LTD	24,531	94.46	2,317,198.26
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,842	317.60	3,761,019.20

	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	89.60	562,419.20
	SWISSCOM	2,064	520.00	1,073,280.00
	スイスフラン 小計	1,309,479		93,502,777.05 (10,765,909,749)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	205.40	2,914,831.40
	BOLIDEN AB	20,141	289.90	5,838,875.90
	ALFA LAVAL AB	18,631	209.30	3,899,468.30
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	178.80	14,356,746.00
	ATLAS COPCO A	53,833	380.80	20,499,606.40
	ATLAS COPCO B	29,972	337.40	10,112,552.80
	SANDVIK AB	87,313	159.15	13,895,863.95
	SKANSKA B	28,530	160.25	4,571,932.50
	SKF AB-B	28,335	199.40	5,649,999.00
	VOLVO B	123,214	165.30	20,367,274.20
	SECURITAS B	22,844	148.15	3,384,338.60
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	258.90	4,704,213.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	82.36	3,188,320.32
	HENNES & MAURITZ B	73,962	157.80	11,671,203.60
	ICA GRUPPEN AB	5,730	310.60	1,779,738.00
	SWEDISH MATCH AB	15,149	326.70	4,949,178.30
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	234.50	11,389,899.50
	GETINGE AB-B SHS	15,845	115.55	1,830,889.75
	NORDEA BANK AB	244,135	100.25	24,474,533.75
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	100.00	12,248,400.00
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	115.50	13,880,443.50
	SWEDBANK AB-A	71,353	200.40	14,299,141.20
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	215.70	2,759,234.40
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	393.10	14,447,211.20
	KINNEVIK AB - B	18,104	291.60	5,279,126.40
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	644.00	2,344,160.00
ERICSSON (LM) B	248,169	58.56	14,532,776.64	
HEXAGON AB-B SHS	18,134	472.80	8,573,755.20	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	573.50	3,552,259.00	
TELE2 AB-B SHS	20,067	95.44	1,915,194.48	
TELIA CO AB	199,107	37.22	7,410,762.54	
	スウェーデンクローナ 小計	1,844,546		270,721,929.83 (3,735,962,631)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	92,696	181.95	16,866,037.20
	NORSK HYDRO	106,150	60.80	6,453,920.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	384.00	5,172,480.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	233.50	1,627,728.50
	MARINE HARVEST	32,238	131.35	4,234,461.30

	ORKLA	46,317	81.56	3,777,614.52	
	DNB ASA	80,217	160.65	12,886,861.05	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	161.50	2,999,701.00	
	TELENOR ASA	60,821	189.25	11,510,374.25	
	ノルウェークローネ 小計	457,454		65,529,177.82 (923,306,115)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	544.00	4,026,144.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	338.10	5,979,974.70	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	432.30	7,660,356.00	
	ISS A/S	14,253	243.50	3,470,605.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	10,500.00	3,139,500.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	10,965.00	5,570,220.00	
	DSV A/S	14,599	498.50	7,277,601.50	
	PANDORA A/S	8,431	630.80	5,318,274.80	
	CARLSBERG AS-B	8,236	759.60	6,256,065.60	
	COLOPLAST-B	9,476	521.00	4,936,996.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	183.60	1,362,312.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,170.50	5,281,296.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	316.00	1,539,236.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	145,701	349.50	50,922,499.50	
	DANSKE BANK A/S	59,378	243.70	14,470,418.60	
	TRYG A/S	9,828	155.20	1,525,305.60	
TDC A/S	72,376	39.35	2,847,995.60		
ORSTED A/S	13,830	350.00	4,840,500.00		
	デンマーククローネ 小計	416,526		136,425,301.40 (2,484,304,738)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	34.66	715,001.14	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.66	909,862.46	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	8.95	1,201,107.90	
	SANTOS	156,437	5.14	804,086.18	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	33.35	2,023,344.50	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.40	409,099.20	
	AMCOR	88,486	14.47	1,280,392.42	
	BHP BILLITON LTD	250,465	30.69	7,686,770.85	
	BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	15.61	611,974.44	
	BORAL LIMITED	81,732	7.58	619,528.56	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	5.12	689,541.12	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.71	558,722.29	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	21.45	801,436.35	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	22.54	1,378,523.86	
ORICA LTD	29,211	18.19	531,348.09		
RIO TINTO LTD	32,522	78.01	2,537,041.22		

SOUTH32 LTD	408,172	3.85	1,571,462.20
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	49.04	452,148.80
BRAMBLES LTD	129,297	9.79	1,265,817.63
SEEK LTD	26,358	18.77	494,739.66
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.54	724,070.98
TRANSURBAN GROUP	162,844	11.99	1,952,499.56
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	23.50	1,027,537.50
CROWN RESORTS LTD	30,328	12.90	391,231.20
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	45.66	252,180.18
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	48.83	159,332.29
TABCORP HOLDINGS LTD	121,846	5.17	629,943.82
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.41	199,168.83
WESFARMERS LTD	89,270	43.72	3,902,884.40
WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	27.06	2,782,336.26
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.19	377,804.70
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	15.51	905,396.25
COCHLEAR LIMITED	3,911	163.64	639,996.04
HEALTHSCOPE LTD	140,279	1.97	276,349.63
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	67.92	831,884.16
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	23.40	743,581.80
CSL LIMITED	35,265	143.93	5,075,691.45
AUST AND NZ BANKING GROUP	228,871	28.56	6,536,555.76
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	12.28	437,168.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.33	480,777.22
COMMONWEALTH BANK OF AUST	135,283	79.83	10,799,641.89
NATIONAL AUSTRALIA BANK	208,480	29.16	6,079,276.80
WESTPAC BANKING	262,130	30.93	8,107,680.90
AMP LTD	244,230	5.13	1,252,899.90
ASX LTD	15,814	54.64	864,076.96
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	13.77	606,816.36
MACQUARIE GROUP LIMITED	24,804	102.04	2,531,000.16
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.11	1,297,973.16
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.25	697,164.00
QBE INSURANCE GROUP	113,093	10.44	1,180,690.92
SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.63	1,402,813.23
COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	16.38	533,398.32
REA GROUP LTD	3,593	73.65	264,624.45
TELSTRA CORP	342,339	3.57	1,222,150.23
TPG TELECOM LTD	31,475	6.43	202,384.25
AGL ENERGY LTD	51,344	23.67	1,215,312.48
AUSNET SERVICES	120,230	1.70	204,391.00
	5,668,237		93,330,633.91

オーストラリアドル 小計				(8,262,561,020)
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	7.50	469,552.50
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.54	555,573.00
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,508	13.26	351,496.08
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	10.40	377,696.80
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.56	517,798.44
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.31	204,362.71
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.91	322,235.76
ニュージーランドドル 小計		528,116		2,798,715.29 (225,744,375)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	100.70	21,448,697.20
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	14.68	1,453,320.00
	MTR CORP	114,000	45.05	5,135,700.00
	MINTH GROUP LTD	46,000	45.95	2,113,700.00
	LI & FUNG	554,800	4.11	2,280,228.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	95,500	50.00	4,775,000.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	32.10	2,198,850.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	63.90	11,502,000.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	24.30	1,632,960.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	46.00	9,328,800.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	18.18	1,781,640.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.97	1,052,040.00
	WYNN MACAU LTD	102,800	26.75	2,749,900.00
	WH GROUP LTD	699,000	8.99	6,284,010.00
	BANK EAST ASIA	109,160	34.30	3,744,188.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	282,000	41.20	11,618,400.00
	HANG SENG BANK	61,100	189.50	11,578,450.00
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.52	706,560.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	294.80	26,974,200.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	248,000	8.92	2,212,160.00
	AIA GROUP LTD	943,800	66.65	62,904,270.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	199,996	73.55	14,709,705.80
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	30.80	2,494,800.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.60	3,563,800.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	83,495	52.40	4,375,138.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	45.30	2,672,700.00
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	33.60	1,293,600.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	12.34	6,065,110.00	
SINO LAND CO	235,400	14.58	3,432,132.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	133.10	15,572,700.00	
SWIRE PACIFIC A	40,500	78.00	3,159,000.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	26.10	2,510,820.00	

	WHARF HOLDINGS	91,000	30.50	2,775,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	52.90	4,813,900.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	59.80	3,887,000.00	
	PCCW LTD	357,000	4.51	1,610,070.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	66.30	3,315,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	78.35	10,459,725.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	670,830	15.40	10,330,782.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	66.85	7,420,350.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	113.70	2,694,690.00	
	香港ドル 小計	7,744,777		300,631,596.00 (4,256,943,399)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	8.25	926,475.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.39	193,230.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.32	361,880.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.64	327,836.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.07	344,655.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	11.03	477,962.99	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.85	299,520.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.33	565,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.70	343,170.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	40.00	396,000.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.38	159,220.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.17	363,916.00	
	DBS GROUP	139,600	26.33	3,675,668.00	
	OCBC BANK	245,300	13.20	3,237,960.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	28.03	2,909,514.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.98	497,154.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.82	714,722.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	13.30	414,960.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	9.19	298,675.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.60	2,307,394.80	
	STARHUB LTD	38,000	2.95	112,100.00	
	シンガポールドル 小計	3,315,776		18,927,262.79 (1,587,997,348)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	319.90	969,936.80	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	14.63	479,220.28	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	479.90	700,654.00	
	BANK HAPUALIM BM	84,067	25.60	2,152,115.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	21.40	2,477,991.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	64.65	530,130.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	183.00	791,109.00	
	NICE LTD	4,894	316.40	1,548,461.60	

	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	5.80	896,714.80	
	イスラエルシェケル 小計	409,132		10,546,333.28 (341,384,808)	
	合 計	87,984,001		326,580,028,108 (326,580,028,108)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472,900	196,253.50	
		アメリカドル 小計	472,900	196,253.50 (21,735,075)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	708,506.61	
		LENDLEASE GROUP	44,009	683,459.77	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	602,062.00	
	オーストラリアドル 小計	223,440	1,994,028.38 (176,531,332)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,592,010.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,629,080.00	
	香港ドル 小計	488,500	4,221,090.00 (59,770,634)		
	投資信託受益証券合計			1,184,840	258,037,041 (258,037,041)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	530,774.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,450	938,327.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,285	4,580,681.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	917,546.43	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,822,972.20	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,500,228.90	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	420,672.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	601,472.52	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	446,160.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	31,470	3,378,304.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,499	1,663,042.70	
		DUKE REALTY CORP	29,929	767,379.56	
		EQUINIX INC	6,083	2,663,684.87	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,736,637.93	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,135,369.51	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	844,094.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	739,215.69	
		GGP INC	48,203	1,111,079.15	

	HCP INC	36,011	843,377.62	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,230,519.36	
	INVITATION HOMES INC	24,000	532,320.00	
	IRON MOUNTAIN INC	20,489	727,154.61	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	581,028.87	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	483,874.46	
	MACERICH CO/THE	10,128	645,660.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	806,404.32	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	444,436.60	
	PROLOGIS INC	41,651	2,573,198.78	
	PUBLIC STORAGE	12,201	2,361,625.56	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,152,659.74	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	747,193.09	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,552,789.14	
	SIMON PROPERTY GROUP	24,417	4,010,248.08	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	757,571.97	
	UDR INC	20,960	753,931.20	
	VENTAS INC	27,813	1,514,974.11	
	VEREIT INC	77,798	574,149.24	
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	954,448.05	
	WELLTOWER INC	29,615	1,755,873.35	
	アメリカドル 小計	945,285	50,801,083.47 (5,626,219,994)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	199,122.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	373,773.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	171,632.88	
	カナダドル 小計	30,576	744,528.88 (66,054,602)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	204,781.50	
	GECINA SA	3,549	565,710.60	
	ICADE	2,845	244,385.50	
	KLEPIERRE	17,225	620,100.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,814	1,586,242.00	
	ユーロ 小計	33,743	3,221,219.60 (436,765,165)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	59,575	405,110.00	
	HAMMERSON PLC	61,184	305,308.16	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	579,762.10	
	SEGRO PLC	81,695	473,177.44	
	イギリスポンド 小計	261,004	1,763,357.70 (271,080,979)	
	DEXUS	74,090	706,818.60	

オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	140,271	1,134,792.39
	GPT GROUP	136,015	688,235.90
	MIRVAC GROUP	306,089	676,456.69
	SCENTRE GROUP	426,663	1,749,318.30
	STOCKLAND	207,412	879,426.88
	VICINITY CENTERS	291,115	768,543.60
	WESTFIELD CORP	161,441	1,477,185.15
	オーストラリアドル 小計		1,743,096
香港ドル	LINK REIT	179,500	12,708,600.00
香港ドル 小計		179,500	12,708,600.00 (179,953,776)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	547,075.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	466,560.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	414,621.00
	SUNTEC REIT	173,000	378,870.00
シンガポールドル 小計		813,800	1,807,126.00 (151,617,871)
投資証券合計		4,007,004	7,447,083,619 (7,447,083,619)
合計			7,705,120,660 (7,705,120,660)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 602銘柄	97.4%			63.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 39銘柄			2.6%	1.7%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.0%			13.2%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 99銘柄	98.9%			7.1%
	投資証券 4銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%			3.2%

スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	90.3%			2.5%
	投資信託受益証券	3銘柄		1.9%		0.1%
	投資証券	8銘柄			7.8%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	41銘柄	94.7%			1.3%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.0%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	91.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			8.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成30年 1月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,040,538,295
コール・ローン	215,841,326
国債証券	33,490,850,282
派生商品評価勘定	128,607
未収利息	531,440,615
前払費用	35,877,704
流動資産合計	35,314,676,829
資産合計	35,314,676,829
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	318,757
未払金	493,371,641
未払解約金	12,580,185
未払利息	357

	平成30年 1月22日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	506,270,940
負債合計	506,270,940
純資産の部	
元本等	
元本	19,505,694,501
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,302,711,388
元本等合計	34,808,405,889
純資産合計	34,808,405,889
負債純資産合計	35,314,676,829

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,505,694,501口

		平成30年 1月22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)	1.7845円 (17,845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

		平成30年 1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		平成30年 1月22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。	

	平成30年 1月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	14,621,557,846円
期中追加設定元本額	6,257,813,618円
期中一部解約元本額	1,373,676,963円
期末元本額	19,505,694,501円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,531,965,851円
世界経済インデックスファンド	4,436,723,411円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,423,352,335円
DC世界経済インデックスファンド	3,498,547,149円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,910,734,212円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	54,645,175円

区分	平成30年 1月22日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	110,661,408円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,338,373,530円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	179,380,576円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,437,557円
S M T インデックスバランス・オープン	226,499,509円
S M T 世界経済インデックス・オープン	1,775,118円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	55,306,455円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	59,278,555円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	442,858円
グローバル経済コア	585,570,802円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	293,670,890
合計	293,670,890

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成30年 1月22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	38,620,182	-	38,301,425	318,757
	ロシアルーブル	38,620,182	-	38,301,425	318,757
	売建	38,620,182	-	38,491,575	128,607
	アメリカドル	38,620,182	-	38,491,575	128,607
合計		77,240,364	-	76,793,000	190,150

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	11,800,000.00	14,434,055.00			
		MBONO 10% 12/05/24	59,850,000.00	67,929,450.75			
		MBONO 5.75% 03/05/26	37,800,000.00	33,733,098.00			
		MBONO 5% 12/11/19	78,200,000.00	74,814,331.00			
		MBONO 6.5% 06/09/22	56,400,000.00	54,328,428.00			
		MBONO 6.5% 06/10/21	63,000,000.00	61,163,235.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	37,100,000.00	36,933,977.50			
		MBONO 7.75% 05/29/31	33,800,000.00	33,978,464.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	40,250,000.00	40,155,211.25			
		MBONO 7.75% 11/23/34	37,600,000.00	37,730,660.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	21,400,000.00	22,831,767.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	16,350,000.00	17,583,771.00			
		MBONO 8% 06/11/20	47,200,000.00	47,729,584.00			
		MBONO 8% 11/07/47	15,300,000.00	15,662,227.50			
		MBONO 8% 12/07/23	22,500,000.00	23,049,562.50			
			メキシコペソ 小計		578,550,000.00	582,057,822.50 (3,463,244,043)	
		国債証券	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/20	17,850,000.00	15,362,977.35	
BLTN 0% 04/01/19	8,650,000.00			7,979,503.90			
BLTN 0% 07/01/19	4,500,000.00			4,066,906.50			
BLTN 0% 07/01/20	11,800,000.00			9,669,002.60			
BLTN 0% 07/01/21	16,800,000.00			12,462,861.60			
BLTN 0% 10/01/19	9,750,000.00			8,596,097.25			
BNTNF 10% 01/01/21	14,800,000.00			15,283,624.39			
BNTNF 10% 01/01/23	11,100,000.00			11,362,296.59			
BNTNF 10% 01/01/25	6,850,000.00			6,960,698.21			
BNTNF 10% 01/01/27	7,950,000.00			8,017,315.22			
BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00			1,515,500.00			
BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00			509,906.25			
BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00			1,923,750.00			
	ブラジルリアル 小計		113,800,000.00	103,710,439.86 (3,592,529,636)			

チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	4,350,000,000.00	4,556,277,000.00	
チリペソ 小計		4,350,000,000.00	4,556,277,000.00	(829,242,414)
コロンビア ペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	12,950,000,000.00	12,284,434,750.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	19,600,000,000.00	20,804,420,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	21,900,000,000.00	27,572,866,500.00	
コロンビアペソ 小計		54,450,000,000.00	60,661,721,250.00	(2,353,674,784)
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,450,000.00	3,815,303.25	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	3,950,000.00	4,368,423.50	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	4,300,000.00	4,871,513.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,950,000.00	3,449,980.75	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	3,950,000.00	4,659,775.50	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,650,000.00	1,849,691.25	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	3,700,000.00	4,677,928.50	
ペルーヌエボソル 小計		23,950,000.00	27,692,615.75	(953,179,834)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	11,000,000.00	10,702,230.00	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	12,250,000.00	12,716,235.00	
ウルグアイペソ 小計		23,250,000.00	23,418,465.00	(91,097,828)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,600,000.00	1,491,840.00	
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,618,068.50	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	3,150,000.00	3,025,181.25	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	4,000,000.00	3,702,880.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	10,750,000.00	9,992,931.25	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,500,000.00	6,155,240.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	5,500,000.00	5,188,150.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	1,800,000.00	1,707,264.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	8,100,000.00	7,713,508.50	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	5,950,000.00	4,843,984.25	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,460,784.25	
	TURKGB 8.5% 07/10/19	5,450,000.00	5,127,087.50	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	2,450,000.00	2,143,946.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	5,050,000.00	4,386,909.75	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,957,470.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	3,000,000.00	2,708,175.00	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	5,500,000.00	5,082,935.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,735,415.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	5,000,000.00	4,355,000.00	
トルコリラ 小計		89,450,000.00	81,396,770.25	(2,358,064,434)
	CZGB 0.45% 10/25/23	14,500,000.00	13,874,977.50	

チェココルナ	CZGB 0.95% 05/15/30	17,550,000.00	15,420,044.25
	CZGB 0% 02/10/20	5,550,000.00	5,489,643.75
	CZGB 1.5% 10/29/19	43,100,000.00	43,882,911.50
	CZGB 1% 06/26/26	17,500,000.00	16,588,600.00
	CZGB 2.4% 09/17/25	21,000,000.00	22,278,900.00
	CZGB 2.5% 08/25/28	24,750,000.00	26,205,918.75
	CZGB 3.75% 09/12/20	17,800,000.00	19,276,599.00
	CZGB 3.85% 09/29/21	33,000,000.00	36,608,055.00
	CZGB 4.7% 09/12/22	15,000,000.00	17,588,625.00
	CZGB 5.7% 05/25/24	24,900,000.00	31,784,850.00
	チェココルナ 小計		234,650,000.00
ハンガリーフォリント	HGB 1.75% 10/26/22	250,000,000.00	257,202,500.00
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	232,710,550.00
	HGB 2.5% 10/27/21	255,000,000.00	269,988,900.00
	HGB 2% 10/30/19	173,000,000.00	178,892,380.00
	HGB 3.5% 06/24/20	302,000,000.00	324,834,220.00
	HGB 3% 06/26/24	278,000,000.00	303,113,130.00
	HGB 3% 10/27/27	215,000,000.00	230,373,575.00
	HGB 5.5% 06/24/25	397,000,000.00	497,830,060.00
	HGB 6.0% 11/24/23	358,000,000.00	451,753,040.00
	HGB 6.5% 06/24/19	210,000,000.00	229,166,700.00
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	282,387,870.00
	HGB 7% 06/24/22	285,000,000.00	358,031,250.00
	ハンガリーフォリント 小計		3,190,000,000.00
ポーランドズロチ	POLGB 0% 04/25/19	3,300,000.00	3,240,649.50
	POLGB 1.5% 04/25/20	6,150,000.00	6,116,175.00
	POLGB 1.75% 07/25/21	8,400,000.00	8,274,042.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,300,000.00	10,226,818.50
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,300,000.00	1,292,369.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	10,500,000.00	9,953,160.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	7,000,000.00	6,541,885.00
	POLGB 2% 04/25/21	7,300,000.00	7,270,508.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	8,350,000.00	8,567,350.50
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,900,000.00	6,983,283.00
	POLGB 4% 10/25/23	7,050,000.00	7,517,133.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,800,000.00	6,317,795.00
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,600,000.00	4,911,259.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,550,000.00	6,342,845.25
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,000,000.00	2,253,480.00
ポーランドズロチ 小計		94,500,000.00	95,808,752.75

			(3,112,826,376)	
ロシアルーブル	RFLB 6.4% 05/27/20	68,800,000.00	68,433,984.00	
	RFLB 6.7% 05/15/19	91,000,000.00	91,062,335.00	
	RFLB 6.8% 12/11/19	46,200,000.00	46,369,554.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	92,000,000.00	90,618,620.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	106,500,000.00	106,857,840.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	127,400,000.00	130,456,963.00	
	RFLB 7.5% 02/27/19	45,800,000.00	46,268,076.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	100,400,000.00	102,713,216.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,350,000.00	66,215,506.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	47,500,000.00	48,960,625.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	99,600,000.00	101,075,076.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	132,000,000.00	136,542,120.00	
	RFLB 7% 01/25/23	42,700,000.00	43,054,410.00	
	RFLB 7% 08/16/23	81,200,000.00	81,837,826.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	105,000,000.00	111,776,700.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	83,900,000.00	91,599,083.50	
ロシアルーブル 小計		1,334,350,000.00	1,363,841,935.00 (2,673,130,192)	
マレーシアリンギット	MGS 3.48% 03/15/23	5,200,000.00	5,133,700.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	7,000,000.00	7,029,050.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	7,450,000.00	7,486,281.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	4,550,000.00	4,578,574.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	5,100,000.00	5,142,559.50	
	MGS 3.759% 03/15/19	1,400,000.00	1,410,066.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	6,550,000.00	6,549,574.25	
	MGS 3.899% 11/16/27	4,200,000.00	4,192,629.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,400,000.00	2,378,040.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	4,750,000.00	4,744,703.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	3,500,000.00	3,532,060.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,250,000.00	2,299,061.25	
	MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,751,800.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	4,200,000.00	4,138,680.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	5,050,000.00	5,157,943.75	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,000,000.00	2,038,520.00	
マレーシアリンギット 小計		69,300,000.00	69,563,243.00 (1,955,422,760)	
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	79,000,000.00	79,499,280.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	64,000,000.00	62,898,560.00	
	THAIGB 2.55% 06/26/20	76,750,000.00	78,731,685.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	31,000,000.00	31,304,420.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	42,000,000.00	45,097,500.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	74,500,000.00	81,214,685.00	

	THAIGB 3.65% 06/20/31	60,000,000.00	66,565,500.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	91,000,000.00	97,866,405.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	65,400,000.00	73,142,706.00	
	THAIGB 3.875% 06/13/19	94,700,000.00	98,067,058.50	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	71,500,000.00	88,296,422.50	
	タイバーツ 小計	749,850,000.00	802,684,222.00 (2,785,314,250)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,935,300.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	15,000,000.00	15,460,875.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	22,687,900.00	
	フィリピンペソ 小計	45,000,000.00	48,084,075.00 (104,823,283)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	8,370,589,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	6,700,000,000.00	8,669,230,500.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	15,800,000,000.00	18,097,873,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	8,311,368,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	14,500,000,000.00	14,613,245,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	6,500,000,000.00	6,537,830,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	26,500,000,000.00	26,712,397,500.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	3,000,000,000.00	3,207,330,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	9,000,000,000.00	9,684,720,000.00	
	INDOGB 7.875% 04/15/19	13,200,000,000.00	13,671,438,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	25,000,000,000.00	26,332,375,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	25,800,000,000.00	27,346,581,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	19,000,000,000.00	21,665,890,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	16,600,000,000.00	18,927,818,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	26,200,000,000.00	28,449,794,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	32,000,000,000.00	36,381,440,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	21,000,000,000.00	24,050,775,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	33,800,000,000.00	38,810,174,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	21,900,000,000.00	25,931,133,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	14,178,465,000.00	
INDOGB 9% 03/15/29	21,500,000,000.00	25,997,262,500.00		
	インドネシアルピア 小計	362,500,000,000.00	405,947,729,000.00 (3,409,960,923)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	49,000,000.00	55,092,415.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,300,000.00	11,859,554.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	21,021,285.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,150,000.00	13,893,955.75	
	SAGB 7.25% 01/15/20	12,500,000.00	12,530,125.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	19,100,000.00	19,073,260.00	
	SAGB 7% 02/28/31	25,800,000.00	21,695,478.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	27,100,000.00	25,018,313.50	

	SAGB 8.5% 01/31/37	31,300,000.00	28,535,740.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	21,200,000.00	19,455,876.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	38,150,000.00	35,011,399.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	16,800,000.00	15,987,132.00	
	SAGB 8% 01/31/30	22,300,000.00	20,640,434.00	
	SAGB 9% 01/31/40	17,250,000.00	16,319,880.00	
	南アフリカランド 小計	340,250,000.00	316,134,848.25	(2,895,795,209)
	合計		33,490,850,282	(33,490,850,282)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 13銘柄	100.0%	10.7%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.5%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.0%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	2.8%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	7.0%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	4.7%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	9.3%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	8.0%
マレーシアリングット	国債証券 16銘柄	100.0%	5.8%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.3%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 21銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成30年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,077,140,564
コール・ローン	225,588,253
株式	49,728,655,158
投資信託受益証券	91,390,031
投資証券	243,056,642
派生商品評価勘定	65,379,601
未収入金	784,617
未収配当金	37,194,444
差入委託証拠金	309,964,719
流動資産合計	52,779,154,029
資産合計	52,779,154,029
負債の部	
流動負債	
前受金	65,379,601
未払金	4,162
未払解約金	217,817,219
未払利息	373
流動負債合計	283,201,355
負債合計	283,201,355
純資産の部	
元本等	
元本	16,271,676,908
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	36,224,275,766
元本等合計	52,495,952,674
純資産合計	52,495,952,674
負債純資産合計	52,779,154,029

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成30年 1月22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</p>

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

	平成30年 1月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		16,271,676,908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)	3.2262円 (32,262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

	平成30年 1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 1月22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. 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	平成30年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成29年 1月21日
期首元本額	13,041,313,502円
期中追加設定元本額	4,524,819,692円
期中一部解約元本額	1,294,456,286円
期末元本額	16,271,676,908円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	6,492,526,267円
世界経済インデックスファンド	2,709,808,328円
D C 新興国株式インデックス・オープン	3,375,124,010円
D C 世界経済インデックスファンド	2,202,288,817円
新興国株式インデックス・オープン ( S M A 専用 )	35,432,096円
D C 世界経済インデックスファンド ( 株式シフト型 )	213,633,505円
D C 世界経済インデックスファンド ( 債券シフト型 )	282,574,392円
世界経済インデックスファンド ( 株式シフト型 )	353,554,152円
世界経済インデックスファンド ( 債券シフト型 )	18,309,348円
S M T インデックスバランス・オープン	139,900,384円
S M T 世界経済インデックス・オープン	1,020,622円

SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	98,681,575円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	11,475,229円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	258,928円
グローバル経済コア	335,355,465円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	1,733,790円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,746,704,324
投資信託受益証券	1,956,892
投資証券	3,848,939
合計	2,744,812,277

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成30年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,361,179,479	-	2,426,559,080	65,379,601
合計		2,361,179,479	-	2,426,559,080	65,379,601

## （注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成30年 1月22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	8,858,400	-	8,858,400	-
	アメリカドル	8,858,400	-	8,858,400	-
合計		8,858,400	-	8,858,400	-

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	410,701	5.23	2,147,966.23	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	33,763	67.20	2,268,873.60	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,031	128.10	900,671.10	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	5.79	626,138.36	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	73,787	5.24	387,012.81	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	22,131	58.28	1,289,794.68	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.02	254,288.60	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49,894	20.23	1,009,355.62	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	9,509	27.40	260,546.60	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	9,620	16.53	159,018.60	

	POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,736	38.70	183,283.20	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	16.82	426,387.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	50.34	271,936.68	
	DP WORLD LTD	10,914	26.27	286,710.78	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	11,374	101.69	1,156,622.06	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	22,188	28.99	643,230.12	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,276	45.97	1,299,847.72	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	31,722	46.85	1,486,175.70	
	JD.COM INC-ADR	49,870	46.02	2,295,017.40	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	15.93	577,287.27	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	26.40	817,581.60	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	93,588	4.42	413,658.96	
	CREDICORP LTD	5,824	229.99	1,339,461.76	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	202,157	18.69	3,778,314.33	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	264,285	1.93	511,920.04	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.51	68,765.76	
	58.COM INC-ADR	7,312	80.13	585,910.56	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	89,983	184.05	16,561,371.15	
	AUTOHOME INC-ADR	3,833	82.57	316,490.81	
	BAIDU INC - SPON ADR	21,428	255.98	5,485,139.44	
	MOMO INC-SPON ADR	10,135	28.60	289,861.00	
	NETEASE INC-ADR	6,195	325.55	2,016,782.25	
	SINA CORP	4,000	120.06	480,240.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,838	130.29	500,053.02	
	YY INC-ADR	2,611	138.20	360,840.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	10.92	435,205.68	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	109,599	1.34	147,301.05	
	アメリカドル 小計	1,908,512		52,039,061.74 (5,763,326,087)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,231,061	15.27	18,798,301.47	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	64.60	19,431,163.20	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	428.61	4,253,954.25	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	52.90	5,123,470.80	
	ALFA S.A.B. -A	242,900	23.80	5,781,020.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	66.96	2,511,000.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	369.90	5,727,901.50	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	201.88	6,274,430.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	192.75	3,272,895.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	190,790	74.85	14,280,631.50	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	131.01	1,428,009.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	369,980	47.29	17,496,354.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	137.13	4,617,852.75	

	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	139.52	6,041,216.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	159,440	180.18	28,727,899.20	
	GRUMA S.A.B. -B	14,210	229.64	3,263,184.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	44.16	5,846,784.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	28.90	1,034,620.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	34.90	3,231,740.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	169,700	28.70	4,870,390.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	181,800	109.90	19,979,820.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	150,500	34.45	5,184,725.00	
	ENTERA SAB DE CV	77,100	16.91	1,303,761.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	2,721,740	16.94	46,106,275.60	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	91.63	3,454,451.00	
	メキシコペソ 小計	6,404,210		238,041,850.27 (1,416,349,009)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	18,400	42.37	779,608.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	253,300	19.31	4,891,223.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	297,740	18.26	5,436,732.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	78.71	2,258,977.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	50.71	451,319.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	32,800	10.68	350,304.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	24,900	52.81	1,314,969.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	14.16	1,231,920.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,300	21.20	854,360.00	
	VALE SA	242,378	42.88	10,393,168.64	
	EMBRAER SA	69,700	19.68	1,371,696.00	
	WEG SA	51,440	25.89	1,331,781.60	
	CCR SA	101,100	16.00	1,617,600.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	34,302	23.99	822,904.98	
	RUMO SA	97,700	12.90	1,260,330.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	91,584	17.00	1,556,928.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	16.50	1,051,314.00	
	LOJAS RENNER S.A.	60,370	36.58	2,208,334.60	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	14.84	615,860.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	75.65	817,020.00	
	RAIA DROGASIL SA	17,000	85.30	1,450,100.00	
	AMBEV SA	369,000	22.00	8,118,000.00	
	BRF SA	38,800	37.49	1,454,612.00	
	JBS SA	35,800	9.70	347,260.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	52.92	333,396.00	
	NATURA COSMETICOS SA	10,700	34.30	367,010.00	
	ODONTOPREV S.A.	12,400	16.30	202,120.00	
	QUALICORP SA	20,800	32.76	681,408.00	

	HYPERMARCAS SA	35,300	36.26	1,279,978.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	72,518	35.00	2,538,130.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	228,310	37.11	8,472,584.10	
	BANCO DO BRASIL S.A.	69,100	34.95	2,415,045.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	255,021	47.06	12,001,288.26	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	279,625	11.98	3,349,907.50	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	172,503	24.88	4,291,874.64	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	30.69	1,727,847.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	41.95	306,235.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	12.47	711,575.61	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	72.99	401,445.00	
	CIELO SA	99,269	26.65	2,645,518.85	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,800	49.35	1,569,330.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.78	931,662.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	20.70	366,390.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	12,500	17.50	218,750.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	6.66	439,506.72	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	35.41	924,201.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	13.58	361,228.00	
	ENGIE BRASIL SA	13,400	36.75	492,450.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,800	66.79	854,912.00	
	ブラジルリアル 小計	3,785,031		99,870,114.90 (3,459,500,780)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	30,397	10,481.00	318,590,957.00	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	2,331.40	196,490,392.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	35,122.00	254,985,720.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	10,197.00	225,425,079.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	53,093	6,498.40	345,019,551.20	
	CENCOSUD SA	137,988	1,927.60	265,985,668.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,799.90	82,041,467.70	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	3,018.30	45,914,379.60	
	BANCO DE CHILE	2,284,160	104.72	239,197,235.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,504	43,802.00	109,680,208.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	52.28	328,309,041.88	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.96	99,875,217.22	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	7,357.90	136,503,760.80	
	AES GENER SA	141,749	203.33	28,821,824.17	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	411.15	67,119,415.20	
	COLBUN SA	475,888	148.99	70,902,553.12	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	142.76	308,730,063.56	
	ENEL CHILE SA	1,939,330	75.00	145,449,750.00	
	ENEL GENERACION CHILE SA	216,099	571.21	123,437,909.79	

	チリペソ 小計	30,792,748		3,392,480,194.24 (617,431,395)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	2,465.00	880,811,055.00
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	11,700.00	374,528,700.00
	GRUPO ARGOS SA	17,723	20,920.00	370,765,160.00
	BANCOLOMBIA SA	13,742	31,000.00	426,002,000.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	31,180.00	1,193,508,040.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,290.00	391,783,320.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	40,800.00	593,721,600.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	39,200.00	492,391,200.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	14,580.00	736,450,380.00
	コロンビアペソ 小計	840,413		5,459,961,455.00 (211,846,504)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	23.75	103,502.50
	OPAP SA	17,668	11.00	194,348.00
	FF GROUP	3,404	18.40	62,633.60
	JUMBO SA	8,599	15.02	129,156.98
	ALPHA BANK AE	94,467	1.98	187,422.52
	EUROBANK ERGASIAS SA	148,978	0.86	128,716.99
	NATIONAL BANK OF GREECE	401,525	0.34	137,160.94
	PIRAEUS BANK S.A	18,601	3.36	62,499.36
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	12.31	249,806.83
	ユーロ 小計	717,893		1,255,247.72 (170,199,038)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	117.70	1,365,673.10
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	9.89	1,154,706.95
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	7.71	370,180.23
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	31.72	755,284.92
	KOC HOLDING AS	62,460	18.50	1,155,510.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.87	210,228.16
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	22.00	216,392.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	14.99	932,243.09
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	59.70	194,502.60
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	33.20	224,100.00
	ARCELIK AS	15,358	20.08	308,388.64
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,577	75.75	1,179,957.75
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	26.74	300,290.20
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	35.42	156,450.14
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	22.92	220,627.92
	AKBANK T.A.S.	176,098	10.01	1,762,740.98
	TURKIYE GARANTI BANKASI	166,475	11.01	1,832,889.75
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	10.00	524,310.00

	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	7.18	798,193.42
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	6.98	362,562.14
	YAPI VE KREDI BANKASI	109,792	4.30	472,105.60
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	11.01	676,520.46
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	6.21	110,513.16
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	15.42	1,466,380.32
	トルコリラ 小計	1,286,299		16,750,751.53 (485,269,271)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	930.00	6,940,590.00
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	84.30	2,252,243.10
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	278.00	1,251,000.00
	CEZ AS	13,737	515.00	7,074,555.00
	チェココルナ 小計	52,417		17,518,388.10 (93,373,008)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,098.00	101,837,456.00
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	6,700.00	56,675,300.00
	OTP BANK NYRT	19,549	10,970.00	214,452,530.00
	ハンガリーフォリント 小計	60,880		372,965,286.00 (163,507,981)
ポーランドズ ロチ	GRUPA LOTOS SA	5,516	58.40	322,134.40
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	21,535	108.80	2,343,008.00
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	146,497	6.76	990,319.72
	GRUPA AZOTY SA	2,786	75.95	211,596.70
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	105.00	437,955.00
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	112.70	1,479,976.40
	CCC SA	3,138	309.00	969,642.00
	LPP SA	124	9,850.00	1,221,400.00
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	24.32	571,568.64
	ALIOR BANK SA	8,830	87.25	770,417.50
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	84.10	169,041.00
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	9.52	314,321.84
	BANK PEKAO SA	9,706	135.00	1,310,310.00
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	432.00	1,035,936.00
	M BANK SA	747	525.50	392,548.50
	PKO BANK POLSKI SA	63,489	46.26	2,937,001.14
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	45.05	2,295,342.55
	CD PROJEKT SA	6,704	121.30	813,195.20
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.35	353,428.30
	PLAY COMMUNICATIONS SA	18,973	33.50	635,595.50
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	13.25	841,322.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	3.21	183,075.93	
		593,413		20,599,136.32

ポーランドズロチ 小計				(669,265,939)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	9.09	945,360.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,903,400	6.53	12,429,202.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	250,500	22.50	5,636,250.00
	CNOOC LTD-R	1,389,000	12.14	16,862,460.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.64	1,971,120.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,754,000	5.80	10,173,200.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	12.08	1,352,960.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	5.90	2,006,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	41.85	4,603,500.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	6.00	2,016,000.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	7.83	2,583,900.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	12.76	1,059,080.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	9.25	1,535,500.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	12.76	1,288,760.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	4.83	961,170.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.34	2,434,860.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.45	551,800.00
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	47.50	1,852,500.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	312,000	9.52	2,970,240.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	20.65	3,293,675.00
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	9.60	1,051,200.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.18	1,854,000.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	11.50	1,955,000.00
	CITIC LTD	502,000	11.84	5,943,680.00
	CRRG CORP LTD-H	313,050	7.92	2,479,356.00
	FOSUN INTERNATIONAL	185,000	18.62	3,444,700.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	25.20	882,000.00
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.19	535,920.00
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	23.35	887,300.00
	WEICHAH POWER CO LTD-H	108,800	10.12	1,101,056.00
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	39,500	47.45	1,874,275.00
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	125,000	12.58	1,572,500.00
	AIR CHINA LIMITED-H	118,000	10.36	1,222,480.00
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	11.82	1,276,560.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	21.10	2,058,241.70	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	8.79	1,547,040.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	8.40	856,800.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	12.44	845,920.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	9.32	820,160.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	19.40	4,850,000.00	
BYD CO LTD-H	49,500	70.25	3,477,375.00	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	9.96	2,649,360.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	32.65	888,080.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	25.00	9,750,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	9.51	1,937,662.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	180,246	17.58	3,168,724.68
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	17.06	1,569,520.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,000	38.00	2,698,000.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	26.50	3,074,000.00
SHENZHU INTERNATIONAL GROUP	47,000	80.40	3,778,800.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	780,000	1.07	834,600.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	1.00	593,958.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	9.93	1,936,350.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.42	182,700.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	193,000	26.35	5,085,550.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	30.95	4,394,900.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	17.12	2,088,640.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	45.40	908,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	6.92	2,276,680.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	77.25	5,137,125.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	224,000	4.20	940,800.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	6.38	689,040.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	20.80	894,400.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	33.85	3,371,460.00
3SBIO INC	84,500	16.02	1,353,690.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	18.60	1,860,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	380,000	17.78	6,756,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	10.74	1,691,550.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	49.40	2,741,700.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	3.18	1,020,780.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	352,000	14.86	5,230,720.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,858,000	4.50	8,361,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,193,200	4.43	27,435,876.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	609,475	6.51	3,967,682.25
CHINA CITIC BANK-H	627,200	6.18	3,876,096.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,582,620	8.48	55,820,617.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	4.23	943,290.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	295,423	36.50	10,782,939.50
CHINA MINSHENG BANKING-H	459,500	8.56	3,933,320.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	6.57	913,230.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,776,515	7.19	41,533,142.85
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	3.20	2,662,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	18.62	1,154,440.00

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	6.53	2,145,105.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	3.96	3,670,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	19.98	3,976,020.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	8.29	1,168,890.00
GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	17.42	1,839,552.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	12.84	3,554,112.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	18.46	1,945,684.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	583,000	25.75	15,012,250.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	205,200	40.35	8,279,820.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	34.70	4,921,292.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	54.35	3,641,450.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	4.37	3,024,040.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	408,859	17.14	7,007,843.26
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	404,000	93.30	37,693,200.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	14.10	2,002,200.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	28.00	6,664,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	4.03	886,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	327,040	29.80	9,745,792.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	219,111	28.30	6,200,841.30
CHINA VANKE CO LTD-H	74,300	40.70	3,024,010.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	421,285	17.04	7,178,696.40
FULLSHARE HOLDINGS LTD	460,000	4.23	1,945,800.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	21.10	1,451,680.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	23.70	2,926,950.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	23.60	1,545,800.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	187,591	6.43	1,206,210.13
SOHO CHINA LTD	113,000	4.72	533,360.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	176,000	35.00	6,160,000.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	28.00	1,848,000.00
TENCENT HOLDINGS LTD	444,900	452.40	201,272,760.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	53,000	24.65	1,306,450.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	135.90	8,154,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	17.36	1,475,600.00
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	45,000	45.85	2,063,250.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	4.56	2,635,680.00
MEITU INC	143,000	11.70	1,673,100.00
SUNNY OPTICAL TECH	57,000	111.80	6,372,600.00
ZTE CORP-H	48,508	30.35	1,472,217.80
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	5.12	665,600.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	480,000	80.50	38,640,000.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	3.80	4,180,000.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	442,000	11.40	5,038,800.00

	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	6.02	2,456,160.00	
	CGN POWER CO LTD-H	504,000	2.16	1,088,640.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	22.20	3,019,200.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.62	1,421,860.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	24.10	2,072,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	14.44	2,532,776.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	53.25	2,982,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	10.88	2,415,360.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	5.16	1,331,280.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.62	801,720.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	1.39	1,438,650.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	11.48	3,042,200.00	
	香港ドル 小計	57,311,102		808,818,647.77 (11,452,872,052)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	2.65	590,865.20	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	24.60	617,460.00	
	SAPURA ENERGY BHD	282,600	0.84	237,384.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.10	1,701,810.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	5.60	808,080.00	
	GAMUDA BHD	139,200	5.10	709,920.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.70	370,540.00	
	IJM CORP BHD	198,100	3.01	596,281.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.80	468,288.80	
	AIRASIA BHD	64,800	3.90	252,720.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.98	481,274.12	
	MISC BHD	125,040	7.48	935,299.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.58	250,600.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	6.86	233,240.00	
	GENTING BHD	205,300	9.68	1,987,304.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	5.43	1,216,863.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.57	304,545.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	33.00	359,700.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.95	156,585.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.40	145,600.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.66	837,122.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	25.12	1,376,576.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	500	105.90	52,950.00	
	PPB GROUP BERHAD	43,900	17.36	762,104.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.50	919,853.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	11.10	399,600.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.00	1,375,800.00	

	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	4.22	297,932.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.70	611,940.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	280,567	6.83	1,916,272.61	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	17.52	1,073,835.84	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	17.78	265,508.74	
	MALAYAN BANKING BHD	348,360	9.87	3,438,313.20	
	PUBLIC BANK BERHAD	228,020	20.90	4,765,618.00	
	RHB BANK BHD	53,119	5.30	281,530.70	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	2.02	310,726.50	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.59	265,921.14	
	SP SETIA BHD	227,600	3.24	737,424.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	156,574	5.55	868,985.70	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.84	1,508,628.00	
	MAXIS BHD	135,500	6.04	818,420.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.05	426,839.60	
	PETRONAS GAS BHD	34,400	18.20	626,080.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	255,675	15.82	4,044,778.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.54	388,642.10	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	124,771	1.32	164,697.72	
	マレーシアリングット 小計	6,217,033		40,960,459.07 (1,151,398,504)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	21.00	2,488,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	69.00	4,740,300.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	7.35	4,210,080.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	115.00	14,340,500.00	
	PTT PCL-NVDR	78,900	478.00	37,714,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	100.50	12,070,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,900	57.75	5,884,725.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	146,134	94.00	13,736,596.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	13,500	500.00	6,750,000.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	502.00	9,387,400.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	58.00	3,932,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	305,000	70.25	21,426,250.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	7.75	3,031,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	8.20	3,013,500.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	43.75	7,079,187.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	14.10	3,266,053.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	74.75	2,601,300.00	
	CP ALL PCL-NVDR	372,000	80.25	29,853,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	24.30	8,279,010.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	20.70	4,968,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	21.20	9,660,840.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	197.00	5,043,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	229.00	3,709,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	90,300	230.00	20,769,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	227.00	11,713,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	20.40	5,043,900.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	153.50	22,718,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	3.12	4,169,880.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	86.00	11,360,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	77.00	2,487,100.00	
	KCE ELECTRONICS - NVDR	24,700	83.00	2,050,100.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	66,700	193.00	12,873,100.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	6.35	3,858,952.15	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	218.00	5,057,600.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	85.00	2,516,000.00	
	タイパーツ 小計	7,163,838		321,804,124.15 (1,116,660,310)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	78.00	8,945,820.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	16.20	9,567,720.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	14.64	5,057,388.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	79.00	18,198,440.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,060.00	24,173,300.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	112.00	7,082,880.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	280.00	7,126,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	170.00	10,774,600.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	123.50	6,473,870.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	159.50	27,708,499.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	100.20	4,123,430.40	
	SECURITY BANK CORP	30,810	250.00	7,702,500.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	1,031.00	23,063,470.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,392.00	8,539,920.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	6.80	5,002,760.00	
	AYALA LAND INC	637,000	44.90	28,601,300.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.13	3,272,940.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	20.00	1,860,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	568,350	39.00	22,165,650.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,725.00	3,087,750.00	
	PLDT INC	6,225	1,482.00	9,225,450.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	41.50	3,714,250.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	330.00	9,606,300.00	
	フィリピンペソ 小計	4,581,258		255,074,237.90 (556,061,838)	
	ADARO ENERGY PT	800,500	2,180.00	1,745,090,000.00	

インドネシアルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	37,400.00	4,820,860,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	22,575.00	4,289,250,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	10,950.00	2,568,870,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	6,300.00	883,260,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,400	2,630.00	1,032,012,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	6,200.00	765,700,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	8,350.00	14,372,020,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	2,520.00	1,343,160,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	11,000.00	2,040,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,540.00	1,529,634,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	84,025.00	2,587,970,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	5,100.00	4,681,290,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,700.00	1,400,700,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,925.00	3,400,617,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	54,450.00	6,457,770,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,705.00	2,137,047,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	22,450.00	18,660,440,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	7,125.00	1,400,062,500.00	
	BANK MANDIRI	1,424,996	8,075.00	11,506,842,700.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	474,200	9,425.00	4,469,335,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,048,400	3,620.00	14,655,208,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,690.00	1,154,946,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	700.00	1,127,280,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,928,900	4,160.00	16,344,224,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	6,400.00	853,760,000.00		
XL AXIATA TBK PT	172,500	3,150.00	543,375,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,350.00	1,860,025,000.00		
	インドネシアルピア 小計	22,088,096		128,631,248,700.00 (1,080,502,489)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	64,600.00	273,064,200.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	113,000.00	384,313,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,252	194,500.00	1,021,514,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	33,750.00	361,327,500.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	127,500.00	179,647,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	59,600.00	431,623,200.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	515,000.00	403,245,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	106,500.00	111,931,500.00	
	LG CHEM LTD	3,844	423,500.00	1,627,934,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	250,500.00	119,989,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	387,500.00	430,125,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	166,500.00	187,645,500.00	
	POSCO	5,622	385,500.00	2,167,281,000.00	

CJ CORP	1,230	185,000.00	227,550,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	85,600.00	339,318,400.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,960.00	49,289,200.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,650.00	153,580,200.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	15,700.00	52,469,400.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	30,700.00	104,318,600.00
HANWHA CORPORATION	2,825	46,600.00	131,645,000.00
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	42,800.00	161,655,600.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	40,000.00	255,200,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,820	133,500.00	376,470,000.00
KCC CORP	326	401,000.00	130,726,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	52,900.00	273,810,400.00
LG CORP	7,072	93,500.00	661,232,000.00
LOTTE CORP	2,370	67,200.00	159,264,000.00
POSCO DAEWOO CORP	1,560	20,150.00	31,434,000.00
SAMSUNG C&T CORP	6,354	135,500.00	860,967,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	24,326	8,720.00	212,122,720.00
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,160	33,400.00	72,144,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	295,500.00	818,239,500.00
SK NETWORKS CO LTD	26,186	6,340.00	166,019,240.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	40,250.00	37,875,250.00
S-1 CORPORATION	960	100,000.00	96,000,000.00
CJ LOGISTICS	324	135,000.00	43,740,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	139,500.00	202,972,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,378	37,000.00	87,986,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,410.00	160,871,760.00
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	52,800.00	373,084,800.00
HANON SYSTEMS	10,825	12,650.00	136,936,250.00
HYUNDAI MOBIS	5,577	267,000.00	1,489,059,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	11,843	162,000.00	1,918,566,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	104,500.00	302,214,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	94,200.00	282,882,600.00
HYUNDAI WIA CORP	1,737	65,600.00	113,947,200.00
KIA MOTORS CORPORATION	20,627	34,050.00	702,349,350.00
COWAY CO.,LTD.	3,982	97,400.00	387,846,800.00
HANSSEM CO LTD	615	180,000.00	110,700,000.00
LG ELECTRONICS INC	8,015	107,500.00	861,612,500.00
KANGWON LAND INC	8,683	32,350.00	280,895,050.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	19,850.00	100,639,500.00
CJ E&M CORP	2,024	93,800.00	189,851,200.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	96,600.00	207,883,200.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	110,000.00	134,420,000.00

LOTTE SHOPPING CO	1,034	233,000.00	240,922,000.00
SHINSEGAE CO LTD	417	323,000.00	134,691,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	215,000.00	118,035,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,521	28,150.00	42,816,150.00
EMART	1,661	266,000.00	441,826,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	42,750.00	56,045,250.00
CJ CHEILJEDANG CORP	503	358,000.00	180,074,000.00
KT&G CORP	8,330	106,500.00	887,145,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	115,000.00	229,195,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	779,000.00	52,972,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,436	309,500.00	753,942,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	163,000.00	115,730,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	750	1,244,000.00	933,000,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	710,000.00	95,850,000.00
PACIFIC CORP	2,115	155,000.00	327,825,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,499	124,000.00	309,876,000.00
CELLTRION INC	6,004	287,800.00	1,727,951,200.00
HANMI PHARM CO LTD	372	570,000.00	212,040,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	616	105,500.00	64,988,000.00
MEDY-TOX INC	317	553,800.00	175,554,600.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	387,500.00	605,662,500.00
SILLAJEN INC	4,157	103,000.00	428,171,000.00
YUHAN CORPORATION	600	222,000.00	133,200,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	10,250.00	237,964,000.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	11,650.00	143,015,400.00
HANA FINANCIAL GROUP	21,405	55,500.00	1,187,977,500.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	16,700.00	301,368,200.00
KB FINANCIAL GROUP INC	30,262	67,100.00	2,030,580,200.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	32,297	52,900.00	1,708,511,300.00
WOORI BANK	29,912	16,750.00	501,026,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	83,100.00	187,390,500.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	10,050.00	312,474,600.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	15,700.00	177,378,600.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	38,850.00	73,776,150.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	40,700.00	235,083,200.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	71,900.00	302,627,100.00
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	7,340.00	89,694,800.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	46,950.00	202,730,100.00
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,975	54,300.00	215,842,500.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	278,000.00	702,228,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,300	133,500.00	707,550,000.00
KAKAO CORP	3,347	138,000.00	461,886,000.00

	NAVER CORP	2,113	881,000.00	1,861,553,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,650	426,000.00	702,900,000.00	
	NETMARBLE GAMES CORP	1,183	167,500.00	198,152,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	254,500.00	794,294,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	18,774	30,450.00	571,668,300.00	
	LG INNOTEK CO LTD	857	132,500.00	113,552,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	101,500.00	463,449,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,550	2,466,000.00	18,618,300,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,433	2,000,000.00	2,866,000,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	204,000.00	963,696,000.00	
	KT CORP	3,800	30,150.00	114,570,000.00	
	SK TELECOM	1,647	280,000.00	461,160,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,460	35,250.00	685,965,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	47,850.00	68,521,200.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	810	427,500.00	346,275,000.00	
	SK HYNIX INC	46,200	73,300.00	3,386,460,000.00	
	韓国ウォン 小計	710,603		71,422,561,970.00 (7,413,661,932)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	121.00	13,218,040.00	
	ASIA CEMENT CORP	297,176	30.50	9,063,868.00	
	CHINA STEEL	1,120,261	25.10	28,118,551.10	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	247,061	107.50	26,559,057.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	311,824	100.50	31,338,312.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	370,752	81.10	30,067,987.20	
	TAIWAN CEMENT	297,929	37.90	11,291,509.10	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	502.00	6,024,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	167,028	26.90	4,493,053.20	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,019	345.00	4,491,555.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	28.80	3,196,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	12.60	1,640,557.80	
	EVA AIRWAYS CORP	143,931	15.95	2,295,699.45	
	EVERGREEN MARINE	119,812	18.05	2,162,606.60	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	23.85	4,221,450.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	52.20	9,242,584.20	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	305.50	3,646,753.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	137.00	4,509,492.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	32.55	1,302,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	168.00	4,277,952.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	308.00	2,156,000.00	
	POU CHEN	153,780	38.65	5,943,597.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	52.70	1,941,836.90	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	369.50	9,607,000.00	

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	287.50	13,093,900.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	74.60	2,667,397.60
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	374,395	69.20	25,908,134.00
TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	202.00	2,626,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	396,370	17.30	6,857,201.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	10.90	13,698,902.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,377,237	21.70	29,886,042.90
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	673,363	19.60	13,197,914.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	716,984	20.05	14,375,529.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	816,242	17.45	14,243,422.90
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	25.55	23,054,761.45
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,134,205	10.20	11,568,891.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	904,989	14.80	13,393,837.20
TAIWAN BUSINESS BANK	191,961	8.84	1,696,935.24
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	725,442	17.40	12,622,690.80
CHAILEASE HOLDING CO LTD	66,429	95.60	6,350,612.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	53.90	29,703,319.80
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	14.30	11,041,787.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	602,951	56.00	33,765,256.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	153,922	31.30	4,817,758.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	10.80	6,650,326.80
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	42.85	1,804,842.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,734	33.20	1,850,368.80
ACER INC	255,803	29.30	7,495,027.90
ADVANTECH CO LTD	20,402	237.00	4,835,274.00
ASUSTEK COMPUTER INC	55,092	280.50	15,453,306.00
AU OPTRONICS CORP	590,090	13.20	7,789,188.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	50,700	335.50	17,009,850.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,649	76.50	2,191,648.50
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	14.20	11,005,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	20.95	9,045,372.00
DELTA ELECTRONICS INC	138,903	144.50	20,071,483.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	87.40	8,115,090.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	184.50	2,583,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,213,311	96.90	117,569,835.90
HTC CORPORATION	37,430	71.10	2,661,273.00
INVENTEC CO LTD	136,511	23.60	3,221,659.60
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	4,000.00	32,160,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,452	41.25	6,206,145.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	31,000	90.00	2,790,000.00
PEGATRON CORP	159,474	77.30	12,327,340.20
QUANTA COMPUTER INC	196,270	65.00	12,757,550.00

	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	78,100	41.95	3,276,295.00	
	WISTRON CORP	235,771	23.80	5,611,349.80	
	WPG HOLDINGS CO LTD	156,187	40.20	6,278,717.40	
	YAGEO CORPORATION	19,000	389.00	7,391,000.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	68.90	1,510,425.80	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	10.20	2,019,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	285,315	109.00	31,099,335.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	75.00	11,775,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	109.50	16,665,900.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	518,630	42.00	21,782,460.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	442.00	7,956,000.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	127,000	41.55	5,276,850.00	
	MEDIATEK INC	110,804	319.00	35,346,476.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	80.60	3,868,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	123.50	4,945,557.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	306.50	3,555,093.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	88.80	4,241,976.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	118.50	3,311,364.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	159,000	50.50	8,029,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,919,389	255.50	490,403,889.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	14.20	13,873,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	68.10	3,677,400.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	259.50	5,709,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	23.85	4,865,400.00	
	新台湾ドル 小計	26,538,423		1,513,444,928.04 (5,705,687,378)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	477.30	31,559,076.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	284.00	11,906,416.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	416.20	24,732,685.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	58,804	385.95	22,695,403.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	193.70	19,915,071.80	
	PETRONET LNG LTD	49,423	237.05	11,715,722.15	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	208,670	931.30	194,334,371.00	
	ACC LTD	1,768	1,829.50	3,234,556.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	268.60	9,987,891.00	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,189.90	29,699,904.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	1,223.55	33,454,304.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	258.00	20,387,418.00	
	JSW STEEL LTD	80,284	282.10	22,648,116.40	
	SHREE CEMENT LTD	901	18,354.60	16,537,494.60	
	TATA STEEL LTD	25,839	753.00	19,456,767.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	4,300.00	31,622,200.00	

UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	802.35	21,036,012.30
VEDANTA LTD	110,508	331.65	36,649,978.20
ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	121.05	7,646,849.55
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	50,995	97.55	4,974,562.25
EICHER MOTORS LTD	939	28,009.45	26,300,873.55
HAVELLS INDIA LTD	23,476	547.60	12,855,457.60
LARSEN & TOUBRO LTD	35,454	1,371.45	48,623,388.30
SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,299.35	6,961,917.30
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	433.45	27,101,894.70
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,337	1,473.65	4,917,570.05
BAJAJ AUTO LTD	4,812	3,210.40	15,448,444.80
BHARAT FORGE LTD	13,392	735.75	9,853,164.00
BOSCH LTD	431	19,976.15	8,609,720.65
HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,589.75	11,663,097.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	765.40	48,180,399.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,838	9,323.95	73,081,120.10
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,225	382.30	19,583,317.50
TATA MOTORS LTD	108,553	418.05	45,380,581.65
TATA MOTORS LTD-A-DVR	34,784	243.70	8,476,860.80
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	891.45	24,799,247.55
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	600.35	29,601,457.45
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,739	4,684.45	12,830,708.55
ITC LTD	272,605	274.55	74,843,702.75
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	7,680.65	18,395,156.75
UNITED SPIRITS LTD	3,561	3,713.95	13,225,375.95
DABUR INDIA LTD	58,111	363.80	21,140,781.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,624	1,050.95	19,572,892.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	48,921	1,362.45	66,652,416.45
MARICO LTD	42,465	314.10	13,338,256.50
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	643.20	13,080,115.20
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	441.55	4,638,924.30
CIPLA LTD	31,308	602.75	18,870,897.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	2,490.35	19,427,220.35
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	624.30	10,011,274.80
LUPIN LTD	16,340	924.10	15,099,794.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,422	2,793.95	17,942,746.90
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	572.10	47,455,695.00
AXIS BANK LTD	141,543	590.25	83,545,755.75
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	120,033	1,901.25	228,212,741.25
ICICI BANK LTD	190,983	353.60	67,531,588.80
IDFC BANK LTD	75,550	58.70	4,434,785.00
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	1,301.80	35,041,852.40

	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	562.00	15,719,702.00	
	STATE BANK OF INDIA	132,502	309.25	40,976,243.50	
	YES BANK LTD	123,760	349.35	43,235,556.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,190	1,701.90	19,044,261.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	468.60	7,599,754.80	
	POWER FINANCE CORPORATION	37,247	120.20	4,477,089.40	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	48,168	156.45	7,535,883.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,428.00	17,331,636.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,289	4,973.05	11,383,311.45	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	958.30	43,927,513.70	
	INFOSYS LTD	135,190	1,143.45	154,583,005.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	36,157	2,959.30	106,999,410.10	
	TECH MAHINDRA LTD	26,929	552.90	14,889,044.10	
	VAKRANGEE LTD	36,538	446.60	16,317,870.80	
	WIPRO LTD	89,034	328.95	29,287,734.30	
	BHARTI AIRTEL LTD	81,534	497.90	40,595,778.60	
	BHARTI INFRATEL LTD	68,125	346.05	23,574,656.25	
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	102.30	14,552,686.50	
	GAIL INDIA LTD	39,878	468.75	18,692,812.50	
	NTPC LTD	145,475	172.75	25,130,806.25	
	TATA POWER CO LTD	93,250	92.20	8,597,650.00	
	インドルピー 小計	4,166,007		2,465,378,400.75 (4,314,412,201)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	17.78	404,317.20	
	INDUSTRIES QATAR	15,948	109.50	1,746,306.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	28.00	571,172.00	
	DOHA BANK QSC	12,309	31.70	390,195.30	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	40.81	1,099,747.88	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	98.00	576,926.00	
	QATAR NATIONAL BANK	17,714	136.00	2,409,104.00	
	QATAR INSURANCE CO	9,170	53.23	488,119.10	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	35.30	135,057.80	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	12.04	584,529.96	
	OOREDOO QSC	7,280	98.50	717,080.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	193.00	307,063.00	
	カタールリアル 小計	192,361		9,429,618.24 (287,414,763)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	157.56	3,094,163.28	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	377.72	1,205,682.24	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	27,598	133.77	3,691,784.46	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	52.14	3,367,253.34	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,758	370.00	650,460.00	

MONDI LTD	9,893	333.00	3,294,369.00
SAPPI LIMITED	49,985	89.64	4,480,655.40
SASOL LTD	43,699	438.50	19,162,011.50
SIBANYE-STILLWATER	160,975	15.62	2,514,429.50
BIDVEST GROUP LTD	27,702	208.22	5,768,110.44
NASPERS LTD-N SHS	34,318	3,717.81	127,587,803.58
IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	254.01	3,159,884.40
MR PRICE GROUP LTD	21,299	252.24	5,372,459.76
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	184.89	4,443,276.48
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	91.88	4,352,079.96
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	67.29	5,631,096.36
BID CORP LTD	26,440	277.34	7,332,869.60
PICK N PAY STORES LTD	12,479	71.49	892,123.71
SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,463	239.09	8,239,758.67
SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	204.15	2,983,243.95
PIONEER FOODS LTD	8,805	141.80	1,248,549.00
TIGER BRANDS LTD	13,023	451.81	5,883,921.63
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	79,877	26.50	2,116,740.50
NETCARE LTD	60,221	25.50	1,535,635.50
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	256.50	7,727,062.50
BARCLAYS AFRICA GROUP	61,049	179.00	10,927,771.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,020.00	3,286,440.00
NEDBANK GROUP LTD	14,966	259.00	3,876,194.00
STANDARD BANK GROUP LTD	98,518	194.50	19,161,751.00
BRAIT SE	20,371	37.80	770,023.80
CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	76.35	771,440.40
FIRSTRAND LTD	243,356	64.47	15,689,161.32
INVESTEC LTD	28,883	92.85	2,681,786.55
PSG GROUP LTD	8,086	253.50	2,049,801.00
REMGRO LTD	46,153	234.81	10,837,185.93
RMB HOLDINGS LTD	74,398	76.80	5,713,766.40
DISCOVERY LIMITED	19,467	177.79	3,461,037.93
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	130.58	812,991.08
MMI HOLDINGS LTD	68,078	22.40	1,524,947.20
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	46.15	1,864,829.20
SANLAM LTD	113,378	87.67	9,939,849.26
NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	169.71	5,246,414.94
MTN GROUP LTD	132,522	133.55	17,698,313.10
TELKOM SA LTD	11,353	47.70	541,538.10
VODACOM GROUP	42,279	148.14	6,263,211.06
南アフリカランド 小計	1,985,938		358,853,878.03 (3,287,101,522)

アラブ首長国連邦ディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	234,432	0.63	149,333.18
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	7.28	1,343,451.20
	DUBAI ISLAMIC BANK	96,441	6.53	629,759.73
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	107,533	11.35	1,220,499.55
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	296,657	2.52	747,575.64
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.33	632,553.06
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	3.38	612,486.42
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	2.32	416,771.76
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	7.28	2,188,528.16
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	17.80	2,451,505.00
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		1,990,284		10,392,463.70 (312,813,157)
合 計		179,386,759		49,728,655,158 (49,728,655,158)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	914,760.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	962,597.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	344,158.36	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20,500	416,765.00	
	ブラジルリアル 小計		120,162	2,638,280.36 (91,390,031)	
投資信託受益証券合計			120,162	91,390,031 (91,390,031)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,940,516.00	
		メキシコペソ 小計		308,400	8,940,516.00 (53,196,070)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	358,063.20	
		トルコリラ 小計		135,630	358,063.20 (10,373,090)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	856,707.84	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	3,021,911.22	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	153,979	4,282,155.99	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,610,471.24	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,962,076.80	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	2,861,380.24	
南アフリカランド 小計		883,364	19,594,703.33 (179,487,482)		
			1,327,394	243,056,642	

投資証券合計		(243,056,642)	
合計		334,446,673	(334,446,673)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 37銘柄	100.0%			11.5%
メキシコペソ	株式 25銘柄	96.4%			2.8%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.1%
ブラジルレアル	株式 49銘柄	97.4%			6.9%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.6%		0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%			1.2%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.9%			1.0%
	投資証券 1銘柄			2.1%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.0%			1.3%
香港ドル	株式 138銘柄	100.0%			22.9%
マレーシアリングギット	株式 46銘柄	100.0%			2.3%
タイバーツ	株式 35銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式 113銘柄	100.0%			14.8%
新台湾ドル	株式 90銘柄	100.0%			11.4%
インドルピー	株式 79銘柄	100.0%			8.6%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%			0.6%
南アフリカランド	株式 45銘柄	94.8%			6.6%
	投資証券 6銘柄			5.2%	0.4%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 10銘柄	100.0%			0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【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6期中間計算期間(2018年1月23日から2018年7月22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。

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2018年 1月22日現在)	第6期中間計算期間 (2018年 7月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	86,306,902	75,194,846
親投資信託受益証券	4,677,781,119	4,731,769,068
未収入金	-	1,353,358
流動資産合計	4,764,088,021	4,808,317,272
資産合計	4,764,088,021	4,808,317,272
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	18,086,031	15,744,595
未払受託者報酬	1,196,629	1,231,698
未払委託者報酬	11,966,207	12,316,946
未払利息	143	579
その他未払費用	119,599	123,411
流動負債合計	31,368,609	29,417,229
負債合計	31,368,609	29,417,229
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,212,034,490	3,375,630,063
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,520,684,922	1,403,269,980
（分配準備積立金）	823,308,388	764,128,906
元本等合計	4,732,719,412	4,778,900,043
純資産合計	4,732,719,412	4,778,900,043
負債純資産合計	4,764,088,021	4,808,317,272

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2017年 1月21日 至 2017年 7月20日	第6期中間計算期間 自 2018年 1月23日 至 2018年 7月22日
営業収益		
受取利息	24	8
有価証券売買等損益	342,570,455	168,362,051
営業収益合計	342,570,479	168,362,043
営業費用		
支払利息	21,921	24,989
受託者報酬	1,009,729	1,231,698
委託者報酬	10,097,256	12,316,946
その他費用	101,242	124,763
営業費用合計	11,230,148	13,698,396
営業利益又は営業損失（ ）	331,340,331	182,060,439
経常利益又は経常損失（ ）	331,340,331	182,060,439
中間純利益又は中間純損失（ ）	331,340,331	182,060,439
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（ ）	17,515,800	17,812,193
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	650,850,723	1,520,684,922
剰余金増加額又は欠損金減少額	144,843,554	162,239,629
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	144,843,554	162,239,629
剰余金減少額又は欠損金増加額	98,683,311	115,406,325
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	98,683,311	115,406,325
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,010,835,497	1,403,269,980

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第6期中間計算期間は2018年 1月23日から2018年 7月22日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第5期 (2018年 1月22日現在)	第6期中間計算期間 (2018年 7月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,212,034,490口	3,375,630,063口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4734円 (14,734円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4157円 (14,157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6期中間計算期間 (2018年 7月22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6期中間計算期間 (2018年 7月22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5期 自 2017年 1月21日 至 2018年 1月22日	第6期中間計算期間 自 2018年 1月23日 至 2018年 7月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,955,939,413円	3,212,034,490円
期中追加設定元本額	1,109,479,703円	410,209,907円
期中一部解約元本額	853,384,626円	246,614,334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

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,255,457,607
国債証券	328,307,130,900
地方債証券	22,101,857,061
特殊債券	27,819,518,802
社債券	15,711,355,500
未収入金	77,408
未収利息	713,476,433
前払費用	28,396,199
流動資産合計	395,937,269,910
資産合計	395,937,269,910
負債の部	
流動負債	
未払金	499,437,400
未払解約金	178,584,419
未払利息	3,229
その他未払費用	11,739
流動負債合計	678,036,787
負債合計	678,036,787
純資産の部	
元本等	
元本	283,010,685,278
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,248,547,845
元本等合計	395,259,233,123
純資産合計	395,259,233,123
負債純資産合計	395,937,269,910

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2018年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	283,010,685,278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 103,204,000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 1.3966円 (1万口当たり純資産額) (13,966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

	2018年 7月22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。

## （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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	256,411,785,507円
期中追加設定元本額	34,331,874,946円
期中一部解約元本額	7,732,975,175円
期末元本額	283,010,685,278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）	3,564,059,246円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,154,042円
S M T 国内債券インデックス・オープン	12,836,911,672円
世界経済インデックスファンド	1,682,342,321円
D C マイセレクション 2 5	19,347,236,858円
D C マイセレクション 5 0	22,044,740,856円
D C マイセレクション 7 5	6,058,572,125円
D C 日本債券インデックス・オープン	450,365,447円
D C 日本債券インデックス・オープン S	76,699,663,730円
D C 日本債券インデックス・オープン P	35,099,244,298円
D C マイセレクション S 2 5	7,664,388,167円
D C マイセレクション S 5 0	8,709,176,113円
D C マイセレクション S 7 5	1,725,942,809円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,261,053,387円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,121,853,893円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	360,963,392円
D C 世界経済インデックスファンド	1,313,736,541円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	100,193,027円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,919,619円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	97,338,518円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,668,118円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	995,042円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	317,789,852円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	443,823,548円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	77,324,367円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	202,025,121円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,352,829,574円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,131,200,298円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,291,095,238円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	889,192,775円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	151,895,662円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,497,318,926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）	587,069,922円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,670,626,175円

区分	2018年 7月22日現在
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,160,422,462円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	180,314,540円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,805,663,836円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,555,651,471円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	52,461,116円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	642,916,305円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	68,611,248円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,016,677円
SMT インデックスバランス・オープン	79,539,247円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,868,714円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	16,501,059円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	20,009,266円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	838,521円
グローバル経済コア	273,819,559円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	4,877,637円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	67,485円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	45,316,168,216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。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2018年 7月22日現在
	金額（円）
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
コール・ローン	2,609,233,834
株式	212,866,063,560
派生商品評価勘定	31,102,380
未収入金	9,564,980
未収配当金	259,698,922
差入委託証拠金	53,560,000
流動資産合計	215,829,223,676
<b>資産合計</b>	215,829,223,676
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	60,760
前受金	31,067,000
未払解約金	200,527,071
未払利息	6,711
その他未払費用	25,184
流動負債合計	231,686,726

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
負債合計	231,686,726
純資産の部	
元本等	
元本	137,314,504,810
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,283,032,140
元本等合計	215,597,536,950
純資産合計	215,597,536,950
負債純資産合計	215,829,223,676

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 7月22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 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,314,504,810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 1.5701円 (1万口当たり純資産額) (15,701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

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	121,805,661,791円
期中追加設定元本額	20,524,795,635円
期中一部解約元本額	5,015,952,616円
期末元本額	137,314,504,810円

区分	2018年 7月22日現在
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）	656,110,120円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,596,565,691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	9,263,564,644円
世界経済インデックスファンド	1,954,479,545円
日本株式インデックス・オープン	5,922,745,643円
DCマイセレクション25	5,769,001,375円
DCマイセレクション50	16,911,964,614円
DCマイセレクション75	16,053,925,599円
DC日本株式インデックス・オープン	5,199,538,324円
DCマイセレクションS25	2,279,149,918円
DCマイセレクションS50	6,724,538,004円
DCマイセレクションS75	4,560,585,238円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,397,409,958円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	375,114,726円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	562,968,978円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	356,037,049円
DC世界経済インデックスファンド	1,521,071,445円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	451,630,934円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	23,987,825円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	76,027,341円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,621,993円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	350,397,999円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,635,767円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	135,002,873円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	474,934,152円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	72,255,065円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	647,321,870円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,011,068,557円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	773,237,185円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,388,943,215円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	664,797,049円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	61,968,502円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	858,417,880円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	756,821,467円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	501,596,303円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	628,934,521円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	59,719,761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）	985,724,004円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,553,811,574円

区分	2018年 7月22日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	168,384,275円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	207,804,478円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	231,341,260円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,546,292円
S M T インデックスバランス・オープン	85,323,793円
S M T 世界経済インデックス・オープン	3,818,776円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	44,995,497円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	5,952,042円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	808,941円
グローバル経済コア	325,996,151円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	4,747,829円
i - S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	35,487,033円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	149,100円
F O F s 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）	28,714,820,616円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年 7月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,467,883,380	-	2,498,925,000	31,041,620
合計		2,467,883,380	-	2,498,925,000	31,041,620

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	254,445,826
コール・ローン	1,935,878,934
国債証券	252,785,929,966
派生商品評価勘定	18,032,565
未収入金	4,423,678
未収利息	1,972,821,400

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
前払費用	116,841,275
差入委託証拠金	138,161,988
流動資産合計	257,226,535,632
資産合計	257,226,535,632
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	878,498
前受金	2,204,038
未払金	11,343
未払解約金	252,868,819
未払利息	4,979
その他未払費用	14,896
流動負債合計	255,982,573
負債合計	255,982,573
純資産の部	
元本等	
元本	93,009,092,554
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,961,460,505
元本等合計	256,970,553,059
純資産合計	256,970,553,059
負債純資産合計	257,226,535,632

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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>

2018年 7月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,009,092,554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 2.7629円 (1万口当たり純資産額) (27,629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

2018年 7月22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 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	94,509,771,464円
期中追加設定元本額	10,483,045,506円
期中一部解約元本額	11,983,724,416円
期末元本額	93,009,092,554円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,050,554,034円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	854,950,313円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	552,338,378円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,001,736,324円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,341,222円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,036,002,093円
世界経済インデックスファンド	6,239,051,936円
D C マイセレクション 2 5	1,585,140,712円
D C マイセレクション 5 0	1,382,403,270円
D C マイセレクション 7 5	913,670,191円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,742,330,681円
D C マイセレクション S 2 5	622,733,397円
D C マイセレクション S 5 0	548,044,982円
D C マイセレクション S 7 5	259,058,530円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	54,653,354円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	59,841,891円

区分	2018年 7月22日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	27,802,053円
D C世界経済インデックスファンド	4,918,073,859円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	578,074,936円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	50,370,524円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,000,917円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,271,349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)	61,848,636円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	186,428,919円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	265,885,351円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	201,338,566円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	601,014,471円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,632,736,735円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	708,697,864円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,574,578,604円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	964,512,975円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	125,838,093円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	726,150,056円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	758,125,646円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	286,604,970円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	351,033,370円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,142,302,436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)	978,430,209円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	912,264,322円
外国債券ファンド・シリーズ1	642,334,681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)	4,673,724,403円
分散投資コア戦略ファンドA	1,011,921,448円
分散投資コア戦略ファンドS	2,876,971,685円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	186,700,405円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,014,030,280円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,210,304,516円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	232,516,896円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	116,966,046円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	942,499,878円
SMT インデックスバランス・オープン	253,952,468円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	24,229,752,210円
SMT 世界経済インデックス・オープン	20,130,873円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	75,921,717円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	92,695,883円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	460,002円
グローバル経済コア	1,163,116,013円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,783,207円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	9,345円

区分	2018年 7月22日現在
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）	1,007,344,794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）	6,475,368,093円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	359,357,887円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2018年 7月22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	1,221,262,602	-	1,223,466,640	2,204,038
合計		1,221,262,602	-	1,223,466,640	2,204,038

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2018年 7月22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	1,574,810,971	-	1,589,761,000	14,950,029
	アメリカドル	744,263,553	-	754,338,200	10,074,647
	カナダドル	68,287,725	-	68,679,900	392,175
	ユーロ	646,121,717	-	651,000,000	4,878,283
	イギリスポンド	116,137,976	-	115,742,900	395,076
合計		1,574,810,971	-	1,589,761,000	14,950,029

## (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

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,145,752,819
コール・ローン	614,936,543
株式	332,205,519,320
投資信託受益証券	262,838,975
投資証券	7,807,229,786
派生商品評価勘定	189,912,027
未収入金	1,272,819
未収配当金	312,418,563
差入委託証拠金	2,404,658,961
流動資産合計	354,944,539,813
資産合計	354,944,539,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,984,419
前受金	186,255,528
未払解約金	927,841,193
未払利息	1,581
その他未払費用	2,622
流動負債合計	1,117,085,343
負債合計	1,117,085,343
純資産の部	
元本等	
元本	137,317,936,606
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	216,509,517,864
元本等合計	353,827,454,470
純資産合計	353,827,454,470
負債純資産合計	354,944,539,813

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2018年 7月22日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <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 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		137,317,936,606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)	2.5767円 (25,767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

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	133,409,705,614円
期中追加設定元本額	11,201,611,462円
期中一部解約元本額	7,293,380,470円
期末元本額	137,317,936,606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）	2,387,489,443円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,232,050円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,149,179,978円
世界経済インデックスファンド	7,147,197,889円
外国株式インデックス・オープン	889,606,850円
D C マイセレクション 2 5	1,017,451,429円
D C マイセレクション 5 0	4,710,201,208円
D C マイセレクション 7 5	5,178,543,302円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,642,426,517円
D C マイセレクション S 2 5	391,276,934円
D C マイセレクション S 5 0	1,881,961,343円
D C マイセレクション S 7 5	1,472,620,838円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	121,436,453円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	182,416,543円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	115,486,961円
D C 世界経済インデックスファンド	5,646,825,976円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,718,905,979円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	20,692,823円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,166,847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）	62,473,154円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	87,989,099円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	300,693,970円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	46,145,585円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	413,168,246円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	878,793,761円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	438,160,789円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,858,079,899円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,099,680,803円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	117,454,786円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	421,619,405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）	185,961,221円

区分	2018年 7月22日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	139,365,890円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,101,299,425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)	2,419,237,485円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,447,703,678円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,970,451,711円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,687,901,456円
分散投資コア戦略ファンドA	2,022,313,048円
分散投資コア戦略ファンドS	4,213,127,565円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	635,485,482円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	789,896,037円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,736,786,986円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	876,945,162円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,392,074円
SMT インデックスバランス・オープン	306,804,419円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	2,075,435,289円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,664,683,732円
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,573,865円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	266,051,539円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	35,358,954円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	519,707円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	24,486,460円
グローバル経済コア	1,264,882,159円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,061,107円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	48,752円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,625,425,168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)	1,335,158,286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)	201,089円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2018年 7月22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	13,321,377,558	-	13,507,633,086	186,255,528
	合計	13,321,377,558	-	13,507,633,086	186,255,528

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2018年 7月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	338,023,280	-	337,351,200	672,080
	アメリカドル	236,733,000	-	236,418,000	315,000
	カナダドル	15,411,240	-	15,278,400	132,840
	ユーロ	42,032,640	-	41,996,800	35,840
	イギリスポンド	29,483,400	-	29,318,000	165,400
	香港ドル	14,363,000	-	14,340,000	23,000
合計		338,023,280	-	337,351,200	672,080

### (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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2018年 7月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	674,354,819
コール・ローン	305,662,150
国債証券	43,452,422,892
派生商品評価勘定	606,678
未収入金	153,012
未収利息	566,282,049
前払費用	105,954,453
流動資産合計	45,105,436,053
資産合計	45,105,436,053
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,898,407
未払金	485,624,279
未払解約金	73,632,691
未払利息	786
その他未払費用	4,248
流動負債合計	561,160,411

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
負債合計	561,160,411
純資産の部	
元本等	
元本	26,962,144,339
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,582,131,303
元本等合計	44,544,275,642
純資産合計	44,544,275,642
負債純資産合計	45,105,436,053

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,962,144,339口

		2018年 7月22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		1.6521円
	(1万口当たり純資産額)		(16,521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

		2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2018年 1月23日

区分	2018年 7月22日現在
期首元本額	19,505,694,501円
期中追加設定元本額	8,001,855,575円
期中一部解約元本額	545,405,737円
期末元本額	26,962,144,339円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,858,123,272円
世界経済インデックスファンド	4,942,421,422円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,656,451,853円
DC世界経済インデックスファンド	3,928,078,247円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,874,740,342円
コア投資戦略ファンド（安定型）	200,114,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	657,518,583円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	110,433,898円
分散投資コア戦略ファンドA	126,499,407円
分散投資コア戦略ファンドS	387,564,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	142,118,253円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,633,162,046円
コア投資戦略ファンド（切替型）	129,073,783円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	189,464,256円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,419,598円
SMT インデックスバランス・オープン	210,966,593円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,524,251,006円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,119,811円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,983,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	105,462,501円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	728,603円
グローバル経済コア	944,782,105円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	136,665,486円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2018年 7月22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	316,864,125	-	315,338,839	1,525,286
	メキシコペソ	23,872,000	-	23,640,000	232,000
	ブラジルリアル	47,710,652	-	48,083,773	373,121
	トルコリラ	35,170,500	-	35,055,000	115,500

	チェココルナ	24,934,646	-	24,835,938	98,708
	ハンガリーフォリ ント	23,327,251	-	23,080,641	246,610
	ポーランドズロチ	30,480,000	-	30,170,000	310,000
	マレーシアリン ギット	24,275,561	-	24,195,231	80,330
	タイバーツ	40,667,781	-	40,258,561	409,220
	インドネシアルピ ア	57,933,734	-	57,719,695	214,039
	南アフリカランド	8,492,000	-	8,300,000	192,000
	売建	146,312,167	-	146,078,610	233,557
	アメリカドル	146,312,167	-	146,078,610	233,557
	合計	463,176,292	-	461,417,449	1,291,729

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,411,141,471
コール・ローン	157,670,926
株式	49,313,707,628
投資信託受益証券	70,379,970
投資証券	214,095,909
派生商品評価勘定	4,462,169
未収入金	16,462,346
未収配当金	323,697,313
差入委託証拠金	231,949,049
流動資産合計	51,743,566,781
資産合計	51,743,566,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,662,714
前受金	801,782
未払金	1,191,297,238
未払解約金	54,591,385
未払利息	405
その他未払費用	1,146
流動負債合計	1,251,354,670
負債合計	1,251,354,670
純資産の部	
元本等	

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
元本	17,614,269,212
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,877,942,899
元本等合計	50,492,212,111
純資産合計	50,492,212,111
負債純資産合計	51,743,566,781

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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>

2018年 7月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2018年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,614,269,212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 2.8666円 (1万口当たり純資産額) (28,666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

2018年 7月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引

	2018年 7月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	16,271,676,908円
期中追加設定元本額	1,860,715,934円
期中一部解約元本額	518,123,630円
期末元本額	17,614,269,212円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,677,213,339円
世界経済インデックスファンド	2,980,663,157円
DC 新興国株式インデックス・オープン	3,668,664,290円
DC 世界経済インデックスファンド	2,366,786,423円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	94,897,665円
DC 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	263,716,572円
DC 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	322,744,128円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	368,959,137円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,529,351円
SMT インデックスバランス・オープン	126,995,225円

区分	2018年 7月22日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	13,197,542円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	154,460,795円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,268,371円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	422,094円
グローバル経済コア	527,908,388円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	8,842,735円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2018年 7月22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	846,621,124	-	847,422,906	801,782
合計		846,621,124	-	847,422,906	801,782

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2018年 7月22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	182,483,643	-	181,330,093	1,153,550
	ブラジルリアル	76,418,850	-	77,016,481	597,631
	マレーシアリンギット	15,569,120	-	15,517,600	51,520
	インドネシアルピア	18,313,673	-	18,246,012	67,661
	南アフリカランド	72,182,000	-	70,550,000	1,632,000
	売建	94,732,523	-	94,581,300	151,223
	アメリカドル	94,732,523	-	94,581,300	151,223
合計		277,216,166	-	275,911,393	1,002,327

(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】

## 【世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

## 【純資産額計算書】

（2018年 8月31日現在）

資産総額	4,783,414,030円
負債総額	10,812,504円
純資産総額（ - ）	4,772,601,526円
発行済口数	3,391,304,237口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4073円
（1万口当たり純資産額）	（14,073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

（2018年 8月31日現在）

資産総額	415,420,478,094円
負債総額	9,562,063,854円
純資産総額（ - ）	405,858,414,240円
発行済口数	293,216,638,649口
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）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2018年 8月31日現在）

資産総額	222,039,212,987円
負債総額	802,906,573円
純資産総額（ - ）	221,236,306,414円
発行済口数	141,647,900,435口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5619円
（1万口当たり純資産額）	（15,619円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 8月31日現在)

資産総額	256,484,814,349円
負債総額	81,374,357円
純資産総額（ - ）	256,403,439,992円
発行済口数	94,628,743,676口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7096円
（1万口当たり純資産額）	（27,096円）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 8月31日現在)

資産総額	357,321,202,475円
負債総額	646,196,290円
純資産総額（ - ）	356,675,006,185円
発行済口数	136,919,147,334口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6050円
（1万口当たり純資産額）	（26,050円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 8月31日現在)

資産総額	43,373,003,755円
負債総額	10,787,089円
純資産総額（ - ）	43,362,216,666円
発行済口数	27,921,182,994口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5530円
（1万口当たり純資産額）	（15,530円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2018年 8月31日現在)

資産総額	51,085,745,750円
負債総額	54,104,370円
純資産総額（ - ）	51,031,641,380円
発行済口数	18,056,336,785口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8262円
（1万口当たり純資産額）	（28,262円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2018年10月1日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2018年10月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	497	10,106,666
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	230,389
単位型公社債投資信託	0	0
合計	564	10,337,055

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

評価・換算差額等

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

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

### (1) 概要

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

### (2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

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

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

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	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の主な原因別の内訳

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

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

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

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2018年10月22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
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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	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。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
高木証券株式会社	11,069	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。
丸八証券株式会社	3,751	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。
GMOクリック証券株式会社	4,346	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。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 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

平成30年3月22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」に掲げられている世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の平成29年1月21日から平成30年1月22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、世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の平成30年1月22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

1. 上記は、当社が、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おりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2018年9月21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」に掲げられている世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2018年1月23日から2018年7月22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な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、世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2018年7月22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1月23日から2018年7月22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。

## 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。