# 【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 有価証券報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2019年10月10日提出 |
| 【計算期間】 | 第6期(自 2018年7月11日至 2019年7月10日) |
| 【ファンド名】 | コア投資戦略ファンド（切替型） |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 菱田　賀夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝公園一丁目１番１号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 投資業務推進部長　民野　誠 |
| 【連絡場所】 | 東京都港区芝公園一丁目１番１号 |
| 【電話番号】 | 03-6453-3610 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

# 第一部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

### １【ファンドの性格】

#### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　1兆円

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<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br><br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　　）<br><br>不動産投信<br><br>その他資産<br>（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信、その他資産（バンクローン、デリバティブ、為替予約取引等））資産配分変更型））<br><br>資産複合<br>（　　）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回<br><br>年2回<br><br>年4回<br><br>年6回（隔月）<br><br>年12回（毎月）<br><br>日々<br><br>その他（　） | グローバル（日本を含む）<br><br>日本<br><br>北米<br><br>欧州<br><br>アジア<br><br>オセアニア<br><br>中南米<br><br>アフリカ<br><br>中近東（中東）<br><br>エマージング | ファミリーファンド<br><br>ファンド・オブ・ファンズ | あり（部分ヘッジ）<br><br>なし | 日経225<br><br>ＴＯＰＩＸ<br><br>その他（　　） | ブル・ベア型<br><br>条件付運用型<br><br>ロング・ショート型/絶対収益追求型<br><br>その他（　　） |

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…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。

②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

［特殊型］

**(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。**

**(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。**

**＜ファンドの特色＞**

## 1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

●投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。

●今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

## 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

●保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。

●市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド※1等に投資し、オルタナティブ運用※2を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、MLP、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

## 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた機動的な調整を行います。

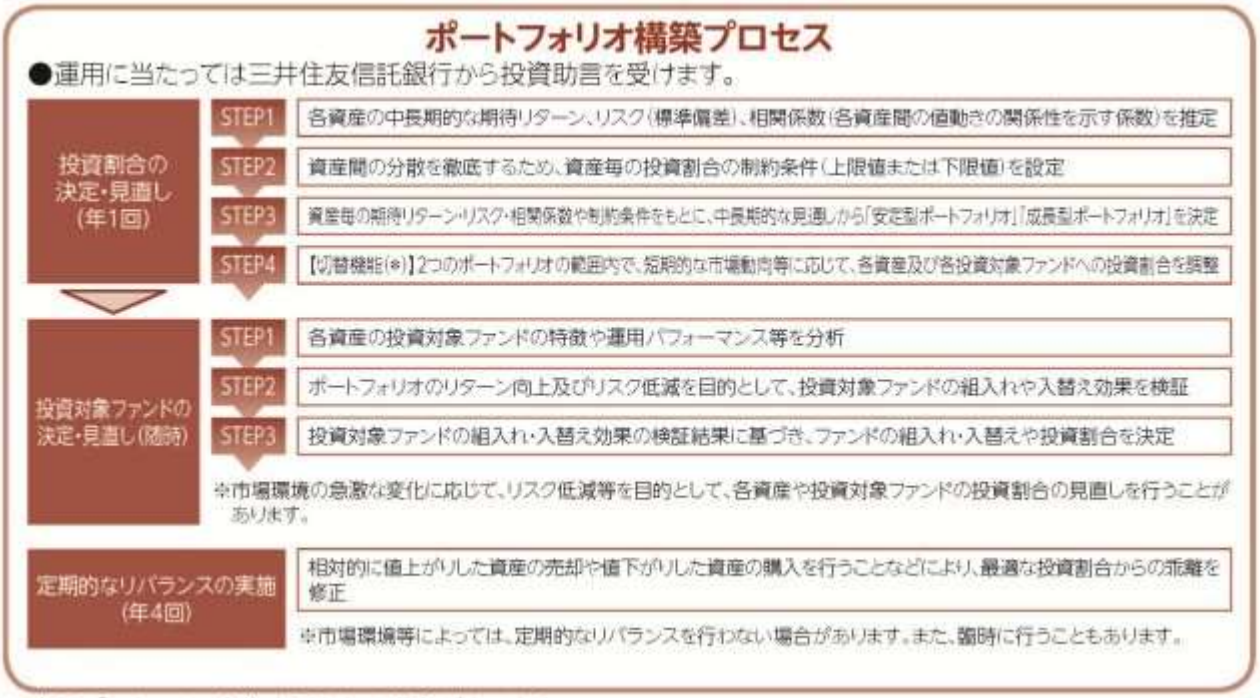
●投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

**●「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。**

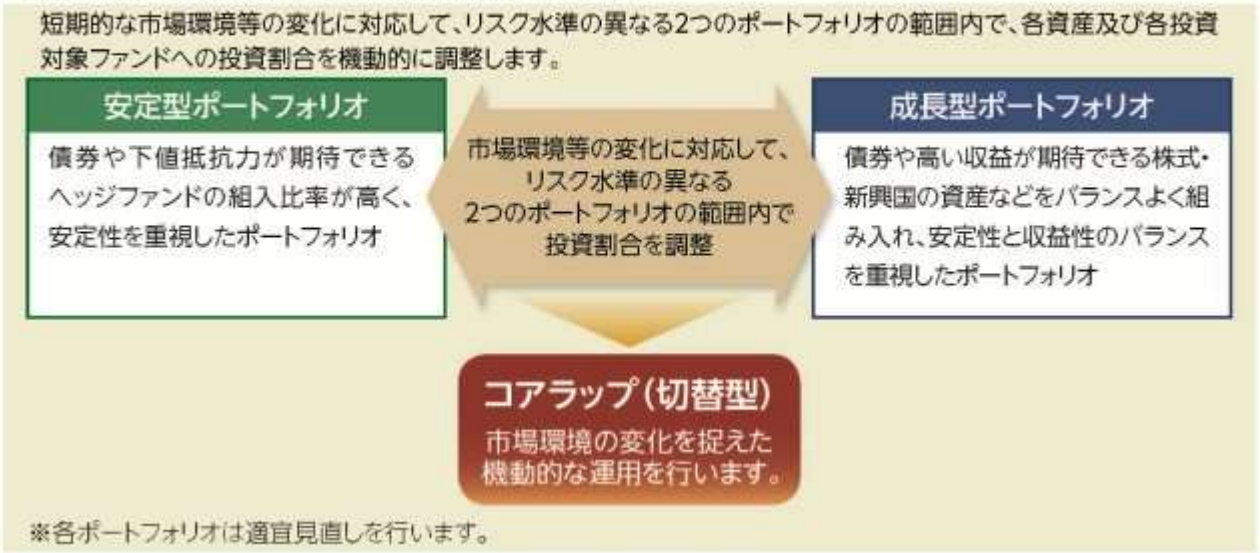
**※当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3　投資リスク　(1)ファンドのリスク　⑫ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。**

**●市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。**



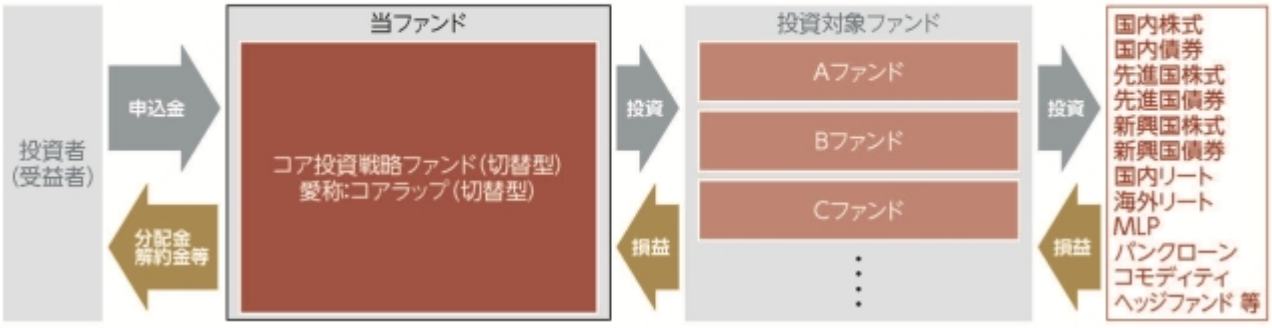

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(※)「コアラップ（切替型）」の切替機能のイメージ>



ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。




**※投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「２　投資方針（２）投資対象　(参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。**

**ファンド・オブ・ファンズ方式とは**

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

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

●投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
●株式への直接投資は行いません。
●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
●デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

**米国地方債**

米国地方債は、地方公共団体等が発行する債券で、発行体自身の信用力によって元利金の支払いを保証する一般財源保証債と、インフラ施設やサービス事業の利用料等を返済原資とするレベニュー債が主に発行されています。

**MLP**

MLPはマスター・リミテッド・パートナーシップ(Master Limited Partnership)の略称です。米国で行われている共同投資事業形態の1つで、米国の金融商品取引所で取引されています。MLPの多くは、エネルギー・天然資源に関連する事業を行っています。

**バンクローン**

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

**コモディティ**

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

**ヘッジファンド**

ヘッジとは元々"回避する"という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド※などがあります。
※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

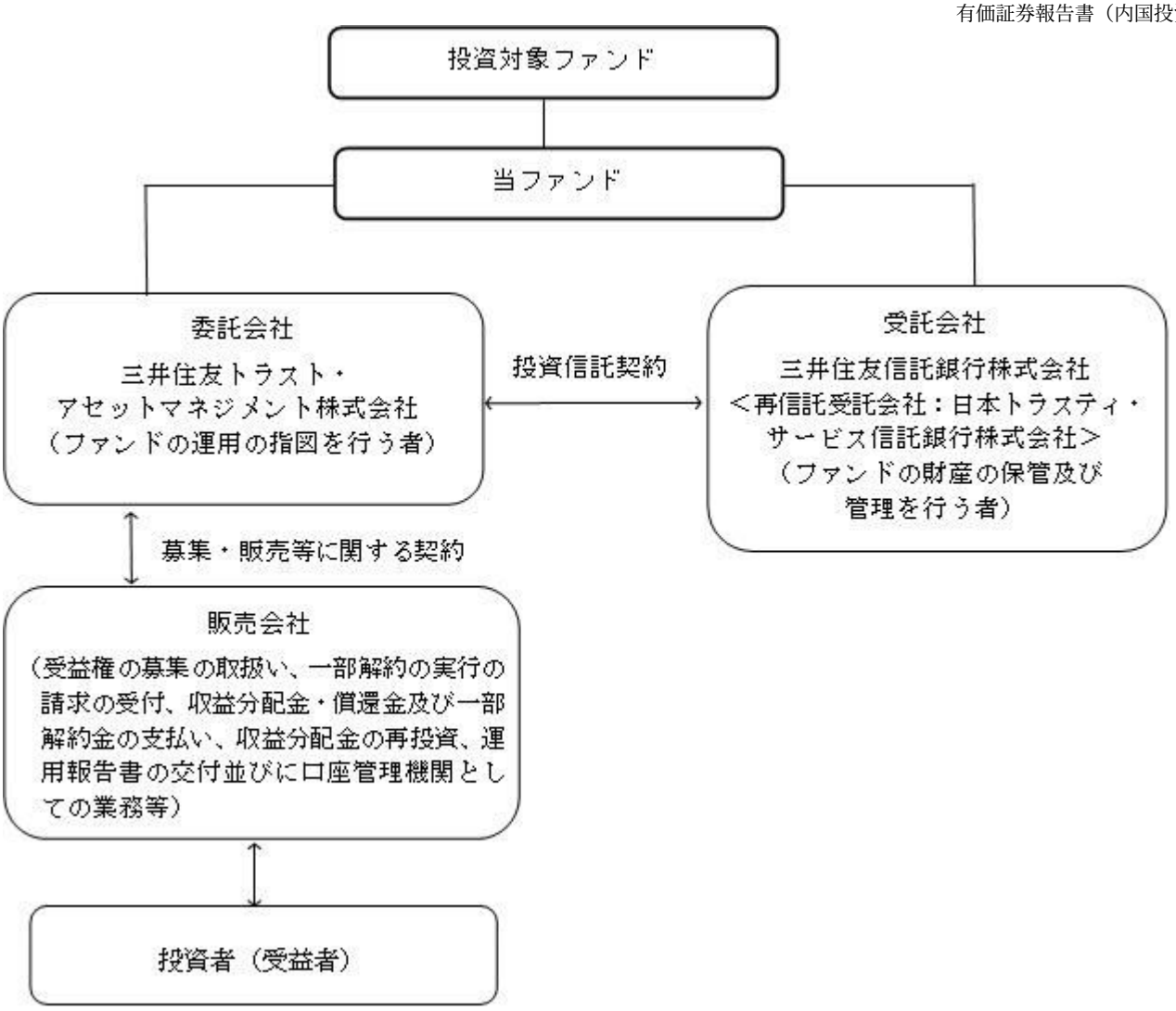
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

**（2）【ファンドの沿革】**

**2013年10月17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】**

**①当ファンドの仕組み及び関係法人**




**②委託会社の概況（2019年 7月31日現在）**

**イ．資本金の額：20億円**

**ロ．委託会社の沿革**

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

**ハ．大株主の状況**

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

## 2【投資方針】

**（1）【投資方針】**

**①基本方針**

**当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。**

**②投資対象**

**別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。**

**③投資態度**

**イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ[*1]、ヘッジファンド[*2]及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。**

**＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。**

**＊2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。**

**ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。**

**※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。**

**ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、75%未満とします。なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。**

**ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。**

**ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。**

**ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。**

**ト．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。**

**（2）【投資対象】**

**①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. 金銭債権**

**3. 約束手形**

**ロ．次に掲げる特定資産以外の資産**

**1. 為替手形**

**②有価証券の指図範囲**

**委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。**

**1.コマーシャル・ペーパー及び短期社債等**

**2.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの**

**3.国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）**

**4.外国法人が発行する譲渡性預金証書**

**5.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）**

**なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。**

**③金融商品の指図範囲**

**イ．委託会社は、信託金を、上記②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**

**ロ．上記②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。**

**④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。**

**（参考）投資対象ファンドの概要**

**・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。**

**・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。**

**以下の内容は、2019年 7月31日（（★）のファンドに関しては2019年10月10日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。**

**なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。**

**1.FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）**

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。 |
| 投資態度 | ①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。<br>②株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③運用の効率化を図るため、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。<br>④株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。<br>⑤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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、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。<br>③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>④同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、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。<br>⑥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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑦外貨建資産への投資は行いません。<br>⑧一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、委託者は、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。<br>⑨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。 |

| | |
|---|---|
| ベンチマーク | JPX日経インデックス400（配当込み） |
| 決算日 | 年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.077%（税抜　0.07%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2014年2月3日 |
| 信託期間 | 原則として2014年2月3日から2023年10月20日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※ＪＰＸ日経インデックス400（配当込み）とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「ＪＰＸグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。「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。

①同指数は、ＪＰＸグループ並びに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、ＪＰＸグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

②同指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てＪＰＸグループ及び日経に帰属しています。

③当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、ＪＰＸグループ及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

④ＪＰＸグループ及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

⑤ＪＰＸグループ及び日経は、同指数の構成銘柄、計算方法、その他同指数の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

2.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本株配当マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式の中から、予想配当利回りが比較的高いと判断される銘柄及び配当増が予想される銘柄群に投資します。<br>②株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>③投資信託証券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。<br>④外貨建資産への投資は行いません。<br>⑤一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、委託者は、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。<br>⑥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。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2015年2月2日 |
| 信託期間 | 原則として2015年2月2日から2025年4月10日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

3.ＦＯＦｓ用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | 国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | 主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。<br>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。<br>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。<br>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。<br>②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>④デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。<br>⑤一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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 |
| ベンチマーク | TOPIX（東証株価指数）（※） |
| 決算日 | 年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。<br>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。<br>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.374%（税抜　0.34%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2015年1月30日 |
| 信託期間 | 2015年1月30日から2025年2月17日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。**

**4.国内株式インデックス マザーファンド**

| | |
|---|---|
| **運用会社** | **三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社** |
| **運用の基本方針** | **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。** |
| **主要投資対象** | **わが国の取引所に上場されている株式** |
| **投資態度** | **①原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。**<br>**②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。**<br>**③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。**<br>**④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。**<br>**⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。** |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資割合には制限を設けません。<br>②外貨建資産への投資は、行いません。<br>③新株引受権証券およ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。<br>④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。<br>⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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。<br>⑥同一銘柄の新株引受権証券およ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。<br>⑦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。<br>⑧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およ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、委託者は、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。<br>⑨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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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。 |
| ベンチマーク | TOPIX（東証株価指数） |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2000年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
④東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
⑧以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動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.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | 主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。<br>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。<br>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。<br>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。<br>②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行ないません。<br>④一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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。<br>⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 |
| ベンチマーク | TOPIX（東証株価指数） |

| | |
|---|---|
| 決算日 | 年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。<br>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。<br>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2018年9月28日 |
| 信託期間 | 2018年9月28日から2028年10月25日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

6.国内債券インデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 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。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債 |
| 投資態度 | ①NOMURA-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。<br>②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。<br>③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。<br>④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。<br>⑤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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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。<br>②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。<br>③外貨建資産への投資は、行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤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。 |
| ベンチマーク | NOMURA-BPI総合 |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2000年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

7.日本債券ツイン戦略マザーファンド（★）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（※）を上回る投資成果を目指します。<br>②ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。<br>③公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | NOMURA-BPI総合 |
| 決算日 | 年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2019年10月18日（予定） |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

8.FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。<br>②ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。<br>③債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質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。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、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。<br>④転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑤外貨建資産への投資は行いません。<br>⑥一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、委託者は、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。<br>⑦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。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |

| | |
|---|---|
| 決算日 | 年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2014年4月11日 |
| 信託期間 | 原則として2014年4月11日から2024年2月14日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

9.FOFs用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド　為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。 |
| 投資態度 | ①マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（※）に連動する投資成果を目指します。<br>②インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。<br>④運用の効率化をはかるため、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。<br>⑤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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース） |
| 決算日 | 年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2017年3月31日 |
| 信託期間 | 原則として2017年3月31日から2027年1月18日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスをあらわします。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標及びサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標及びサービスマークです。ブルームバーグ

**またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。**

**10.マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）（★）**

| | |
|---|---|
| 運用会社 | マニュライフ・アセット・マネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
| 投資態度 | ①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。<br>②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。<br>③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。<br>④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。 |
| 主な投資制限 | ①債券への実質投資割合には制限を設けません。<br>②外貨建資産への投資は行いません。<br>③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。<br>④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。<br>⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。<br>⑥デリバティブ取引等について、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、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。<br>⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日） |

| | |
|---|---|
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。<br>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。<br>②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。<br>③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。 |
| 信託報酬 | 毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。<br>新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬<br>0.5%未満の場合・・・・・・・・・・・年率0.264%（税抜　0.24%）<br>0.5%以上１%未満の場合・・・・・・年率0.297%（税抜　0.27%）<br>１%以上の場合　・・・・・・・・・・年率0.33%　（税抜　0.3%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2019年10月10日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

11. Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class

| | |
|---|---|
| 投資顧問会社 | ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。 |
| 投資態度 | ①主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。<br>②ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。<br>③米国の投資適格地方債への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。<br>⑤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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。<br>②投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。<br>③投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。<br>④流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。<br>⑤受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。<br>⑥一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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 収益の分配 | 毎月 |
| 信託報酬 | 年率0.44%<br>※この他、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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等及びデリバティブ取引に要する費用等並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2016年2月26日 |
| 関係法人 | ・投資顧問会社<br>Nuveen Asset Management ,LLC<br>・受託会社<br>G.A.S. (Cayman) Limited<br>・管理事務代行会社<br>SMT Fund Services (Ireland) Limited<br>・名義書換事務受託会社<br>SMT Fund Services (Ireland) Limited<br>・保管受託銀行<br>Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited |

12.外国株式インデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| **主要投資対象** | **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** |
| **投資態度** | **①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。**<br>**②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。**<br>**③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。**<br>**④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。**<br>**⑤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。**<br>**⑥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。**<br>**⑦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。**<br>**⑧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。** |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資割合には制限を設けません。<br>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>③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。<br>④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。<br>⑤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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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。<br>⑥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。<br>⑦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。<br>⑧一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、委託者は、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。<br>⑨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。 |
| ベンチマーク | MSCIコクサイ・インデックス（円ベース） |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2000年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

### 13.外国債券インデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | 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。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界の主要国の公社債 |
| 投資態度 | ①FTSE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。<br>②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。<br>③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。<br>④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。<br>⑤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。<br>⑥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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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。<br>②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。<br>③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤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。 |
| ベンチマーク | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース） |
| 決算日 | 年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2000年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

### 14.新興国株式インデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 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。 |
| 主要投資対象 | 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。） |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①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。<br>②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。<br>③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。<br>④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者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。<br>⑤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。 |
| 主な投資制限 | ①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。<br>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>③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。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤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。 |
| ベンチマーク | MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。 |
| 設定日 | 2008年12月12日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

15. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

| | |
|---|---|
| 運用会社 | Wellington Management Company LLP |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 金融商品取引所等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。<br>※この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。 |
| 投資態度 | ①MSCIエマージング・マーケット・インデックス（※）の騰落率を上回る投資成果を追求します。<br>②ポートフォリオは、カントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。<br>③株式への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。<br>⑤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。 |
| 主な投資制限 | ①投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>②投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。<br>③投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。<br>④運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。<br>⑤流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。<br>⑥受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。 |
| ベンチマーク | MSCI エマージング・マーケット・インデックス |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |

| | |
|---|---|
| 信託報酬 | 年率0.8%<br>なお、この報酬率には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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2018年5月30日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 関係法人 | ・管理会社（マネージメントカンパニー）<br>Wellington Luxembourg S.a r.l.<br>・運用会社（インベストメントマネージャー）<br>Wellington Management Company LLP<br>・預託機関（デポジタリー）<br>State Street Bank Luxembourg S.C.A.<br>・管理事務代行会社（アドミニストレーター）<br>State Street Bank Luxembourg S.C.A.<br>・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント）<br>State Street Bank Luxembourg S.C.A. |

※「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。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。

**16.新興国債券インデックス マザーファンド**

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 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・ディバーシファイド（円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 新興国の債券 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①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・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。<br>②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。<br>③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者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。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は行いません。<br>②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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤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。 |
| ベンチマーク | 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・ディバーシファイド（円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。 |
| 設定日 | 2008年12月11日 |

| | |
|---|---|
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「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。

17.FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主として日本を含む世界各国の債券（国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。以下同じ。）に投資する世界ハイインカム入替戦略マザーファンド　為替ヘッジあり（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を含む世界各国の債券に直接投資することもあります。 |
| 投資態度 | ①マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の債券に投資します。<br>②ポートフォリオの構築に当たっては、主として日本を含む世界各国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への実質投資割合を決定します。<br>③債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。<br>⑤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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、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。<br>④同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑤外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>⑥一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、委託者は、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。<br>⑦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。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2014年10月8日 |
| 信託期間 | 原則として、2014年10月8日から2024年9月17日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

## 18．大和住銀／ウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。 |
| 主要投資対象 | マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含みます。）への実質的な投資を行います。<br>※中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。<br>②世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。<br>③実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。<br>④マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。<br>⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | ①株式への直接投資は行いません。<br>②外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>③為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。<br>④デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。<br>⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.759%以内（税抜　0.69%以内） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2015年5月12日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

## 19.LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 当ファンドは、主に「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。<br>②ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）をベンチマークとします。<br>③LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。<br>④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>①主に、日本を除く世界の公社債に投資します。<br>②ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。<br>③原則として、取得時において1社以上の格付機関から投資適格（ＢＢＢ－／Ｂａａ３）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。<br>④外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。<br>⑤資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。<br>⑥運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国）<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル）<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール）<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア）<br>ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。<br>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。<br>③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。<br>④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。<br>⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。<br>⑦一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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース） |
| 決算日 | 毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日。第1期決算日は2019年10月9日） |
| 収益の分配 | 原則、毎決算時に分配を行います。<br>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。<br>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。<br>※分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2018年10月10日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックスをレッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社が独自に円換算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

20.J-REITインデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券 |
| 投資態度 | ①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。<br>②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。<br>③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。<br>③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。<br>④外貨建資産への投資は行いません。<br>⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。<br>⑥一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、委託者は、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。<br>⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 東証REIT指数（配当込み） |

| | |
|---|---|
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2008年1月9日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

21.グローバルREITインデックス マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券 |
| 投資態度 | ①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。<br>②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。<br>③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。<br>④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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。<br>③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。<br>④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） |
| 決算日 | 年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2008年1月9日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's(R)およびS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追随するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

**る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。**

**S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。**

**22.ＦＯＦｓ用ＭＬＰインデックスファンド（適格機関投資家専用）**

| | |
|---|---|
| **運用会社** | **日興アセットマネジメント株式会社** |
| **運用の基本方針** | **この投資信託は、別に定めるＭＬＰ（マスター・リミテッド・パートナーシップ）市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。** |
| **主要投資対象** | **インデックス マザーファンドＭＬＰ受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているＭＬＰやＭＬＰに関連する証券** |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | 主として、インデックス マザーファンドＭＬＰ受益証券および米国の金融商品取引所に上場されているＭＬＰやＭＬＰに関連する証券に投資を行ない、別に定めるＭＬＰ市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。<br>運用にあたって、対象指数に採用されていないＭＬＰ等についても、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は投資を行ないます。また、対象指数に採用されているＭＬＰ等の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合もあります。<br>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。<br>＜別に定めるＭＬＰ市場の動きをとらえる指数＞<br>S&P MLP 指数（円換算ベース）（※） |
| 主な投資制限 | ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。<br>②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>④デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。<br>⑤一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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 |
| ベンチマーク | S&P MLP 指数（円換算ベース）（2019年7月31日現在） |
| 決算日 | 年1回：11月20日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額。<br>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定する。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともある。<br>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行なう。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.154%（税抜　0.14%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2014年10月8日 |
| 信託期間 | 2014年10月8日から2024年11月20日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「S&P MLP 指数」とはS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、ニューヨーク証券取引所やNASDAQなどに上場するＭＬＰなどのうち、GICS（世界産業分類基準）においてエネルギーセクターまたは公益事業セクターのガス産業に属する銘柄を対象とした、浮動株調整後の時価総

**額加重を基本とする指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに日興アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。同指数は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが日興アセットマネジメント株式会社に付与されています。**

23.HYFI Loan Fund － JPY-USDクラス

| | |
|---|---|
| 投資顧問会社 | Credit Suisse Asset Management, LLC |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。 |
| 投資態度 | ①主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。<br>②ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。<br>③米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行ないます。<br>④米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。 |
| 主な投資制限 | ①第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。<br>②組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。<br>③組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。<br>④投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>⑤投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。<br>⑥投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。<br>⑦投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。<br>⑧流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。<br>⑨受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。 |
| ベンチマーク | クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス |
| 決算日 | 毎年12月31日 |
| 収益の分配 | 収益の分配は行いません。 |

| | |
|---|---|
| 信託報酬 | 年率0.65%<br>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。<br>※この他、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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2013年10月2日 |
| 関係法人 | ・投資顧問会社<br>Credit Suisse Asset Management, LLC<br>・受託会社<br>G.A.S. (Cayman) Limited<br>・管理事務代行会社<br>SMT Fund Services (Ireland) Limited<br>・保管受託銀行<br>State Street Bank and Trust Company |

24.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（※）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 米ドル建て債券 |
| 投資態度 | ①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。<br>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。<br>④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、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並びに委託者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（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。<br>⑤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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資割合は、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。<br>②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。<br>③同一銘柄の株式への投資割合は、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。<br>④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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、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。<br>⑤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割合は、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。<br>⑥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。<br>⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。<br>⑧一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およ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、委託者は、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。<br>⑨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。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2008年7月1日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index $^{SM}$）および「ブルームバーグ（Bloomberg $^{(R)}$）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

の利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

25.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。<br>＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2019年7月31日現在）<br>iShares Gold Trust<br>SPDR Gold Shares |
| 投資態度 | ①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。<br>②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。<br>③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>④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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | ＬＢＭＡ金価格（円ヘッジベース）（※）（2019年7月31日現在）<br>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。 |
| 決算日 | 年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2017年10月11日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※ＬＢＭＡ金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、ＬＢＭＡは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、ＬＢＭＡ金価格及びＬＢＭＡ金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

26.ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | ＢＮＰパリバ・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、ファミリーファンド方式により、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | 主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。 |
| 投資態度 | マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。<br>①当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象（海外の上場先物、為替取引など）の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）（※）を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。<br>②マザーファンドの組入れ比率は高位に保つことを原則とします。<br>③当ファンドは、原則として対円での為替ヘッジを行います。<br>④ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす状態になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時（原則として毎年8月15日）に分配対象収益の中から、収益分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。ただし、信託財産の状況によっては、分配を行わないことがあります。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.5775%（税抜　0.525%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2012年8月8日 |
| 信託期間 | 原則として2012年8月8日から2022年6月27日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※「HFRI総合指数（HFRI Weighted Composite Index）」（以下「HFR指数」といいます。）は、ヘッジ・ファンド・リサーチ・インク（HFR）の商標であり、「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」に関する使用を、ＢＮＰパリバ・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。この使用許諾以外に、HFR及びHFR指数（当該指数は当該投資信託と独立し、関係なく算出されている）は、当該投資信託と関係はなく、当該投資信託の設定、投資判断や他の事務や販売に関与しておらず、又は関与する予定はありません。HFRは、当該投資信託を発起、支持、販売又は推奨していません。HFRは、当該投資信託あるいは当該投資信託への投資に関する妥当性や、HFR指数の使用に起因して当該投資信託が得た結果即ちある特定の日における当該投資信託の運用成績がHFR指数の運用成績あるいはHFR指数の価値に追従するかどうかを含む運用成績について明示的あるいは暗示的な推奨、保証又は表明をしていません。HFRは当該投資信託や当該投資信託の投資家に対してHFR指数の過誤について通知する義務を負いません。HFRは、HFR指数の計算に使用される方法を含むHFR指数をいつでも修正、変更し、HFR指数の計算、公表そして周知を停止する権利を有します。これは、HFR指数に基づく有価証券の売買の申込み又は申込みの勧誘ではありません。

HFRは、当該投資信託及び当該投資信託の投資家に対して、HFR指数の過誤を含むいかなる種類、性質の損害も賠償する責任を負いません。

HFR指数に関して、HFRは、全ての明示的あるいは暗示的な保証（特定の目的に係る商品性又は適合性、権利及び非侵害性の保証を含むがこれに限らない）を明示的に否認します。

27.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY

| | |
|---|---|
| 管理会社 | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| 運用の基本方針 | 主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 |
| 主要投資対象 | わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。<br>なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 |
| 投資態度 | ①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。<br>②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。<br>③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。<br>⑤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。 |
| 主な投資制限 | ①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 毎年6月30日（休業日の場合は前営業日） |
| 収益の分配 | 収益の分配は行いません。 |
| 信託報酬 | 年率0.74%<br>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2011年5月24日 |
| 関係法人 | ・管理会社<br>BlueBay Funds Management Company S.A.<br>・投資顧問会社<br>BlueBay Asset Management LLP<br>・副投資顧問会社<br>BlueBay Asset Management USA LLC<br>・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行<br>Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. |

28.FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | KIM マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、Kairos Investment Management Ltd.が運用する外国投資信託証券「SuMi-KAIROS MULTI－STRATEGY FUND」（以下「スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。<br>※スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドは、様々なヘッジファンド等に分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。<br>②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日） |

| | |
|---|---|
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2016年1月20日 |
| 信託期間 | 原則として、2016年1月20日から2025年10月10日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

29.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR － Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。<br>※PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。<br>②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2016年1月20日 |
| 信託期間 | 原則として、2016年1月20日から2025年10月10日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

30.FOFs用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンク　マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（ＳＰＣ）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。<br>※MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。<br>②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日） |

| | |
|---|---|
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2016年1月20日 |
| 信託期間 | 原則として、2016年1月20日から2025年10月10日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

31.マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」ということがあります。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。<br>②ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りを用いる運用戦略を含みます。<br>③実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。<br>④信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。<br>⑤債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。<br>⑥有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。<br>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。<br>債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。<br>⑦為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。<br>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。<br>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。<br>⑧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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>④同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、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。<br>⑥同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>⑦外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>⑧デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。<br>⑨為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。<br>⑩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、委託者は、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。<br>⑪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。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①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。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。<br>③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.88%（税抜　0.8%） |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2013年4月2日 |
| 信託期間 | 2013年4月2日から2026年3月26日 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

32.Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A

| | |
|---|---|
| 投資顧問会社 | Numeric Investors LLC |
| 運用の基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要投資対象 | 主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。 |
| 投資態度 | ①主として世界の株式や株式関連の派生商品等に投資します。<br>②企業の財務情報、市場価格、その他のデータを収集し、モニタリングするシステム運用手法を用いてロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築します。 |
| 主な投資制限 | ①投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。<br>②投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。<br>③流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。<br>④受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。<br>⑤一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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 毎年12月の最終ファンド営業日 |
| 収益の分配 | 収益の分配は行いません。 |
| 運用報酬 | 年率1.5%<br>上記の他、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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2017年3月10日 |
| 信託期間 | 当該ファンドでは信託期間は定められておりません。 |
| 関係法人 | ・投資顧問会社<br>Numeric Investors LLC<br>・管理事務代行会社<br>State Street (Cayman) Trust, Limited<br>・保管受託銀行<br>STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY |

33.米国株式LSマザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | ①米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用※を行います。<br>※米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。<br>②米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。<br>④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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資割合には制限を設けません。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2017年10月10日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

34.コモディティLSアルファ・マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※１といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。<br>※1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。<br>※2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。 |
| 投資態度 | ①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。<br>②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>③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。 |
| 主な投資制限 | ①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。<br>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>④一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、委託者は、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。<br>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日） |

| | |
|---|---|
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 該当事項はありません。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2019年7月8日 |
| 信託期間 | 原則として無期限 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 |

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）および「ブルームバーグ（Bloomberg (R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

35.ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 |
| 主要投資対象 | 日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | 各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。<br>①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。<br>②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。<br>③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。<br>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。<br>＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞<br>①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。<br>②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。<br>③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。<br>④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。<br>⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。<br>＜野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度＞<br>①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。<br>②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。<br>③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。<br>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。<br>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。<br>④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。<br>⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。<br>⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。<br>⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。<br>⑧投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。<br>⑨一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、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。<br>⑩一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およびデリバティブ等エクスポージャーの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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日） |
| 収益の分配 | 期中無分配とします。 |
| 信託報酬 | 純資産総額に対し、年率0.506%（税抜　0.46%） |
| 信託財産留保額 | 解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額 |
| 設定日 | 2019年4月10日 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |

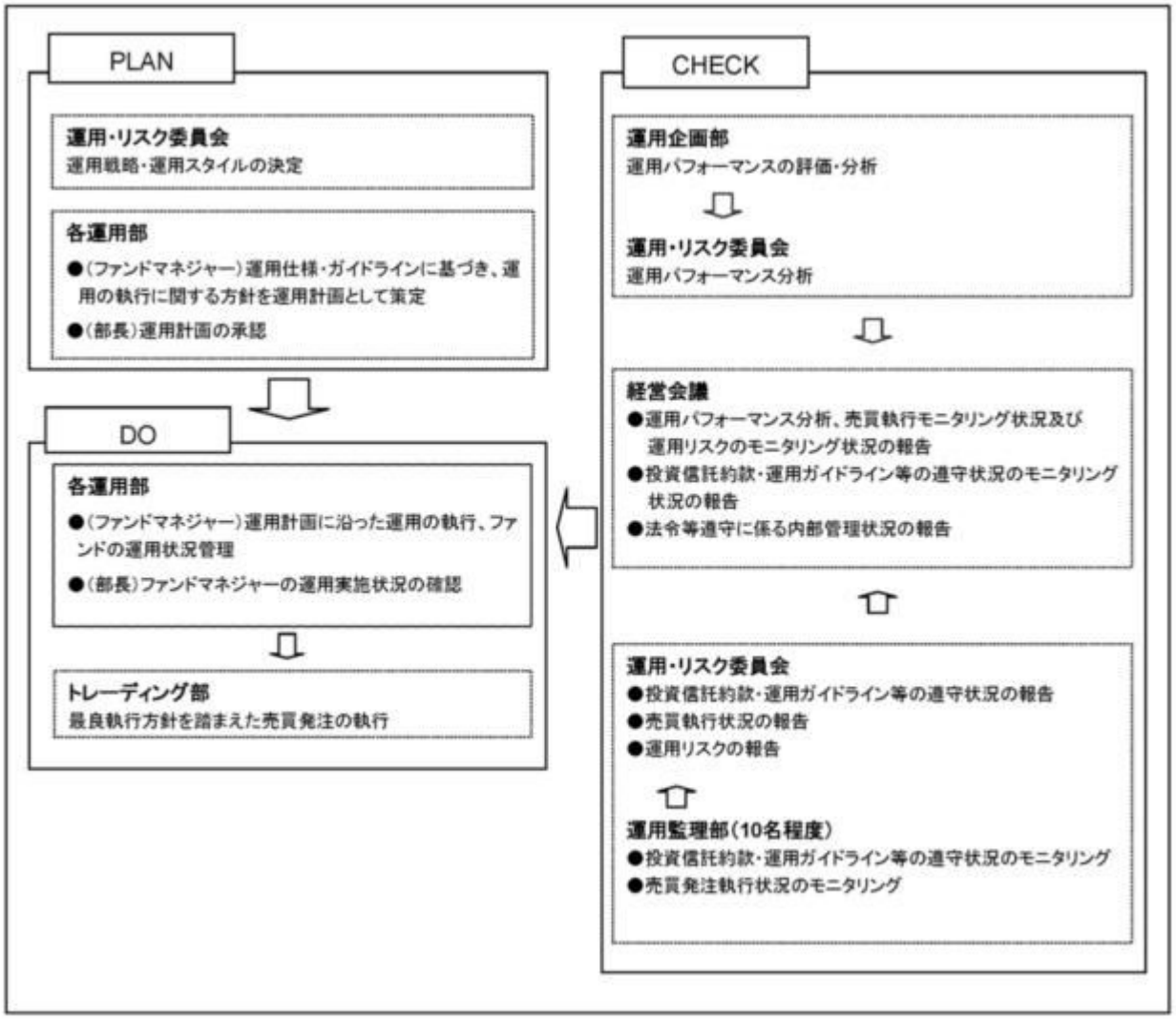
36.MA Hedge Fund Strategies Limited（★）

| | |
|---|---|
| 運用会社 | UBS O'Connor LLC |
| 運用の基本方針 | 主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業の案件成立前の株価の差異（スプレッド）を捉え、収益を積み上げることを目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 世界各国（日本を含みます。）の企業の株式を主要投資対象とします。なお、上場デリバティブ商品等に投資することがあります。 |

| | |
|---|---|
| 投資態度 | ①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。<br>②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。<br>③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。 |
| 主な投資制限 | ①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。<br>②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。<br>③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。<br>④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。<br>⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>⑥一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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。<br>⑦投資信託証券への投資は行いません。<br>⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| ベンチマーク | 該当事項はありません。 |
| 決算日 | 年1回：12月31日 |
| 収益の分配 | 該当事項はありません。 |
| 信託報酬 | 運用報酬：年率0.6%<br>成功報酬：15%<br>月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。 |
| 信託財産留保額 | 該当事項はありません。 |
| 設定日 | 2019年10月10日 |
| 関係法人 | ・運用会社<br>UBS O'Connor LLC<br>・保管銀行・管理事務代行会社<br>MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited |

（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．投資信託証券への投資割合**

**投資信託証券への投資割合には制限を設けません。**

**ロ．株式への投資**

**株式への直接投資は行いません。**

**ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合**

**同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。**

**ニ．外貨建資産への投資割合**

**外貨建資産への投資割合には制限を設けません。**

**ホ．デリバティブの利用**

**デリバティブの直接利用は行いません。**

**ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲**

**（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。**

**（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。**

**（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。**

**（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。**

**ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限**

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

**チ．外国為替予約取引の指図**

**委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。**

**リ．資金の借入れ**

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

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

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

**（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。**

ヌ．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、委託者は、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。

＜その他の投資制限＞

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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ないものとします。

## 3【投資リスク】

### (1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①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。

②金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、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。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等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。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

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

④ＭＬＰの価格変動リスク

ＭＬＰ（マスター・リミテッド・パートナーシップ）の多くは、エネルギー、天然資源に関わる事業を主な投資対象とするため、ＭＬＰの価格は、事業を取り巻く環境やエネルギー市況の変化、金利変動等の要因により変動し、基準価額の変動要因となります。

⑤商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

**⑥為替変動リスク**

**為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。**

**⑦信用リスク**

**有価証券等の発行体等が財政難、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、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、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るリスクがより高いものになると想定されます。**

**⑧米国地方債に関する信用リスク**

**米国地方債は、元利償還財源の相違によって「レベニュー債」と「一般財源保証債」に大別されます。**

**＜レベニュー債＞**

**レベニュー債は、特定事業（例としては、空港、上下水道、公立病院、公立学校の整備・運営等）から生じる収入等を元利償還財源として発行されます。このため、発行体である地方公共団体や公的機関等が、レベニュー債の裏付けとしてあらかじめ定められた特定事業以外の事業等から生じた資金を保有していたとしても、その資金がレベニュー債の元利償還に充当されることはありません。したがって、発行体である地方公共団体や公的機関等の財政状況にかかわらず、レベニュー債の裏付けとなる特定事業が不振となり、当該レベニュー債に係る元利払いができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、レベニュー債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。**

**＜一般財源保証債＞**

**一般財源保証債は、起債する地方公共団体の課税権を含む全信用力を担保として発行され、発行体が元利償還の全責任を負います。したがって、発行体である地方公共団体が財政難、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、一般財源保証債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。**

**⑨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。**

**⑩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。**

**⑪資産等の選定・配分に係るリスク**

**ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比**

率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

⑫ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

⑬仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑭ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被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＞

①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象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。

②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。**

**③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10月～2019年7月の4年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年8月～2019年7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について

| | |
|---|---|
| 日本株<br>TOPIX(東証株価指数、配当込み) | 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。 |
| 先進国株<br>MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み、円ベース) | 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。 |
| 新興国株<br>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) | 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。 |
| 日本国債<br>NOMURA-BPI国債 | 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。 |
| 先進国債<br>FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース) | FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または算定につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債<br>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・ディバーシファイド(円ベース) | 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. |

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

## 4【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

**①取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（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。）。

②「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。

③上記①及び②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：https://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＞
当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンド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

①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1.518%（税抜　1.38%）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　0.968%　　（税抜　0.88%） | 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　0.495%　　（税抜　0.45%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率　0.055%　　（税抜　0.05%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

**（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等**

**各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。**
**当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。**
**なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。**

| ファンド名 | 信託報酬 |
|---|---|
| FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用） | 年率　0.077%　（税抜　0.07%） |
| FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用） | 年率　0.066%　（税抜　0.06%） |
| ＦＯＦｓ用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.374%　（税抜　0.34%） |
| 国内株式インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.517%　（税抜　0.47%） |
| 国内債券インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 日本債券ツイン戦略マザーファンド | ありません。 |
| FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.066%　（税抜　0.06%） |
| FOFs用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 年率　0.066%　（税抜　0.06%） |
| マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用） | 毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。<br>新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬<br>0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率　0.264%（税抜　0.24%）<br>0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297%（税抜　0.27%）<br>１%以上の場合 ・・・・・・・・・年率　0.33%（税抜　0.3%） |
| Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class | 年率　0.44% |
| 外国株式インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 外国債券インデックス マザーファンド | ありません。 |
| 新興国株式インデックス マザーファンド | ありません。 |
| Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J | 年率　0.8% |
| 新興国債券インデックス マザーファンド | ありません。 |

| | | |
|---|---|---|
| FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 年率　0.066% | （税抜　0.06%） |
| 大和住銀／ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.759%以内 | （税抜　0.69%以内） |
| LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.33% | （税抜　0.3%） |
| J-REITインデックス マザーファンド | ありません。 | |
| グローバルREITインデックス マザーファンド | ありません。 | |
| ＦＯＦｓ用ＭＬＰインデックスファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.154% | （税抜　0.14%） |
| HYFI Loan Fund － JPY-USDクラス | 年率　0.65% | |
| グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド | ありません。 | |
| ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり） | ありません。 | |
| ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 年率　0.5775% | （税抜　0.525%） |
| BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY | 年率　0.74% | |
| FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.066% | （税抜　0.06%） |
| FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.066% | （税抜　0.06%） |
| FOFs用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.066% | （税抜　0.06%） |
| マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.88% | （税抜　0.8%） |
| Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral - Class A | 年率　1.5% | |
| 米国株式LSマザーファンド | ありません。 | |
| コモディティLSアルファ・マザーファンド | ありません。 | |
| ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 年率　0.506% | （税抜　0.46%） |
| MA Hedge Fund Strategies Limited | 運用報酬：年率　0.6%<br>成功報酬：15%<br>月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。 | |

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.00946%程度（税抜　1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））

（４）【その他の手数料等】

①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（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②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。

③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（※）、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（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④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。

⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（※）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

⑥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

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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

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。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）

《　仕組み債券の費用にかかる記載　》

・FOFs用 KIM マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。

・円建債券の連動対象となるスミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドにおいては、運用報酬（スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドの純資産総額に対して年率0.725%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

・スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドが組み入れるヘッジファンド等は、一般的に固定

報酬（各ヘッジファンド等の純資産総額に対して年率1.0%～2.0%程度）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。

・円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOFs用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。

・円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。

・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。

・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（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。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」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。

②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。）

③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「④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。）

④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。

※2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2019年 7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

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

## 5【運用状況】

以下は、2019年7月31日現在の状況について記載してあります。

### 【コア投資戦略ファンド（切替型）】

#### （1）【投資状況】

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 13,551,895,946 | 42.96 |
| | ケイマン | 3,175,275,219 | 10.07 |
| | ルクセンブルク | 508,171,312 | 1.61 |
| | 小計 | 17,235,342,477 | 54.64 |
| 投資証券 | ルクセンブルク | 1,440,817,439 | 4.57 |
| | ケイマン | 198,727,879 | 0.63 |
| | 小計 | 1,639,545,318 | 5.20 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 12,438,962,328 | 39.43 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 230,155,669 | 0.73 |
| 合計(純資産総額) | | 31,544,005,792 | 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】

##### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 2,926,386,998 | 1.1265 | 3,296,574,953 | 1.1287 | 3,303,013,004 | 10.47 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス　マザーファンド | 1,119,077,753 | 2.6386 | 2,952,798,560 | 2.6441 | 2,958,953,486 | 9.38 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり） | 1,969,262,226 | 1.0200 | 2,008,647,470 | 1.0435 | 2,054,925,132 | 6.51 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド | 1,037,555,577 | 1.9412 | 2,014,102,886 | 1.9677 | 2,041,598,108 | 6.47 |
| 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 | 633,079,220 | 2.7932 | 1,768,316,877 | 2.7832 | 1,761,986,085 | 5.59 |
| ケイマン | 投資信託受益証券 | Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class | 172,260.0737 | 9,259.56 | 1,595,053,073 | 9,230.79 | 1,590,097,185 | 5.04 |
| ケイマン | 投資信託受益証券 | HYFI Loan Fund－JPY-USD クラス | 1,394,601.4263 | 1,130.75 | 1,576,957,137 | 1,136.65 | 1,585,178,034 | 5.03 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ルクセンブルク | 投資証券 | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY | 144,280.996 | 9,915.23 | 1,430,579,259 | 9,986.19 | 1,440,817,439 | 4.57 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 米国株式ＬＳマザーファンド | 1,088,610,280 | 1.0662 | 1,160,676,280 | 1.0772 | 1,172,650,993 | 3.72 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用) | 808,036,704 | 1.4461 | 1,168,501,877 | 1.445 | 1,167,613,037 | 3.70 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 973,921,482 | 1.2011 | 1,169,777,092 | 1.1954 | 1,164,225,739 | 3.69 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 1,027,926,422 | 1.0681 | 1,097,928,211 | 1.0714 | 1,101,320,368 | 3.49 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 937,763,700 | 1.011 | 948,079,100 | 1.0117 | 948,735,535 | 3.01 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド | 484,111,071 | 1.9469 | 942,515,844 | 1.9085 | 923,925,979 | 2.93 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＦＯＦｓ用　ＫＩＭ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 888,317,115 | 1.0129 | 899,776,405 | 1.0135 | 900,309,396 | 2.85 |
| 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 | 544,973,808 | 1.4477 | 788,958,581 | 1.4422 | 785,961,225 | 2.49 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＦＯＦｓ用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 720,626,732 | 1.045 | 753,054,934 | 1.0496 | 756,369,817 | 2.40 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 738,093,911 | 1.0111 | 746,286,753 | 1.011 | 746,212,944 | 2.37 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用) | 723,199,524 | 0.9832 | 711,049,771 | 0.9807 | 709,241,773 | 2.25 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド | 2,038,753,933 | 0.2961 | 603,675,039 | 0.2951 | 601,636,285 | 1.91 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | 大和住銀／ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用） | 546,622,479 | 0.9709 | 530,715,764 | 0.9741 | 532,464,956 | 1.69 |
| ルクセンブルク | 投資信託受益証券 | Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J | 52,703.932 | 9,619 | 506,959,121 | 9,642 | 508,171,312 | 1.61 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用） | 408,216,234 | 1.2079 | 493,084,389 | 1.2116 | 494,594,789 | 1.57 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＦＯＦｓ用ＭＡＮ　ＡＨＬ　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 498,169,075 | 0.9526 | 474,555,860 | 0.9662 | 481,330,960 | 1.53 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用） | 438,109,232 | 0.8762 | 383,871,309 | 0.8712 | 381,680,762 | 1.21 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用) | 332,407,387 | 0.9555 | 317,615,258 | 0.9586 | 318,645,721 | 1.01 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＬＭ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用） | 247,672,869 | 1.0439 | 258,545,707 | 1.0427 | 258,248,500 | 0.82 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＦＯＦｓ用ＭＬＰインデックスファンド（適格機関投資家専用） | 362,798,972 | 0.6409 | 232,517,861 | 0.6336 | 229,869,428 | 0.73 |
| ケイマン | 投資証券 | Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A | 23,396 | 8,532.25 | 199,620,628 | 8,494.09 | 198,727,879 | 0.63 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックス　マザーファンド | 79,323,611 | 1.7258 | 136,896,687 | 1.7312 | 137,325,035 | 0.44 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

**(注2)投資比率は、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（%） |
|---|---|
| 投資信託受益証券 | 54.64 |
| 投資証券 | 5.20 |
| 親投資信託受益証券 | 39.43 |

| | |
|---|---|
| 合計 | 99.27 |

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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 7月10日) | 8,047,177,409 | 8,047,177,409 | 10,389 | 10,389 |
| 第2期計算期間末 (2015年 7月10日) | 27,366,014,831 | 27,366,014,831 | 10,787 | 10,787 |
| 第3期計算期間末 (2016年 7月11日) | 30,311,407,780 | 30,311,407,780 | 10,121 | 10,121 |
| 第4期計算期間末 (2017年 7月10日) | 27,946,158,080 | 27,946,158,080 | 10,720 | 10,720 |
| 第5期計算期間末 (2018年 7月10日) | 31,588,404,244 | 31,588,404,244 | 10,895 | 10,895 |
| 第6期計算期間末 (2019年 7月10日) | 31,612,123,675 | 31,612,123,675 | 10,862 | 10,862 |
| 2018年 7月末日 | 32,155,388,045 | — | 10,938 | — |
| 8月末日 | 32,745,990,793 | — | 10,895 | — |
| 9月末日 | 33,838,157,083 | — | 11,016 | — |
| 10月末日 | 32,171,182,902 | — | 10,572 | — |
| 11月末日 | 32,387,092,879 | — | 10,672 | — |
| 12月末日 | 30,837,610,479 | — | 10,290 | — |
| 2019年 1月末日 | 31,534,622,964 | — | 10,516 | — |
| 2月末日 | 31,994,694,099 | — | 10,700 | — |
| 3月末日 | 31,781,819,861 | — | 10,727 | — |
| 4月末日 | 31,779,392,239 | — | 10,836 | — |
| 5月末日 | 30,987,787,003 | — | 10,578 | — |
| 6月末日 | 31,429,003,534 | — | 10,766 | — |
| 7月末日 | 31,544,005,792 | — | 10,885 | — |

②【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10月17日～2014年 7月10日 | 0 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0 |

③【収益率の推移】

| | 期　間 | 収益率（%） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年10月17日～2014年 7月10日 | 3.9 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 3.8 |
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | △6.2 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 5.9 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 1.6 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | △0.3 |

(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10月17日～2014年 7月10日 | 7,756,133,400 | 10,141,270 | 7,745,992,130 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 17,904,927,940 | 280,776,696 | 25,370,143,374 |
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 5,892,656,977 | 1,314,548,833 | 29,948,251,518 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 1,610,441,134 | 5,489,774,092 | 26,068,918,560 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 10,500,659,721 | 7,576,138,726 | 28,993,439,555 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 7,219,577,787 | 7,109,737,294 | 29,103,280,048 |

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 日本 | 284,452,460,560 | 98.96 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 3,001,484,408 | 1.04 |
| 合計(純資産総額) | | 287,453,944,968 | 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 | 2,975,400,000 | 1.04 |

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 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 | 1,414,100 | 6,598.30 | 9,330,660,283 | 7,024.00 | 9,932,638,400 | 3.46 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 988,000 | 5,252.11 | 5,189,092,039 | 5,628.00 | 5,560,464,000 | 1.93 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 851,600 | 5,336.51 | 4,544,578,428 | 6,170.00 | 5,254,372,000 | 1.83 |
| 日本 | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 8,615,500 | 506.22 | 4,361,376,574 | 524.20 | 4,516,245,100 | 1.57 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 851,700 | 4,926.09 | 4,195,558,320 | 4,922.00 | 4,192,067,400 | 1.46 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1,107,800 | 3,843.12 | 4,257,415,240 | 3,635.00 | 4,026,853,000 | 1.40 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 62,300 | 62,811.43 | 3,913,152,364 | 63,130.00 | 3,932,999,000 | 1.37 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 882,100 | 3,818.90 | 3,368,652,288 | 3,807.00 | 3,358,154,700 | 1.17 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 868,600 | 3,613.01 | 3,138,264,580 | 3,718.00 | 3,229,454,800 | 1.12 |
| 日本 | 株式 | ＫＤＤＩ | 情報・通信業 | 1,020,800 | 2,793.39 | 2,851,502,448 | 2,853.50 | 2,912,852,800 | 1.01 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 72,600 | 38,993.27 | 2,830,911,780 | 40,100.00 | 2,911,260,000 | 1.01 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,070,500 | 2,760.61 | 2,955,235,984 | 2,710.50 | 2,901,590,250 | 1.01 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 17,006,500 | 155.34 | 2,641,820,632 | 154.40 | 2,625,803,600 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 447,500 | 5,556.01 | 2,486,316,714 | 5,797.00 | 2,594,157,500 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 877,000 | 2,846.37 | 2,496,267,850 | 2,936.50 | 2,575,310,500 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 113,600 | 22,751.35 | 2,584,553,584 | 21,920.00 | 2,490,112,000 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 308,100 | 8,668.85 | 2,670,873,499 | 7,979.00 | 2,458,329,900 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 219,000 | 9,269.25 | 2,029,965,825 | 11,155.00 | 2,442,945,000 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 363,100 | 5,416.66 | 1,966,789,549 | 6,647.00 | 2,413,525,700 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 120,600 | 18,397.62 | 2,218,753,140 | 19,530.00 | 2,355,318,000 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 173,200 | 13,797.74 | 2,389,769,456 | 13,585.00 | 2,352,922,000 | 0.82 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 225,600 | 10,434.53 | 2,354,030,426 | 10,005.00 | 2,257,128,000 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 152,700 | 13,722.63 | 2,095,445,824 | 14,715.00 | 2,246,980,500 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 571,300 | 3,776.89 | 2,157,739,663 | 3,892.00 | 2,223,499,600 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | ＨＯＹＡ | 精密機器 | 255,500 | 7,883.97 | 2,014,355,303 | 8,405.00 | 2,147,477,500 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 143,300 | 13,448.09 | 1,927,111,310 | 14,440.00 | 2,069,252,000 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | ＮＴＴドコモ | 情報・通信業 | 788,500 | 2,513.85 | 1,982,173,000 | 2,615.00 | 2,061,927,500 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 683,200 | 3,077.16 | 2,102,317,380 | 2,970.50 | 2,029,445,600 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 資生堂 | 化学 | 252,100 | 8,051.78 | 2,029,854,104 | 8,046.00 | 2,028,396,600 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | セブン＆アイ・ホールディングス | 小売業 | 523,900 | 3,757.41 | 1,968,509,591 | 3,728.00 | 1,953,099,200 | 0.68 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.11 |
| | | 鉱業 | 0.27 |
| | | 建設業 | 2.75 |
| | | 食料品 | 3.99 |
| | | 繊維製品 | 0.63 |
| | | パルプ・紙 | 0.26 |
| | | 化学 | 7.26 |
| | | 医薬品 | 5.53 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.58 |
| | | ゴム製品 | 0.75 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.83 |
| | | 鉄鋼 | 0.84 |
| | | 非鉄金属 | 0.74 |
| | | 金属製品 | 0.58 |
| | | 機械 | 4.99 |
| | | 電気機器 | 13.72 |
| | | 輸送用機器 | 7.66 |
| | | 精密機器 | 2.12 |
| | | その他製品 | 2.17 |
| | | 電気・ガス業 | 1.68 |
| | | 陸運業 | 4.62 |
| | | 海運業 | 0.17 |
| | | 空運業 | 0.54 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.20 |
| | | 情報・通信業 | 8.94 |
| | | 卸売業 | 4.90 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 小売業 | 4.59 |
| | | 銀行業 | 5.75 |
| | | 証券、商品先物取引業 | 0.71 |
| | | 保険業 | 2.36 |
| | | その他金融業 | 1.08 |
| | | 不動産業 | 2.40 |
| | | サービス業 | 5.22 |
| | | 小計 | 98.96 |
| 合計 | | | 98.96 |

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 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 | 190 | 円 | 2,941,494,290 | 2,975,400,000 | 1.04 |

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

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

## 外国株式インデックス　マザーファンド

## 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | アメリカ | 222,672,947,820 | 62.23 |
| | イギリス | 20,743,278,892 | 5.80 |
| | カナダ | 13,062,661,847 | 3.65 |
| | スイス | 12,739,839,989 | 3.56 |
| | フランス | 12,649,940,092 | 3.54 |
| | ドイツ | 10,663,277,556 | 2.98 |
| | オーストラリア | 8,109,956,449 | 2.27 |
| | アイルランド | 6,354,168,025 | 1.78 |
| | オランダ | 6,305,516,781 | 1.76 |
| | スペイン | 3,626,329,028 | 1.01 |
| | 香港 | 3,374,016,585 | 0.94 |
| | スウェーデン | 2,995,249,918 | 0.84 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | イタリア | 2,357,004,564 | 0.66 |
| | デンマーク | 2,095,017,835 | 0.59 |
| | シンガポール | 1,567,177,864 | 0.44 |
| | バミューダ | 1,495,981,186 | 0.42 |
| | フィンランド | 1,430,568,787 | 0.40 |
| | ベルギー | 1,312,233,343 | 0.37 |
| | ジャージー | 987,527,809 | 0.28 |
| | ケイマン | 838,686,401 | 0.23 |
| | ノルウェー | 820,356,046 | 0.23 |
| | イスラエル | 740,278,035 | 0.21 |
| | キュラソー | 489,842,355 | 0.14 |
| | ルクセンブルク | 359,137,587 | 0.10 |
| | ニュージーランド | 338,982,691 | 0.09 |
| | オーストリア | 296,461,216 | 0.08 |
| | ポルトガル | 198,247,006 | 0.06 |
| | パナマ | 180,806,280 | 0.05 |
| | リベリア | 174,967,018 | 0.05 |
| | パプアニューギニア | 62,727,913 | 0.02 |
| | 英ヴァージン諸島 | 44,947,520 | 0.01 |
| | マン島 | 34,089,831 | 0.01 |
| | モーリシャス | 10,295,081 | 0.00 |
| | 小計 | 339,132,519,350 | 94.77 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 180,057,901 | 0.05 |
| | 香港 | 89,470,490 | 0.03 |
| | 小計 | 269,528,391 | 0.08 |
| 投資証券 | アメリカ | 7,527,355,411 | 2.10 |
| | オーストラリア | 659,286,972 | 0.18 |
| | フランス | 366,879,844 | 0.10 |
| | 香港 | 230,002,773 | 0.06 |
| | イギリス | 203,737,206 | 0.06 |
| | シンガポール | 156,287,562 | 0.04 |
| | カナダ | 66,195,696 | 0.02 |
| | 小計 | 9,209,745,464 | 2.57 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 9,218,077,540 | 2.58 |
| 合計(純資産総額) | | 357,829,870,745 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

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

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 6,070,603,845 | 1.70 |
| | 買建 | カナダ | 340,234,998 | 0.10 |
| | 買建 | ドイツ | 1,436,095,128 | 0.40 |
| | 買建 | イギリス | 621,024,426 | 0.17 |
| | 買建 | オーストラリア | 366,809,378 | 0.10 |

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

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

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | — | 43,452,000 | 0.01 |
| | 売建 | — | 282,656,800 | △0.08 |

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 608,377 | 13,706.02 | 8,338,428,789 | 15,247.62 | 9,276,303,746 | 2.59 |
| 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 | 393,573 | 19,362.90 | 7,620,717,475 | 22,681.85 | 8,926,967,371 | 2.49 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 小売 | 34,845 | 199,509.75 | 6,951,917,420 | 206,256.29 | 7,187,000,746 | 2.01 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | メディア・娯楽 | 198,937 | 20,023.43 | 3,983,402,765 | 21,406.42 | 4,258,530,090 | 1.19 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 26,200 | 123,214.05 | 3,228,208,267 | 133,099.20 | 3,487,199,291 | 0.97 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 272,920 | 11,789.61 | 3,217,621,125 | 12,557.69 | 3,427,246,829 | 0.96 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 24,947 | 123,801.79 | 3,088,483,464 | 133,409.91 | 3,328,177,274 | 0.93 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 222,390 | 14,891.28 | 3,311,672,826 | 14,349.17 | 3,191,112,183 | 0.89 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 254,925 | 10,832.54 | 2,761,486,687 | 11,537.01 | 2,941,072,835 | 0.82 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 353,018 | 7,888.35 | 2,784,729,681 | 8,186.02 | 2,889,813,820 | 0.81 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 145,818 | 17,785.45 | 2,593,439,390 | 19,721.41 | 2,875,737,905 | 0.80 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 208,359 | 11,348.53 | 2,364,569,279 | 13,081.34 | 2,725,615,421 | 0.76 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 764,204 | 3,031.05 | 2,316,345,120 | 3,355.88 | 2,564,584,256 | 0.72 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 108,603 | 21,695.40 | 2,356,186,395 | 22,576.47 | 2,451,873,284 | 0.69 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO | メディア・娯楽 | 149,862 | 14,407.83 | 2,159,187,238 | 15,745.19 | 2,359,606,443 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CLASS A | ソフトウェア・サービス | 76,003 | 27,532.63 | 2,092,562,873 | 30,219.30 | 2,296,757,640 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 606,346 | 3,468.87 | 2,103,338,602 | 3,713.31 | 2,251,553,818 | 0.63 |
| 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 | 366,517 | 5,858.95 | 2,147,406,683 | 6,134.90 | 2,248,545,436 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 小売 | 94,028 | 20,809.99 | 1,956,721,927 | 23,613.99 | 2,220,376,289 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 80,049 | 26,297.39 | 2,105,080,444 | 27,695.59 | 2,217,004,700 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 158,168 | 12,853.19 | 2,032,964,685 | 13,508.29 | 2,136,580,415 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 電気通信サービス | 343,914 | 6,380.42 | 2,194,318,240 | 6,152.28 | 2,115,856,324 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 374,310 | 4,733.44 | 1,771,775,723 | 5,616.68 | 2,102,382,485 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO | 食品・飲料・タバコ | 337,999 | 5,334.22 | 1,802,962,378 | 5,836.14 | 1,972,609,754 | 0.55 |
| 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 | 463,115 | 4,552.01 | 2,108,106,890 | 4,214.14 | 1,951,634,040 | 0.55 |
| 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 | 215,219 | 8,719.44 | 1,876,590,535 | 9,046.45 | 1,946,968,525 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 358,909 | 4,952.89 | 1,777,639,525 | 5,274.47 | 1,893,055,471 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア・娯楽 | 375,711 | 4,613.94 | 1,733,508,312 | 4,788.85 | 1,799,224,073 | 0.50 |
| 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 | 180,050 | 9,706.71 | 1,747,694,180 | 9,956.90 | 1,792,739,881 | 0.50 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING GENUSS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 58,319 | 29,500.91 | 1,720,463,600 | 29,221.09 | 1,704,145,273 | 0.48 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 5.66 |
| | | 素材 | 4.29 |
| | | 資本財 | 6.83 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 商業・専門サービス | 1.22 |
| | | 運輸 | 1.91 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.07 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.84 |
| | | 消費者サービス | 1.91 |
| | | メディア・娯楽 | 5.94 |
| | | 小売 | 4.75 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.45 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 4.90 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 2.12 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 4.79 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.55 |
| | | 銀行 | 7.65 |
| | | 各種金融 | 4.16 |
| | | 保険 | 3.85 |
| | | 不動産 | 0.56 |
| | | ソフトウェア・サービス | 9.50 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.24 |
| | | 電気通信サービス | 2.26 |
| | | 公益事業 | 3.33 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 3.01 |
| | | 小計 | 94.77 |
| 投資信託受益証券 | — | — | 0.08 |
| 投資証券 | — | — | 2.57 |
| 合計 | | | 97.42 |

(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 | 371 | アメリカドル | 55,378,847 | 6,016,357,937 | 55,878,165 | 6,070,603,845 | 1.70 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 21 | カナダドル | 4,127,622.5 | 341,230,551 | 4,115,580 | 340,234,998 | 0.10 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 32 | スイスフラン | 3,177,384 | 348,654,346 | 3,154,880 | 346,184,982 | 0.10 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOX | 買建 | 260 | ユーロ | 9,096,640 | 1,102,421,802 | 8,993,400 | 1,089,910,146 | 0.30 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 29 | オーストラリアドル | 4,817,653 | 359,348,737 | 4,917,675 | 366,809,378 | 0.10 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 | 買建 | 62 | イギリスポンド | 4,617,667.5 | 609,393,580 | 4,705,800 | 621,024,426 | 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。

| 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 | 400,000.00 | 43,548,000 | 43,452,000 | 0.01 |
| | アメリカドル | 売建 | 1,900,000.00 | 206,378,000 | 206,378,000 | △0.06 |
| | ユーロ | 売建 | 200,000.00 | 24,235,200 | 24,238,000 | △0.01 |
| | デンマーククローネ | 売建 | 1,400,000.00 | 22,715,000 | 22,722,000 | △0.01 |
| | シンガポールドル | 売建 | 370,000.00 | 29,318,060 | 29,318,800 | △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。

## 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 | 177,199,834,284 | 46.19 |
| | フランス | 37,698,658,131 | 9.83 |
| | イタリア | 33,539,809,854 | 8.74 |
| | ドイツ | 24,871,032,866 | 6.48 |
| | イギリス | 23,470,454,403 | 6.12 |
| | スペイン | 21,883,030,100 | 5.70 |
| | ベルギー | 9,550,639,997 | 2.49 |
| | オーストラリア | 7,541,268,950 | 1.97 |
| | オランダ | 7,488,630,693 | 1.95 |
| | カナダ | 7,223,060,600 | 1.88 |
| | オーストリア | 5,584,203,171 | 1.46 |
| | メキシコ | 2,895,541,096 | 0.75 |
| | アイルランド | 2,746,016,864 | 0.72 |
| | ポーランド | 2,283,389,362 | 0.60 |
| | フィンランド | 2,211,849,782 | 0.58 |
| | 南アフリカ | 2,149,443,845 | 0.56 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | デンマーク | 1,975,380,963 | 0.51 |
| | マレーシア | 1,761,629,112 | 0.46 |
| | シンガポール | 1,607,662,953 | 0.42 |
| | スウェーデン | 1,307,741,704 | 0.34 |
| | ノルウェー | 907,989,739 | 0.24 |
| | 小計 | 375,897,268,469 | 97.98 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 7,730,945,483 | 2.02 |
| 合計(純資産総額) | | 383,628,213,952 | 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 | 1,509,266,785 | 0.39 |
| | 買建 | ドイツ | 1,813,076,325 | 0.47 |

(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 | ― | 4,288,216,600 | 1.12 |

(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 1.625% 07/31/20 | 24,000,000 | 10,808.57 | 2,594,058,342 | 10,823.26 | 2,597,582,400 | 1.625 | 2020/7/31 | 0.68 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 05/31/23 | 20,000,000 | 11,228.59 | 2,245,719,168 | 11,231.08 | 2,246,216,870 | 2.750 | 2023/5/31 | 0.59 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 05/15/27 | 18,750,000 | 11,102.95 | 2,081,804,650 | 11,182.28 | 2,096,677,743 | 2.375 | 2027/5/15 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 01/31/26 | 18,000,000 | 11,292.04 | 2,032,567,488 | 11,327.41 | 2,038,935,150 | 2.625 | 2026/1/31 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.125% 12/31/21 | 18,500,000 | 10,934.72 | 2,022,923,311 | 10,939.11 | 2,023,736,154 | 2.125 | 2021/12/31 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 08/15/46 | 19,200,000 | 10,015.15 | 1,922,909,327 | 10,162.08 | 1,951,120,090 | 2.250 | 2046/8/15 | 0.51 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 05/15/23 | 17,500,000 | 10,735.41 | 1,878,697,511 | 10,833.02 | 1,895,778,614 | 1.750 | 2023/5/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 12/31/25 | 16,700,000 | 11,180.58 | 1,867,157,495 | 11,324.87 | 1,891,253,507 | 2.625 | 2025/12/31 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 08/15/28 | 15,920,000 | 11,423.32 | 1,818,593,546 | 11,618.53 | 1,849,671,376 | 2.875 | 2028/8/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 02/15/46 | 16,500,000 | 10,448.11 | 1,723,938,562 | 10,708.67 | 1,766,932,002 | 2.500 | 2046/2/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 02/15/49 | 14,970,000 | 11,693.54 | 1,750,524,152 | 11,802.71 | 1,766,866,808 | 3.000 | 2049/2/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 09/30/25 | 15,000,000 | 11,415.26 | 1,712,289,473 | 11,552.33 | 1,732,850,446 | 3.000 | 2025/9/30 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 09/30/20 | 15,970,000 | 10,775.44 | 1,720,838,939 | 10,789.31 | 1,723,052,807 | 1.375 | 2020/9/30 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 05/15/46 | 16,000,000 | 10,441.32 | 1,670,611,600 | 10,702.73 | 1,712,438,000 | 2.500 | 2046/5/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 02/15/29 | 15,000,000 | 11,332.02 | 1,699,803,168 | 11,402.95 | 1,710,443,445 | 2.625 | 2029/2/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 11/15/28 | 14,400,000 | 11,660.97 | 1,679,180,588 | 11,857.88 | 1,707,535,628 | 3.125 | 2028/11/15 | 0.45 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 01/31/23 | 15,000,000 | 11,079.21 | 1,661,882,376 | 11,066.00 | 1,659,900,375 | 2.375 | 2023/1/31 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 04/30/24 | 15,000,000 | 11,049.77 | 1,657,466,160 | 11,063.45 | 1,659,518,446 | 2.250 | 2024/4/30 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.75% 11/15/43 | 12,500,000 | 13,068.30 | 1,633,537,929 | 13,266.81 | 1,658,351,413 | 3.750 | 2043/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/28 | 14,260,000 | 11,419.93 | 1,628,482,203 | 11,610.05 | 1,655,593,315 | 2.875 | 2028/5/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 01/15/22 | 15,000,000 | 10,981.12 | 1,647,169,125 | 11,037.14 | 1,655,571,750 | 2.500 | 2022/1/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 11/30/21 | 15,050,000 | 10,835.21 | 1,630,699,165 | 10,843.20 | 1,631,902,450 | 1.750 | 2021/11/30 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 11/15/27 | 14,650,000 | 10,883.52 | 1,594,435,871 | 11,071.94 | 1,622,039,766 | 2.250 | 2027/11/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.625% 08/31/22 | 15,000,000 | 10,806.09 | 1,620,914,232 | 10,800.76 | 1,620,115,223 | 1.625 | 2022/8/31 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 10/31/22 | 14,650,000 | 10,800.76 | 1,582,312,533 | 10,883.09 | 1,594,373,687 | 1.875 | 2022/10/31 | 0.42 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.75% 04/25/21 | 11,370,000 | 13,118.93 | 1,491,623,249 | 13,060.28 | 1,484,954,147 | 3.750 | 2021/4/25 | 0.39 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 4.5% 04/25/41 | 6,640,000 | 20,678.61 | 1,373,060,261 | 22,207.52 | 1,474,579,470 | 4.500 | 2041/4/25 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 08/15/44 | 12,000,000 | 11,855.53 | 1,422,663,614 | 12,014.05 | 1,441,686,756 | 3.125 | 2044/8/15 | 0.38 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.25% 10/25/21 | 10,850,000 | 13,247.58 | 1,437,362,633 | 13,202.19 | 1,432,438,290 | 3.250 | 2021/10/25 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 10/31/20 | 13,000,000 | 10,962.24 | 1,425,091,568 | 10,987.06 | 1,428,318,945 | 2.875 | 2020/10/31 | 0.37 |

**(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 | 97.98 |
| 合計 | 97.98 |

**(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 | 53 | アメリカドル | 6,235,657.25 | 677,441,803 | 6,233,711.07 | 677,230,370 | 0.18 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 31 | アメリカドル | 3,945,499.12 | 428,639,024 | 3,947,656.25 | 428,873,375 | 0.11 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 24 | アメリカドル | 3,703,971 | 402,399,410 | 3,711,000 | 403,163,040 | 0.11 |
| | 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 | 2,806,885 | 340,166,393 | 2,807,250 | 340,210,627 | 0.09 |
| | 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 | 3,766,952 | 456,516,912 | 3,774,960 | 457,487,402 | 0.12 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 48 | ユーロ | 8,309,512 | 1,007,029,759 | 8,378,400 | 1,015,378,296 | 0.26 |

(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 | 20,400,000.00 | 2,202,777,616 | 2,213,808,000 | 0.58 |
| | カナダドル | 買建 | 2,220,000.00 | 183,199,934 | 183,372,000 | 0.05 |
| | ユーロ | 買建 | 13,220,000.00 | 1,602,747,185 | 1,602,131,800 | 0.42 |
| | イギリスポンド | 買建 | 2,190,000.00 | 295,505,443 | 288,904,800 | 0.08 |

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

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

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | ブラジル | 5,148,634,334 | 10.05 |
| | インドネシア | 5,075,811,366 | 9.91 |
| | メキシコ | 5,057,761,748 | 9.87 |
| | タイ | 4,423,626,694 | 8.63 |
| | ポーランド | 4,306,138,226 | 8.40 |
| | 南アフリカ | 4,253,945,798 | 8.30 |
| | ロシア | 3,960,210,414 | 7.73 |
| | コロンビア | 3,388,811,243 | 6.61 |
| | マレーシア | 2,966,816,384 | 5.79 |
| | ハンガリー | 2,131,636,149 | 4.16 |
| | チェコ | 2,120,002,683 | 4.14 |
| | トルコ | 1,901,517,416 | 3.71 |
| | ペルー | 1,771,313,394 | 3.46 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | チリ | 1,515,124,314 | 2.96 |
| | フィリピン | 146,223,754 | 0.29 |
| | ウルグアイ | 100,359,015 | 0.20 |
| | ドミニカ共和国 | 43,860,014 | 0.09 |
| | 小計 | 48,311,792,946 | 94.29 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 2,925,023,345 | 5.71 |
| 合計(純資産総額) | | 51,236,816,291 | 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 | 54,750,000,000 | 4.06 | 2,224,079,516 | 4.19 | 2,297,607,320 | 9.850 | 2027/6/28 | 4.48 |
| チリ | 国債証券 | CHILE 5.5% 08/05/20 | 9,530,000,000 | 15.95 | 1,520,412,468 | 15.89 | 1,515,124,314 | 5.500 | 2020/8/5 | 2.96 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/23 | 28,650,000 | 2,935.99 | 841,161,603 | 3,176.13 | 909,962,626 | 10.000 | 2023/1/1 | 1.78 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 01/01/22 | 35,400,000 | 2,339.59 | 828,216,680 | 2,494.98 | 883,224,170 | 0.000 | 2022/1/1 | 1.72 |
| コロンビア | 国債証券 | COLOM 4.375% 03/21/23 | 23,650,000,000 | 3.10 | 735,053,009 | 3.21 | 760,912,664 | 4.375 | 2023/3/21 | 1.49 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 10.5% 12/21/26 | 86,950,000 | 823.35 | 715,908,995 | 855.27 | 743,661,682 | 10.500 | 2026/12/21 | 1.45 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 3.4% 06/17/36 | 176,100,000 | 360.96 | 635,665,908 | 421.91 | 743,000,627 | 3.400 | 2036/6/17 | 1.45 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/21 | 23,800,000 | 2,978.87 | 708,971,575 | 3,032.09 | 721,639,073 | 10.000 | 2021/1/1 | 1.41 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/25 | 21,100,000 | 2,973.35 | 627,377,035 | 3,265.72 | 689,068,236 | 10.000 | 2025/1/1 | 1.34 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 2.5% 01/25/23 | 21,150,000 | 2,852.85 | 603,378,097 | 2,890.60 | 611,362,450 | 2.500 | 2023/1/25 | 1.19 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 3.65% 06/20/31 | 136,900,000 | 371.44 | 508,502,345 | 419.63 | 574,476,591 | 3.650 | 2031/6/20 | 1.12 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 10% 12/05/24 | 82,250,000 | 605.52 | 498,040,833 | 638.18 | 524,908,191 | 10.000 | 2024/12/5 | 1.02 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 6.5% 06/10/21 | 91,700,000 | 542.38 | 497,368,283 | 561.62 | 515,006,457 | 6.500 | 2021/6/10 | 1.01 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.75% 02/28/48 | 74,400,000 | 675.87 | 502,853,763 | 680.68 | 506,433,077 | 8.750 | 2048/2/28 | 0.99 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/27 | 15,000,000 | 2,858.12 | 428,718,600 | 3,332.01 | 499,802,276 | 10.000 | 2027/1/1 | 0.98 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.5% 06/03/27 | 85,300,000 | 525.49 | 448,243,815 | 571.34 | 487,359,887 | 7.500 | 2027/6/3 | 0.95 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8% 12/07/23 | 77,600,000 | 556.97 | 432,209,153 | 584.90 | 453,884,456 | 8.000 | 2023/12/7 | 0.89 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 6.5% 06/09/22 | 81,200,000 | 533.32 | 433,060,943 | 558.48 | 453,486,004 | 6.500 | 2022/6/9 | 0.89 |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 4.875% 06/22/29 | 95,000,000 | 414.52 | 393,794,798 | 448.93 | 426,484,716 | 4.875 | 2029/6/22 | 0.83 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 2.5% 07/25/27 | 14,000,000 | 2,689.44 | 376,522,152 | 2,901.97 | 406,276,817 | 2.500 | 2027/7/25 | 0.79 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 2.5% 07/25/26 | 13,950,000 | 2,721.17 | 379,604,229 | 2,903.21 | 404,998,859 | 2.500 | 2026/7/25 | 0.79 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| インドネシア | 国債証券 | INDOGB 8.375% 03/15/24 | 48,200,000,000 | 0.78 | 380,452,145 | 0.83 | 400,096,632 | 8.375 | 2024/3/15 | 0.78 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/23 | 17,500,000 | 2,208.69 | 386,520,946 | 2,237.74 | 391,605,111 | 0.000 | 2023/7/1 | 0.76 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8.5% 05/31/29 | 63,700,000 | 576.05 | 366,944,721 | 608.36 | 387,531,403 | 8.500 | 2029/5/31 | 0.76 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 3.25% 07/25/25 | 12,700,000 | 2,891.18 | 367,179,965 | 3,023.23 | 383,951,042 | 3.250 | 2025/7/25 | 0.75 |
| インドネシア | 国債証券 | INDOGB 8.375% 09/15/26 | 45,000,000,000 | 0.79 | 355,557,735 | 0.83 | 377,869,050 | 8.375 | 2026/9/15 | 0.74 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/21 | 14,600,000 | 2,329.85 | 340,158,223 | 2,579.58 | 376,619,448 | 0.000 | 2021/7/1 | 0.74 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.25% 12/09/21 | 64,300,000 | 553.72 | 356,042,433 | 568.89 | 365,798,971 | 7.250 | 2021/12/9 | 0.71 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.75% 01/31/44 | 53,500,000 | 673.54 | 360,345,184 | 682.82 | 365,313,419 | 8.750 | 2044/1/31 | 0.71 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8% 01/31/30 | 50,300,000 | 684.49 | 344,301,753 | 714.00 | 359,143,932 | 8.000 | 2030/1/31 | 0.70 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 94.29 |
| 合計 | 94.29 |

(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。

## Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | 日本 | 112,903,533,980 | 97.93 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 2,381,103,183 | 2.07 |
| 合計(純資産総額) | | 115,284,637,163 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本 | 2,349,026,000 | 2.04 |

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 10,743 | 683,519.52 | 7,343,050,203 | 764,000 | 8,207,652,000 | 7.12 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 11,094 | 612,330.74 | 6,793,197,229 | 681,000 | 7,555,014,000 | 6.55 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 34,597 | 147,902.04 | 5,116,966,877 | 172,900 | 5,981,821,300 | 5.19 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 22,104 | 178,613.43 | 3,948,071,256 | 211,300 | 4,670,575,200 | 4.05 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 | 20,967 | 215,265.29 | 4,513,467,335 | 218,800 | 4,587,579,600 | 3.98 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 24,909 | 177,272.15 | 4,415,671,984 | 184,100 | 4,585,746,900 | 3.98 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 15,939 | 239,372.09 | 3,815,351,742 | 261,700 | 4,171,236,300 | 3.62 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 14,956 | 247,965.82 | 3,708,576,803 | 266,500 | 3,985,774,000 | 3.46 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 10,271 | 298,886.58 | 3,069,864,063 | 337,500 | 3,466,462,500 | 3.01 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 7,022 | 418,774.55 | 2,940,634,890 | 481,500 | 3,381,093,000 | 2.93 |
| 日本 | 投資証券 | ＧＬＰ投資法人 | 27,631 | 113,130.45 | 3,125,907,463 | 121,400 | 3,354,403,400 | 2.91 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 35,738 | 80,684.37 | 2,883,498,015 | 90,800 | 3,245,010,400 | 2.81 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 48,664 | 50,061.09 | 2,436,172,883 | 62,500 | 3,041,500,000 | 2.64 |
| 日本 | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 5,559 | 480,375.81 | 2,670,409,127 | 499,500 | 2,776,720,500 | 2.41 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 32,437 | 72,195.79 | 2,341,814,840 | 84,400 | 2,737,682,800 | 2.37 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 3,432 | 727,456.08 | 2,496,629,266 | 782,000 | 2,683,824,000 | 2.33 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3,686 | 528,374.77 | 1,947,589,402 | 641,000 | 2,362,726,000 | 2.05 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 2,561 | 724,248.28 | 1,854,799,845 | 805,000 | 2,061,605,000 | 1.79 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 12,764 | 139,871.2 | 1,785,315,996 | 160,300 | 2,046,069,200 | 1.77 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 13,649 | 114,795.91 | 1,566,849,375 | 142,400 | 1,943,617,600 | 1.69 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7,249 | 229,012.68 | 1,660,112,917 | 261,300 | 1,894,163,700 | 1.64 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 3,774 | 443,211.48 | 1,672,680,125 | 469,000 | 1,770,006,000 | 1.54 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 9,017 | 165,815.48 | 1,495,158,183 | 194,200 | 1,751,101,400 | 1.52 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 | 9,934 | 149,560.2 | 1,485,731,026 | 162,000 | 1,609,308,000 | 1.40 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 11,388 | 126,867.93 | 1,444,771,986 | 141,300 | 1,609,124,400 | 1.40 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人 | 3,603 | 372,488.99 | 1,342,077,830 | 437,000 | 1,574,511,000 | 1.37 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 4,619 | 277,380 | 1,281,218,220 | 325,500 | 1,503,484,500 | 1.30 |
| 日本 | 投資証券 | プレミア投資法人 | 10,020 | 123,879.08 | 1,241,268,381 | 146,700 | 1,469,934,000 | 1.28 |
| 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人 | 7,438 | 162,564.63 | 1,209,155,717 | 197,300 | 1,467,517,400 | 1.27 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人 | 7,929 | 163,307.72 | 1,294,866,911 | 181,100 | 1,435,941,900 | 1.25 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 97.93 |
| 合計 | 97.93 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証ＲＥＩＴ指数先物 | 買建 | 1,171 | 円 | 2,226,188,100 | 2,349,026,000 | 2.04 |

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 55,932,492,022 | 72.78 |
| | オーストラリア | 5,429,586,537 | 7.06 |
| | イギリス | 3,527,127,972 | 4.59 |
| | シンガポール | 2,965,279,865 | 3.86 |
| | フランス | 2,870,297,505 | 3.73 |
| | 香港 | 1,765,323,089 | 2.30 |
| | カナダ | 1,496,491,326 | 1.95 |
| | ベルギー | 765,027,751 | 1.00 |
| | スペイン | 531,177,321 | 0.69 |
| | ニュージーランド | 377,369,815 | 0.49 |
| | ドイツ | 208,046,873 | 0.27 |
| | アイルランド | 205,690,161 | 0.27 |
| | オランダ | 203,217,961 | 0.26 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | ガーンジー | 120,591,018 | 0.16 |
| | イスラエル | 60,308,601 | 0.08 |
| | イタリア | 23,955,809 | 0.03 |
| | マン島 | 22,862,060 | 0.03 |
| | 韓国 | 11,511,500 | 0.01 |
| | 小計 | 76,516,357,186 | 99.56 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 337,577,903 | 0.44 |
| 合計(純資産総額) | | 76,853,935,089 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | — | 23,896,400 | 0.03 |

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

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 360,260 | 7,350.81 | 2,648,204,909 | 8,909.56 | 3,209,760,391 | 4.18 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP | 176,480 | 20,392.52 | 3,598,872,037 | 17,405.21 | 3,071,672,237 | 4.00 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 85,660 | 22,421.12 | 1,920,593,413 | 26,410.38 | 2,262,313,493 | 2.94 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 231,630 | 7,654.75 | 1,773,071,795 | 9,120.32 | 2,112,541,575 | 2.75 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 210,600 | 7,362.53 | 1,550,549,407 | 8,641.22 | 1,819,842,111 | 2.37 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 78,930 | 19,925.66 | 1,572,732,533 | 22,907.83 | 1,808,115,053 | 2.35 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 211,090 | 6,557.75 | 1,384,277,547 | 7,354.92 | 1,552,551,751 | 2.02 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 1,194,500 | 1,011.05 | 1,207,702,928 | 1,281.35 | 1,530,575,561 | 1.99 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 118,310 | 12,046.00 | 1,425,162,639 | 12,384.96 | 1,465,264,618 | 1.91 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 179,860 | 6,877.05 | 1,236,906,548 | 7,606.97 | 1,368,190,128 | 1.78 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES | 87,290 | 13,497.43 | 1,178,190,979 | 14,450.20 | 1,261,358,517 | 1.64 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST | 37,260 | 27,603.25 | 1,028,497,139 | 33,317.71 | 1,241,418,068 | 1.62 |
| フランス | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 78,160 | 19,535.82 | 1,526,920,317 | 15,179.04 | 1,186,394,353 | 1.54 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 64,940 | 13,657.95 | 886,947,306 | 16,080.89 | 1,044,293,178 | 1.36 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 905,710 | 780.21 | 706,645,267 | 1,109.89 | 1,005,246,804 | 1.31 |
| アメリカ | 投資証券 | HCP INC | 273,990 | 3,133.17 | 858,459,331 | 3,503.64 | 959,962,324 | 1.25 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 97,520 | 7,228.42 | 704,915,629 | 9,385.40 | 915,265,144 | 1.19 |
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 2,992,430 | 300.59 | 899,517,576 | 295.37 | 883,893,201 | 1.15 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 72,200 | 9,919.91 | 716,218,108 | 12,156.81 | 877,722,115 | 1.14 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 65,170 | 10,925.92 | 712,042,519 | 12,952.06 | 844,085,802 | 1.10 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 419,930 | 2,054.38 | 862,696,801 | 1,920.75 | 806,582,731 | 1.05 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 159,170 | 4,456.41 | 709,327,225 | 5,062.62 | 805,817,862 | 1.05 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 51,510 | 11,450.88 | 589,835,334 | 14,498.00 | 746,792,392 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 203,230 | 3,109.27 | 631,898,324 | 3,658.99 | 743,617,594 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 239,090 | 2,496.49 | 596,886,997 | 3,015.84 | 721,058,716 | 0.94 |
| アメリカ | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST | 99,150 | 7,611.31 | 754,662,220 | 7,008.36 | 694,879,529 | 0.90 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 50,860 | 10,707.55 | 544,586,421 | 13,453.97 | 684,269,301 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORP | 94,000 | 7,085.50 | 666,037,075 | 7,271.27 | 683,499,869 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 55,700 | 10,100.65 | 562,606,395 | 11,525.61 | 641,976,900 | 0.84 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 611,860 | 840.64 | 514,359,436 | 1,032.26 | 631,604,318 | 0.82 |

**(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。**

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

**ロ.種類別投資比率**

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 99.56 |
| 合計 | 99.56 |

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

**投資不動産物件**

**該当事項はありません。**

**その他投資資産の主要なもの**

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 220,000.00 | 23,896,400 | 23,896,400 | 0.03 |

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

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

**グローバル・コモディティ（米ドル建て）　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（%） |
|---|---|---|---|
| 社債券 | ルクセンブルク | 9,850,866,816 | 44.12 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | アイルランド | 9,241,005,312 | 41.39 |
| | イギリス | 2,061,526,566 | 9.23 |
| | アメリカ | 360,956,400 | 1.62 |
| | ジャージー | 351,559,040 | 1.57 |
| | 小計 | 21,865,914,134 | 97.93 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | — | 461,079,806 | 2.07 |
| 合計(純資産総額) | | 22,326,993,940 | 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アイルランド | 社債券 | STAR HELIOS 006 11/08/19 | 88,000,000 | 10,431.61 | 9,179,819,264 | 10,501.14 | 9,241,005,312 | 0.000 | 2019/11/8 | 41.39 |
| ルクセンブルク | 社債券 | SG ISSUER 012 08/30/19 | 30,000,000 | 10,360.99 | 3,108,299,040 | 10,451.16 | 3,135,350,400 | 0.000 | 2019/8/30 | 14.04 |
| ルクセンブルク | 社債券 | SG ISSUER 015 05/29/20 | 27,000,000 | 10,914.13 | 2,946,816,544 | 10,976.98 | 2,963,786,112 | 0.000 | 2020/5/29 | 13.27 |
| ルクセンブルク | 社債券 | SG ISSUER 013 01/31/20 | 21,000,000 | 10,473.98 | 2,199,536,304 | 10,522.87 | 2,209,802,784 | 0.000 | 2020/1/31 | 9.90 |
| ルクセンブルク | 社債券 | SG ISSUER 014 03/31/20 | 15,000,000 | 10,238.23 | 1,535,735,040 | 10,279.51 | 1,541,927,520 | 0.000 | 2020/3/31 | 6.91 |
| イギリス | 社債券 | CS USD COM 015 09/30/19 | 12,000,000 | 9,976.41 | 1,197,169,344 | 10,080.70 | 1,209,684,672 | 0.000 | 2019/9/30 | 5.42 |
| イギリス | 社債券 | BAR USD COM 036 10/31/19 | 8,000,000 | 10,544.27 | 843,541,798 | 10,648.02 | 851,841,894 | 0.000 | 2019/10/31 | 3.82 |
| アメリカ | 社債券 | IPATH DOW COMM 06/12/36 | 15,000,000 | 2,386.82 | 358,023,120 | 2,406.37 | 360,956,400 | 0.000 | 2036/6/12 | 1.62 |
| ジャージー | 社債券 | ETFS ALL COMMODITIES | 40,000,000 | 872.37 | 348,951,680 | 878.89 | 351,559,040 | 0.000 | 9999/99/99 | 1.57 |

(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。
(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

#### ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 社債券 | 97.93 |
| 合計 | 97.93 |

(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。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 27,341,441,293 | 100.34 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | △92,888,951 | △0.34 |
| 合計(純資産総額) | | 27,248,552,342 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 売建 | ― | 27,186,212,748 | △99.77 |

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資信託受益証券 | ISHARES GOLD TRUST | 18,383,500 | 1,451.43 | 26,682,370,758 | 1,487.28 | 27,341,441,293 | 100.34 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 投資信託受益証券 | 100.34 |
| 合計 | 100.34 |

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 売建 | 250,379,458.00 | 27,232,445,921 | 27,186,212,748 | △99.77 |

(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。

## 米国株式ＬＳ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（%） |
|---|---|---|---|
| 社債券 | アイルランド | 26,846,389,672 | 96.21 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 1,056,857,702 | 3.79 |
| 合計(純資産総額) | | 27,903,247,374 | 100.00 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 売建 | ― | 26,747,630,000 | △95.86 |

(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(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アイルランド | 社債券 | STAR HELIOS 004 10/18/22 | 217,000,000 | 12,221.31 | 26,520,254,782 | 12,371.60 | 26,846,389,672 | 0.000 | 2022/10/18 | 96.21 |

**(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（%） |
|---|---|
| 社債券 | 96.21 |
| 合計 | 96.21 |

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

**投資不動産物件**

**該当事項はありません。**

**その他投資資産の主要なもの**

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 売建 | 247,000,000.00 | 26,738,367,500 | 26,747,630,000 | △95.86 |

**(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。**

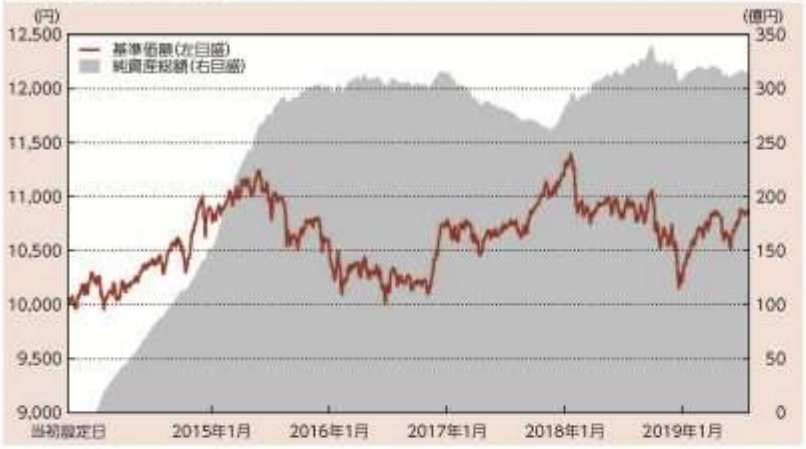
**≪参考情報≫**

**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10月17日
作成基準日：2019年 7 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。

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 10,885円 |
| 純資産総額 | 315.44億円 |

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2015年 7 月 | 0円 |
| 2016年 7 月 | 0円 |
| 2017年 7 月 | 0円 |
| 2018年 7 月 | 0円 |
| 2019年 7 月 | 0円 |
| 設定来分配金合計額 | 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

| 投資信託証券 | 投資比率 |
|---|---|
| FOFs 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 10.5% |
| 外国株式インデックス マザーファンド | 9.4% |
| ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) | 6.5% |
| J-REIT インデックス マザーファンド | 6.5% |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 5.6% |
| Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class | 5.0% |
| HYFI Loan Fund-JPY-USDクラス | 5.0% |
| BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY | 4.6% |
| 米国株式LSマザーファンド | 3.7% |
| FOFs 用JPX 日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用) | 3.7% |

※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、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第２【管理及び運営】

### １【申込（販売）手続等】

**＜申込手続＞**

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

**＜申込コース＞**

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

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

**＜申込みの受付＞**

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

**＜申込単位＞**

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

**＜申込価額＞**

**取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。**

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

**＜申込手数料＞**

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

**＜申込代金の支払い＞**

**販売会社が定める期日までにお支払いください。**

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨーク証券取引所の休業日**
**ロンドン証券取引所の休業日**
**ニューヨークの銀行休業日**
**ロンドンの銀行休業日**

**＜申込受付の中止等＞**

**収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。**

**＜その他＞**

**取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン**

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

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。
販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

＜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：https://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々営業日の基準価額（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（https://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、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。**

**＜受付不可日＞**

**一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。**
**ニューヨーク証券取引所の休業日**
**ロンドン証券取引所の休業日**
**ニューヨークの銀行休業日**
**ロンドンの銀行休業日**

**＜一部解約受付の中止等＞**

**委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。**
**一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。**

**＜一部解約の制限＞**

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

**＜その他＞**

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

**＜問い合わせ先＞**

**上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。**
**（照会先）**
**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
**ホームページ：https://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（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1万口当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＞**

**①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法**

**計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。**

**②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。）の評価方法**

**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。**

**③外国投資信託証券の評価方法**

**原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。**

**④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。**

**⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法**

**・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）**

**原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。**

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

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

**・公社債等（仕組債を含みます。）**

**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。**

**・市場デリバティブ取引**

**金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。**

**・店頭デリバティブ取引**

**計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。**

**a.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。）**

**b.価格情報会社の提供する価額**

**⑥外貨建資産等の円換算**

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

＜基準価額の照会方法＞

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（https://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：https://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10月17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7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年10月17日から2014年7月10日までとします。

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②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。

③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。

④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）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。

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらか

じめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①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。

④上記①から③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①から③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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①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。

④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。

⑤上記①から④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。

⑥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＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れ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＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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**

**①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。**

**②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ます。）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。**

**③上記②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。**

**④上記②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。**

**⑤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**

**①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。**

**②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、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。**

**③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。**

**④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6期計算期間(2018年7月11日から2019年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。**

**１【財務諸表】**

## 【コア投資戦略ファンド（切替型）】

### （１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第5期<br>（2018年 7月10日現在） | 第6期<br>（2019年 7月10日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 487,385,230 | 704,008,991 |
| 投資信託受益証券 | 15,447,047,441 | 17,219,654,576 |
| 投資証券 | 2,263,079,818 | 1,630,199,887 |
| 親投資信託受益証券 | 13,659,663,969 | 12,426,933,579 |
| 未収入金 | 30,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 31,887,176,458 | 31,980,797,033 |
| 資産合計 | 31,887,176,458 | 31,980,797,033 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 74,325,412 | 134,368,173 |
| 未払受託者報酬 | 8,103,089 | 8,459,990 |
| 未払委託者報酬 | 215,542,065 | 225,035,710 |
| 未払利息 | 1,238 | 1,942 |
| その他未払費用 | 800,410 | 807,543 |
| 流動負債合計 | 298,772,214 | 368,673,358 |
| 負債合計 | 298,772,214 | 368,673,358 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 28,993,439,555 | 29,103,280,048 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,594,964,689 | 2,508,843,627 |
| （分配準備積立金） | 384,859,275 | 303,442,172 |
| 元本等合計 | 31,588,404,244 | 31,612,123,675 |
| 純資産合計 | 31,588,404,244 | 31,612,123,675 |
| 負債純資産合計 | 31,887,176,458 | 31,980,797,033 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第5期<br>自　2017年 7月11日<br>至　2018年 7月10日 | 第6期<br>自　2018年 7月11日<br>至　2019年 7月10日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 39,843,153 | 39,204,019 |
| 受取利息 | 238 | 410 |
| 有価証券売買等損益 | 753,080,853 | 323,599,728 |
| その他収益 | - | 5,729 |
| 営業収益合計 | 792,924,244 | 362,809,886 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 284,070 | 461,262 |
| 受託者報酬 | 15,461,845 | 17,239,342 |
| 委託者報酬 | 411,284,788 | 458,566,315 |
| その他費用 | 1,542,656 | 1,664,565 |
| 営業費用合計 | 428,573,359 | 477,931,484 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 364,350,885 | △115,121,598 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 364,350,885 | △115,121,598 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 364,350,885 | △115,121,598 |
| 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（△） | 150,032,850 | △111,925,687 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,877,239,520 | 2,594,964,689 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,081,263,547 | 543,681,841 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,081,263,547 | 543,681,841 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 577,856,413 | 626,606,992 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 577,856,413 | 626,606,992 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,594,964,689 | 2,508,843,627 |

## （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 | (1)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。<br><br>(2)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 |
| ２.収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>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。 |

### （貸借対照表に関する注記）

| | 第5期<br>(2018年 7月10日現在) | 第6期<br>(2019年 7月10日現在) |
|---|---|---|
| １．計算期間の末日における受益権の総数 | 28,993,439,555口 | 29,103,280,048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 1.0895円<br>(1万口当たり純資産額) (10,895円) | 1口当たり純資産額 1.0862円<br>(1万口当たり純資産額) (10,862円) |

### （損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第5期<br>自 2017年 7月11日<br>至 2018年 7月10日 | 第6期<br>自 2018年 7月11日<br>至 2019年 7月10日 |
|---|---|
| 分配金の計算過程 | 分配金の計算過程 |

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 91,571,020円 |

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | －円 |

| 第5期<br>自 2017年 7月11日<br>至 2018年 7月10日 | | | 第6期<br>自 2018年 7月11日<br>至 2019年 7月10日 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | －円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | －円 |
| 収益調整金額 | C | 2,210,105,414円 | 収益調整金額 | C | 2,205,401,455円 |
| 分配準備積立金額 | D | 293,288,255円 | 分配準備積立金額 | D | 303,442,172円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,594,964,689円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,508,843,627円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 28,993,439,555口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 29,103,280,048口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 895円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 862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6期<br>自 2018年 7月11日<br>至 2019年 7月10日 |
|---|---|
| １.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| ２.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| ３.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>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6期<br>(2019年 7月10日現在) |
|---|---|
| １.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | 第6期<br>(2019年 7月10日現在) |
|---|---|
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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5期<br>自 2017年 7月11日<br>至 2018年 7月10日 | 第6期<br>自 2018年 7月11日<br>至 2019年 7月10日 |
|---|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 26,068,918,560円 | 28,993,439,555円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,500,659,721円 | 7,219,577,787円 |
| 期中一部解約元本額 | 7,576,138,726円 | 7,109,737,294円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 第5期<br>(2018年 7月10日現在) | 第6期<br>(2019年 7月10日現在) |
|---|---|---|
| | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |

| | | |
|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | 60,811,671 | 71,976,320 |
| 投資証券 | △41,546,079 | △14,234,086 |
| 親投資信託受益証券 | 470,171,934 | 664,562,082 |
| 合計 | 489,437,526 | 722,304,316 |

**（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 |
|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 738,093,911 | 746,286,753 | |
| | 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用） | 438,109,232 | 383,871,309 | |
| | FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 973,921,482 | 1,169,777,092 | |
| | ＦＯＦｓ用ＭＬＰインデックスファンド（適格機関投資家専用） | 362,798,972 | 232,517,861 | |
| | Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J | 52,703.932 | 506,959,121 | |
| | 大和住銀／ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用） | 546,622,479 | 530,715,764 | |
| | ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 1,027,926,422 | 1,097,928,211 | |
| | ＬＭ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用） | 247,672,869 | 258,545,707 | |
| | マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用) | 332,407,387 | 317,615,258 | |
| | FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド　為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 2,926,386,998 | 3,296,574,953 | |
| | FOFs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用) | 808,036,704 | 1,168,501,877 | |
| | FOFs用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資家専用) | 723,199,524 | 711,049,771 | |
| | ＦＯＦｓ用　ＫＩＭ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 888,317,115 | 899,776,405 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用） | 408,216,234 | 493,084,389 | |
| | ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 937,763,700 | 948,079,100 | |
| | FOFs用FRM ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用) | 62,460,133 | 58,750,001 | |
| | ＦＯＦｓ用MAN　AHL　ダイバーシファイド　リンクファンド（適格機関投資家専用） | 498,169,075 | 474,555,860 | |
| | ＦＯＦｓ用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） | 720,626,732 | 753,054,934 | |
| | HYFI Loan Fund－JPY-USD クラス | 1,394,601.4263 | 1,576,957,137 | |
| | Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class | 172,260.0737 | 1,595,053,073 | |
| 投資信託受益証券合計 | | 12,642,348,534.432 | 17,219,654,576 | |
| 投資証券 | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY | 144,280.996 | 1,430,579,259 | |
| | Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A | 23,396 | 199,620,628 | |
| 投資証券合計 | | 167,676.996 | 1,630,199,887 | |
| 親投資信託受益証券 | Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド | 1,037,555,577 | 2,014,102,886 | |
| | グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド | 484,111,071 | 942,515,844 | |
| | 国内株式インデックス　マザーファンド | 544,973,808 | 788,958,581 | |
| | 外国株式インデックス　マザーファンド | 1,138,158,082 | 3,003,143,915 | |
| | 外国債券インデックス　マザーファンド | 633,079,220 | 1,768,316,877 | |
| | グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド | 2,038,753,933 | 603,675,039 | |
| | 新興国債券インデックス　マザーファンド | 79,323,611 | 136,896,687 | |
| | ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり） | 1,969,262,226 | 2,008,647,470 | |
| | 米国株式ＬＳマザーファンド | 1,088,610,280 | 1,160,676,280 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | 9,013,827,808 | 12,426,933,579 | |
| 合計 | | | 31,276,788,042 | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,578,024,849 |
| 株式 | 277,313,751,020 |
| 派生商品評価勘定 | 67,977,030 |
| 未収入金 | 1,006,770,430 |
| 未収配当金 | 413,638,500 |
| 差入委託証拠金 | 81,780,000 |
| 流動資産合計 | 280,461,941,829 |
| 資産合計 | 280,461,941,829 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 381,620 |
| 前受金 | 67,612,690 |
| 未払解約金 | 99,593,506 |
| 未払利息 | 4,354 |
| その他未払費用 | 76 |
| 流動負債合計 | 167,592,246 |
| 負債合計 | 167,592,246 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 193,616,822,892 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 86,677,526,691 |
| 元本等合計 | 280,294,349,583 |
| 純資産合計 | 280,294,349,583 |
| 負債純資産合計 | 280,461,941,829 |

### 注記表

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)新株予約権証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 193,616,822,892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　1.4477円<br>(1万口当たり純資産額)　(14,477円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>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。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 136,991,982,887円 |
| 期中追加設定元本額 | 73,712,526,256円 |
| 期中一部解約元本額 | 17,087,686,251円 |
| 期末元本額 | 193,616,822,892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） | 607,309,081円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 4,010,214,226円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 15,932,856円 |
| ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン | 9,894,473,078円 |
| 世界経済インデックスファンド | 2,031,267,468円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 5,408,278,349円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 6,740,842,210円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 19,184,174,208円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 17,646,289,759円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープン | 5,596,262,721円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 2,732,224,082円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 7,817,011,631円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 5,064,510,463円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ | 6,398,575,643円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 379,767,295円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 648,559,079円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 426,221,790円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 1,797,033,494円 |
| 日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,196,840,952円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 16,342,633円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 42,889,163円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 38,766,263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） | 295,062,372円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 2,717,839円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 101,139,764円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 359,011,799円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 63,720,310円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 529,708,726円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| バランスA（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,879,344,444円 |
| バランスB（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 750,531,615円 |
| バランスC（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 4,341,404,889円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 680,186,721円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 48,210,027円 |
| バランスD（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 828,385,826円 |
| グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用） | 39,628,784円 |
| バランスE（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 478,704,016円 |
| バランスF（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 599,077,616円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 56,015,261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） | 908,567,624円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 5,162,966,236円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ２ | 1,371,302,434円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,205,290,370円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,610,074,483円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,047,855,488円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 2,245,019,382円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 247,082,853円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 272,414,486円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 544,973,808円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 224,734,988円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 11,169,738円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 76,404,482円 |
| 国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 12,862,104,941円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 673,595,588円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 13,055,458円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 55,523,004円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 8,215,102円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 2,323,318円 |
| グローバル経済コア | 304,162,092円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 10,684,464円 |
| ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード） | 46,743,978円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 1,827,207円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 148,867,684円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 26,476,683円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 17,365円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 19,408円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 21,791円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 23,834円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 54,131,150,813円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 657,517,337円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 6,152,029,894 |
| 合計 | 6,152,029,894 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**株式関連**

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 2,914,437,310 | － | 2,982,050,000 | 67,612,690 |
| 合計 | | 2,914,437,310 | － | 2,982,050,000 | 67,612,690 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**附属明細表**

**第１　有価証券明細表**

**(1)株式**

| 銘　柄 | 株式数(株) | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| | | 単価(円) | 金額(円) | |
| 極洋 | 5,400 | 3,035.00 | 16,389,000 | |
| 日本水産 | 167,200 | 698.00 | 116,705,600 | |
| マルハニチロ | 24,200 | 3,285.00 | 79,497,000 | |
| カネコ種苗 | 5,100 | 1,312.00 | 6,691,200 | |
| サカタのタネ | 20,400 | 3,190.00 | 65,076,000 | |
| ホクト | 14,000 | 1,852.00 | 25,928,000 | |
| ホクリヨウ | 2,300 | 605.00 | 1,391,500 | |
| 住石ホールディングス | 36,000 | 138.00 | 4,968,000 | |
| 日鉄鉱業 | 3,800 | 4,610.00 | 17,518,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三井松島ホールディングス | 7,000 | 1,323.00 | 9,261,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 670,700 | 973.80 | 653,127,660 | |
| 石油資源開発 | 24,000 | 2,447.00 | 58,728,000 | |
| K＆Oエナジーグループ | 8,100 | 1,557.00 | 12,611,700 | |
| ヒノキヤグループ | 4,700 | 2,158.00 | 10,142,600 | |
| ショーボンドホールディングス | 23,900 | 3,845.00 | 91,895,500 | |
| ミライト・ホールディングス | 47,000 | 1,626.00 | 76,422,000 | |
| タマホーム | 8,000 | 1,097.00 | 8,776,000 | |
| サンヨーホームズ | 2,400 | 681.00 | 1,634,400 | |
| 日本アクア | 5,300 | 660.00 | 3,498,000 | |
| ファーストコーポレーション | 5,100 | 662.00 | 3,376,200 | |
| ベステラ | 3,200 | 1,319.00 | 4,220,800 | |
| ＴＡＴＥＲＵ | 20,400 | 206.00 | 4,202,400 | |
| スペースバリューホールディングス | 20,400 | 511.00 | 10,424,400 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 3,200 | 663.00 | 2,121,600 | |
| 第一カッター興業 | 2,100 | 1,751.00 | 3,677,100 | |
| 安藤・間 | 108,000 | 736.00 | 79,488,000 | |
| 東急建設 | 49,800 | 747.00 | 37,200,600 | |
| コムシスホールディングス | 59,300 | 2,741.00 | 162,541,300 | |
| ミサワホーム | 13,800 | 1,045.00 | 14,421,000 | |
| ビーアールホールディングス | 18,200 | 345.00 | 6,279,000 | |
| 高松コンストラクショングループ | 10,700 | 2,278.00 | 24,374,600 | |
| 東建コーポレーション | 5,200 | 6,360.00 | 33,072,000 | |
| ソネック | 1,700 | 803.00 | 1,365,100 | |
| ヤマウラ | 7,200 | 842.00 | 6,062,400 | |
| 大成建設 | 137,500 | 3,935.00 | 541,062,500 | |
| 大林組 | 414,200 | 1,063.00 | 440,294,600 | |
| 清水建設 | 422,600 | 893.00 | 377,381,800 | |
| 飛島建設 | 12,300 | 1,305.00 | 16,051,500 | |
| 長谷工コーポレーション | 173,000 | 1,166.00 | 201,718,000 | |
| 松井建設 | 16,100 | 626.00 | 10,078,600 | |
| 錢高組 | 1,700 | 4,505.00 | 7,658,500 | |
| 鹿島建設 | 323,700 | 1,470.00 | 475,839,000 | |
| 不動テトラ | 9,900 | 1,362.00 | 13,483,800 | |
| 大末建設 | 5,500 | 940.00 | 5,170,000 | |
| 鉄建建設 | 8,600 | 2,976.00 | 25,593,600 | |
| 西松建設 | 30,000 | 2,135.00 | 64,050,000 | |
| 三井住友建設 | 99,500 | 602.00 | 59,899,000 | |
| 大豊建設 | 9,500 | 2,772.00 | 26,334,000 | |
| 前田建設工業 | 99,000 | 880.00 | 87,120,000 | |
| 佐田建設 | 10,400 | 381.00 | 3,962,400 | |
| ナカノフドー建設 | 11,900 | 433.00 | 5,152,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 奥村組 | 22,900 | 3,300.00 | 75,570,000 | |
| 東鉄工業 | 16,600 | 2,987.00 | 49,584,200 | |
| イチケン | 2,900 | 1,708.00 | 4,953,200 | |
| 富士ピー・エス | 5,700 | 487.00 | 2,775,900 | |
| 淺沼組 | 4,800 | 3,545.00 | 17,016,000 | |
| 戸田建設 | 161,300 | 612.00 | 98,715,600 | |
| 熊谷組 | 19,900 | 3,160.00 | 62,884,000 | |
| 青木あすなろ建設 | 7,500 | 865.00 | 6,487,500 | |
| 北野建設 | 3,100 | 2,641.00 | 8,187,100 | |
| 植木組 | 2,000 | 2,226.00 | 4,452,000 | |
| 矢作建設工業 | 18,800 | 724.00 | 13,611,200 | |
| ピーエス三菱 | 15,500 | 605.00 | 9,377,500 | |
| 日本ハウスホールディングス | 26,400 | 434.00 | 11,457,600 | |
| 大東建託 | 49,200 | 14,015.00 | 689,538,000 | |
| 新日本建設 | 17,100 | 904.00 | 15,458,400 | |
| ＮＩＰＰＯ | 36,500 | 2,103.00 | 76,759,500 | |
| 東亜道路工業 | 2,600 | 3,270.00 | 8,502,000 | |
| 前田道路 | 43,200 | 2,321.00 | 100,267,200 | |
| 日本道路 | 3,700 | 6,210.00 | 22,977,000 | |
| 東亜建設工業 | 12,000 | 1,602.00 | 19,224,000 | |
| 日本国土開発 | 22,500 | 525.00 | 11,812,500 | |
| 若築建設 | 6,900 | 1,439.00 | 9,929,100 | |
| 東洋建設 | 50,500 | 407.00 | 20,553,500 | |
| 五洋建設 | 164,000 | 522.00 | 85,608,000 | |
| 世紀東急工業 | 20,100 | 631.00 | 12,683,100 | |
| 福田組 | 4,600 | 4,500.00 | 20,700,000 | |
| 住友林業 | 98,200 | 1,300.00 | 127,660,000 | |
| 日本基礎技術 | 14,100 | 336.00 | 4,737,600 | |
| 巴コーポレーション | 18,700 | 372.00 | 6,956,400 | |
| 大和ハウス工業 | 382,200 | 3,187.00 | 1,218,071,400 | |
| ライト工業 | 26,500 | 1,429.00 | 37,868,500 | |
| 積水ハウス | 422,700 | 1,848.50 | 781,360,950 | |
| 日特建設 | 11,800 | 601.00 | 7,091,800 | |
| 北陸電気工事 | 6,700 | 897.00 | 6,009,900 | |
| ユアテック | 22,100 | 749.00 | 16,552,900 | |
| 四電工 | 2,100 | 2,716.00 | 5,703,600 | |
| 中電工 | 17,800 | 2,336.00 | 41,580,800 | |
| 関電工 | 62,800 | 929.00 | 58,341,200 | |
| きんでん | 91,700 | 1,656.00 | 151,855,200 | |
| 東京エネシス | 14,200 | 944.00 | 13,404,800 | |
| トーエネック | 3,900 | 3,335.00 | 13,006,500 | |
| 住友電設 | 9,500 | 1,751.00 | 16,634,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本電設工業 | 23,500 | 2,168.00 | 50,948,000 | |
| 協和エクシオ | 54,000 | 2,655.00 | 143,370,000 | |
| 新日本空調 | 11,500 | 1,720.00 | 19,780,000 | |
| 九電工 | 27,200 | 3,445.00 | 93,704,000 | |
| 三機工業 | 31,600 | 1,211.00 | 38,267,600 | |
| 日揮 | 119,200 | 1,503.00 | 179,157,600 | |
| 中外炉工業 | 4,200 | 1,616.00 | 6,787,200 | |
| ヤマト | 13,400 | 575.00 | 7,705,000 | |
| 太平電業 | 9,300 | 2,270.00 | 21,111,000 | |
| 高砂熱学工業 | 33,900 | 1,783.00 | 60,443,700 | |
| 三晃金属工業 | 1,900 | 2,426.00 | 4,609,400 | |
| 朝日工業社 | 3,100 | 2,720.00 | 8,432,000 | |
| 明星工業 | 25,000 | 734.00 | 18,350,000 | |
| 大氣社 | 19,000 | 3,315.00 | 62,985,000 | |
| ダイダン | 9,500 | 2,311.00 | 21,954,500 | |
| 日比谷総合設備 | 12,400 | 1,900.00 | 23,560,000 | |
| 東芝プラントシステム | 30,100 | 2,005.00 | 60,350,500 | |
| ＯＳＪＢホールディングス | 60,900 | 259.00 | 15,773,100 | |
| 東洋エンジニアリング | 16,200 | 554.00 | 8,974,800 | |
| レイズネクスト | 24,800 | 1,195.00 | 29,636,000 | |
| 日本製粉 | 39,200 | 1,762.00 | 69,070,400 | |
| 日清製粉グループ本社 | 139,600 | 2,477.00 | 345,789,200 | |
| 日東富士製粉 | 900 | 5,760.00 | 5,184,000 | |
| 昭和産業 | 11,300 | 3,150.00 | 35,595,000 | |
| 鳥越製粉 | 10,900 | 853.00 | 9,297,700 | |
| 中部飼料 | 15,100 | 1,272.00 | 19,207,200 | |
| フィード・ワン | 83,000 | 194.00 | 16,102,000 | |
| 東洋精糖 | 1,900 | 1,011.00 | 1,920,900 | |
| 日本甜菜製糖 | 7,000 | 2,053.00 | 14,371,000 | |
| 三井製糖 | 9,700 | 2,263.00 | 21,951,100 | |
| 塩水港精糖 | 13,400 | 210.00 | 2,814,000 | |
| 日新製糖 | 5,900 | 1,991.00 | 11,746,900 | |
| 森永製菓 | 31,100 | 5,400.00 | 167,940,000 | |
| 中村屋 | 3,200 | 4,340.00 | 13,888,000 | |
| 江崎グリコ | 37,100 | 4,735.00 | 175,668,500 | |
| 名糖産業 | 5,900 | 1,431.00 | 8,442,900 | |
| 井村屋グループ | 5,300 | 2,100.00 | 11,130,000 | |
| 不二家 | 6,900 | 1,983.00 | 13,682,700 | |
| 山崎製パン | 101,000 | 1,712.00 | 172,912,000 | |
| 第一屋製パン | 2,100 | 985.00 | 2,068,500 | |
| モロゾフ | 2,100 | 5,050.00 | 10,605,000 | |
| 亀田製菓 | 7,700 | 4,985.00 | 38,384,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 寿スピリッツ | 13,100 | 5,660.00 | 74,146,000 | |
| カルビー | 56,300 | 3,010.00 | 169,463,000 | |
| 森永乳業 | 24,800 | 4,355.00 | 108,004,000 | |
| 六甲バター | 9,000 | 1,820.00 | 16,380,000 | |
| ヤクルト本社 | 91,500 | 6,370.00 | 582,855,000 | |
| 明治ホールディングス | 87,500 | 7,690.00 | 672,875,000 | |
| 雪印メグミルク | 29,700 | 2,379.00 | 70,656,300 | |
| プリマハム | 17,400 | 2,084.00 | 36,261,600 | |
| 日本ハム | 51,200 | 4,605.00 | 235,776,000 | |
| 林兼産業 | 4,100 | 656.00 | 2,689,600 | |
| 丸大食品 | 13,200 | 2,038.00 | 26,901,600 | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 11,100 | 3,795.00 | 42,124,500 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 79,600 | 724.00 | 57,630,400 | |
| サッポロホールディングス | 45,200 | 2,404.00 | 108,660,800 | |
| アサヒグループホールディングス | 258,800 | 5,024.00 | 1,300,211,200 | |
| キリンホールディングス | 559,000 | 2,367.00 | 1,323,153,000 | |
| 宝ホールディングス | 92,500 | 1,158.00 | 107,115,000 | |
| オエノンホールディングス | 35,100 | 375.00 | 13,162,500 | |
| 養命酒製造 | 3,800 | 1,996.00 | 7,584,800 | |
| コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 94,600 | 2,724.00 | 257,690,400 | |
| サントリー食品インターナショナル | 82,700 | 4,705.00 | 389,103,500 | |
| ダイドーグループホールディングス | 7,000 | 4,680.00 | 32,760,000 | |
| 伊藤園 | 37,500 | 5,100.00 | 191,250,000 | |
| キーコーヒー | 12,100 | 2,154.00 | 26,063,400 | |
| ユニカフェ | 3,400 | 981.00 | 3,335,400 | |
| ジャパンフーズ | 1,800 | 1,218.00 | 2,192,400 | |
| 日清オイリオグループ | 15,900 | 3,070.00 | 48,813,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 30,100 | 3,370.00 | 101,437,000 | |
| かどや製油 | 1,300 | 4,100.00 | 5,330,000 | |
| Ｊ－オイルミルズ | 6,400 | 4,015.00 | 25,696,000 | |
| キッコーマン | 81,500 | 4,830.00 | 393,645,000 | |
| 味の素 | 272,900 | 1,872.00 | 510,868,800 | |
| キユーピー | 68,800 | 2,530.00 | 174,064,000 | |
| ハウス食品グループ本社 | 46,200 | 4,190.00 | 193,578,000 | |
| カゴメ | 49,500 | 2,483.00 | 122,908,500 | |
| 焼津水産化学工業 | 6,000 | 1,102.00 | 6,612,000 | |
| アリアケジャパン | 11,300 | 7,020.00 | 79,326,000 | |
| ピエトロ | 1,600 | 1,600.00 | 2,560,000 | |
| エバラ食品工業 | 3,000 | 2,143.00 | 6,429,000 | |
| ニチレイ | 64,200 | 2,670.00 | 171,414,000 | |
| 東洋水産 | 63,600 | 4,585.00 | 291,606,000 | |
| イートアンド | 4,300 | 1,663.00 | 7,150,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大冷 | 1,400 | 1,901.00 | 2,661,400 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 3,400 | 947.00 | 3,219,800 | |
| 日清食品ホールディングス | 52,500 | 6,900.00 | 362,250,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 6,600 | 2,139.00 | 14,117,400 | |
| 一正蒲鉾 | 4,800 | 1,032.00 | 4,953,600 | |
| フジッコ | 13,400 | 2,027.00 | 27,161,800 | |
| ロック・フィールド | 13,300 | 1,454.00 | 19,338,200 | |
| 日本たばこ産業 | 713,500 | 2,447.50 | 1,746,291,250 | |
| ケンコーマヨネーズ | 6,900 | 2,364.00 | 16,311,600 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 8,100 | 1,803.00 | 14,604,300 | |
| なとり | 6,900 | 1,611.00 | 11,115,900 | |
| イフジ産業 | 2,200 | 670.00 | 1,474,000 | |
| ピックルスコーポレーション | 2,900 | 2,484.00 | 7,203,600 | |
| 北の達人コーポレーション | 48,500 | 611.00 | 29,633,500 | |
| ユーグレナ | 52,700 | 1,024.00 | 53,964,800 | |
| ミヨシ油脂 | 4,700 | 1,109.00 | 5,212,300 | |
| 理研ビタミン | 5,800 | 3,480.00 | 20,184,000 | |
| 片倉工業 | 15,100 | 1,294.00 | 19,539,400 | |
| グンゼ | 8,200 | 4,980.00 | 40,836,000 | |
| 東洋紡 | 51,400 | 1,319.00 | 67,796,600 | |
| ユニチカ | 36,300 | 406.00 | 14,737,800 | |
| 富士紡ホールディングス | 6,400 | 2,344.00 | 15,001,600 | |
| 倉敷紡績 | 11,700 | 1,932.00 | 22,604,400 | |
| シキボウ | 6,300 | 1,005.00 | 6,331,500 | |
| 日本毛織 | 40,100 | 838.00 | 33,603,800 | |
| トーア紡コーポレーション | 5,100 | 457.00 | 2,330,700 | |
| 帝国繊維 | 13,700 | 2,099.00 | 28,756,300 | |
| 帝人 | 98,600 | 1,819.00 | 179,353,400 | |
| 東レ | 935,900 | 770.00 | 720,643,000 | |
| サカイオーベックス | 3,200 | 1,741.00 | 5,571,200 | |
| 住江織物 | 3,500 | 3,000.00 | 10,500,000 | |
| 日本フエルト | 7,700 | 452.00 | 3,480,400 | |
| イチカワ | 2,000 | 1,786.00 | 3,572,000 | |
| 日東製網 | 1,400 | 1,438.00 | 2,013,200 | |
| アツギ | 10,100 | 911.00 | 9,201,100 | |
| ダイニック | 4,900 | 745.00 | 3,650,500 | |
| セーレン | 29,900 | 1,540.00 | 46,046,000 | |
| ソトー | 4,900 | 970.00 | 4,753,000 | |
| 東海染工 | 1,800 | 1,128.00 | 2,030,400 | |
| 小松マテーレ | 19,900 | 786.00 | 15,641,400 | |
| ワコールホールディングス | 34,100 | 2,806.00 | 95,684,600 | |
| ホギメディカル | 15,000 | 3,175.00 | 47,625,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| レナウン | 34,900 | 102.00 | 3,559,800 | |
| クラウディアホールディングス | 3,200 | 528.00 | 1,689,600 | |
| ＴＳＩホールディングス | 44,700 | 635.00 | 28,384,500 | |
| マツオカコーポレーション | 3,900 | 2,610.00 | 10,179,000 | |
| ワールド | 15,800 | 2,040.00 | 32,232,000 | |
| 三陽商会 | 7,300 | 1,597.00 | 11,658,100 | |
| ナイガイ | 4,700 | 461.00 | 2,166,700 | |
| オンワードホールディングス | 72,600 | 585.00 | 42,471,000 | |
| ルックホールディングス | 4,500 | 1,262.00 | 5,679,000 | |
| ゴールドウイン | 10,900 | 13,720.00 | 149,548,000 | |
| デサント | 29,500 | 1,780.00 | 52,510,000 | |
| キング | 6,600 | 605.00 | 3,993,000 | |
| ヤマトインターナショナル | 7,600 | 418.00 | 3,176,800 | |
| 特種東海製紙 | 7,700 | 3,905.00 | 30,068,500 | |
| 王子ホールディングス | 542,800 | 588.00 | 319,166,400 | |
| 日本製紙 | 57,800 | 1,901.00 | 109,877,800 | |
| 三菱製紙 | 19,600 | 589.00 | 11,544,400 | |
| 北越コーポレーション | 80,000 | 561.00 | 44,880,000 | |
| 中越パルプ工業 | 5,100 | 1,571.00 | 8,012,100 | |
| 巴川製紙所 | 4,000 | 886.00 | 3,544,000 | |
| 大王製紙 | 58,800 | 1,290.00 | 75,852,000 | |
| 阿波製紙 | 3,100 | 443.00 | 1,373,300 | |
| レンゴー | 124,300 | 830.00 | 103,169,000 | |
| トーモク | 7,400 | 1,816.00 | 13,438,400 | |
| ザ・パック | 9,100 | 3,300.00 | 30,030,000 | |
| クラレ | 203,500 | 1,254.00 | 255,189,000 | |
| 旭化成 | 857,800 | 1,103.00 | 946,153,400 | |
| 共和レザー | 7,500 | 806.00 | 6,045,000 | |
| 昭和電工 | 80,100 | 2,944.00 | 235,814,400 | |
| 住友化学 | 949,100 | 483.00 | 458,415,300 | |
| 住友精化 | 5,900 | 3,275.00 | 19,322,500 | |
| 日産化学 | 73,500 | 4,645.00 | 341,407,500 | |
| ラサ工業 | 4,300 | 1,406.00 | 6,045,800 | |
| クレハ | 11,100 | 7,120.00 | 79,032,000 | |
| 多木化学 | 3,500 | 4,190.00 | 14,665,000 | |
| テイカ | 9,800 | 2,425.00 | 23,765,000 | |
| 石原産業 | 23,200 | 1,197.00 | 27,770,400 | |
| 片倉コープアグリ | 3,500 | 1,055.00 | 3,692,500 | |
| 日本曹達 | 19,000 | 2,688.00 | 51,072,000 | |
| 東ソー | 186,400 | 1,485.00 | 276,804,000 | |
| トクヤマ | 34,800 | 2,718.00 | 94,586,400 | |
| セントラル硝子 | 26,300 | 2,449.00 | 64,408,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東亞合成 | 75,700 | 1,153.00 | 87,282,100 | |
| 大阪ソーダ | 13,000 | 2,626.00 | 34,138,000 | |
| 関東電化工業 | 28,600 | 712.00 | 20,363,200 | |
| デンカ | 47,400 | 3,130.00 | 148,362,000 | |
| 信越化学工業 | 212,500 | 9,691.00 | 2,059,337,500 | |
| 日本カーバイド工業 | 4,100 | 1,369.00 | 5,612,900 | |
| 堺化学工業 | 8,000 | 2,598.00 | 20,784,000 | |
| 第一稀元素化学工業 | 13,100 | 862.00 | 11,292,200 | |
| エア・ウォーター | 98,700 | 1,746.00 | 172,330,200 | |
| 大陽日酸 | 99,300 | 2,139.00 | 212,402,700 | |
| 日本化学工業 | 4,100 | 2,114.00 | 8,667,400 | |
| 東邦アセチレン | 1,800 | 1,300.00 | 2,340,000 | |
| 日本パーカライジング | 65,900 | 1,180.00 | 77,762,000 | |
| 高圧ガス工業 | 19,100 | 860.00 | 16,426,000 | |
| チタン工業 | 1,500 | 3,005.00 | 4,507,500 | |
| 四国化成工業 | 20,300 | 1,150.00 | 23,345,000 | |
| 戸田工業 | 2,600 | 2,318.00 | 6,026,800 | |
| ステラ　ケミファ | 7,100 | 2,763.00 | 19,617,300 | |
| 保土谷化学工業 | 4,200 | 2,746.00 | 11,533,200 | |
| 日本触媒 | 20,300 | 7,100.00 | 144,130,000 | |
| 大日精化工業 | 10,000 | 3,085.00 | 30,850,000 | |
| カネカ | 31,200 | 3,995.00 | 124,644,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 122,600 | 1,411.00 | 172,988,600 | |
| 三井化学 | 109,400 | 2,524.00 | 276,125,600 | |
| ＪＳＲ | 121,000 | 1,633.00 | 197,593,000 | |
| 東京応化工業 | 20,700 | 3,370.00 | 69,759,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 11,100 | 957.00 | 10,622,700 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 806,100 | 743.40 | 599,254,740 | |
| ＫＨネオケム | 18,400 | 2,831.00 | 52,090,400 | |
| ダイセル | 177,600 | 934.00 | 165,878,400 | |
| 住友ベークライト | 20,900 | 3,560.00 | 74,404,000 | |
| 積水化学工業 | 259,300 | 1,604.00 | 415,917,200 | |
| 日本ゼオン | 108,700 | 1,168.00 | 126,961,600 | |
| アイカ工業 | 36,200 | 3,600.00 | 130,320,000 | |
| 宇部興産 | 60,900 | 2,185.00 | 133,066,500 | |
| 積水樹脂 | 19,900 | 2,090.00 | 41,591,000 | |
| タキロンシーアイ | 26,100 | 656.00 | 17,121,600 | |
| 旭有機材 | 8,300 | 1,386.00 | 11,503,800 | |
| 日立化成 | 55,800 | 2,945.00 | 164,331,000 | |
| ニチバン | 6,300 | 2,023.00 | 12,744,900 | |
| リケンテクノス | 32,900 | 532.00 | 17,502,800 | |
| 大倉工業 | 6,200 | 1,730.00 | 10,726,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 積水化成品工業 | 18,000 | 756.00 | 13,608,000 | |
| 群栄化学工業 | 3,100 | 2,408.00 | 7,464,800 | |
| タイガースポリマー | 6,300 | 569.00 | 3,584,700 | |
| ミライアル | 3,500 | 1,355.00 | 4,742,500 | |
| ダイキアクシス | 4,300 | 865.00 | 3,719,500 | |
| ダイキョーニシカワ | 25,400 | 896.00 | 22,758,400 | |
| 竹本容器 | 4,300 | 1,252.00 | 5,383,600 | |
| 森六ホールディングス | 6,500 | 2,444.00 | 15,886,000 | |
| 日本化薬 | 74,600 | 1,322.00 | 98,621,200 | |
| カーリットホールディングス | 12,900 | 635.00 | 8,191,500 | |
| 日本精化 | 9,700 | 1,234.00 | 11,969,800 | |
| 扶桑化学工業 | 12,200 | 2,076.00 | 25,327,200 | |
| トリケミカル研究所 | 2,700 | 4,570.00 | 12,339,000 | |
| ＡＤＥＫＡ | 59,400 | 1,603.00 | 95,218,200 | |
| 日油 | 45,400 | 3,930.00 | 178,422,000 | |
| 新日本理化 | 21,800 | 211.00 | 4,599,800 | |
| ハリマ化成グループ | 10,000 | 1,031.00 | 10,310,000 | |
| 花王 | 298,900 | 8,275.00 | 2,473,397,500 | |
| 第一工業製薬 | 4,500 | 3,440.00 | 15,480,000 | |
| 石原ケミカル | 3,000 | 1,625.00 | 4,875,000 | |
| 日華化学 | 4,100 | 845.00 | 3,464,500 | |
| ニイタカ | 1,900 | 1,415.00 | 2,688,500 | |
| 三洋化成工業 | 8,100 | 5,520.00 | 44,712,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 9,200 | 235.00 | 2,162,000 | |
| 大日本塗料 | 13,600 | 1,028.00 | 13,980,800 | |
| 日本ペイントホールディングス | 99,500 | 4,400.00 | 437,800,000 | |
| 関西ペイント | 135,500 | 2,092.00 | 283,466,000 | |
| 神東塗料 | 9,500 | 172.00 | 1,634,000 | |
| 中国塗料 | 39,600 | 926.00 | 36,669,600 | |
| 日本特殊塗料 | 9,000 | 1,385.00 | 12,465,000 | |
| 藤倉化成 | 16,300 | 578.00 | 9,421,400 | |
| 太陽ホールディングス | 9,900 | 3,235.00 | 32,026,500 | |
| ＤＩＣ | 54,600 | 2,811.00 | 153,480,600 | |
| サカタインクス | 26,300 | 1,033.00 | 27,167,900 | |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 25,500 | 2,315.00 | 59,032,500 | |
| Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ | 9,300 | 980.00 | 9,114,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 255,700 | 5,415.00 | 1,384,615,500 | |
| 資生堂 | 244,600 | 8,124.00 | 1,987,130,400 | |
| ライオン | 171,500 | 2,103.00 | 360,664,500 | |
| 高砂香料工業 | 8,500 | 2,953.00 | 25,100,500 | |
| マンダム | 27,700 | 2,677.00 | 74,152,900 | |
| ミルボン | 15,200 | 5,470.00 | 83,144,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ファンケル | 54,800 | 2,610.00 | 143,028,000 | |
| コーセー | 20,800 | 17,820.00 | 370,656,000 | |
| コタ | 6,400 | 1,183.00 | 7,571,200 | |
| シーボン | 1,500 | 2,356.00 | 3,534,000 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 52,500 | 2,969.00 | 155,872,500 | |
| ノエビアホールディングス | 11,800 | 5,910.00 | 69,738,000 | |
| アジュバンコスメジャパン | 2,700 | 938.00 | 2,532,600 | |
| エステー | 8,800 | 1,640.00 | 14,432,000 | |
| アグロ　カネショウ | 5,000 | 1,815.00 | 9,075,000 | |
| コニシ | 21,800 | 1,538.00 | 33,528,400 | |
| 長谷川香料 | 16,300 | 1,974.00 | 32,176,200 | |
| 星光ＰＭＣ | 8,200 | 775.00 | 6,355,000 | |
| 小林製薬 | 34,500 | 7,730.00 | 266,685,000 | |
| 荒川化学工業 | 11,100 | 1,494.00 | 16,583,400 | |
| メック | 8,400 | 1,070.00 | 8,988,000 | |
| 日本高純度化学 | 3,400 | 2,360.00 | 8,024,000 | |
| タカラバイオ | 32,200 | 2,149.00 | 69,197,800 | |
| ＪＣＵ | 16,000 | 2,061.00 | 32,976,000 | |
| 新田ゼラチン | 7,700 | 725.00 | 5,582,500 | |
| ＯＡＴアグリオ | 1,700 | 1,369.00 | 2,327,300 | |
| デクセリアルズ | 31,700 | 709.00 | 22,475,300 | |
| アース製薬 | 9,300 | 4,865.00 | 45,244,500 | |
| 北興化学工業 | 12,600 | 488.00 | 6,148,800 | |
| 大成ラミック | 4,000 | 2,846.00 | 11,384,000 | |
| クミアイ化学工業 | 50,900 | 794.00 | 40,414,600 | |
| 日本農薬 | 21,900 | 421.00 | 9,219,900 | |
| アキレス | 9,000 | 2,067.00 | 18,603,000 | |
| 有沢製作所 | 19,400 | 889.00 | 17,246,600 | |
| 日東電工 | 85,000 | 5,084.00 | 432,140,000 | |
| レック | 13,100 | 1,219.00 | 15,968,900 | |
| 三光合成 | 14,100 | 364.00 | 5,132,400 | |
| きもと | 20,900 | 171.00 | 3,573,900 | |
| 藤森工業 | 11,000 | 2,978.00 | 32,758,000 | |
| 前澤化成工業 | 8,400 | 1,111.00 | 9,332,400 | |
| 未来工業 | 6,600 | 1,905.00 | 12,573,000 | |
| ウェーブロックホールディングス | 3,400 | 689.00 | 2,342,600 | |
| ＪＳＰ | 7,200 | 1,999.00 | 14,392,800 | |
| エフピコ | 13,500 | 6,600.00 | 89,100,000 | |
| 天馬 | 8,500 | 1,858.00 | 15,793,000 | |
| 信越ポリマー | 22,100 | 741.00 | 16,376,100 | |
| 東リ | 30,700 | 250.00 | 7,675,000 | |
| ニフコ | 49,300 | 2,698.00 | 133,011,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| バルカー | 10,000 | 2,237.00 | 22,370,000 | |
| ユニ・チャーム | 261,000 | 3,187.00 | 831,807,000 | |
| ショーエイコーポレーション | 1,000 | 778.00 | 778,000 | |
| 協和キリン | 144,500 | 1,913.00 | 276,428,500 | |
| 武田薬品工業 | 1,074,800 | 3,862.00 | 4,150,877,600 | |
| アステラス製薬 | 1,083,000 | 1,572.50 | 1,703,017,500 | |
| 大日本住友製薬 | 91,300 | 2,006.00 | 183,147,800 | |
| 塩野義製薬 | 157,400 | 6,238.00 | 981,861,200 | |
| 田辺三菱製薬 | 128,800 | 1,237.00 | 159,325,600 | |
| わかもと製薬 | 14,600 | 266.00 | 3,883,600 | |
| あすか製薬 | 15,200 | 1,287.00 | 19,562,400 | |
| 日本新薬 | 32,200 | 7,990.00 | 257,278,000 | |
| ビオフェルミン製薬 | 2,100 | 2,274.00 | 4,775,400 | |
| 中外製薬 | 128,400 | 7,250.00 | 930,900,000 | |
| 科研製薬 | 21,100 | 5,520.00 | 116,472,000 | |
| エーザイ | 147,400 | 6,156.00 | 907,394,400 | |
| ロート製薬 | 63,100 | 3,045.00 | 192,139,500 | |
| 小野薬品工業 | 290,800 | 2,021.50 | 587,852,200 | |
| 久光製薬 | 36,400 | 4,410.00 | 160,524,000 | |
| 持田製薬 | 18,600 | 4,705.00 | 87,513,000 | |
| 参天製薬 | 229,200 | 1,772.00 | 406,142,400 | |
| 扶桑薬品工業 | 4,300 | 1,920.00 | 8,256,000 | |
| 日本ケミファ | 1,600 | 2,933.00 | 4,692,800 | |
| ツムラ | 38,100 | 3,060.00 | 116,586,000 | |
| 日医工 | 32,400 | 1,287.00 | 41,698,800 | |
| キッセイ薬品工業 | 21,800 | 2,737.00 | 59,666,600 | |
| 生化学工業 | 23,900 | 1,285.00 | 30,711,500 | |
| 栄研化学 | 21,600 | 1,806.00 | 39,009,600 | |
| 日水製薬 | 5,200 | 1,225.00 | 6,370,000 | |
| 鳥居薬品 | 6,600 | 2,634.00 | 17,384,400 | |
| ＪＣＲファーマ | 8,700 | 6,520.00 | 56,724,000 | |
| 東和薬品 | 17,700 | 2,887.00 | 51,099,900 | |
| 富士製薬工業 | 8,400 | 1,455.00 | 12,222,000 | |
| 沢井製薬 | 25,300 | 6,120.00 | 154,836,000 | |
| ゼリア新薬工業 | 24,400 | 2,124.00 | 51,825,600 | |
| 第一三共 | 352,300 | 5,955.00 | 2,097,946,500 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 27,200 | 1,877.00 | 51,054,400 | |
| 大幸薬品 | 5,500 | 2,200.00 | 12,100,000 | |
| ダイト | 7,200 | 3,420.00 | 24,624,000 | |
| 大塚ホールディングス | 234,500 | 3,886.00 | 911,267,000 | |
| 大正製薬ホールディングス | 27,600 | 8,480.00 | 234,048,000 | |
| ペプチドリーム | 61,700 | 5,630.00 | 347,371,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本コークス工業 | 104,000 | 93.00 | 9,672,000 | |
| ニチレキ | 15,700 | 1,054.00 | 16,547,800 | |
| ユシロ化学工業 | 6,400 | 1,328.00 | 8,499,200 | |
| ビーピー・カストロール | 4,400 | 1,361.00 | 5,988,400 | |
| 富士石油 | 29,900 | 268.00 | 8,013,200 | |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 4,400 | 1,453.00 | 6,393,200 | |
| 出光興産 | 142,100 | 3,190.00 | 453,299,000 | |
| ＪＸＴＧホールディングス | 2,070,800 | 535.10 | 1,108,085,080 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 35,600 | 2,446.00 | 87,077,600 | |
| 横浜ゴム | 71,300 | 2,042.00 | 145,594,600 | |
| ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ | 63,200 | 1,507.00 | 95,242,400 | |
| ブリヂストン | 378,400 | 4,204.00 | 1,590,793,600 | |
| 住友ゴム工業 | 110,600 | 1,232.00 | 136,259,200 | |
| 藤倉コンポジット | 10,800 | 433.00 | 4,676,400 | |
| オカモト | 8,200 | 4,960.00 | 40,672,000 | |
| フコク | 5,400 | 742.00 | 4,006,800 | |
| ニッタ | 13,900 | 3,055.00 | 42,464,500 | |
| 住友理工 | 23,900 | 834.00 | 19,932,600 | |
| 三ツ星ベルト | 16,200 | 2,022.00 | 32,756,400 | |
| バンドー化学 | 23,500 | 979.00 | 23,006,500 | |
| 日東紡績 | 18,300 | 2,325.00 | 42,547,500 | |
| ＡＧＣ | 121,700 | 3,680.00 | 447,856,000 | |
| 日本板硝子 | 58,900 | 719.00 | 42,349,100 | |
| 石塚硝子 | 2,100 | 2,136.00 | 4,485,600 | |
| 日本山村硝子 | 5,100 | 1,401.00 | 7,145,100 | |
| 日本電気硝子 | 53,300 | 2,738.00 | 145,935,400 | |
| オハラ | 4,900 | 1,557.00 | 7,629,300 | |
| 住友大阪セメント | 24,900 | 4,115.00 | 102,463,500 | |
| 太平洋セメント | 77,800 | 3,175.00 | 247,015,000 | |
| 日本ヒューム | 12,400 | 707.00 | 8,766,800 | |
| 日本コンクリート工業 | 26,600 | 290.00 | 7,714,000 | |
| 三谷セキサン | 5,700 | 2,992.00 | 17,054,400 | |
| アジアパイルホールディングス | 17,500 | 570.00 | 9,975,000 | |
| 東海カーボン | 111,800 | 1,052.00 | 117,613,600 | |
| 日本カーボン | 5,900 | 4,110.00 | 24,249,000 | |
| 東洋炭素 | 7,200 | 2,215.00 | 15,948,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 7,400 | 4,495.00 | 33,263,000 | |
| ＴＯＴＯ | 94,700 | 4,330.00 | 410,051,000 | |
| 日本碍子 | 150,300 | 1,564.00 | 235,069,200 | |
| 日本特殊陶業 | 103,800 | 1,931.00 | 200,437,800 | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 4,300 | 5,690.00 | 24,467,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 3,300 | 2,922.00 | 9,642,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 黒崎播磨 | 2,400 | 6,040.00 | 14,496,000 | |
| ヨータイ | 10,800 | 540.00 | 5,832,000 | |
| イソライト工業 | 6,400 | 457.00 | 2,924,800 | |
| 東京窯業 | 15,800 | 296.00 | 4,676,800 | |
| ニッカトー | 5,600 | 674.00 | 3,774,400 | |
| フジミインコーポレーテッド | 11,000 | 2,232.00 | 24,552,000 | |
| クニミネ工業 | 5,600 | 870.00 | 4,872,000 | |
| エーアンドエーマテリアル | 2,400 | 1,019.00 | 2,445,600 | |
| ニチアス | 33,700 | 1,960.00 | 66,052,000 | |
| ニチハ | 17,100 | 3,030.00 | 51,813,000 | |
| 日本製鉄 | 565,800 | 1,813.00 | 1,025,795,400 | |
| 神戸製鋼所 | 222,900 | 692.00 | 154,246,800 | |
| 中山製鋼所 | 17,000 | 497.00 | 8,449,000 | |
| 合同製鐵 | 5,900 | 2,089.00 | 12,325,100 | |
| ジェイ　エフ　イー　ホールディングス | 328,800 | 1,523.50 | 500,926,800 | |
| 東京製鐵 | 65,300 | 823.00 | 53,741,900 | |
| 共英製鋼 | 13,800 | 1,864.00 | 25,723,200 | |
| 大和工業 | 25,900 | 3,095.00 | 80,160,500 | |
| 東京鐵鋼 | 5,100 | 1,305.00 | 6,655,500 | |
| 大阪製鐵 | 8,100 | 1,718.00 | 13,915,800 | |
| 淀川製鋼所 | 16,500 | 2,086.00 | 34,419,000 | |
| 丸一鋼管 | 43,100 | 2,857.00 | 123,136,700 | |
| モリ工業 | 3,700 | 1,958.00 | 7,244,600 | |
| 大同特殊鋼 | 19,900 | 3,990.00 | 79,401,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 4,600 | 466.00 | 2,143,600 | |
| 日本冶金工業 | 101,000 | 224.00 | 22,624,000 | |
| 山陽特殊製鋼 | 15,400 | 1,436.00 | 22,114,400 | |
| 愛知製鋼 | 6,900 | 3,175.00 | 21,907,500 | |
| 日立金属 | 131,200 | 1,186.00 | 155,603,200 | |
| 日本金属 | 2,800 | 910.00 | 2,548,000 | |
| 大平洋金属 | 8,300 | 2,259.00 | 18,749,700 | |
| 新日本電工 | 73,100 | 203.00 | 14,839,300 | |
| 栗本鐵工所 | 6,200 | 1,498.00 | 9,287,600 | |
| 虹技 | 1,800 | 1,342.00 | 2,415,600 | |
| 三菱製鋼 | 9,100 | 1,230.00 | 11,193,000 | |
| 日亜鋼業 | 18,000 | 339.00 | 6,102,000 | |
| 日本精線 | 1,800 | 2,628.00 | 4,730,400 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 4,700 | 672.00 | 3,158,400 | |
| シンニッタン | 19,100 | 338.00 | 6,455,800 | |
| 新家工業 | 2,800 | 1,504.00 | 4,211,200 | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 20,200 | 770.00 | 15,554,000 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 332,400 | 228.00 | 75,787,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三井金属鉱業 | 32,900 | 2,428.00 | 79,881,200 | |
| 東邦亜鉛 | 6,800 | 2,453.00 | 16,680,400 | |
| 三菱マテリアル | 80,500 | 2,999.00 | 241,419,500 | |
| 住友金属鉱山 | 166,800 | 3,135.00 | 522,918,000 | |
| ＤＯＷＡホールディングス | 28,500 | 3,370.00 | 96,045,000 | |
| 古河機械金属 | 20,200 | 1,388.00 | 28,037,600 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 14,100 | 1,816.00 | 25,605,600 | |
| 東邦チタニウム | 21,900 | 1,016.00 | 22,250,400 | |
| ＵＡＣＪ | 18,600 | 1,808.00 | 33,628,800 | |
| ＣＫサンエツ | 2,300 | 2,800.00 | 6,440,000 | |
| 古河電気工業 | 35,200 | 3,175.00 | 111,760,000 | |
| 住友電気工業 | 455,300 | 1,415.50 | 644,477,150 | |
| フジクラ | 147,400 | 413.00 | 60,876,200 | |
| 昭和電線ホールディングス | 14,100 | 889.00 | 12,534,900 | |
| 東京特殊電線 | 1,600 | 1,839.00 | 2,942,400 | |
| タツタ電線 | 24,400 | 521.00 | 12,712,400 | |
| カナレ電気 | 2,100 | 1,880.00 | 3,948,000 | |
| 平河ヒューテック | 5,200 | 1,232.00 | 6,406,400 | |
| リョービ | 15,000 | 2,043.00 | 30,645,000 | |
| アーレスティ | 15,200 | 562.00 | 8,542,400 | |
| アサヒホールディングス | 22,900 | 2,285.00 | 52,326,500 | |
| 稲葉製作所 | 6,900 | 1,482.00 | 10,225,800 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 3,700 | 1,862.00 | 6,889,400 | |
| トーカロ | 31,400 | 806.00 | 25,308,400 | |
| アルファＣｏ | 4,300 | 1,245.00 | 5,353,500 | |
| ＳＵＭＣＯ | 134,500 | 1,300.00 | 174,850,000 | |
| 川田テクノロジーズ | 2,700 | 7,630.00 | 20,601,000 | |
| ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ | 2,500 | 3,030.00 | 7,575,000 | |
| 信和 | 6,400 | 941.00 | 6,022,400 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 77,600 | 2,059.00 | 159,778,400 | |
| ホッカンホールディングス | 6,200 | 1,731.00 | 10,732,200 | |
| コロナ | 6,800 | 1,083.00 | 7,364,400 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 22,700 | 1,681.00 | 38,158,700 | |
| 駒井ハルテック | 2,300 | 1,673.00 | 3,847,900 | |
| 高田機工 | 1,100 | 2,503.00 | 2,753,300 | |
| 三和ホールディングス | 125,800 | 1,138.00 | 143,160,400 | |
| 文化シヤッター | 35,900 | 858.00 | 30,802,200 | |
| 三協立山 | 16,900 | 1,208.00 | 20,415,200 | |
| アルインコ | 9,700 | 1,005.00 | 9,748,500 | |
| 東洋シヤッター | 3,000 | 692.00 | 2,076,000 | |
| ＬＩＸＩＬグループ | 179,700 | 1,802.00 | 323,819,400 | |
| 日本フイルコン | 9,400 | 479.00 | 4,502,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ノーリツ | 27,200 | 1,338.00 | 36,393,600 | |
| 長府製作所 | 12,400 | 2,268.00 | 28,123,200 | |
| リンナイ | 21,700 | 6,940.00 | 150,598,000 | |
| ダイニチ工業 | 6,600 | 632.00 | 4,171,200 | |
| 日東精工 | 16,900 | 590.00 | 9,971,000 | |
| 三洋工業 | 1,600 | 1,793.00 | 2,868,800 | |
| 岡部 | 24,700 | 933.00 | 23,045,100 | |
| ジーテクト | 13,400 | 1,515.00 | 20,301,000 | |
| 東プレ | 22,700 | 1,735.00 | 39,384,500 | |
| 高周波熱錬 | 23,500 | 888.00 | 20,868,000 | |
| 東京製綱 | 7,500 | 985.00 | 7,387,500 | |
| サンコール | 6,900 | 518.00 | 3,574,200 | |
| モリテック　スチール | 9,600 | 376.00 | 3,609,600 | |
| パイオラックス | 19,500 | 1,903.00 | 37,108,500 | |
| エイチワン | 12,000 | 756.00 | 9,072,000 | |
| 日本発條 | 121,300 | 838.00 | 101,649,400 | |
| 中央発條 | 1,500 | 2,891.00 | 4,336,500 | |
| アドバネクス | 1,600 | 1,705.00 | 2,728,000 | |
| 立川ブラインド工業 | 5,400 | 1,408.00 | 7,603,200 | |
| 三益半導体工業 | 10,900 | 1,579.00 | 17,211,100 | |
| 日本ドライケミカル | 3,400 | 1,134.00 | 3,855,600 | |
| 日本製鋼所 | 37,000 | 1,796.00 | 66,452,000 | |
| 三浦工業 | 52,700 | 3,170.00 | 167,059,000 | |
| タクマ | 44,500 | 1,380.00 | 61,410,000 | |
| ツガミ | 27,500 | 941.00 | 25,877,500 | |
| オークマ | 15,500 | 5,540.00 | 85,870,000 | |
| 東芝機械 | 13,800 | 2,386.00 | 32,926,800 | |
| アマダホールディングス | 183,000 | 1,199.00 | 219,417,000 | |
| アイダエンジニアリング | 33,000 | 902.00 | 29,766,000 | |
| 滝澤鉄工所 | 3,800 | 1,421.00 | 5,399,800 | |
| ＦＵＪＩ | 48,700 | 1,407.00 | 68,520,900 | |
| 牧野フライス製作所 | 14,300 | 4,435.00 | 63,420,500 | |
| オーエスジー | 60,000 | 2,190.00 | 131,400,000 | |
| ダイジェット工業 | 1,400 | 1,656.00 | 2,318,400 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 32,100 | 678.00 | 21,763,800 | |
| DMG森精機 | 77,100 | 1,773.00 | 136,698,300 | |
| ソディック | 26,700 | 965.00 | 25,765,500 | |
| ディスコ | 16,500 | 18,450.00 | 304,425,000 | |
| 日東工器 | 6,700 | 2,173.00 | 14,559,100 | |
| 日進工具 | 3,600 | 2,062.00 | 7,423,200 | |
| パンチ工業 | 8,600 | 583.00 | 5,013,800 | |
| 冨士ダイス | 5,500 | 689.00 | 3,789,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 豊和工業 | 6,800 | 860.00 | 5,848,000 | |
| ＯＫＫ | 5,100 | 825.00 | 4,207,500 | |
| 東洋機械金属 | 8,900 | 595.00 | 5,295,500 | |
| 津田駒工業 | 2,700 | 1,607.00 | 4,338,900 | |
| エンシュウ | 3,300 | 1,190.00 | 3,927,000 | |
| 島精機製作所 | 16,800 | 3,135.00 | 52,668,000 | |
| オプトラン | 11,900 | 2,566.00 | 30,535,400 | |
| ＮＣホールディングス | 4,100 | 480.00 | 1,968,000 | |
| イワキポンプ | 5,300 | 1,136.00 | 6,020,800 | |
| フリュー | 9,800 | 1,148.00 | 11,250,400 | |
| ヤマシンフィルタ | 21,300 | 642.00 | 13,674,600 | |
| 日阪製作所 | 15,100 | 898.00 | 13,559,800 | |
| やまびこ | 23,700 | 922.00 | 21,851,400 | |
| 平田機工 | 5,800 | 6,240.00 | 36,192,000 | |
| ペガサスミシン製造 | 11,600 | 567.00 | 6,577,200 | |
| マルマエ | 5,100 | 798.00 | 4,069,800 | |
| タツモ | 5,200 | 812.00 | 4,222,400 | |
| ナブテスコ | 67,000 | 2,961.00 | 198,387,000 | |
| 三井海洋開発 | 13,000 | 2,942.00 | 38,246,000 | |
| レオン自動機 | 12,000 | 1,801.00 | 21,612,000 | |
| ＳＭＣ | 36,100 | 39,620.00 | 1,430,282,000 | |
| ヤマハモーターロボティクスホールディングス | 9,200 | 437.00 | 4,020,400 | |
| ホソカワミクロン | 4,300 | 4,445.00 | 19,113,500 | |
| ユニオンツール | 5,300 | 3,090.00 | 16,377,000 | |
| オイレス工業 | 17,100 | 1,566.00 | 26,778,600 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 4,100 | 2,527.00 | 10,360,700 | |
| サトーホールディングス | 14,700 | 2,724.00 | 40,042,800 | |
| 技研製作所 | 10,700 | 3,250.00 | 34,775,000 | |
| 日本エアーテック | 4,000 | 584.00 | 2,336,000 | |
| カワタ | 3,400 | 1,076.00 | 3,658,400 | |
| 日精樹脂工業 | 10,300 | 1,029.00 | 10,598,700 | |
| オカダアイヨン | 4,200 | 1,294.00 | 5,434,800 | |
| ワイエイシイホールディングス | 4,800 | 944.00 | 4,531,200 | |
| 小松製作所 | 557,500 | 2,523.50 | 1,406,851,250 | |
| 住友重機械工業 | 70,500 | 3,615.00 | 254,857,500 | |
| 日立建機 | 49,400 | 2,731.00 | 134,911,400 | |
| 日工 | 3,400 | 2,948.00 | 10,023,200 | |
| 巴工業 | 5,300 | 2,384.00 | 12,635,200 | |
| 井関農機 | 12,400 | 1,559.00 | 19,331,600 | |
| ＴＯＷＡ | 10,600 | 832.00 | 8,819,200 | |
| 丸山製作所 | 2,800 | 1,113.00 | 3,116,400 | |
| 北川鉄工所 | 5,600 | 2,208.00 | 12,364,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ローツェ | 5,400 | 2,319.00 | 12,522,600 | |
| タカキタ | 4,500 | 558.00 | 2,511,000 | |
| クボタ | 659,600 | 1,747.00 | 1,152,321,200 | |
| 荏原実業 | 3,700 | 2,002.00 | 7,407,400 | |
| 三菱化工機 | 4,300 | 1,659.00 | 7,133,700 | |
| 月島機械 | 24,500 | 1,254.00 | 30,723,000 | |
| 帝国電機製作所 | 8,700 | 1,201.00 | 10,448,700 | |
| 新東工業 | 29,300 | 954.00 | 27,952,200 | |
| 澁谷工業 | 10,800 | 2,952.00 | 31,881,600 | |
| アイチ　コーポレーション | 21,400 | 713.00 | 15,258,200 | |
| 小森コーポレーション | 31,300 | 1,169.00 | 36,589,700 | |
| 鶴見製作所 | 9,600 | 1,936.00 | 18,585,600 | |
| 住友精密工業 | 2,100 | 2,764.00 | 5,804,400 | |
| 酒井重工業 | 2,300 | 2,690.00 | 6,187,000 | |
| 荏原製作所 | 54,600 | 2,889.00 | 157,739,400 | |
| 石井鐵工所 | 1,900 | 1,993.00 | 3,786,700 | |
| 酉島製作所 | 12,700 | 1,044.00 | 13,258,800 | |
| 北越工業 | 12,800 | 1,222.00 | 15,641,600 | |
| ダイキン工業 | 168,100 | 14,160.00 | 2,380,296,000 | |
| オルガノ | 4,500 | 3,560.00 | 16,020,000 | |
| トーヨーカネツ | 4,700 | 2,128.00 | 10,001,600 | |
| 栗田工業 | 66,700 | 2,740.00 | 182,758,000 | |
| 椿本チエイン | 16,100 | 3,520.00 | 56,672,000 | |
| 大同工業 | 6,000 | 881.00 | 5,286,000 | |
| 木村化工機 | 10,600 | 349.00 | 3,699,400 | |
| アネスト岩田 | 19,300 | 948.00 | 18,296,400 | |
| ダイフク | 67,800 | 5,950.00 | 403,410,000 | |
| サムコ | 3,500 | 871.00 | 3,048,500 | |
| 加藤製作所 | 6,300 | 2,007.00 | 12,644,100 | |
| 油研工業 | 2,100 | 1,696.00 | 3,561,600 | |
| タダノ | 59,500 | 1,084.00 | 64,498,000 | |
| フジテック | 44,800 | 1,405.00 | 62,944,000 | |
| ＣＫＤ | 34,300 | 1,117.00 | 38,313,100 | |
| キトー | 9,400 | 1,652.00 | 15,528,800 | |
| 平和 | 34,400 | 2,177.00 | 74,888,800 | |
| 理想科学工業 | 10,900 | 1,733.00 | 18,889,700 | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 30,800 | 3,890.00 | 119,812,000 | |
| 日本金銭機械 | 13,700 | 1,100.00 | 15,070,000 | |
| マースグループホールディングス | 7,900 | 2,038.00 | 16,100,200 | |
| 福島工業 | 7,600 | 3,410.00 | 25,916,000 | |
| オーイズミ | 5,400 | 384.00 | 2,073,600 | |
| ダイコク電機 | 5,700 | 1,351.00 | 7,700,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 竹内製作所 | 20,700 | 1,768.00 | 36,597,600 | |
| アマノ | 35,200 | 3,040.00 | 107,008,000 | |
| ＪＵＫＩ | 17,100 | 1,013.00 | 17,322,300 | |
| 蛇の目ミシン工業 | 11,400 | 461.00 | 5,255,400 | |
| マックス | 18,800 | 1,588.00 | 29,854,400 | |
| グローリー | 34,100 | 2,902.00 | 98,958,200 | |
| 新晃工業 | 11,500 | 1,655.00 | 19,032,500 | |
| 大和冷機工業 | 17,900 | 1,064.00 | 19,045,600 | |
| セガサミーホールディングス | 122,200 | 1,349.00 | 164,847,800 | |
| 日本ピストンリング | 4,600 | 1,400.00 | 6,440,000 | |
| リケン | 5,700 | 4,145.00 | 23,626,500 | |
| ＴＰＲ | 16,600 | 1,843.00 | 30,593,800 | |
| ツバキ・ナカシマ | 18,900 | 1,818.00 | 34,360,200 | |
| ホシザキ | 36,000 | 7,690.00 | 276,840,000 | |
| 大豊工業 | 10,200 | 820.00 | 8,364,000 | |
| 日本精工 | 253,000 | 940.00 | 237,820,000 | |
| ＮＴＮ | 264,900 | 314.00 | 83,178,600 | |
| ジェイテクト | 118,200 | 1,315.00 | 155,433,000 | |
| 不二越 | 11,500 | 4,475.00 | 51,462,500 | |
| 日本トムソン | 36,700 | 497.00 | 18,239,900 | |
| ＴＨＫ | 76,800 | 2,599.00 | 199,603,200 | |
| ユーシン精機 | 9,600 | 1,010.00 | 9,696,000 | |
| 前澤給装工業 | 4,900 | 2,001.00 | 9,804,900 | |
| イーグル工業 | 15,300 | 1,036.00 | 15,850,800 | |
| 前澤工業 | 8,500 | 365.00 | 3,102,500 | |
| 日本ピラー工業 | 12,500 | 1,030.00 | 12,875,000 | |
| キッツ | 50,000 | 740.00 | 37,000,000 | |
| マキタ | 149,900 | 3,685.00 | 552,381,500 | |
| 日立造船 | 97,900 | 396.00 | 38,768,400 | |
| 三菱重工業 | 206,300 | 4,789.00 | 987,970,700 | |
| ＩＨＩ | 94,600 | 2,466.00 | 233,283,600 | |
| スター精密 | 21,100 | 1,407.00 | 29,687,700 | |
| 日清紡ホールディングス | 68,600 | 816.00 | 55,977,600 | |
| イビデン | 75,600 | 1,800.00 | 136,080,000 | |
| コニカミノルタ | 269,400 | 1,081.00 | 291,221,400 | |
| ブラザー工業 | 160,600 | 2,098.00 | 336,938,800 | |
| ミネベアミツミ | 228,800 | 1,785.00 | 408,408,000 | |
| 日立製作所 | 554,300 | 4,057.00 | 2,248,795,100 | |
| 三菱電機 | 1,231,200 | 1,450.00 | 1,785,240,000 | |
| 富士電機 | 79,900 | 3,695.00 | 295,230,500 | |
| 東洋電機製造 | 5,000 | 1,301.00 | 6,505,000 | |
| 安川電機 | 142,800 | 3,550.00 | 506,940,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シンフォニアテクノロジー | 17,200 | 1,262.00 | 21,706,400 | |
| 明電舎 | 24,500 | 1,697.00 | 41,576,500 | |
| オリジン | 3,400 | 1,475.00 | 5,015,000 | |
| 山洋電気 | 6,000 | 4,245.00 | 25,470,000 | |
| デンヨー | 11,500 | 1,545.00 | 17,767,500 | |
| 東芝テック | 15,500 | 3,130.00 | 48,515,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 2,300 | 2,726.00 | 6,269,800 | |
| マブチモーター | 34,200 | 3,750.00 | 128,250,000 | |
| 日本電産 | 148,200 | 14,315.00 | 2,121,483,000 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 6,900 | 1,333.00 | 9,197,700 | |
| トレックス・セミコンダクター | 5,800 | 1,187.00 | 6,884,600 | |
| 東光高岳 | 6,500 | 1,205.00 | 7,832,500 | |
| ダブル・スコープ | 18,000 | 1,433.00 | 25,794,000 | |
| ダイヘン | 13,500 | 3,025.00 | 40,837,500 | |
| ヤーマン | 18,300 | 938.00 | 17,165,400 | |
| ＪＶＣケンウッド | 95,600 | 253.00 | 24,186,800 | |
| ミマキエンジニアリング | 11,700 | 624.00 | 7,300,800 | |
| 第一精工 | 5,400 | 1,280.00 | 6,912,000 | |
| 日新電機 | 29,000 | 1,219.00 | 35,351,000 | |
| 大崎電気工業 | 24,700 | 700.00 | 17,290,000 | |
| オムロン | 130,900 | 5,480.00 | 717,332,000 | |
| 日東工業 | 19,800 | 2,103.00 | 41,639,400 | |
| ＩＤＥＣ | 16,600 | 2,032.00 | 33,731,200 | |
| 正興電機製作所 | 2,700 | 764.00 | 2,062,800 | |
| 不二電機工業 | 1,600 | 1,273.00 | 2,036,800 | |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 44,500 | 2,125.00 | 94,562,500 | |
| サクサホールディングス | 3,200 | 1,967.00 | 6,294,400 | |
| メルコホールディングス | 5,200 | 3,060.00 | 15,912,000 | |
| テクノメディカ | 2,900 | 2,151.00 | 6,237,900 | |
| 日本電気 | 159,300 | 4,385.00 | 698,530,500 | |
| 富士通 | 118,700 | 7,778.00 | 923,248,600 | |
| 沖電気工業 | 53,500 | 1,325.00 | 70,887,500 | |
| 岩崎通信機 | 5,800 | 800.00 | 4,640,000 | |
| 電気興業 | 6,500 | 2,970.00 | 19,305,000 | |
| サンケン電気 | 14,500 | 2,333.00 | 33,828,500 | |
| ナカヨ | 2,500 | 1,629.00 | 4,072,500 | |
| アイホン | 7,100 | 1,686.00 | 11,970,600 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 130,100 | 612.00 | 79,621,200 | |
| セイコーエプソン | 152,900 | 1,735.00 | 265,281,500 | |
| ワコム | 90,200 | 373.00 | 33,644,600 | |
| アルバック | 24,600 | 3,580.00 | 88,068,000 | |
| アクセル | 5,800 | 717.00 | 4,158,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＥＩＺＯ | 11,300 | 4,040.00 | 45,652,000 | |
| 日本信号 | 31,500 | 1,226.00 | 38,619,000 | |
| 京三製作所 | 26,900 | 375.00 | 10,087,500 | |
| 能美防災 | 16,400 | 2,310.00 | 37,884,000 | |
| ホーチキ | 8,100 | 1,333.00 | 10,797,300 | |
| 星和電機 | 7,300 | 529.00 | 3,861,700 | |
| エレコム | 11,800 | 3,835.00 | 45,253,000 | |
| パナソニック | 1,406,600 | 927.50 | 1,304,621,500 | |
| シャープ | 122,200 | 1,395.00 | 170,469,000 | |
| アンリツ | 79,300 | 1,859.00 | 147,418,700 | |
| 富士通ゼネラル | 37,700 | 1,697.00 | 63,976,900 | |
| ソニー | 826,200 | 5,955.00 | 4,920,021,000 | |
| ＴＤＫ | 64,400 | 8,460.00 | 544,824,000 | |
| 帝国通信工業 | 5,800 | 1,184.00 | 6,867,200 | |
| タムラ製作所 | 47,700 | 590.00 | 28,143,000 | |
| アルプスアルパイン | 128,400 | 1,818.00 | 233,431,200 | |
| 池上通信機 | 3,900 | 1,111.00 | 4,332,900 | |
| 鈴木 | 7,200 | 646.00 | 4,651,200 | |
| 日本トリム | 2,400 | 5,030.00 | 12,072,000 | |
| ローランド　ディー．ジー． | 6,500 | 2,491.00 | 16,191,500 | |
| フォスター電機 | 14,000 | 1,613.00 | 22,582,000 | |
| ＳＭＫ | 3,500 | 2,804.00 | 9,814,000 | |
| ヨコオ | 9,000 | 2,193.00 | 19,737,000 | |
| ホシデン | 36,600 | 1,195.00 | 43,737,000 | |
| ヒロセ電機 | 17,600 | 11,980.00 | 210,848,000 | |
| 日本航空電子工業 | 28,300 | 1,528.00 | 43,242,400 | |
| ＴＯＡ | 13,300 | 1,264.00 | 16,811,200 | |
| マクセルホールディングス | 26,800 | 1,543.00 | 41,352,400 | |
| 古野電気 | 16,200 | 1,026.00 | 16,621,200 | |
| ユニデンホールディングス | 3,700 | 1,952.00 | 7,222,400 | |
| スミダコーポレーション | 10,800 | 1,158.00 | 12,506,400 | |
| アイコム | 6,900 | 2,480.00 | 17,112,000 | |
| リオン | 5,800 | 2,150.00 | 12,470,000 | |
| 本多通信工業 | 11,300 | 500.00 | 5,650,000 | |
| 横河電機 | 123,300 | 2,122.00 | 261,642,600 | |
| 新電元工業 | 4,400 | 3,545.00 | 15,598,000 | |
| アズビル | 77,800 | 2,650.00 | 206,170,000 | |
| 東亜ディーケーケー | 6,600 | 819.00 | 5,405,400 | |
| 日本光電工業 | 54,400 | 2,968.00 | 161,459,200 | |
| チノー | 4,400 | 1,431.00 | 6,296,400 | |
| 共和電業 | 13,300 | 414.00 | 5,506,200 | |
| 日本電子材料 | 5,200 | 531.00 | 2,761,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 堀場製作所 | 24,400 | 5,680.00 | 138,592,000 | |
| アドバンテスト | 84,000 | 3,035.00 | 254,940,000 | |
| 小野測器 | 6,300 | 549.00 | 3,458,700 | |
| エスペック | 11,100 | 2,274.00 | 25,241,400 | |
| キーエンス | 60,400 | 65,170.00 | 3,936,268,000 | |
| 日置電機 | 6,500 | 3,545.00 | 23,042,500 | |
| シスメックス | 96,000 | 7,407.00 | 711,072,000 | |
| 日本マイクロニクス | 21,800 | 978.00 | 21,320,400 | |
| メガチップス | 10,000 | 1,424.00 | 14,240,000 | |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 6,500 | 3,645.00 | 23,692,500 | |
| 澤藤電機 | 1,700 | 1,765.00 | 3,000,500 | |
| 原田工業 | 5,500 | 832.00 | 4,576,000 | |
| コーセル | 16,000 | 1,147.00 | 18,352,000 | |
| イリソ電子工業 | 11,300 | 5,450.00 | 61,585,000 | |
| オプテックスグループ | 21,900 | 1,358.00 | 29,740,200 | |
| 千代田インテグレ | 5,400 | 2,149.00 | 11,604,600 | |
| アイ・オー・データ機器 | 5,000 | 936.00 | 4,680,000 | |
| レーザーテック | 25,300 | 4,360.00 | 110,308,000 | |
| スタンレー電気 | 87,000 | 2,667.00 | 232,029,000 | |
| 岩崎電気 | 5,100 | 1,299.00 | 6,624,900 | |
| ウシオ電機 | 71,800 | 1,421.00 | 102,027,800 | |
| 岡谷電機産業 | 9,800 | 381.00 | 3,733,800 | |
| ヘリオス　テクノ　ホールディング | 12,000 | 633.00 | 7,596,000 | |
| エノモト | 3,900 | 827.00 | 3,225,300 | |
| 日本セラミック | 12,600 | 2,964.00 | 37,346,400 | |
| 遠藤照明 | 6,700 | 748.00 | 5,011,600 | |
| 古河電池 | 9,400 | 646.00 | 6,072,400 | |
| 双信電機 | 6,700 | 561.00 | 3,758,700 | |
| 山一電機 | 9,300 | 1,049.00 | 9,755,700 | |
| 図研 | 8,200 | 1,745.00 | 14,309,000 | |
| 日本電子 | 24,400 | 2,358.00 | 57,535,200 | |
| カシオ計算機 | 109,000 | 1,312.00 | 143,008,000 | |
| ファナック | 117,000 | 19,595.00 | 2,292,615,000 | |
| 日本シイエムケイ | 32,000 | 620.00 | 19,840,000 | |
| エンプラス | 5,700 | 3,245.00 | 18,496,500 | |
| 大真空 | 4,800 | 1,176.00 | 5,644,800 | |
| ローム | 58,900 | 7,270.00 | 428,203,000 | |
| 浜松ホトニクス | 88,400 | 4,185.00 | 369,954,000 | |
| 三井ハイテック | 13,900 | 1,184.00 | 16,457,600 | |
| 新光電気工業 | 41,800 | 918.00 | 38,372,400 | |
| 京セラ | 187,700 | 7,098.00 | 1,332,294,600 | |
| 太陽誘電 | 54,900 | 2,095.00 | 115,015,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 村田製作所 | 387,600 | 4,849.00 | 1,879,472,400 | |
| 双葉電子工業 | 20,400 | 1,414.00 | 28,845,600 | |
| 北陸電気工業 | 5,000 | 1,075.00 | 5,375,000 | |
| ニチコン | 39,200 | 895.00 | 35,084,000 | |
| 日本ケミコン | 8,700 | 1,683.00 | 14,642,100 | |
| ＫＯＡ | 18,900 | 1,379.00 | 26,063,100 | |
| 市光工業 | 19,000 | 720.00 | 13,680,000 | |
| 小糸製作所 | 73,800 | 5,820.00 | 429,516,000 | |
| ミツバ | 23,300 | 622.00 | 14,492,600 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 21,400 | 4,890.00 | 104,646,000 | |
| キヤノン電子 | 11,500 | 1,935.00 | 22,252,500 | |
| キヤノン | 662,800 | 3,193.00 | 2,116,320,400 | |
| リコー | 370,300 | 1,052.00 | 389,555,600 | |
| 象印マホービン | 30,900 | 1,324.00 | 40,911,600 | |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 1,900 | 1,707.00 | 3,243,300 | |
| 東京エレクトロン | 82,100 | 16,405.00 | 1,346,850,500 | |
| トヨタ紡織 | 43,300 | 1,416.00 | 61,312,800 | |
| 芦森工業 | 2,700 | 1,623.00 | 4,382,100 | |
| ユニプレス | 24,000 | 1,781.00 | 42,744,000 | |
| 豊田自動織機 | 99,700 | 5,890.00 | 587,233,000 | |
| モリタホールディングス | 21,700 | 1,885.00 | 40,904,500 | |
| 三櫻工業 | 16,300 | 450.00 | 7,335,000 | |
| デンソー | 271,100 | 4,564.00 | 1,237,300,400 | |
| 東海理化電機製作所 | 32,600 | 1,812.00 | 59,071,200 | |
| 三井Ｅ＆Ｓホールディングス | 44,500 | 938.00 | 41,741,000 | |
| 川崎重工業 | 95,800 | 2,528.00 | 242,182,400 | |
| 名村造船所 | 37,000 | 295.00 | 10,915,000 | |
| 日本車輌製造 | 4,500 | 2,528.00 | 11,376,000 | |
| 三菱ロジスネクスト | 14,600 | 1,134.00 | 16,556,400 | |
| 近畿車輛 | 1,800 | 1,752.00 | 3,153,600 | |
| 日産自動車 | 1,452,000 | 773.70 | 1,123,412,400 | |
| いすゞ自動車 | 389,200 | 1,221.00 | 475,213,200 | |
| トヨタ自動車 | 1,371,900 | 6,908.00 | 9,477,085,200 | |
| 日野自動車 | 153,700 | 860.00 | 132,182,000 | |
| 三菱自動車工業 | 455,700 | 512.00 | 233,318,400 | |
| エフテック | 9,000 | 748.00 | 6,732,000 | |
| レシップホールディングス | 4,400 | 805.00 | 3,542,000 | |
| ＧＭＢ | 2,700 | 846.00 | 2,284,200 | |
| ファルテック | 2,500 | 805.00 | 2,012,500 | |
| 武蔵精密工業 | 30,100 | 1,431.00 | 43,073,100 | |
| 日産車体 | 24,000 | 1,070.00 | 25,680,000 | |
| 新明和工業 | 51,600 | 1,342.00 | 69,247,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 極東開発工業 | 24,500 | 1,334.00 | 32,683,000 | |
| 日信工業 | 22,700 | 1,484.00 | 33,686,800 | |
| トピー工業 | 10,200 | 2,400.00 | 24,480,000 | |
| ティラド | 4,600 | 1,924.00 | 8,850,400 | |
| タチエス | 20,400 | 1,369.00 | 27,927,600 | |
| ＮＯＫ | 66,400 | 1,632.00 | 108,364,800 | |
| フタバ産業 | 34,700 | 634.00 | 21,999,800 | |
| ＫＹＢ | 12,800 | 3,220.00 | 41,216,000 | |
| 大同メタル工業 | 20,400 | 662.00 | 13,504,800 | |
| プレス工業 | 61,600 | 490.00 | 30,184,000 | |
| ミクニ | 16,400 | 374.00 | 6,133,600 | |
| 太平洋工業 | 26,000 | 1,584.00 | 41,184,000 | |
| ケーヒン | 28,500 | 1,540.00 | 43,890,000 | |
| 河西工業 | 15,500 | 825.00 | 12,787,500 | |
| アイシン精機 | 101,500 | 3,690.00 | 374,535,000 | |
| マツダ | 386,400 | 1,113.00 | 430,063,200 | |
| 今仙電機製作所 | 11,700 | 925.00 | 10,822,500 | |
| 本田技研工業 | 1,038,600 | 2,859.50 | 2,969,876,700 | |
| スズキ | 225,200 | 4,723.00 | 1,063,619,600 | |
| ＳＵＢＡＲＵ | 382,200 | 2,766.50 | 1,057,356,300 | |
| 安永 | 6,100 | 1,444.00 | 8,808,400 | |
| ヤマハ発動機 | 173,900 | 1,898.00 | 330,062,200 | |
| ショーワ | 29,300 | 1,446.00 | 42,367,800 | |
| ＴＢＫ | 15,400 | 400.00 | 6,160,000 | |
| エクセディ | 16,800 | 2,242.00 | 37,665,600 | |
| 豊田合成 | 39,900 | 2,088.00 | 83,311,200 | |
| 愛三工業 | 19,700 | 679.00 | 13,376,300 | |
| 盟和産業 | 2,100 | 1,037.00 | 2,177,700 | |
| 日本プラスト | 10,100 | 725.00 | 7,322,500 | |
| ヨロズ | 11,700 | 1,365.00 | 15,970,500 | |
| エフ・シー・シー | 22,300 | 2,176.00 | 48,524,800 | |
| シマノ | 49,600 | 15,860.00 | 786,656,000 | |
| テイ・エス　テック | 28,700 | 3,015.00 | 86,530,500 | |
| ジャムコ | 6,300 | 2,069.00 | 13,034,700 | |
| テルモ | 348,400 | 3,291.00 | 1,146,584,400 | |
| クリエートメディック | 4,100 | 931.00 | 3,817,100 | |
| 日機装 | 39,800 | 1,410.00 | 56,118,000 | |
| 島津製作所 | 158,400 | 2,755.00 | 436,392,000 | |
| ＪＭＳ | 11,400 | 755.00 | 8,607,000 | |
| 長野計器 | 9,700 | 788.00 | 7,643,600 | |
| ブイ・テクノロジー | 5,800 | 5,080.00 | 29,464,000 | |
| 東京計器 | 7,900 | 974.00 | 7,694,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 愛知時計電機 | 1,600 | 4,105.00 | 6,568,000 | |
| インターアクション | 6,600 | 1,365.00 | 9,009,000 | |
| オーバル | 12,100 | 262.00 | 3,170,200 | |
| 東京精密 | 22,300 | 2,830.00 | 63,109,000 | |
| マニー | 16,400 | 7,690.00 | 126,116,000 | |
| ニコン | 214,500 | 1,568.00 | 336,336,000 | |
| トプコン | 66,100 | 1,368.00 | 90,424,800 | |
| オリンパス | 733,600 | 1,216.00 | 892,057,600 | |
| 理研計器 | 10,900 | 2,013.00 | 21,941,700 | |
| タムロン | 10,900 | 2,207.00 | 24,056,300 | |
| ＨＯＹＡ | 247,900 | 7,998.00 | 1,982,704,200 | |
| シード | 5,300 | 1,158.00 | 6,137,400 | |
| ノーリツ鋼機 | 9,700 | 2,105.00 | 20,418,500 | |
| エー・アンド・デイ | 11,300 | 805.00 | 9,096,500 | |
| 朝日インテック | 104,400 | 2,764.00 | 288,561,600 | |
| シチズン時計 | 134,800 | 565.00 | 76,162,000 | |
| リズム時計工業 | 4,200 | 1,334.00 | 5,602,800 | |
| 大研医器 | 9,800 | 638.00 | 6,252,400 | |
| メニコン | 16,900 | 3,710.00 | 62,699,000 | |
| シンシア | 1,900 | 621.00 | 1,179,900 | |
| 松風 | 6,000 | 1,434.00 | 8,604,000 | |
| セイコーホールディングス | 19,000 | 2,238.00 | 42,522,000 | |
| ニプロ | 85,200 | 1,219.00 | 103,858,800 | |
| 中本パックス | 3,400 | 1,510.00 | 5,134,000 | |
| スノーピーク | 4,800 | 1,449.00 | 6,955,200 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 14,200 | 4,130.00 | 58,646,000 | |
| トランザクション | 7,800 | 936.00 | 7,300,800 | |
| ＳＨＯ－ＢＩ | 3,600 | 379.00 | 1,364,400 | |
| ニホンフラッシュ | 5,300 | 2,814.00 | 14,914,200 | |
| 前田工繊 | 13,600 | 1,947.00 | 26,479,200 | |
| 永大産業 | 16,100 | 359.00 | 5,779,900 | |
| アートネイチャー | 13,100 | 668.00 | 8,750,800 | |
| バンダイナムコホールディングス | 127,300 | 5,190.00 | 660,687,000 | |
| アイフィスジャパン | 2,700 | 628.00 | 1,695,600 | |
| 共立印刷 | 20,500 | 187.00 | 3,833,500 | |
| ＳＨＯＥＩ | 5,900 | 4,520.00 | 26,668,000 | |
| フランスベッドホールディングス | 17,400 | 994.00 | 17,295,600 | |
| パイロットコーポレーション | 21,500 | 4,160.00 | 89,440,000 | |
| 萩原工業 | 6,800 | 1,354.00 | 9,207,200 | |
| トッパン・フォームズ | 26,400 | 931.00 | 24,578,400 | |
| フジシールインターナショナル | 27,600 | 3,460.00 | 95,496,000 | |
| タカラトミー | 51,500 | 1,299.00 | 66,898,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 廣済堂 | 11,400 | 699.00 | 7,968,600 | |
| エステールホールディングス | 3,300 | 616.00 | 2,032,800 | |
| アーク | 47,000 | 104.00 | 4,888,000 | |
| タカノ | 4,800 | 775.00 | 3,720,000 | |
| プロネクサス | 10,600 | 1,120.00 | 11,872,000 | |
| ホクシン | 7,600 | 132.00 | 1,003,200 | |
| ウッドワン | 4,100 | 1,021.00 | 4,186,100 | |
| 大建工業 | 9,300 | 2,131.00 | 19,818,300 | |
| 凸版印刷 | 173,800 | 1,744.00 | 303,107,200 | |
| 大日本印刷 | 173,500 | 2,341.00 | 406,163,500 | |
| 図書印刷 | 11,500 | 1,392.00 | 16,008,000 | |
| 共同印刷 | 3,800 | 2,834.00 | 10,769,200 | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 25,300 | 1,151.00 | 29,120,300 | |
| 光村印刷 | 1,100 | 1,991.00 | 2,190,100 | |
| 宝印刷 | 5,900 | 1,687.00 | 9,953,300 | |
| アシックス | 116,100 | 1,170.00 | 135,837,000 | |
| ツツミ | 3,800 | 1,979.00 | 7,520,200 | |
| 小松ウオール工業 | 3,800 | 1,869.00 | 7,102,200 | |
| ヤマハ | 73,200 | 5,020.00 | 367,464,000 | |
| 河合楽器製作所 | 3,800 | 3,105.00 | 11,799,000 | |
| クリナップ | 11,400 | 589.00 | 6,714,600 | |
| ピジョン | 74,400 | 4,035.00 | 300,204,000 | |
| 兼松サステック | 800 | 1,659.00 | 1,327,200 | |
| キングジム | 10,200 | 833.00 | 8,496,600 | |
| リンテック | 29,300 | 2,221.00 | 65,075,300 | |
| イトーキ | 22,700 | 460.00 | 10,442,000 | |
| 任天堂 | 70,500 | 40,000.00 | 2,820,000,000 | |
| 三菱鉛筆 | 20,300 | 1,722.00 | 34,956,600 | |
| タカラスタンダード | 25,400 | 1,727.00 | 43,865,800 | |
| コクヨ | 59,100 | 1,498.00 | 88,531,800 | |
| ナカバヤシ | 12,100 | 538.00 | 6,509,800 | |
| グローブライド | 6,000 | 3,385.00 | 20,310,000 | |
| オカムラ | 43,000 | 1,059.00 | 45,537,000 | |
| 美津濃 | 12,200 | 2,457.00 | 29,975,400 | |
| 東京電力ホールディングス | 982,800 | 545.00 | 535,626,000 | |
| 中部電力 | 376,700 | 1,517.50 | 571,642,250 | |
| 関西電力 | 502,300 | 1,267.50 | 636,665,250 | |
| 中国電力 | 170,200 | 1,357.00 | 230,961,400 | |
| 北陸電力 | 120,600 | 777.00 | 93,706,200 | |
| 東北電力 | 288,300 | 1,085.00 | 312,805,500 | |
| 四国電力 | 110,900 | 1,000.00 | 110,900,000 | |
| 九州電力 | 253,700 | 1,068.00 | 270,951,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 北海道電力 | 115,200 | 598.00 | 68,889,600 | |
| 沖縄電力 | 22,800 | 1,721.00 | 39,238,800 | |
| 電源開発 | 98,000 | 2,477.00 | 242,746,000 | |
| エフオン | 5,800 | 834.00 | 4,837,200 | |
| イーレックス | 21,400 | 1,159.00 | 24,802,600 | |
| レノバ | 20,200 | 816.00 | 16,483,200 | |
| 東京瓦斯 | 241,500 | 2,686.00 | 648,669,000 | |
| 大阪瓦斯 | 238,900 | 1,922.00 | 459,165,800 | |
| 東邦瓦斯 | 61,000 | 3,970.00 | 242,170,000 | |
| 北海道瓦斯 | 6,600 | 1,491.00 | 9,840,600 | |
| 広島ガス | 25,300 | 336.00 | 8,500,800 | |
| 西部瓦斯 | 13,900 | 2,240.00 | 31,136,000 | |
| 静岡ガス | 37,900 | 816.00 | 30,926,400 | |
| メタウォーター | 5,900 | 3,385.00 | 19,971,500 | |
| ＳＢＳホールディングス | 12,100 | 1,528.00 | 18,488,800 | |
| 東武鉄道 | 129,800 | 3,145.00 | 408,221,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 42,200 | 2,964.00 | 125,080,800 | |
| 東京急行電鉄 | 334,400 | 1,949.00 | 651,745,600 | |
| 京浜急行電鉄 | 168,600 | 1,848.00 | 311,572,800 | |
| 小田急電鉄 | 197,200 | 2,584.00 | 509,564,800 | |
| 京王電鉄 | 68,800 | 7,130.00 | 490,544,000 | |
| 京成電鉄 | 92,300 | 3,990.00 | 368,277,000 | |
| 富士急行 | 16,800 | 4,125.00 | 69,300,000 | |
| 新京成電鉄 | 3,200 | 2,035.00 | 6,512,000 | |
| 東日本旅客鉄道 | 218,900 | 10,250.00 | 2,243,725,000 | |
| 西日本旅客鉄道 | 110,400 | 8,845.00 | 976,488,000 | |
| 東海旅客鉄道 | 110,200 | 21,770.00 | 2,399,054,000 | |
| 西武ホールディングス | 152,500 | 1,803.00 | 274,957,500 | |
| 鴻池運輸 | 19,600 | 1,720.00 | 33,712,000 | |
| 西日本鉄道 | 34,100 | 2,376.00 | 81,021,600 | |
| ハマキョウレックス | 9,400 | 3,825.00 | 35,955,000 | |
| サカイ引越センター | 6,500 | 6,740.00 | 43,810,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 116,600 | 5,190.00 | 605,154,000 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 155,500 | 3,860.00 | 600,230,000 | |
| 南海電気鉄道 | 52,000 | 2,657.00 | 138,164,000 | |
| 京阪ホールディングス | 51,900 | 4,640.00 | 240,816,000 | |
| 神戸電鉄 | 3,000 | 4,015.00 | 12,045,000 | |
| 名古屋鉄道 | 95,800 | 3,010.00 | 288,358,000 | |
| 山陽電気鉄道 | 9,000 | 2,155.00 | 19,395,000 | |
| 日本通運 | 45,000 | 5,810.00 | 261,450,000 | |
| ヤマトホールディングス | 204,400 | 2,190.00 | 447,636,000 | |
| 山九 | 32,400 | 5,730.00 | 185,652,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 丸運 | 6,600 | 281.00 | 1,854,600 | |
| 丸全昭和運輸 | 9,500 | 3,310.00 | 31,445,000 | |
| センコーグループホールディングス | 64,300 | 865.00 | 55,619,500 | |
| トナミホールディングス | 2,800 | 5,860.00 | 16,408,000 | |
| ニッコンホールディングス | 44,300 | 2,546.00 | 112,787,800 | |
| 日本石油輸送 | 1,400 | 2,880.00 | 4,032,000 | |
| 福山通運 | 14,900 | 4,040.00 | 60,196,000 | |
| セイノーホールディングス | 87,300 | 1,403.00 | 122,481,900 | |
| エスライン | 3,500 | 985.00 | 3,447,500 | |
| 神奈川中央交通 | 2,900 | 3,800.00 | 11,020,000 | |
| 日立物流 | 25,600 | 3,390.00 | 86,784,000 | |
| 丸和運輸機関 | 6,100 | 4,600.00 | 28,060,000 | |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 11,800 | 1,296.00 | 15,292,800 | |
| 九州旅客鉄道 | 97,900 | 3,185.00 | 311,811,500 | |
| ＳＧホールディングス | 110,200 | 3,010.00 | 331,702,000 | |
| 日本郵船 | 97,900 | 1,795.00 | 175,730,500 | |
| 商船三井 | 69,500 | 2,663.00 | 185,078,500 | |
| 川崎汽船 | 35,900 | 1,436.00 | 51,552,400 | |
| ＮＳユナイテッド海運 | 6,700 | 2,352.00 | 15,758,400 | |
| 飯野海運 | 57,400 | 362.00 | 20,778,800 | |
| 共栄タンカー | 1,600 | 1,437.00 | 2,299,200 | |
| 乾汽船 | 10,500 | 862.00 | 9,051,000 | |
| 日本航空 | 213,500 | 3,441.00 | 734,653,500 | |
| ＡＮＡホールディングス | 213,100 | 3,639.00 | 775,470,900 | |
| パスコ | 2,300 | 822.00 | 1,890,600 | |
| トランコム | 3,300 | 6,340.00 | 20,922,000 | |
| 日新 | 10,100 | 1,781.00 | 17,988,100 | |
| 三菱倉庫 | 40,300 | 2,963.00 | 119,408,900 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 14,300 | 1,526.00 | 21,821,800 | |
| 住友倉庫 | 42,900 | 1,383.00 | 59,330,700 | |
| 澁澤倉庫 | 6,400 | 1,723.00 | 11,027,200 | |
| 東陽倉庫 | 21,000 | 320.00 | 6,720,000 | |
| 日本トランスシティ | 25,700 | 503.00 | 12,927,100 | |
| ケイヒン | 2,200 | 1,248.00 | 2,745,600 | |
| 中央倉庫 | 7,100 | 1,084.00 | 7,696,400 | |
| 川西倉庫 | 2,400 | 1,057.00 | 2,536,800 | |
| 安田倉庫 | 9,600 | 887.00 | 8,515,200 | |
| ファイズ | 2,100 | 737.00 | 1,547,700 | |
| 東洋埠頭 | 3,600 | 1,409.00 | 5,072,400 | |
| 宇徳 | 10,000 | 491.00 | 4,910,000 | |
| 上組 | 71,900 | 2,517.00 | 180,972,300 | |
| サンリツ | 2,800 | 643.00 | 1,800,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| キムラユニティー | 3,100 | 1,110.00 | 3,441,000 | |
| キユーソー流通システム | 2,900 | 2,008.00 | 5,823,200 | |
| 近鉄エクスプレス | 22,000 | 1,417.00 | 31,174,000 | |
| 東海運 | 6,600 | 268.00 | 1,768,800 | |
| エーアイテイー | 7,600 | 1,059.00 | 8,048,400 | |
| 内外トランスライン | 3,700 | 1,343.00 | 4,969,100 | |
| 日本コンセプト | 4,200 | 1,268.00 | 5,325,600 | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 13,400 | 2,803.00 | 37,560,200 | |
| クロスキャット | 3,400 | 1,000.00 | 3,400,000 | |
| システナ | 43,200 | 1,858.00 | 80,265,600 | |
| デジタルアーツ | 6,500 | 10,070.00 | 65,455,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 18,200 | 3,500.00 | 63,700,000 | |
| キューブシステム | 6,700 | 837.00 | 5,607,900 | |
| エイジア | 2,600 | 1,178.00 | 3,062,800 | |
| コア | 5,300 | 1,643.00 | 8,707,900 | |
| ソリトンシステムズ | 7,000 | 1,054.00 | 7,378,000 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 5,400 | 1,597.00 | 8,623,800 | |
| ＴＩＳ | 40,300 | 5,790.00 | 233,337,000 | |
| ネオス | 4,800 | 999.00 | 4,795,200 | |
| 電算システム | 4,700 | 3,450.00 | 16,215,000 | |
| グリー | 83,800 | 524.00 | 43,911,200 | |
| コーエーテクモホールディングス | 24,800 | 2,035.00 | 50,468,000 | |
| 三菱総合研究所 | 5,200 | 3,425.00 | 17,810,000 | |
| 電算 | 1,500 | 2,011.00 | 3,016,500 | |
| ＡＧＳ | 7,200 | 664.00 | 4,780,800 | |
| ファインデックス | 10,400 | 982.00 | 10,212,800 | |
| ブレインパッド | 2,400 | 6,580.00 | 15,792,000 | |
| ＫＬａｂ | 21,600 | 1,012.00 | 21,859,200 | |
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 16,200 | 1,120.00 | 18,144,000 | |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2,000 | 2,119.00 | 4,238,000 | |
| ネクソン | 308,500 | 1,697.00 | 523,524,500 | |
| アイスタイル | 31,200 | 834.00 | 26,020,800 | |
| エムアップ | 4,300 | 2,503.00 | 10,762,900 | |
| エイチーム | 8,500 | 1,199.00 | 10,191,500 | |
| エニグモ | 4,400 | 2,501.00 | 11,004,400 | |
| テクノスジャパン | 10,500 | 590.00 | 6,195,000 | |
| コロプラ | 39,900 | 718.00 | 28,648,200 | |
| ブロードリーフ | 60,300 | 574.00 | 34,612,200 | |
| クロス・マーケティンググループ | 5,100 | 383.00 | 1,953,300 | |
| デジタルハーツホールディングス | 5,700 | 1,102.00 | 6,281,400 | |
| システム情報 | 6,300 | 1,144.00 | 7,207,200 | |
| メディアドゥホールディングス | 3,800 | 3,640.00 | 13,832,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| じげん | 17,400 | 791.00 | 13,763,400 | |
| エンカレッジ・テクノロジ | 1,900 | 837.00 | 1,590,300 | |
| サイバーリンクス | 2,000 | 1,196.00 | 2,392,000 | |
| フィックスターズ | 13,000 | 1,975.00 | 25,675,000 | |
| ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 6,000 | 1,341.00 | 8,046,000 | |
| オプティム | 5,300 | 3,160.00 | 16,748,000 | |
| セレス | 4,100 | 1,941.00 | 7,958,100 | |
| ティーガイア | 8,700 | 2,114.00 | 18,391,800 | |
| セック | 2,000 | 3,675.00 | 7,350,000 | |
| 日本アジアグループ | 12,700 | 354.00 | 4,495,800 | |
| 豆蔵ホールディングス | 8,400 | 1,447.00 | 12,154,800 | |
| テクマトリックス | 8,600 | 2,031.00 | 17,466,600 | |
| プロシップ | 3,700 | 1,260.00 | 4,662,000 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 29,220 | 3,030.00 | 88,536,600 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 19,900 | 7,140.00 | 142,086,000 | |
| ザッパラス | 6,900 | 345.00 | 2,380,500 | |
| システムリサーチ | 1,700 | 3,805.00 | 6,468,500 | |
| インターネットイニシアティブ | 19,800 | 2,130.00 | 42,174,000 | |
| さくらインターネット | 14,800 | 585.00 | 8,658,000 | |
| ヴィンクス | 4,300 | 1,130.00 | 4,859,000 | |
| GMOクラウド | 2,800 | 3,125.00 | 8,750,000 | |
| ＳＲＡホールディングス | 6,500 | 2,586.00 | 16,809,000 | |
| Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ | 2,500 | 1,960.00 | 4,900,000 | |
| システムインテグレータ | 3,700 | 752.00 | 2,782,400 | |
| 朝日ネット | 10,100 | 725.00 | 7,322,500 | |
| ｅＢＡＳＥ | 7,400 | 1,180.00 | 8,732,000 | |
| アバント | 4,400 | 2,050.00 | 9,020,000 | |
| アドソル日進 | 4,400 | 1,664.00 | 7,321,600 | |
| フリービット | 7,400 | 1,046.00 | 7,740,400 | |
| コムチュア | 6,800 | 4,215.00 | 28,662,000 | |
| サイバーコム | 2,300 | 1,922.00 | 4,420,600 | |
| アステリア | 8,200 | 1,050.00 | 8,610,000 | |
| マークラインズ | 5,700 | 1,944.00 | 11,080,800 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 10,900 | 1,196.00 | 13,036,400 | |
| ショーケース | 3,000 | 583.00 | 1,749,000 | |
| モバイルファクトリー | 3,500 | 1,545.00 | 5,407,500 | |
| テラスカイ | 2,100 | 1,635.00 | 3,433,500 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 5,500 | 1,806.00 | 9,933,000 | |
| ＰＣＩホールディングス | 2,600 | 2,235.00 | 5,811,000 | |
| パイプドＨＤ | 2,000 | 1,248.00 | 2,496,000 | |
| アイビーシー | 2,400 | 1,318.00 | 3,163,200 | |
| ネオジャパン | 2,500 | 965.00 | 2,412,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 1,100 | 2,980.00 | 3,278,000 | |
| ランドコンピュータ | 2,000 | 1,116.00 | 2,232,000 | |
| ダブルスタンダード | 1,100 | 4,850.00 | 5,335,000 | |
| オープンドア | 6,100 | 2,891.00 | 17,635,100 | |
| マイネット | 4,200 | 723.00 | 3,036,600 | |
| アカツキ | 4,300 | 6,890.00 | 29,627,000 | |
| ベネフィットジャパン | 1,200 | 900.00 | 1,080,000 | |
| Ｕｂｉｃｏｍホールディングス | 2,300 | 1,748.00 | 4,020,400 | |
| ＬＩＮＥ | 36,900 | 3,150.00 | 116,235,000 | |
| カナミックネットワーク | 2,600 | 2,273.00 | 5,909,800 | |
| ノムラシステムコーポレーション | 1,600 | 938.00 | 1,500,800 | |
| チェンジ | 2,500 | 2,460.00 | 6,150,000 | |
| シンクロ・フード | 5,500 | 567.00 | 3,118,500 | |
| オークネット | 6,500 | 1,320.00 | 8,580,000 | |
| エイトレッド | 1,400 | 1,824.00 | 2,553,600 | |
| ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 13,500 | 679.00 | 9,166,500 | |
| マクロミル | 21,600 | 1,326.00 | 28,641,600 | |
| ビーグリー | 3,300 | 901.00 | 2,973,300 | |
| オロ | 3,300 | 2,492.00 | 8,223,600 | |
| テモナ | 2,000 | 486.00 | 972,000 | |
| サインポスト | 1,900 | 3,000.00 | 5,700,000 | |
| ソルクシーズ | 5,400 | 979.00 | 5,286,600 | |
| フェイス | 5,000 | 882.00 | 4,410,000 | |
| プロトコーポレーション | 11,000 | 1,069.00 | 11,759,000 | |
| ハイマックス | 1,600 | 1,829.00 | 2,926,400 | |
| 野村総合研究所 | 230,600 | 1,761.00 | 406,086,600 | |
| サイバネットシステム | 10,200 | 641.00 | 6,538,200 | |
| ＣＥホールディングス | 3,700 | 1,131.00 | 4,184,700 | |
| 日本システム技術 | 2,100 | 1,774.00 | 3,725,400 | |
| インテージホールディングス | 15,300 | 937.00 | 14,336,100 | |
| 東邦システムサイエンス | 3,800 | 1,036.00 | 3,936,800 | |
| ソースネクスト | 47,400 | 439.00 | 20,808,600 | |
| インフォコム | 13,300 | 2,449.00 | 32,571,700 | |
| ＦＩＧ | 11,400 | 337.00 | 3,841,800 | |
| アルテリア・ネットワークス | 13,600 | 1,278.00 | 17,380,800 | |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 2,900 | 1,822.00 | 5,283,800 | |
| フォーカスシステムズ | 8,400 | 871.00 | 7,316,400 | |
| クレスコ | 3,700 | 3,815.00 | 14,115,500 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 125,500 | 1,478.00 | 185,489,000 | |
| オービック | 41,900 | 11,860.00 | 496,934,000 | |
| ジャストシステム | 17,300 | 3,550.00 | 61,415,000 | |
| ＴＤＣソフト | 10,800 | 872.00 | 9,417,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ヤフー | 788,200 | 332.00 | 261,682,400 | |
| トレンドマイクロ | 64,500 | 4,935.00 | 318,307,500 | |
| ＩＤホールディングス | 4,800 | 1,192.00 | 5,721,600 | |
| 日本オラクル | 24,500 | 8,810.00 | 215,845,000 | |
| アルファシステムズ | 3,800 | 2,800.00 | 10,640,000 | |
| フューチャー | 16,500 | 2,100.00 | 34,650,000 | |
| ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 8,800 | 1,325.00 | 11,660,000 | |
| ソフトバンク・テクノロジー | 5,200 | 2,343.00 | 12,183,600 | |
| トーセ | 3,500 | 855.00 | 2,992,500 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 12,400 | 4,990.00 | 61,876,000 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 55,100 | 2,837.00 | 156,318,700 | |
| アイティフォー | 14,900 | 885.00 | 13,186,500 | |
| 東計電算 | 1,900 | 3,055.00 | 5,804,500 | |
| エックスネット | 2,500 | 906.00 | 2,265,000 | |
| 大塚商会 | 65,400 | 4,330.00 | 283,182,000 | |
| サイボウズ | 14,300 | 1,400.00 | 20,020,000 | |
| ソフトブレーン | 10,000 | 509.00 | 5,090,000 | |
| 電通国際情報サービス | 7,500 | 3,545.00 | 26,587,500 | |
| デジタルガレージ | 23,600 | 3,655.00 | 86,258,000 | |
| ＥＭシステムズ | 10,000 | 1,641.00 | 16,410,000 | |
| ウェザーニューズ | 4,100 | 3,160.00 | 12,956,000 | |
| ＣＩＪ | 9,700 | 996.00 | 9,661,200 | |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1,300 | 2,120.00 | 2,756,000 | |
| 日本エンタープライズ | 13,600 | 194.00 | 2,638,400 | |
| WOWOW | 5,900 | 2,724.00 | 16,071,600 | |
| スカラ | 8,700 | 936.00 | 8,143,200 | |
| インテリジェント　ウェイブ | 4,800 | 926.00 | 4,444,800 | |
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 10,600 | 650.00 | 6,890,000 | |
| ネットワンシステムズ | 42,800 | 2,976.00 | 127,372,800 | |
| システムソフト | 31,100 | 121.00 | 3,763,100 | |
| アルゴグラフィックス | 10,400 | 2,431.00 | 25,282,400 | |
| マーベラス | 18,700 | 805.00 | 15,053,500 | |
| エイベックス | 20,900 | 1,416.00 | 29,594,400 | |
| 日本ユニシス | 37,800 | 3,675.00 | 138,915,000 | |
| 兼松エレクトロニクス | 6,600 | 3,145.00 | 20,757,000 | |
| 東京放送ホールディングス | 80,300 | 1,895.00 | 152,168,500 | |
| 日本テレビホールディングス | 111,100 | 1,662.00 | 184,648,200 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 12,300 | 731.00 | 8,991,300 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 33,300 | 1,882.00 | 62,670,600 | |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 80,000 | 426.00 | 34,080,000 | |
| テレビ東京ホールディングス | 10,000 | 2,343.00 | 23,430,000 | |
| 日本ＢＳ放送 | 4,300 | 1,066.00 | 4,583,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ビジョン | 3,800 | 4,980.00 | 18,924,000 | |
| スマートバリュー | 3,900 | 724.00 | 2,823,600 | |
| ワイヤレスゲート | 5,700 | 559.00 | 3,186,300 | |
| コネクシオ | 8,700 | 1,393.00 | 12,119,100 | |
| クロップス | 2,600 | 616.00 | 1,601,600 | |
| 日本電信電話 | 826,300 | 5,170.00 | 4,271,971,000 | |
| ＫＤＤＩ | 990,400 | 2,857.50 | 2,830,068,000 | |
| ソフトバンク | 1,281,000 | 1,439.50 | 1,843,999,500 | |
| 光通信 | 14,200 | 24,280.00 | 344,776,000 | |
| ＮＴＴドコモ | 765,000 | 2,573.50 | 1,968,727,500 | |
| エムティーアイ | 12,000 | 776.00 | 9,312,000 | |
| GMOインターネット | 44,100 | 1,936.00 | 85,377,600 | |
| アイドママーケティングコミュニケーション | 2,900 | 656.00 | 1,902,400 | |
| ＫＡＤＯＫＡＷＡ | 35,400 | 1,472.00 | 52,108,800 | |
| 学研ホールディングス | 4,100 | 5,260.00 | 21,566,000 | |
| ゼンリン | 24,200 | 1,970.00 | 47,674,000 | |
| 昭文社 | 6,200 | 355.00 | 2,201,000 | |
| インプレスホールディングス | 10,000 | 141.00 | 1,410,000 | |
| アイネット | 7,000 | 1,218.00 | 8,526,000 | |
| 松竹 | 8,000 | 12,660.00 | 101,280,000 | |
| 東宝 | 79,500 | 4,750.00 | 377,625,000 | |
| 東映 | 5,100 | 15,100.00 | 77,010,000 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 321,800 | 1,474.00 | 474,333,200 | |
| ピー・シー・エー | 1,600 | 3,370.00 | 5,392,000 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 2,200 | 2,300.00 | 5,060,000 | |
| ＤＴＳ | 27,100 | 2,312.00 | 62,655,200 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 56,300 | 3,750.00 | 211,125,000 | |
| シーイーシー | 13,000 | 2,461.00 | 31,993,000 | |
| カプコン | 51,900 | 2,248.00 | 116,671,200 | |
| アイ・エス・ビー | 2,500 | 1,720.00 | 4,300,000 | |
| ジャステック | 7,200 | 1,080.00 | 7,776,000 | |
| ＳＣＳＫ | 31,900 | 5,360.00 | 170,984,000 | |
| 日本システムウエア | 4,100 | 2,604.00 | 10,676,400 | |
| アイネス | 15,500 | 1,141.00 | 17,685,500 | |
| ＴＫＣ | 10,300 | 4,760.00 | 49,028,000 | |
| 富士ソフト | 18,100 | 4,965.00 | 89,866,500 | |
| ＮＳＤ | 19,900 | 3,260.00 | 64,874,000 | |
| コナミホールディングス | 49,400 | 4,895.00 | 241,813,000 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 4,100 | 2,426.00 | 9,946,600 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 9,700 | 1,433.00 | 13,900,100 | |
| ミロク情報サービス | 12,000 | 3,385.00 | 40,620,000 | |
| ソフトバンクグループ | 1,009,700 | 5,182.00 | 5,232,265,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ホウスイ | 1,000 | 835.00 | 835,000 | |
| 高千穂交易 | 4,700 | 1,056.00 | 4,963,200 | |
| 伊藤忠食品 | 3,000 | 4,695.00 | 14,085,000 | |
| エレマテック | 11,300 | 1,015.00 | 11,469,500 | |
| ＪＡＬＵＸ | 3,400 | 2,755.00 | 9,367,000 | |
| あらた | 9,000 | 3,765.00 | 33,885,000 | |
| トーメンデバイス | 1,800 | 2,300.00 | 4,140,000 | |
| 東京エレクトロン　デバイス | 4,400 | 1,989.00 | 8,751,600 | |
| フィールズ | 10,600 | 530.00 | 5,618,000 | |
| 双日 | 669,700 | 348.00 | 233,055,600 | |
| アルフレッサ　ホールディングス | 134,800 | 2,754.00 | 371,239,200 | |
| 横浜冷凍 | 34,000 | 1,025.00 | 34,850,000 | |
| 神栄 | 1,700 | 783.00 | 1,331,100 | |
| ラサ商事 | 6,400 | 823.00 | 5,267,200 | |
| ラクーンホールディングス | 5,900 | 655.00 | 3,864,500 | |
| アルコニックス | 12,900 | 1,364.00 | 17,595,600 | |
| 神戸物産 | 18,300 | 5,380.00 | 98,454,000 | |
| あい　ホールディングス | 17,300 | 1,802.00 | 31,174,600 | |
| ディーブイエックス | 4,800 | 797.00 | 3,825,600 | |
| ダイワボウホールディングス | 11,000 | 5,130.00 | 56,430,000 | |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 33,600 | 1,527.00 | 51,307,200 | |
| ラクト・ジャパン | 5,300 | 3,690.00 | 19,557,000 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 22,800 | 1,033.00 | 23,552,400 | |
| 八洲電機 | 9,400 | 843.00 | 7,924,200 | |
| メディアスホールディングス | 6,900 | 700.00 | 4,830,000 | |
| レスターホールディングス | 13,300 | 1,612.00 | 21,439,600 | |
| ジューテックホールディングス | 2,800 | 981.00 | 2,746,800 | |
| 大光 | 5,200 | 649.00 | 3,374,800 | |
| ＯＣＨＩホールディングス | 3,500 | 1,213.00 | 4,245,500 | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 64,100 | 939.00 | 60,189,900 | |
| 黒谷 | 2,800 | 460.00 | 1,288,000 | |
| Ｃｏｍｉｎｉｘ | 2,100 | 830.00 | 1,743,000 | |
| 三洋貿易 | 6,100 | 2,370.00 | 14,457,000 | |
| ビューティガレージ | 2,000 | 1,694.00 | 3,388,000 | |
| ウイン・パートナーズ | 7,900 | 1,174.00 | 9,274,600 | |
| ミタチ産業 | 3,700 | 702.00 | 2,597,400 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 25,300 | 4,870.00 | 123,211,000 | |
| 明治電機工業 | 3,800 | 1,389.00 | 5,278,200 | |
| デリカフーズホールディングス | 2,100 | 1,473.00 | 3,093,300 | |
| スターティアホールディングス | 2,400 | 549.00 | 1,317,600 | |
| コメダホールディングス | 28,100 | 2,078.00 | 58,391,800 | |
| 富士興産 | 4,700 | 1,032.00 | 4,850,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 協栄産業 | 1,500 | 1,436.00 | 2,154,000 | |
| 小野建 | 10,900 | 1,414.00 | 15,412,600 | |
| 南陽 | 2,500 | 1,642.00 | 4,105,000 | |
| 佐鳥電機 | 8,900 | 882.00 | 7,849,800 | |
| エコートレーディング | 2,800 | 543.00 | 1,520,400 | |
| 伯東 | 8,300 | 1,233.00 | 10,233,900 | |
| コンドーテック | 9,400 | 927.00 | 8,713,800 | |
| 中山福 | 7,000 | 550.00 | 3,850,000 | |
| ナガイレーベン | 17,500 | 2,384.00 | 41,720,000 | |
| 三菱食品 | 13,300 | 2,876.00 | 38,250,800 | |
| 松田産業 | 8,900 | 1,525.00 | 13,572,500 | |
| 第一興商 | 18,100 | 4,995.00 | 90,409,500 | |
| メディパルホールディングス | 130,900 | 2,406.00 | 314,945,400 | |
| ＳＰＫ | 2,600 | 2,489.00 | 6,471,400 | |
| 萩原電気ホールディングス | 4,500 | 2,941.00 | 13,234,500 | |
| アズワン | 8,700 | 9,120.00 | 79,344,000 | |
| スズデン | 4,200 | 1,364.00 | 5,728,800 | |
| 尾家産業 | 3,900 | 1,303.00 | 5,081,700 | |
| シモジマ | 7,400 | 1,126.00 | 8,332,400 | |
| ドウシシャ | 11,400 | 1,791.00 | 20,417,400 | |
| 小津産業 | 2,700 | 1,738.00 | 4,692,600 | |
| 高速 | 7,200 | 1,228.00 | 8,841,600 | |
| たけびし | 4,300 | 1,391.00 | 5,981,300 | |
| リックス | 2,700 | 1,532.00 | 4,136,400 | |
| 丸文 | 10,800 | 587.00 | 6,339,600 | |
| ハピネット | 10,100 | 1,326.00 | 13,392,600 | |
| 橋本総業ホールディングス | 2,500 | 1,602.00 | 4,005,000 | |
| 日本ライフライン | 35,900 | 1,934.00 | 69,430,600 | |
| タカショー | 5,900 | 460.00 | 2,714,000 | |
| エクセル | 4,500 | 1,588.00 | 7,146,000 | |
| マルカ | 3,900 | 1,958.00 | 7,636,200 | |
| ＩＤＯＭ | 40,900 | 298.00 | 12,188,200 | |
| 日本エム・ディ・エム | 7,100 | 1,499.00 | 10,642,900 | |
| 進和 | 7,200 | 2,258.00 | 16,257,600 | |
| エスケイジャパン | 3,000 | 595.00 | 1,785,000 | |
| ダイトロン | 5,600 | 1,210.00 | 6,776,000 | |
| シークス | 15,400 | 1,376.00 | 21,190,400 | |
| 田中商事 | 4,100 | 621.00 | 2,546,100 | |
| オーハシテクニカ | 6,800 | 1,464.00 | 9,955,200 | |
| 白銅 | 3,900 | 1,422.00 | 5,545,800 | |
| 伊藤忠商事 | 848,100 | 2,075.00 | 1,759,807,500 | |
| 丸紅 | 1,195,700 | 725.80 | 867,839,060 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 高島 | 1,900 | 1,671.00 | 3,174,900 | |
| 長瀬産業 | 68,200 | 1,587.00 | 108,233,400 | |
| 蝶理 | 7,800 | 1,727.00 | 13,470,600 | |
| 豊田通商 | 135,300 | 3,340.00 | 451,902,000 | |
| 三共生興 | 20,700 | 538.00 | 11,136,600 | |
| 兼松 | 48,400 | 1,227.00 | 59,386,800 | |
| ツカモトコーポレーション | 2,200 | 1,045.00 | 2,299,000 | |
| 三井物産 | 999,000 | 1,807.00 | 1,805,193,000 | |
| 日本紙パルプ商事 | 6,900 | 3,710.00 | 25,599,000 | |
| 日立ハイテクノロジーズ | 36,900 | 5,800.00 | 214,020,000 | |
| カメイ | 15,800 | 1,164.00 | 18,391,200 | |
| 東都水産 | 1,700 | 2,582.00 | 4,389,400 | |
| ＯＵＧホールディングス | 1,900 | 2,666.00 | 5,065,400 | |
| スターゼン | 4,500 | 4,345.00 | 19,552,500 | |
| 山善 | 47,400 | 1,039.00 | 49,248,600 | |
| 椿本興業 | 2,700 | 3,250.00 | 8,775,000 | |
| 住友商事 | 717,100 | 1,638.50 | 1,174,968,350 | |
| 内田洋行 | 5,200 | 3,675.00 | 19,110,000 | |
| 三菱商事 | 850,900 | 2,931.50 | 2,494,413,350 | |
| 第一実業 | 5,500 | 3,085.00 | 16,967,500 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 34,700 | 2,330.00 | 80,851,000 | |
| 西華産業 | 6,900 | 1,354.00 | 9,342,600 | |
| 佐藤商事 | 10,900 | 896.00 | 9,766,400 | |
| 菱洋エレクトロ | 12,300 | 1,868.00 | 22,976,400 | |
| 東京産業 | 12,100 | 506.00 | 6,122,600 | |
| ユアサ商事 | 12,400 | 3,150.00 | 39,060,000 | |
| 神鋼商事 | 2,700 | 2,321.00 | 6,266,700 | |
| 小林産業 | 7,300 | 317.00 | 2,314,100 | |
| 阪和興業 | 21,000 | 2,925.00 | 61,425,000 | |
| 正栄食品工業 | 8,500 | 3,300.00 | 28,050,000 | |
| カナデン | 10,900 | 1,387.00 | 15,118,300 | |
| 菱電商事 | 9,600 | 1,606.00 | 15,417,600 | |
| フルサト工業 | 6,700 | 1,418.00 | 9,500,600 | |
| 岩谷産業 | 26,900 | 3,730.00 | 100,337,000 | |
| すてきナイスグループ | 5,200 | 577.00 | 3,000,400 | |
| 昭光通商 | 4,300 | 642.00 | 2,760,600 | |
| ニチモウ | 1,900 | 1,753.00 | 3,330,700 | |
| 極東貿易 | 3,700 | 1,555.00 | 5,753,500 | |
| イワキ | 14,600 | 495.00 | 7,227,000 | |
| 三愛石油 | 32,600 | 1,043.00 | 34,001,800 | |
| 稲畑産業 | 29,100 | 1,389.00 | 40,419,900 | |
| ＧＳＩクレオス | 3,200 | 1,300.00 | 4,160,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 明和産業 | 11,200 | 380.00 | 4,256,000 | |
| クワザワ | 4,400 | 513.00 | 2,257,200 | |
| ワキタ | 25,900 | 1,082.00 | 28,023,800 | |
| 東邦ホールディングス | 35,900 | 2,548.00 | 91,473,200 | |
| サンゲツ | 36,000 | 2,056.00 | 74,016,000 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 16,100 | 813.00 | 13,089,300 | |
| シナネンホールディングス | 5,000 | 1,910.00 | 9,550,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 26,800 | 884.00 | 23,691,200 | |
| サンリオ | 37,500 | 2,380.00 | 89,250,000 | |
| サンワテクノス | 7,400 | 901.00 | 6,667,400 | |
| リョーサン | 13,400 | 2,581.00 | 34,585,400 | |
| 新光商事 | 11,400 | 1,889.00 | 21,534,600 | |
| トーホー | 5,500 | 2,119.00 | 11,654,500 | |
| 三信電気 | 8,400 | 1,786.00 | 15,002,400 | |
| 東陽テクニカ | 14,000 | 999.00 | 13,986,000 | |
| モスフードサービス | 15,900 | 2,379.00 | 37,826,100 | |
| 加賀電子 | 12,100 | 1,678.00 | 20,303,800 | |
| ソーダニッカ | 12,500 | 580.00 | 7,250,000 | |
| 立花エレテック | 9,000 | 1,693.00 | 15,237,000 | |
| フォーバル | 5,300 | 919.00 | 4,870,700 | |
| ＰＡＬＴＡＣ | 21,900 | 6,040.00 | 132,276,000 | |
| 三谷産業 | 14,200 | 282.00 | 4,004,400 | |
| 西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス | 2,700 | 3,830.00 | 10,341,000 | |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1,000 | 1,339.00 | 1,339,000 | |
| 国際紙パルプ商事 | 28,400 | 313.00 | 8,889,200 | |
| ヤマタネ | 6,100 | 1,400.00 | 8,540,000 | |
| 丸紅建材リース | 1,200 | 1,720.00 | 2,064,000 | |
| 日鉄物産 | 8,600 | 4,435.00 | 38,141,000 | |
| 泉州電業 | 4,000 | 2,866.00 | 11,464,000 | |
| トラスコ中山 | 25,200 | 2,302.00 | 58,010,400 | |
| オートバックスセブン | 48,200 | 1,787.00 | 86,133,400 | |
| モリト | 8,900 | 809.00 | 7,200,100 | |
| 加藤産業 | 19,000 | 3,260.00 | 61,940,000 | |
| 北恵 | 2,300 | 869.00 | 1,998,700 | |
| イノテック | 7,200 | 887.00 | 6,386,400 | |
| イエローハット | 22,900 | 1,424.00 | 32,609,600 | |
| ＪＫホールディングス | 11,000 | 580.00 | 6,380,000 | |
| 日伝 | 10,100 | 1,917.00 | 19,361,700 | |
| 北沢産業 | 9,200 | 263.00 | 2,419,600 | |
| 杉本商事 | 6,500 | 2,132.00 | 13,858,000 | |
| 因幡電機産業 | 17,300 | 4,715.00 | 81,569,500 | |
| 東テク | 4,000 | 2,365.00 | 9,460,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ミスミグループ本社 | 151,900 | 2,507.00 | 380,813,300 | |
| アルテック | 9,000 | 216.00 | 1,944,000 | |
| タキヒヨー | 3,700 | 1,824.00 | 6,748,800 | |
| 蔵王産業 | 2,000 | 1,340.00 | 2,680,000 | |
| スズケン | 55,300 | 6,260.00 | 346,178,000 | |
| ジェコス | 8,400 | 977.00 | 8,206,800 | |
| グローセル | 11,200 | 452.00 | 5,062,400 | |
| ローソン | 30,700 | 5,450.00 | 167,315,000 | |
| サンエー | 9,200 | 4,540.00 | 41,768,000 | |
| カワチ薬品 | 9,500 | 2,013.00 | 19,123,500 | |
| エービーシー・マート | 18,900 | 6,640.00 | 125,496,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 5,000 | 691.00 | 3,455,000 | |
| アスクル | 12,700 | 2,309.00 | 29,324,300 | |
| ゲオホールディングス | 18,500 | 1,488.00 | 27,528,000 | |
| アダストリア | 16,900 | 2,144.00 | 36,233,600 | |
| ジーフット | 7,500 | 658.00 | 4,935,000 | |
| くら寿司 | 7,100 | 4,340.00 | 30,814,000 | |
| キャンドゥ | 5,900 | 1,656.00 | 9,770,400 | |
| パルグループホールディングス | 6,200 | 3,510.00 | 21,762,000 | |
| エディオン | 51,500 | 1,034.00 | 53,251,000 | |
| サーラコーポレーション | 24,800 | 612.00 | 15,177,600 | |
| ワッツ | 5,500 | 700.00 | 3,850,000 | |
| ハローズ | 4,600 | 2,333.00 | 10,731,800 | |
| フジオフードシステム | 5,200 | 2,603.00 | 13,535,600 | |
| あみやき亭 | 2,700 | 3,525.00 | 9,517,500 | |
| ひらまつ | 24,500 | 372.00 | 9,114,000 | |
| 大黒天物産 | 2,900 | 3,770.00 | 10,933,000 | |
| ハニーズホールディングス | 10,800 | 1,336.00 | 14,428,800 | |
| ファーマライズホールディングス | 3,100 | 526.00 | 1,630,600 | |
| アルペン | 9,400 | 1,584.00 | 14,889,600 | |
| ハブ | 4,000 | 1,234.00 | 4,936,000 | |
| クオールホールディングス | 17,900 | 1,645.00 | 29,445,500 | |
| ジンズホールディングス | 6,400 | 5,900.00 | 37,760,000 | |
| ビックカメラ | 72,000 | 1,102.00 | 79,344,000 | |
| ＤＣＭホールディングス | 65,500 | 1,091.00 | 71,460,500 | |
| ペッパーフードサービス | 9,700 | 1,701.00 | 16,499,700 | |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 76,700 | 2,703.00 | 207,320,100 | |
| 東京一番フーズ | 3,300 | 606.00 | 1,999,800 | |
| ＤＤホールディングス | 2,700 | 2,191.00 | 5,915,700 | |
| きちりホールディングス | 3,400 | 731.00 | 2,485,400 | |
| アークランドサービスホールディングス | 8,900 | 1,945.00 | 17,310,500 | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 155,200 | 1,290.00 | 200,208,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ドトール・日レスホールディングス | 21,300 | 2,088.00 | 44,474,400 | |
| マツモトキヨシホールディングス | 50,200 | 3,370.00 | 169,174,000 | |
| ブロンコビリー | 6,400 | 2,233.00 | 14,291,200 | |
| ＺＯＺＯ | 131,100 | 1,972.00 | 258,529,200 | |
| トレジャー・ファクトリー | 3,700 | 898.00 | 3,322,600 | |
| 物語コーポレーション | 3,000 | 9,190.00 | 27,570,000 | |
| ココカラファイン | 13,700 | 5,790.00 | 79,323,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 227,100 | 901.00 | 204,617,100 | |
| Ｈａｍｅｅ | 3,900 | 842.00 | 3,283,800 | |
| ウエルシアホールディングス | 32,100 | 4,970.00 | 159,537,000 | |
| クリエイトＳＤホールディングス | 17,900 | 2,527.00 | 45,233,300 | |
| 丸善ＣＨＩホールディングス | 14,200 | 389.00 | 5,523,800 | |
| ティーライフ | 1,800 | 914.00 | 1,645,200 | |
| エー・ピーカンパニー | 2,600 | 488.00 | 1,268,800 | |
| チムニー | 3,800 | 2,430.00 | 9,234,000 | |
| シュッピン | 8,400 | 824.00 | 6,921,600 | |
| ネクステージ | 20,200 | 1,209.00 | 24,421,800 | |
| ジョイフル本田 | 35,600 | 1,245.00 | 44,322,000 | |
| 鳥貴族 | 4,100 | 2,195.00 | 8,999,500 | |
| キリン堂ホールディングス | 4,800 | 1,835.00 | 8,808,000 | |
| ホットランド | 6,500 | 1,566.00 | 10,179,000 | |
| すかいらーくホールディングス | 113,300 | 1,911.00 | 216,516,300 | |
| ＳＦＰホールディングス | 5,200 | 1,883.00 | 9,791,600 | |
| 綿半ホールディングス | 4,600 | 2,410.00 | 11,086,000 | |
| ヨシックス | 2,000 | 2,627.00 | 5,254,000 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 35,400 | 965.00 | 34,161,000 | |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 5,100 | 610.00 | 3,111,000 | |
| ＢＥＥＮＯＳ | 4,300 | 1,617.00 | 6,953,100 | |
| あさひ | 10,100 | 1,249.00 | 12,614,900 | |
| 日本調剤 | 4,300 | 3,340.00 | 14,362,000 | |
| コスモス薬品 | 5,400 | 18,390.00 | 99,306,000 | |
| トーエル | 6,000 | 718.00 | 4,308,000 | |
| オンリー | 2,200 | 845.00 | 1,859,000 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 508,300 | 3,773.00 | 1,917,815,900 | |
| 薬王堂 | 5,300 | 2,513.00 | 13,318,900 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 32,700 | 1,416.00 | 46,303,200 | |
| ツルハホールディングス | 26,400 | 10,470.00 | 276,408,000 | |
| サンマルクホールディングス | 9,600 | 2,398.00 | 23,020,800 | |
| フェリシモ | 2,800 | 968.00 | 2,710,400 | |
| トリドールホールディングス | 15,000 | 2,331.00 | 34,965,000 | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 11,100 | 884.00 | 9,812,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ウイルプラスホールディングス | 2,000 | 811.00 | 1,622,000 | |
| ジャパンミート | 6,200 | 1,894.00 | 11,742,800 | |
| サツドラホールディングス | 1,900 | 1,878.00 | 3,568,200 | |
| デファクトスタンダード | 1,400 | 362.00 | 506,800 | |
| アレンザホールディングス | 6,700 | 919.00 | 6,157,300 | |
| バロックジャパンリミテッド | 9,900 | 905.00 | 8,959,500 | |
| クスリのアオキホールディングス | 12,100 | 7,190.00 | 86,999,000 | |
| 力の源ホールディングス | 4,700 | 925.00 | 4,347,500 | |
| スシローグローバルホールディングス | 13,300 | 6,690.00 | 88,977,000 | |
| ＬＩＸＩＬビバ | 10,400 | 1,253.00 | 13,031,200 | |
| メディカルシステムネットワーク | 13,100 | 568.00 | 7,440,800 | |
| はるやまホールディングス | 5,800 | 812.00 | 4,709,600 | |
| ノジマ | 21,600 | 1,822.00 | 39,355,200 | |
| カッパ・クリエイト | 17,000 | 1,411.00 | 23,987,000 | |
| ライトオン | 9,100 | 721.00 | 6,561,100 | |
| 良品計画 | 17,200 | 20,020.00 | 344,344,000 | |
| 三城ホールディングス | 15,400 | 353.00 | 5,436,200 | |
| アドヴァン | 18,600 | 1,131.00 | 21,036,600 | |
| アルビス | 4,600 | 2,715.00 | 12,489,000 | |
| コナカ | 14,600 | 417.00 | 6,088,200 | |
| ハウス　オブ　ローゼ | 1,600 | 1,628.00 | 2,604,800 | |
| Ｇ－７ホールディングス | 3,600 | 3,005.00 | 10,818,000 | |
| イオン北海道 | 12,400 | 730.00 | 9,052,000 | |
| コジマ | 21,100 | 505.00 | 10,655,500 | |
| ヒマラヤ | 4,400 | 831.00 | 3,656,400 | |
| コーナン商事 | 16,000 | 2,332.00 | 37,312,000 | |
| エコス | 4,500 | 1,491.00 | 6,709,500 | |
| ワタミ | 16,000 | 1,543.00 | 24,688,000 | |
| マルシェ | 3,400 | 781.00 | 2,655,400 | |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 72,600 | 6,830.00 | 495,858,000 | |
| 西松屋チェーン | 26,800 | 865.00 | 23,182,000 | |
| ゼンショーホールディングス | 57,300 | 2,308.00 | 132,248,400 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 7,700 | 2,933.00 | 22,584,100 | |
| ハークスレイ | 2,700 | 1,059.00 | 2,859,300 | |
| サイゼリヤ | 20,000 | 2,450.00 | 49,000,000 | |
| ＶＴホールディングス | 55,100 | 415.00 | 22,866,500 | |
| 魚力 | 3,400 | 1,502.00 | 5,106,800 | |
| フジ・コーポレーション | 3,300 | 2,093.00 | 6,906,900 | |
| ユナイテッドアローズ | 13,900 | 3,300.00 | 45,870,000 | |
| ハイデイ日高 | 17,600 | 2,072.00 | 36,467,200 | |
| 京都きもの友禅 | 8,100 | 344.00 | 2,786,400 | |
| コロワイド | 40,300 | 2,139.00 | 86,201,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ピーシーデポコーポレーション | 16,400 | 448.00 | 7,347,200 | |
| 壱番屋 | 8,600 | 4,845.00 | 41,667,000 | |
| ＰＬＡＮＴ | 3,300 | 784.00 | 2,587,200 | |
| スギホールディングス | 26,700 | 5,210.00 | 139,107,000 | |
| スクロール | 19,000 | 350.00 | 6,650,000 | |
| ヨンドシーホールディングス | 13,500 | 2,567.00 | 34,654,500 | |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 135,700 | 2,678.00 | 363,404,600 | |
| 木曽路 | 14,900 | 2,600.00 | 38,740,000 | |
| ＳＲＳホールディングス | 14,400 | 1,012.00 | 14,572,800 | |
| タカキュー | 10,100 | 180.00 | 1,818,000 | |
| ケーヨー | 22,700 | 483.00 | 10,964,100 | |
| 上新電機 | 14,400 | 2,152.00 | 30,988,800 | |
| 日本瓦斯 | 19,200 | 2,806.00 | 53,875,200 | |
| ロイヤルホールディングス | 21,200 | 2,780.00 | 58,936,000 | |
| いなげや | 13,600 | 1,433.00 | 19,488,800 | |
| 島忠 | 25,700 | 2,542.00 | 65,329,400 | |
| チヨダ | 12,800 | 1,605.00 | 20,544,000 | |
| ライフコーポレーション | 9,300 | 2,350.00 | 21,855,000 | |
| リンガーハット | 15,000 | 2,375.00 | 35,625,000 | |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 16,900 | 479.00 | 8,095,100 | |
| テンアライド | 11,200 | 426.00 | 4,771,200 | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 24,400 | 1,056.00 | 25,766,400 | |
| オークワ | 17,400 | 1,108.00 | 19,279,200 | |
| コメリ | 18,800 | 2,247.00 | 42,243,600 | |
| 青山商事 | 21,300 | 2,069.00 | 44,069,700 | |
| しまむら | 14,100 | 8,250.00 | 116,325,000 | |
| はせがわ | 6,800 | 400.00 | 2,720,000 | |
| 高島屋 | 95,300 | 1,234.00 | 117,600,200 | |
| 松屋 | 24,600 | 870.00 | 21,402,000 | |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 62,300 | 1,269.00 | 79,058,700 | |
| 近鉄百貨店 | 4,700 | 3,245.00 | 15,251,500 | |
| パルコ | 11,700 | 1,154.00 | 13,501,800 | |
| 丸井グループ | 102,700 | 2,410.00 | 247,507,000 | |
| アクシアル　リテイリング | 10,100 | 3,865.00 | 39,036,500 | |
| イオン | 466,700 | 1,865.00 | 870,395,500 | |
| イズミ | 24,700 | 4,210.00 | 103,987,000 | |
| 平和堂 | 24,700 | 2,023.00 | 49,968,100 | |
| フジ | 14,700 | 1,900.00 | 27,930,000 | |
| ヤオコー | 13,800 | 4,945.00 | 68,241,000 | |
| ゼビオホールディングス | 14,800 | 1,261.00 | 18,662,800 | |
| ケーズホールディングス | 126,100 | 1,052.00 | 132,657,200 | |
| Ｏｌｙｍｐｉｃグループ | 7,300 | 657.00 | 4,796,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日産東京販売ホールディングス | 18,300 | 275.00 | 5,032,500 | |
| Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ | 6,000 | 2,708.00 | 16,248,000 | |
| 総合メディカルホールディングス | 10,600 | 1,726.00 | 18,295,600 | |
| ブックオフグループホールディングス | 6,300 | 1,257.00 | 7,919,100 | |
| アインホールディングス | 16,300 | 6,550.00 | 106,765,000 | |
| 元気寿司 | 3,400 | 3,340.00 | 11,356,000 | |
| ヤマダ電機 | 369,700 | 499.00 | 184,480,300 | |
| アークランドサカモト | 20,700 | 1,352.00 | 27,986,400 | |
| ニトリホールディングス | 52,500 | 14,645.00 | 768,862,500 | |
| グルメ杵屋 | 8,800 | 1,161.00 | 10,216,800 | |
| 愛眼 | 9,700 | 251.00 | 2,434,700 | |
| ケーユーホールディングス | 6,500 | 915.00 | 5,947,500 | |
| 吉野家ホールディングス | 42,400 | 2,049.00 | 86,877,600 | |
| 松屋フーズホールディングス | 5,900 | 3,425.00 | 20,207,500 | |
| サガミホールディングス | 16,300 | 1,330.00 | 21,679,000 | |
| 関西スーパーマーケット | 9,300 | 1,126.00 | 10,471,800 | |
| 王将フードサービス | 8,900 | 6,420.00 | 57,138,000 | |
| プレナス | 13,600 | 1,869.00 | 25,418,400 | |
| ミニストップ | 9,100 | 1,565.00 | 14,241,500 | |
| アークス | 22,800 | 2,241.00 | 51,094,800 | |
| バローホールディングス | 26,200 | 2,330.00 | 61,046,000 | |
| ベルク | 6,000 | 5,310.00 | 31,860,000 | |
| 大庄 | 6,600 | 1,599.00 | 10,553,400 | |
| ファーストリテイリング | 16,200 | 66,880.00 | 1,083,456,000 | |
| サンドラッグ | 45,700 | 3,050.00 | 139,385,000 | |
| サックスバー　ホールディングス | 10,400 | 977.00 | 10,160,800 | |
| ヤマザワ | 2,600 | 1,648.00 | 4,284,800 | |
| やまや | 2,100 | 2,229.00 | 4,680,900 | |
| ベルーナ | 29,900 | 751.00 | 22,454,900 | |
| 島根銀行 | 3,700 | 707.00 | 2,615,900 | |
| じもとホールディングス | 82,000 | 104.00 | 8,528,000 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 633,800 | 284.00 | 179,999,200 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 16,900 | 1,628.00 | 27,513,200 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 201,100 | 437.00 | 87,880,700 | |
| ゆうちょ銀行 | 344,700 | 1,112.00 | 383,306,400 | |
| 富山第一銀行 | 31,500 | 317.00 | 9,985,500 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 763,800 | 422.00 | 322,323,600 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 77,400 | 790.00 | 61,146,000 | |
| 関西みらいフィナンシャルグループ | 58,100 | 736.00 | 42,761,600 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 11,000 | 1,526.00 | 16,786,000 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 21,400 | 2,834.00 | 60,647,600 | |
| 新生銀行 | 89,100 | 1,739.00 | 154,944,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| あおぞら銀行 | 67,800 | 2,651.00 | 179,737,800 | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 8,358,800 | 526.40 | 4,400,072,320 | |
| りそなホールディングス | 1,332,500 | 459.60 | 612,417,000 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 238,700 | 3,946.00 | 941,910,200 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 855,800 | 3,839.00 | 3,285,416,200 | |
| 千葉銀行 | 419,100 | 569.00 | 238,467,900 | |
| 群馬銀行 | 245,000 | 395.00 | 96,775,000 | |
| 武蔵野銀行 | 18,500 | 2,150.00 | 39,775,000 | |
| 千葉興業銀行 | 36,200 | 274.00 | 9,918,800 | |
| 筑波銀行 | 50,500 | 174.00 | 8,787,000 | |
| 七十七銀行 | 38,600 | 1,602.00 | 61,837,200 | |
| 青森銀行 | 9,700 | 2,693.00 | 26,122,100 | |
| 秋田銀行 | 8,200 | 2,042.00 | 16,744,400 | |
| 山形銀行 | 14,100 | 1,687.00 | 23,786,700 | |
| 岩手銀行 | 8,800 | 2,853.00 | 25,106,400 | |
| 東邦銀行 | 108,600 | 271.00 | 29,430,600 | |
| 東北銀行 | 6,200 | 1,050.00 | 6,510,000 | |
| みちのく銀行 | 7,800 | 1,703.00 | 13,283,400 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 107,400 | 2,037.00 | 218,773,800 | |
| 静岡銀行 | 301,700 | 819.00 | 247,092,300 | |
| 十六銀行 | 16,700 | 2,385.00 | 39,829,500 | |
| 八十二銀行 | 294,900 | 445.00 | 131,230,500 | |
| 山梨中央銀行 | 15,300 | 1,160.00 | 17,748,000 | |
| 大垣共立銀行 | 25,900 | 2,433.00 | 63,014,700 | |
| 福井銀行 | 10,900 | 1,475.00 | 16,077,500 | |
| 北國銀行 | 12,800 | 3,040.00 | 38,912,000 | |
| 清水銀行 | 5,400 | 1,826.00 | 9,860,400 | |
| 富山銀行 | 2,700 | 2,569.00 | 6,936,300 | |
| 滋賀銀行 | 24,700 | 2,527.00 | 62,416,900 | |
| 南都銀行 | 19,300 | 2,345.00 | 45,258,500 | |
| 百五銀行 | 111,600 | 334.00 | 37,274,400 | |
| 京都銀行 | 43,700 | 4,235.00 | 185,069,500 | |
| 紀陽銀行 | 43,500 | 1,459.00 | 63,466,500 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 81,500 | 1,159.00 | 94,458,500 | |
| 広島銀行 | 180,700 | 541.00 | 97,758,700 | |
| 山陰合同銀行 | 73,200 | 701.00 | 51,313,200 | |
| 中国銀行 | 105,300 | 992.00 | 104,457,600 | |
| 鳥取銀行 | 4,700 | 1,426.00 | 6,702,200 | |
| 伊予銀行 | 162,300 | 565.00 | 91,699,500 | |
| 百十四銀行 | 13,300 | 2,238.00 | 29,765,400 | |
| 四国銀行 | 18,100 | 946.00 | 17,122,600 | |
| 阿波銀行 | 18,900 | 2,558.00 | 48,346,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大分銀行 | 7,700 | 3,060.00 | 23,562,000 | |
| 宮崎銀行 | 8,400 | 2,534.00 | 21,285,600 | |
| 佐賀銀行 | 7,900 | 1,621.00 | 12,805,900 | |
| 沖縄銀行 | 11,400 | 3,390.00 | 38,646,000 | |
| 琉球銀行 | 28,700 | 1,148.00 | 32,947,600 | |
| セブン銀行 | 413,000 | 291.00 | 120,183,000 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 16,499,900 | 158.50 | 2,615,234,150 | |
| 高知銀行 | 4,400 | 789.00 | 3,471,600 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 152,600 | 786.00 | 119,943,600 | |
| 長野銀行 | 4,400 | 1,753.00 | 7,713,200 | |
| 名古屋銀行 | 10,100 | 3,405.00 | 34,390,500 | |
| 北洋銀行 | 186,300 | 255.00 | 47,506,500 | |
| 愛知銀行 | 4,600 | 3,755.00 | 17,273,000 | |
| 中京銀行 | 5,400 | 2,233.00 | 12,058,200 | |
| 大光銀行 | 4,600 | 1,786.00 | 8,215,600 | |
| 愛媛銀行 | 17,700 | 1,078.00 | 19,080,600 | |
| トマト銀行 | 5,400 | 1,045.00 | 5,643,000 | |
| 京葉銀行 | 53,000 | 661.00 | 35,033,000 | |
| 栃木銀行 | 67,200 | 185.00 | 12,432,000 | |
| 北日本銀行 | 4,200 | 1,798.00 | 7,551,600 | |
| 東和銀行 | 21,300 | 713.00 | 15,186,900 | |
| 福島銀行 | 10,500 | 257.00 | 2,698,500 | |
| 大東銀行 | 5,800 | 550.00 | 3,190,000 | |
| トモニホールディングス | 96,100 | 375.00 | 36,037,500 | |
| フィデアホールディングス | 117,900 | 117.00 | 13,794,300 | |
| 池田泉州ホールディングス | 132,700 | 208.00 | 27,601,600 | |
| ＦＰＧ | 38,300 | 936.00 | 35,848,800 | |
| マーキュリアインベストメント | 4,900 | 827.00 | 4,052,300 | |
| ＳＢＩホールディングス | 144,700 | 2,748.00 | 397,635,600 | |
| ジャフコ | 19,900 | 4,155.00 | 82,684,500 | |
| 大和証券グループ本社 | 974,700 | 474.80 | 462,787,560 | |
| 野村ホールディングス | 2,137,000 | 380.40 | 812,914,800 | |
| 岡三証券グループ | 103,900 | 404.00 | 41,975,600 | |
| 丸三証券 | 36,400 | 567.00 | 20,638,800 | |
| 東洋証券 | 44,800 | 124.00 | 5,555,200 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 145,300 | 333.00 | 48,384,900 | |
| 光世証券 | 3,200 | 672.00 | 2,150,400 | |
| 水戸証券 | 35,900 | 207.00 | 7,431,300 | |
| いちよし証券 | 25,700 | 750.00 | 19,275,000 | |
| 松井証券 | 59,600 | 1,005.00 | 59,898,000 | |
| だいこう証券ビジネス | 5,200 | 493.00 | 2,563,600 | |
| マネックスグループ | 112,400 | 368.00 | 41,363,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 極東証券 | 16,500 | 902.00 | 14,883,000 | |
| 岩井コスモホールディングス | 12,600 | 1,183.00 | 14,905,800 | |
| 藍澤證券 | 22,000 | 664.00 | 14,608,000 | |
| マネーパートナーズグループ | 14,800 | 298.00 | 4,410,400 | |
| スパークス・グループ | 48,800 | 234.00 | 11,419,200 | |
| かんぽ生命保険 | 43,000 | 1,918.00 | 82,474,000 | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 214,000 | 4,370.00 | 935,180,000 | |
| アニコム　ホールディングス | 10,000 | 3,875.00 | 38,750,000 | |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 317,500 | 3,590.00 | 1,139,825,000 | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 99,800 | 2,601.00 | 259,579,800 | |
| 第一生命ホールディングス | 687,000 | 1,634.00 | 1,122,558,000 | |
| 東京海上ホールディングス | 434,200 | 5,656.00 | 2,455,835,200 | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 375,500 | 1,196.50 | 449,285,750 | |
| アドバンスクリエイト | 2,800 | 1,835.00 | 5,138,000 | |
| 全国保証 | 34,200 | 4,380.00 | 149,796,000 | |
| ジェイリース | 3,400 | 364.00 | 1,237,600 | |
| イントラスト | 3,400 | 582.00 | 1,978,800 | |
| 日本モーゲージサービス | 2,200 | 1,197.00 | 2,633,400 | |
| Ｃａｓａ | 5,500 | 1,155.00 | 6,352,500 | |
| アルヒ | 11,000 | 2,056.00 | 22,616,000 | |
| プレミアグループ | 7,000 | 1,958.00 | 13,706,000 | |
| クレディセゾン | 85,100 | 1,295.00 | 110,204,500 | |
| 芙蓉総合リース | 13,900 | 6,230.00 | 86,597,000 | |
| 興銀リース | 22,800 | 2,675.00 | 60,990,000 | |
| 東京センチュリー | 24,500 | 4,610.00 | 112,945,000 | |
| 日本証券金融 | 53,500 | 564.00 | 30,174,000 | |
| アイフル | 185,200 | 229.00 | 42,410,800 | |
| リコーリース | 9,600 | 3,365.00 | 32,304,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 77,600 | 1,759.00 | 136,498,400 | |
| アコム | 244,100 | 385.00 | 93,978,500 | |
| ジャックス | 13,400 | 2,213.00 | 29,654,200 | |
| オリエントコーポレーション | 328,400 | 128.00 | 42,035,200 | |
| 日立キャピタル | 28,600 | 2,336.00 | 66,809,600 | |
| アプラスフィナンシャル | 58,300 | 74.00 | 4,314,200 | |
| オリックス | 810,100 | 1,636.50 | 1,325,728,650 | |
| 三菱ＵＦＪリース | 273,900 | 583.00 | 159,683,700 | |
| 九州リースサービス | 6,000 | 626.00 | 3,756,000 | |
| 日本取引所グループ | 328,000 | 1,710.00 | 560,880,000 | |
| イー・ギャランティ | 11,400 | 1,361.00 | 15,515,400 | |
| アサックス | 5,000 | 579.00 | 2,895,000 | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 4,900 | 1,917.00 | 9,393,300 | |
| いちご | 157,500 | 333.00 | 52,447,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本駐車場開発 | 138,600 | 184.00 | 25,502,400 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 6,200 | 1,678.00 | 10,403,600 | |
| ヒューリック | 254,500 | 918.00 | 233,631,000 | |
| 三栄建築設計 | 5,500 | 1,585.00 | 8,717,500 | |
| 野村不動産ホールディングス | 81,300 | 2,408.00 | 195,770,400 | |
| 三重交通グループホールディングス | 26,300 | 583.00 | 15,332,900 | |
| サムティ | 17,800 | 1,697.00 | 30,206,600 | |
| ディア・ライフ | 17,700 | 475.00 | 8,407,500 | |
| コーセーアールイー | 4,900 | 766.00 | 3,753,400 | |
| エー・ディー・ワークス | 187,800 | 33.00 | 6,197,400 | |
| 日本商業開発 | 8,300 | 1,512.00 | 12,549,600 | |
| プレサンスコーポレーション | 19,900 | 1,533.00 | 30,506,700 | |
| ユニゾホールディングス | 18,800 | 2,390.00 | 44,932,000 | |
| 日本管理センター | 8,900 | 1,130.00 | 10,057,000 | |
| サンセイランディック | 4,600 | 732.00 | 3,367,200 | |
| エストラスト | 1,700 | 718.00 | 1,220,600 | |
| フージャースホールディングス | 26,400 | 611.00 | 16,130,400 | |
| オープンハウス | 17,800 | 4,475.00 | 79,655,000 | |
| 東急不動産ホールディングス | 328,200 | 640.00 | 210,048,000 | |
| 飯田グループホールディングス | 101,800 | 1,795.00 | 182,731,000 | |
| イーグランド | 3,100 | 715.00 | 2,216,500 | |
| ムゲンエステート | 10,100 | 570.00 | 5,757,000 | |
| ファーストブラザーズ | 4,300 | 1,020.00 | 4,386,000 | |
| ハウスドゥ | 6,700 | 1,533.00 | 10,271,100 | |
| シーアールイー | 3,900 | 1,100.00 | 4,290,000 | |
| ケイアイスター不動産 | 3,800 | 1,729.00 | 6,570,200 | |
| グッドコムアセット | 3,400 | 1,497.00 | 5,089,800 | |
| ジェイ・エス・ビー | 800 | 4,730.00 | 3,784,000 | |
| テンポイノベーション | 2,000 | 1,637.00 | 3,274,000 | |
| パーク２４ | 71,400 | 2,479.00 | 177,000,600 | |
| パラカ | 3,600 | 2,004.00 | 7,214,400 | |
| 三井不動産 | 644,600 | 2,604.00 | 1,678,538,400 | |
| 三菱地所 | 851,200 | 2,027.50 | 1,725,808,000 | |
| 平和不動産 | 22,700 | 2,289.00 | 51,960,300 | |
| 東京建物 | 133,500 | 1,260.00 | 168,210,000 | |
| ダイビル | 36,700 | 1,012.00 | 37,140,400 | |
| 京阪神ビルディング | 22,200 | 1,014.00 | 22,510,800 | |
| 住友不動産 | 273,200 | 3,983.00 | 1,088,155,600 | |
| テーオーシー | 29,300 | 668.00 | 19,572,400 | |
| 東京楽天地 | 1,900 | 5,130.00 | 9,747,000 | |
| スターツコーポレーション | 16,900 | 2,611.00 | 44,125,900 | |
| フジ住宅 | 16,800 | 764.00 | 12,835,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 空港施設 | 16,100 | 510.00 | 8,211,000 | |
| 明和地所 | 8,400 | 568.00 | 4,771,200 | |
| ゴールドクレスト | 10,100 | 1,923.00 | 19,422,300 | |
| 日本エスリード | 5,300 | 1,663.00 | 8,813,900 | |
| 日神不動産 | 20,000 | 475.00 | 9,500,000 | |
| 日本エスコン | 23,400 | 703.00 | 16,450,200 | |
| タカラレーベン | 58,000 | 389.00 | 22,562,000 | |
| サンヨーハウジング名古屋 | 7,900 | 951.00 | 7,512,900 | |
| イオンモール | 61,400 | 1,729.00 | 106,160,600 | |
| 毎日コムネット | 4,000 | 734.00 | 2,936,000 | |
| ファースト住建 | 5,300 | 1,239.00 | 6,566,700 | |
| カチタス | 13,800 | 4,090.00 | 56,442,000 | |
| トーセイ | 17,700 | 1,103.00 | 19,523,100 | |
| 穴吹興産 | 1,700 | 2,860.00 | 4,862,000 | |
| サンフロンティア不動産 | 17,700 | 1,093.00 | 19,346,100 | |
| エフ・ジェー・ネクスト | 11,500 | 1,101.00 | 12,661,500 | |
| インテリックス | 4,800 | 687.00 | 3,297,600 | |
| ランドビジネス | 5,100 | 760.00 | 3,876,000 | |
| グランディハウス | 12,700 | 478.00 | 6,070,600 | |
| 日本空港ビルデング | 39,000 | 4,230.00 | 164,970,000 | |
| 日本工営 | 8,000 | 2,388.00 | 19,104,000 | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 41,300 | 510.00 | 21,063,000 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 9,500 | 2,514.00 | 23,883,000 | |
| 日本M&Aセンター | 87,700 | 2,696.00 | 236,439,200 | |
| メンバーズ | 4,000 | 1,940.00 | 7,760,000 | |
| 中広 | 1,400 | 629.00 | 880,600 | |
| アイティメディア | 2,600 | 564.00 | 1,466,400 | |
| タケエイ | 12,300 | 1,001.00 | 12,312,300 | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 1,600 | 1,088.00 | 1,740,800 | |
| トラスト・テック | 13,000 | 1,617.00 | 21,021,000 | |
| コシダカホールディングス | 28,400 | 1,607.00 | 45,638,800 | |
| アルトナー | 3,000 | 790.00 | 2,370,000 | |
| パソナグループ | 14,400 | 1,647.00 | 23,716,800 | |
| ＣＤＳ | 3,000 | 1,328.00 | 3,984,000 | |
| リンクアンドモチベーション | 21,800 | 622.00 | 13,559,600 | |
| ＧＣＡ | 12,100 | 720.00 | 8,712,000 | |
| エス・エム・エス | 43,300 | 2,604.00 | 112,753,200 | |
| サニーサイドアップ | 2,800 | 1,029.00 | 2,881,200 | |
| パーソルホールディングス | 117,700 | 2,544.00 | 299,428,800 | |
| リニカル | 6,800 | 1,039.00 | 7,065,200 | |
| クックパッド | 37,400 | 333.00 | 12,454,200 | |
| エスクリ | 3,400 | 743.00 | 2,526,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アイ・ケイ・ケイ | 5,900 | 705.00 | 4,159,500 | |
| 学情 | 4,900 | 1,142.00 | 5,595,800 | |
| スタジオアリス | 6,000 | 2,098.00 | 12,588,000 | |
| シミックホールディングス | 6,600 | 2,141.00 | 14,130,600 | |
| ＮＪＳ | 2,700 | 1,673.00 | 4,517,100 | |
| 綜合警備保障 | 46,800 | 4,965.00 | 232,362,000 | |
| カカクコム | 88,100 | 2,302.00 | 202,806,200 | |
| アイロムグループ | 4,500 | 1,695.00 | 7,627,500 | |
| セントケア・ホールディング | 8,800 | 506.00 | 4,452,800 | |
| サイネックス | 2,200 | 640.00 | 1,408,000 | |
| ルネサンス | 6,600 | 1,794.00 | 11,840,400 | |
| ディップ | 19,000 | 1,869.00 | 35,511,000 | |
| オプトホールディング | 7,300 | 1,733.00 | 12,650,900 | |
| ツクイ | 28,000 | 533.00 | 14,924,000 | |
| キャリアデザインセンター | 3,100 | 1,595.00 | 4,944,500 | |
| ベネフィット・ワン | 32,700 | 1,903.00 | 62,228,100 | |
| エムスリー | 247,700 | 2,024.00 | 501,344,800 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 7,700 | 586.00 | 4,512,200 | |
| ブラス | 1,500 | 721.00 | 1,081,500 | |
| アウトソーシング | 62,100 | 1,414.00 | 87,809,400 | |
| ウェルネット | 11,300 | 991.00 | 11,198,300 | |
| ワールドホールディングス | 3,300 | 1,714.00 | 5,656,200 | |
| ディー・エヌ・エー | 63,500 | 2,142.00 | 136,017,000 | |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 163,600 | 1,806.00 | 295,461,600 | |
| ぐるなび | 17,000 | 657.00 | 11,169,000 | |
| タカミヤ | 12,300 | 754.00 | 9,274,200 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 8,000 | 1,507.00 | 12,056,000 | |
| ファンコミュニケーションズ | 32,600 | 570.00 | 18,582,000 | |
| ライク | 4,700 | 1,510.00 | 7,097,000 | |
| ビジネス・ブレークスルー | 5,300 | 360.00 | 1,908,000 | |
| ＷＤＢホールディングス | 5,400 | 2,785.00 | 15,039,000 | |
| ティア | 7,100 | 644.00 | 4,572,400 | |
| ＣＤＧ | 1,200 | 1,390.00 | 1,668,000 | |
| バリューコマース | 8,000 | 2,316.00 | 18,528,000 | |
| インフォマート | 64,500 | 1,642.00 | 105,909,000 | |
| ＪＰホールディングス | 34,100 | 289.00 | 9,854,900 | |
| エコナックホールディングス | 22,400 | 127.00 | 2,844,800 | |
| ＥＰＳホールディングス | 17,800 | 1,700.00 | 30,260,000 | |
| レッグス | 3,000 | 1,827.00 | 5,481,000 | |
| プレステージ・インターナショナル | 22,100 | 1,707.00 | 37,724,700 | |
| アミューズ | 7,200 | 2,539.00 | 18,280,800 | |
| ドリームインキュベータ | 3,700 | 1,385.00 | 5,124,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| クイック | 7,400 | 1,619.00 | 11,980,600 | |
| ＴＡＣ | 7,100 | 198.00 | 1,405,800 | |
| ケネディクス | 103,600 | 569.00 | 58,948,400 | |
| 電通 | 143,300 | 3,875.00 | 555,287,500 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 4,600 | 1,114.00 | 5,124,400 | |
| ぴあ | 3,400 | 4,805.00 | 16,337,000 | |
| イオンファンタジー | 3,800 | 2,383.00 | 9,055,400 | |
| シーティーエス | 13,500 | 695.00 | 9,382,500 | |
| ネクシィーズグループ | 4,200 | 2,076.00 | 8,719,200 | |
| みらかホールディングス | 32,900 | 2,508.00 | 82,513,200 | |
| アルプス技研 | 11,430 | 1,645.00 | 18,802,350 | |
| ダイオーズ | 2,800 | 1,420.00 | 3,976,000 | |
| 日本空調サービス | 13,500 | 726.00 | 9,801,000 | |
| オリエンタルランド | 139,000 | 13,830.00 | 1,922,370,000 | |
| ダスキン | 30,300 | 2,902.00 | 87,930,600 | |
| 明光ネットワークジャパン | 14,000 | 995.00 | 13,930,000 | |
| ファルコホールディングス | 6,600 | 1,659.00 | 10,949,400 | |
| ラウンドワン | 36,600 | 1,584.00 | 57,974,400 | |
| リゾートトラスト | 49,900 | 1,625.00 | 81,087,500 | |
| ビー・エム・エル | 15,200 | 3,095.00 | 47,044,000 | |
| ワタベウェディング | 2,100 | 622.00 | 1,306,200 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 21,400 | 1,278.00 | 27,349,200 | |
| リソー教育 | 60,000 | 500.00 | 30,000,000 | |
| 早稲田アカデミー | 3,500 | 761.00 | 2,663,500 | |
| ユー・エス・エス | 143,700 | 2,155.00 | 309,673,500 | |
| 東京個別指導学院 | 4,300 | 955.00 | 4,106,500 | |
| サイバーエージェント | 67,700 | 4,090.00 | 276,893,000 | |
| 楽天 | 548,500 | 1,169.00 | 641,196,500 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 7,000 | 1,275.00 | 8,925,000 | |
| テー・オー・ダブリュー | 10,500 | 785.00 | 8,242,500 | |
| 山田コンサルティンググループ | 5,800 | 2,096.00 | 12,156,800 | |
| セントラルスポーツ | 4,400 | 3,185.00 | 14,014,000 | |
| フルキャストホールディングス | 11,800 | 2,360.00 | 27,848,000 | |
| エン・ジャパン | 17,100 | 4,495.00 | 76,864,500 | |
| リソルホールディングス | 1,300 | 4,075.00 | 5,297,500 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 23,600 | 6,190.00 | 146,084,000 | |
| アトラ | 2,800 | 286.00 | 800,800 | |
| インターワークス | 2,500 | 717.00 | 1,792,500 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 4,800 | 2,620.00 | 12,576,000 | |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 4,400 | 1,322.00 | 5,816,800 | |
| ファーストロジック | 2,900 | 601.00 | 1,742,900 | |
| 三機サービス | 2,600 | 1,206.00 | 3,135,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| Ｇｕｎｏｓｙ | 8,300 | 1,870.00 | 15,521,000 | |
| デザインワン・ジャパン | 2,800 | 331.00 | 926,800 | |
| イー・ガーディアン | 6,000 | 1,902.00 | 11,412,000 | |
| リブセンス | 7,000 | 254.00 | 1,778,000 | |
| ジャパンマテリアル | 32,200 | 1,512.00 | 48,686,400 | |
| ベクトル | 14,800 | 1,075.00 | 15,910,000 | |
| ウチヤマホールディングス | 6,100 | 537.00 | 3,275,700 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 3,800 | 1,737.00 | 6,600,600 | |
| ライクキッズネクスト | 2,900 | 1,051.00 | 3,047,900 | |
| キャリアリンク | 4,600 | 603.00 | 2,773,800 | |
| ＩＢＪ | 8,100 | 977.00 | 7,913,700 | |
| アサンテ | 4,800 | 2,111.00 | 10,132,800 | |
| Ｎ・フィールド | 7,800 | 724.00 | 5,647,200 | |
| バリューＨＲ | 2,600 | 3,350.00 | 8,710,000 | |
| Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ | 4,200 | 6,140.00 | 25,788,000 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 5,000 | 1,190.00 | 5,950,000 | |
| ＥＲＩホールディングス | 3,400 | 818.00 | 2,781,200 | |
| アビスト | 1,900 | 2,684.00 | 5,099,600 | |
| シグマクシス | 5,700 | 1,321.00 | 7,529,700 | |
| ウィルグループ | 7,800 | 902.00 | 7,035,600 | |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 16,700 | 268.00 | 4,475,600 | |
| 日本ビューホテル | 3,800 | 1,434.00 | 5,449,200 | |
| リクルートホールディングス | 842,800 | 3,495.00 | 2,945,586,000 | |
| エラン | 8,200 | 1,770.00 | 14,514,000 | |
| 土木管理総合試験所 | 5,400 | 462.00 | 2,494,800 | |
| ネットマーケティング | 4,400 | 551.00 | 2,424,400 | |
| 日本郵政 | 964,300 | 1,205.00 | 1,161,981,500 | |
| ベルシステム２４ホールディングス | 19,800 | 1,595.00 | 31,581,000 | |
| 鎌倉新書 | 8,700 | 1,469.00 | 12,780,300 | |
| ソネット・メディア・ネットワークス | 1,600 | 869.00 | 1,390,400 | |
| 一蔵 | 1,500 | 690.00 | 1,035,000 | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 2,800 | 1,903.00 | 5,328,400 | |
| グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ | 1,900 | 1,009.00 | 1,917,100 | |
| エボラブルアジア | 5,300 | 2,534.00 | 13,430,200 | |
| アトラエ | 3,100 | 2,744.00 | 8,506,400 | |
| ストライク | 4,500 | 2,350.00 | 10,575,000 | |
| ソラスト | 28,900 | 1,086.00 | 31,385,400 | |
| セラク | 3,900 | 660.00 | 2,574,000 | |
| インソース | 4,600 | 2,413.00 | 11,099,800 | |
| ベイカレント・コンサルティング | 8,400 | 4,030.00 | 33,852,000 | |
| Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 2,100 | 1,277.00 | 2,681,700 | |
| アイモバイル | 3,900 | 800.00 | 3,120,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| キャリアインデックス | 4,200 | 822.00 | 3,452,400 | |
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 4,900 | 1,646.00 | 8,065,400 | |
| 船場 | 2,000 | 957.00 | 1,914,000 | |
| グレイステクノロジー | 4,300 | 2,560.00 | 11,008,000 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 9,300 | 2,719.00 | 25,286,700 | |
| フルテック | 1,800 | 1,176.00 | 2,116,800 | |
| グリーンズ | 4,500 | 1,532.00 | 6,894,000 | |
| ツナググループ・ホールディングス | 1,600 | 605.00 | 968,000 | |
| ソウルドアウト | 1,300 | 2,339.00 | 3,040,700 | |
| ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ | 2,000 | 1,113.00 | 2,226,000 | |
| 日総工産 | 7,900 | 1,532.00 | 12,102,800 | |
| キュービーネットホールディングス | 7,200 | 2,413.00 | 17,373,600 | |
| ＲＰＡホールディングス | 5,000 | 2,362.00 | 11,810,000 | |
| スプリックス | 4,000 | 1,716.00 | 6,864,000 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 4,800 | 733.00 | 3,518,400 | |
| リログループ | 64,400 | 2,880.00 | 185,472,000 | |
| 東祥 | 7,400 | 2,774.00 | 20,527,600 | |
| エイチ・アイ・エス | 21,000 | 2,557.00 | 53,697,000 | |
| ラックランド | 2,400 | 2,245.00 | 5,388,000 | |
| 共立メンテナンス | 18,000 | 4,790.00 | 86,220,000 | |
| イチネンホールディングス | 12,400 | 1,131.00 | 14,024,400 | |
| 建設技術研究所 | 8,200 | 1,530.00 | 12,546,000 | |
| スペース | 7,700 | 1,200.00 | 9,240,000 | |
| 長大 | 4,500 | 762.00 | 3,429,000 | |
| 燦ホールディングス | 2,600 | 2,305.00 | 5,993,000 | |
| スバル興業 | 800 | 6,230.00 | 4,984,000 | |
| 東京テアトル | 4,700 | 1,347.00 | 6,330,900 | |
| タナベ経営 | 2,400 | 1,201.00 | 2,882,400 | |
| ナガワ | 3,300 | 5,040.00 | 16,632,000 | |
| よみうりランド | 2,600 | 4,940.00 | 12,844,000 | |
| 東京都競馬 | 7,700 | 3,300.00 | 25,410,000 | |
| カナモト | 17,600 | 2,850.00 | 50,160,000 | |
| 東京ドーム | 44,100 | 1,015.00 | 44,761,500 | |
| 西尾レントオール | 12,000 | 3,065.00 | 36,780,000 | |
| トランス・コスモス | 13,100 | 2,466.00 | 32,304,600 | |
| 乃村工藝社 | 55,100 | 1,436.00 | 79,123,600 | |
| 藤田観光 | 4,700 | 2,897.00 | 13,615,900 | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 6,300 | 1,423.00 | 8,964,900 | |
| 日本管財 | 12,700 | 1,869.00 | 23,736,300 | |
| トーカイ | 11,400 | 2,281.00 | 26,003,400 | |
| 白洋舎 | 1,400 | 2,885.00 | 4,039,000 | |
| セコム | 124,900 | 9,042.00 | 1,129,345,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| セントラル警備保障 | 5,700 | 5,400.00 | 30,780,000 | |
| 丹青社 | 22,300 | 1,279.00 | 28,521,700 | |
| メイテック | 14,600 | 5,650.00 | 82,490,000 | |
| 応用地質 | 12,800 | 1,109.00 | 14,195,200 | |
| 船井総研ホールディングス | 24,400 | 2,593.00 | 63,269,200 | |
| 進学会ホールディングス | 5,600 | 605.00 | 3,388,000 | |
| オオバ | 9,500 | 614.00 | 5,833,000 | |
| いであ | 2,500 | 1,201.00 | 3,002,500 | |
| 学究社 | 4,000 | 1,321.00 | 5,284,000 | |
| ベネッセホールディングス | 43,100 | 2,552.00 | 109,991,200 | |
| イオンディライト | 14,500 | 3,155.00 | 45,747,500 | |
| ナック | 7,600 | 979.00 | 7,440,400 | |
| ニチイ学館 | 16,800 | 1,663.00 | 27,938,400 | |
| ダイセキ | 19,800 | 2,698.00 | 53,420,400 | |
| ステップ | 4,400 | 1,475.00 | 6,490,000 | |
| 合　計 | 143,378,950 | | 277,313,751,020 | |

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘　柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 新株予約権証券 | 株式会社エー・ディー・ワークス第２２回新株予約権 | 187,800 | － | |
| 合計 | | 187,800 | － | |

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 5,130,711,349 |
| コール・ローン | 200,766,983 |
| 株式 | 342,807,492,939 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 投資信託受益証券 | 264,849,623 |
| 投資証券 | 9,443,430,233 |
| 派生商品評価勘定 | 104,231,238 |
| 未収入金 | 321,293,294 |
| 未収配当金 | 388,443,644 |
| 差入委託証拠金 | 2,408,584,348 |
| 流動資産合計 | 361,069,803,651 |
| 資産合計 | 361,069,803,651 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,221,518 |
| 前受金 | 103,305,164 |
| 未払解約金 | 313,831,275 |
| 未払利息 | 554 |
| その他未払費用 | 3 |
| 流動負債合計 | 418,358,514 |
| 負債合計 | 418,358,514 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 136,683,156,103 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 223,968,289,034 |
| 元本等合計 | 360,651,445,137 |
| 純資産合計 | 360,651,445,137 |
| 負債純資産合計 | 361,069,803,651 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

## （貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 136,683,156,103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　2.6386円<br>(1万口当たり純資産額)　(26,386円) |

**（金融商品に関する注記）**

**１．金融商品の状況に関する事項**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

**２．金融商品の時価等に関する事項**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

**（関連当事者との取引に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**
**元本の移動**

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 138,277,772,586円 |
| 期中追加設定元本額 | 16,588,238,845円 |
| 期中一部解約元本額 | 18,182,855,328円 |
| 期末元本額 | 136,683,156,103円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 2,441,421,561円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 9,755,726円 |
| ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン | 26,182,101,024円 |
| 世界経済インデックスファンド | 7,501,857,508円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 900,618,700円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,078,503,868円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 4,824,041,436円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 5,052,579,824円 |
| ＤＣ外国株式インデックス・オープン | 8,469,928,708円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 434,507,995円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 1,952,170,765円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 1,452,796,376円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 111,191,555円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 189,812,814円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 124,726,550円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 6,540,250,813円 |
| 外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 1,805,592,779円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 10,691,500円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 10,674,210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） | 49,661,715円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 58,082,096円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 204,725,913円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 35,577,292円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 295,789,359円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 735,737,190円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 374,410,938円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,444,334,020円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,889,142,542円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 80,339,769円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 355,942,318円 |
| グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用） | 9,570,712円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 126,062,031円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 2,007,272,335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） | 2,119,333,890円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ１ | 919,706,355円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 2,504,660,906円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 5,581,705,796円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 2,320,725,574円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 4,791,427,715円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 901,159,759円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,033,182,913円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,138,158,082円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 835,371,562円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 43,524,052円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 275,802,959円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 1,664,466,869円 |
| 外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 30,829,621,093円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 73,556,459円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 312,910,058円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 48,570,503円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 1,345,090円 |
| ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード） | 45,046,756円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| グローバル経済コア | 1,019,369,571円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 6,383,901円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 521,935円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 309,189,821円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 60,959,003円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 58,867円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 66,613円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 74,359円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 81,330円 |
| ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 1,382,975,984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） | 341,490,970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） | 361,835,416円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 17,600,845,348 |
| 投資信託受益証券 | 8,787,115 |
| 投資証券 | 387,951,545 |
| 合計 | 17,997,584,008 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 5,533,730,899 | － | 5,637,036,063 | 103,305,164 |
| 合計 | | 5,533,730,899 | － | 5,637,036,063 | 103,305,164 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**通貨関連**

**（2019年 7月10日現在）**

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 2,203,754,736 | － | 2,204,050,180 | △295,444 |
| | アメリカドル | 1,490,853,200 | － | 1,490,993,200 | △140,000 |
| | カナダドル | 107,894,800 | － | 107,900,000 | △5,200 |
| | ユーロ | 274,752,000 | － | 274,770,000 | △18,000 |
| | イギリスポンド | 149,309,600 | － | 149,314,000 | △4,400 |
| | スイスフラン | 97,922,636 | － | 98,044,980 | △122,344 |
| | オーストラリアドル | 83,022,500 | － | 83,028,000 | △5,500 |
| 合計 | | 2,203,754,736 | － | 2,204,050,180 | △295,444 |

**(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。**

**①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。**

**②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。**

**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 | 41,344 | 70.99 | 2,935,010.56 | |
| | APACHE CORP | 34,273 | 26.95 | 923,657.35 | |
| | BAKER HUGHES A GE CO | 44,400 | 25.00 | 1,110,000.00 | |
| | CABOT OIL & GAS CORP | 35,879 | 23.93 | 858,584.47 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 18,402 | 68.50 | 1,260,537.00 | |
| | CHEVRON CORP | 160,248 | 123.35 | 19,766,590.80 | |
| | CIMAREX ENERGY CO | 7,599 | 57.14 | 434,206.86 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 17,481 | 100.27 | 1,752,819.87 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 96,852 | 59.89 | 5,800,466.28 | |
| | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 7,647 | 41.21 | 315,132.87 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 37,861 | 28.08 | 1,063,136.88 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 13,487 | 106.97 | 1,442,704.39 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EOG RESOURCES INC | 49,840 | 89.15 | 4,443,236.00 | |
| EXXON MOBIL | 358,711 | 76.43 | 27,416,281.73 | |
| HALLIBURTON CO | 76,620 | 23.57 | 1,805,933.40 | |
| HELMERICH & PAYNE | 8,315 | 50.56 | 420,406.40 | |
| HESS CORP | 22,081 | 62.05 | 1,370,126.05 | |
| HOLLYFRONTIER CORP | 14,110 | 46.35 | 653,998.50 | |
| KINDER MORGAN INC | 167,254 | 21.24 | 3,552,474.96 | |
| MARATHON OIL CORP | 74,537 | 13.54 | 1,009,230.98 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 57,720 | 54.64 | 3,153,820.80 | |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 30,311 | 21.52 | 652,292.72 | |
| NOBLE ENERGY INC | 38,291 | 21.51 | 823,639.41 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 64,462 | 49.61 | 3,197,959.82 | |
| ONEOK INC | 34,074 | 69.82 | 2,379,046.68 | |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 20,475 | 18.36 | 375,921.00 | |
| PHILLIPS 66 | 38,115 | 97.72 | 3,724,597.80 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES | 14,455 | 143.36 | 2,072,268.80 | |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 9,890 | 24.92 | 246,458.80 | |
| SCHLUMBERGER | 119,098 | 40.20 | 4,787,739.60 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 20,002 | 40.52 | 810,481.04 | |
| TECHNIPFMC PLC | 36,005 | 24.56 | 884,282.80 | |
| VALERO ENERGY CORP | 35,352 | 82.24 | 2,907,348.48 | |
| WILLIAMS COS | 105,155 | 28.74 | 3,022,154.70 | |
| AIR PRODUCTS&CHEMICALS | 19,003 | 226.05 | 4,295,628.15 | |
| ALBEMARLE CORP | 8,647 | 70.62 | 610,651.14 | |
| AMCOR PLC | 138,214 | 11.02 | 1,523,118.28 | |
| AVERY DENNISON CORP | 7,457 | 115.65 | 862,402.05 | |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 17,606 | 29.81 | 524,834.86 | |
| BALL CORP | 27,142 | 70.92 | 1,924,910.64 | |
| CELANESE CORP-SERIES A | 11,053 | 104.73 | 1,157,580.69 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 21,052 | 44.39 | 934,498.28 | |
| CHEMOURS CO/THE | 15,493 | 19.85 | 307,536.05 | |
| CORTEVA INC | 64,411 | 26.99 | 1,738,452.89 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 10,321 | 61.65 | 636,289.65 | |
| DOW INC | 65,790 | 47.87 | 3,149,367.30 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 64,411 | 70.00 | 4,508,770.00 | |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 11,858 | 74.64 | 885,081.12 | |
| ECOLAB INC | 21,748 | 195.86 | 4,259,563.28 | |
| FMC CORP | 12,118 | 82.33 | 997,674.94 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 112,473 | 10.87 | 1,222,581.51 | |
| INT'L PAPER CO | 33,803 | 43.22 | 1,460,965.66 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 8,674 | 142.00 | 1,231,708.00 | |
| LINDE PLC | 46,307 | 200.97 | 9,306,317.79 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 25,177 | 84.65 | 2,131,233.05 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 4,989 | 228.94 | 1,142,181.66 | |
| MOSAIC CO/THE | 31,911 | 23.33 | 744,483.63 | |
| NEWMONT GOLDCORP CORP | 69,458 | 38.76 | 2,692,192.08 | |
| NUCOR CORP | 27,868 | 54.52 | 1,519,363.36 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 8,890 | 99.65 | 885,888.50 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 19,958 | 115.94 | 2,313,930.52 | |
| SEALED AIR CORP | 14,689 | 43.32 | 636,327.48 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 7,287 | 462.14 | 3,367,614.18 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 18,273 | 29.83 | 545,083.59 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 10,740 | 137.93 | 1,481,368.20 | |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 3,455 | 68.32 | 236,045.60 | |
| WESTROCK CO | 21,244 | 37.42 | 794,950.48 | |
| 3 M COMPANY | 49,155 | 165.70 | 8,144,983.50 | |
| ACUITY BRANDS INC | 3,505 | 129.98 | 455,579.90 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 11,330 | 50.17 | 568,426.10 | |
| ALLEGION PLC | 7,435 | 110.17 | 819,113.95 | |
| AMETEK INC | 19,001 | 90.37 | 1,717,120.37 | |
| ARCONIC INC | 36,550 | 25.84 | 944,452.00 | |
| BOEING CO | 45,639 | 353.09 | 16,114,674.51 | |
| CATERPILLAR | 48,214 | 134.29 | 6,474,658.06 | |
| CUMMINS INC | 12,585 | 167.29 | 2,105,344.65 | |
| DEERE&CO | 26,347 | 163.35 | 4,303,782.45 | |
| DOVER CORP | 12,008 | 100.39 | 1,205,483.12 | |
| EATON CORP | 35,051 | 80.25 | 2,812,842.75 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 53,427 | 64.25 | 3,432,684.75 | |
| FASTENAL CO | 46,922 | 31.57 | 1,481,327.54 | |
| FLOWSERVE CORP | 10,826 | 52.13 | 564,359.38 | |
| FLUOR CORP | 11,267 | 31.60 | 356,037.20 | |
| FORTIVE CORP | 25,813 | 80.27 | 2,072,009.51 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 12,810 | 55.70 | 713,517.00 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 21,021 | 180.83 | 3,801,227.43 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 745,767 | 10.25 | 7,644,111.75 | |
| GRAINGER (WW) INC | 3,976 | 266.69 | 1,060,359.44 | |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 15,226 | 39.89 | 607,365.14 | |
| HEICO CORP | 3,640 | 137.12 | 499,116.80 | |
| HEICO CORP-CLASS A | 6,449 | 107.28 | 691,848.72 | |
| HONEYWELL INTL INC | 61,318 | 175.52 | 10,762,535.36 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 3,522 | 231.24 | 814,427.28 | |
| IDEX CORP | 6,916 | 169.98 | 1,175,581.68 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 28,028 | 146.41 | 4,103,579.48 | |
| INGERSOLL-RAND PLC | 20,322 | 124.04 | 2,520,740.88 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 12,026 | 84.00 | 1,010,184.00 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 20,100 | 64.03 | 1,287,003.00 | |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 20,500 | 39.23 | 804,215.00 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 69,399 | 41.65 | 2,890,468.35 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 18,859 | 191.26 | 3,606,972.34 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,885 | 287.46 | 829,322.10 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 21,338 | 369.73 | 7,889,298.74 | |
| MASCO CORP | 24,547 | 39.29 | 964,451.63 | |
| MIDDLEBY CORP | 4,364 | 132.99 | 580,368.36 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 13,442 | 325.81 | 4,379,538.02 | |
| OWENS CORNING | 7,979 | 55.71 | 444,510.09 | |
| PACCAR INC | 30,075 | 70.63 | 2,124,197.25 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 11,340 | 163.36 | 1,852,502.40 | |
| PENTAIR PLC | 13,583 | 36.97 | 502,163.51 | |
| RAYTHEON COMPANY | 23,520 | 174.94 | 4,114,588.80 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 10,511 | 155.15 | 1,630,781.65 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 8,720 | 374.30 | 3,263,896.00 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 13,828 | 46.96 | 649,362.88 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 12,146 | 45.06 | 547,298.76 | |
| SNAP-ON INC | 4,900 | 157.20 | 770,280.00 | |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 8,481 | 74.88 | 635,057.28 | |
| STANLEY BLACK&DECKER | 13,234 | 144.24 | 1,908,872.16 | |
| TEXTRON | 21,877 | 53.34 | 1,166,919.18 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,072 | 483.76 | 1,969,870.72 | |
| UNITED RENTALS INC | 6,446 | 131.41 | 847,068.86 | |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 68,767 | 130.39 | 8,966,529.13 | |
| WABCO HOLDINGS INC | 3,841 | 132.30 | 508,164.30 | |
| WABTEC CORP | 11,163 | 72.27 | 806,750.01 | |
| XYLEM INC | 16,060 | 80.98 | 1,300,538.80 | |
| CINTAS CORP | 7,934 | 238.42 | 1,891,624.28 | |
| COPART INC | 17,540 | 75.26 | 1,320,060.40 | |
| COSTAR GROUP INC | 3,008 | 567.02 | 1,705,596.16 | |
| EQUIFAX INC | 10,799 | 137.19 | 1,481,514.81 | |
| IHS MARKIT LTD | 32,775 | 64.81 | 2,124,147.75 | |
| MANPOWER GROUP | 5,123 | 92.72 | 475,004.56 | |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 27,504 | 22.43 | 616,914.72 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 18,461 | 87.21 | 1,609,983.81 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 9,566 | 57.44 | 549,471.04 | |
| ROLLINS INC | 10,546 | 37.02 | 390,412.92 | |
| TRANSUNION | 15,344 | 73.75 | 1,131,620.00 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 13,480 | 149.62 | 2,016,877.60 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 23,008 | 97.41 | 2,241,209.28 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WASTE MANAGEMENT INC | 36,731 | 117.01 | 4,297,894.31 | |
| AMERCO | 602 | 373.25 | 224,696.50 | |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 9,920 | 32.36 | 321,011.20 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 11,448 | 83.19 | 952,359.12 | |
| CSX CORP | 64,710 | 76.70 | 4,963,257.00 | |
| DELTA AIR LINES INC | 15,095 | 58.96 | 890,001.20 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 13,803 | 73.53 | 1,014,934.59 | |
| FEDEX CORP | 21,697 | 159.19 | 3,453,945.43 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 7,134 | 88.86 | 633,927.24 | |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 8,743 | 120.76 | 1,055,804.68 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 10,700 | 33.05 | 353,635.00 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 22,814 | 197.71 | 4,510,555.94 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 5,245 | 146.33 | 767,500.85 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 11,465 | 51.69 | 592,625.85 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 15,749 | 44.20 | 696,105.80 | |
| UNION PACIFIC CORP | 60,776 | 169.60 | 10,307,609.60 | |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 6,003 | 89.46 | 537,028.38 | |
| UNITED PARCEL SERVICE B | 59,561 | 101.73 | 6,059,140.53 | |
| XPO LOGISTICS INC | 10,037 | 55.00 | 552,035.00 | |
| APTIV PLC | 23,291 | 76.07 | 1,771,746.37 | |
| AUTOLIV INC | 6,639 | 66.08 | 438,705.12 | |
| BORGWARNER INC | 15,953 | 39.30 | 626,952.90 | |
| FORD MOTOR COMPANY | 315,578 | 10.14 | 3,199,960.92 | |
| GENERAL MOTORS CO | 106,331 | 38.08 | 4,049,084.48 | |
| HARLEY-DAVIDSON | 14,677 | 35.45 | 520,299.65 | |
| LEAR CORP | 5,287 | 130.63 | 690,640.81 | |
| TESLA INC | 10,812 | 230.06 | 2,487,408.72 | |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 11,547 | 34.30 | 396,062.10 | |
| DR HORTON INC | 28,998 | 43.91 | 1,273,302.18 | |
| GARMIN LTD | 9,564 | 79.14 | 756,894.96 | |
| HANESBRANDS INC | 31,136 | 17.18 | 534,916.48 | |
| HASBRO INC | 10,617 | 108.22 | 1,148,971.74 | |
| LEGGETT & PLATT INC | 10,594 | 37.92 | 401,724.48 | |
| LENNAR CORP-CL A | 23,545 | 47.37 | 1,115,326.65 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 8,472 | 186.05 | 1,576,215.60 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 5,062 | 149.88 | 758,692.56 | |
| NEWELL BRANDS INC | 37,563 | 15.04 | 564,947.52 | |
| NIKE B | 107,381 | 88.04 | 9,453,823.24 | |
| NVR INC | 264 | 3,371.04 | 889,954.56 | |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 4,691 | 82.39 | 386,491.49 | |
| PULTE GROUP INC | 21,959 | 31.99 | 702,468.41 | |
| PVH CORP | 7,252 | 90.07 | 653,187.64 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| RALPH LAUREN CORPORATION | 4,578 | 110.59 | 506,281.02 | |
| TAPESTRY INC | 25,989 | 29.64 | 770,313.96 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 15,950 | 26.59 | 424,110.50 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 16,283 | 23.21 | 377,928.43 | |
| VF CORP | 28,754 | 86.76 | 2,494,697.04 | |
| WHIRLPOOL CORP | 5,324 | 142.80 | 760,267.20 | |
| ARAMARK | 19,980 | 36.19 | 723,076.20 | |
| BLOCK H & R INC | 16,984 | 28.84 | 489,818.56 | |
| CARNIVAL CORPORATION | 35,126 | 45.92 | 1,612,985.92 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,041 | 745.49 | 1,521,545.09 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 10,031 | 122.58 | 1,229,599.98 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 3,453 | 280.00 | 966,840.00 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 23,523 | 99.00 | 2,328,777.00 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 28,379 | 62.90 | 1,785,039.10 | |
| MARRIOTT INTL A | 25,016 | 139.52 | 3,490,232.32 | |
| MCDONALD'S CORP | 65,135 | 212.09 | 13,814,482.15 | |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR | 17,662 | 23.59 | 416,646.58 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 44,656 | 29.23 | 1,305,294.88 | |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 17,838 | 50.76 | 905,456.88 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 13,885 | 111.22 | 1,544,289.70 | |
| STARBUCKS CORP | 104,538 | 87.23 | 9,118,849.74 | |
| VAIL RESORTS INC | 3,574 | 225.89 | 807,330.86 | |
| WYNN RESORTS LTD | 8,052 | 133.73 | 1,076,793.96 | |
| YUM BRANDS INC | 25,338 | 110.49 | 2,799,595.62 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 61,388 | 46.37 | 2,846,561.56 | |
| ALPHABET INC-CL A | 25,292 | 1,124.29 | 28,435,542.68 | |
| ALPHABET INC-CL C | 26,644 | 1,124.83 | 29,969,970.52 | |
| ALTICE USA INC- A | 12,457 | 24.59 | 306,317.63 | |
| CBS CORP-CL B | 28,628 | 52.31 | 1,497,530.68 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 13,632 | 401.22 | 5,469,431.04 | |
| COMCAST CORP-CL A | 383,994 | 42.98 | 16,504,062.12 | |
| DISCOVERY INC - A | 12,804 | 31.63 | 404,990.52 | |
| DISCOVERY INC-C | 23,672 | 29.03 | 687,198.16 | |
| DISH NETWORK CORPORATION-A | 18,218 | 40.73 | 742,019.14 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 26,819 | 92.05 | 2,468,688.95 | |
| FACEBOOK INC-A | 201,508 | 199.21 | 40,142,408.68 | |
| FOX CORP - CLASS A | 30,270 | 36.02 | 1,090,325.40 | |
| FOX CORP- CLASS B | 12,152 | 36.01 | 437,593.52 | |
| IAC/INTERACTIVECORP | 6,364 | 228.66 | 1,455,192.24 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS | 33,834 | 23.15 | 783,257.10 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 8,663 | 106.59 | 923,389.17 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 15,516 | 26.74 | 414,897.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 46,271 | 26.01 | 1,203,508.71 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 18,693 | 37.42 | 699,492.06 | |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 15,233 | 39.41 | 600,332.53 | |
| LIBERTY SIRIUSXM-A | 6,384 | 39.35 | 251,210.40 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT | 12,637 | 69.08 | 872,963.96 | |
| NETFLIX INC | 36,840 | 379.93 | 13,996,621.20 | |
| NEWS CORP-CLASS A | 33,479 | 13.30 | 445,270.70 | |
| OMNICOM GROUP | 19,030 | 84.25 | 1,603,277.50 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 129,505 | 5.96 | 771,849.80 | |
| SNAP INC - A | 57,914 | 15.25 | 883,188.50 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 9,552 | 115.09 | 1,099,339.68 | |
| THE WALT DISNEY CO | 152,138 | 141.61 | 21,544,262.18 | |
| TRIPADVISOR INC | 10,393 | 45.79 | 475,895.47 | |
| TWITTER INC | 61,378 | 37.65 | 2,310,881.70 | |
| VIACOM INC-CLASS B | 31,895 | 31.25 | 996,718.75 | |
| ZILLOW GROUP INC-C | 9,962 | 49.83 | 496,406.46 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 6,186 | 155.50 | 961,923.00 | |
| AMAZON.COM | 35,295 | 1,988.30 | 70,177,048.50 | |
| AUTOZONE INC | 2,085 | 1,143.09 | 2,383,342.65 | |
| BEST BUY COMPANY INC | 21,836 | 71.86 | 1,569,134.96 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 3,774 | 1,877.87 | 7,087,081.38 | |
| BURLINGTON STORES INC | 6,004 | 175.26 | 1,052,261.04 | |
| CARMAX INC | 14,253 | 87.58 | 1,248,277.74 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 22,330 | 139.55 | 3,116,151.50 | |
| DOLLAR TREE INC | 19,630 | 111.49 | 2,188,548.70 | |
| EBAY | 71,876 | 39.94 | 2,870,727.44 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 9,733 | 133.45 | 1,298,868.85 | |
| GAP | 21,891 | 17.98 | 393,600.18 | |
| GENUINE PARTS CO | 12,722 | 104.16 | 1,325,123.52 | |
| GRUBHUB INC | 8,261 | 77.31 | 638,657.91 | |
| HOME DEPOT | 95,597 | 212.00 | 20,266,564.00 | |
| KOHLS CORP | 14,645 | 47.75 | 699,298.75 | |
| L BRANDS INC | 19,499 | 26.40 | 514,773.60 | |
| LKQ CORP | 24,693 | 26.03 | 642,758.79 | |
| LOWES COMPANIES | 67,906 | 104.86 | 7,120,623.16 | |
| MACY'S INC | 25,926 | 21.23 | 550,408.98 | |
| MERCADOLIBRE INC | 3,727 | 640.56 | 2,387,367.12 | |
| NORDSTROM INC | 10,094 | 30.92 | 312,106.48 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 6,459 | 385.21 | 2,488,071.39 | |
| QURATE RETAIL INC | 35,071 | 13.02 | 456,624.42 | |
| ROSS STORES INC | 31,827 | 101.98 | 3,245,717.46 | |
| TARGET (DAYTON HUDSON) | 41,836 | 87.80 | 3,673,200.80 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TIFFANY & CO | 9,326 | 93.11 | 868,343.86 | |
| TJX COMPANIES INC | 103,117 | 54.79 | 5,649,780.43 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 11,304 | 110.10 | 1,244,570.40 | |
| ULTA BEAUTY INC | 4,911 | 348.48 | 1,711,385.28 | |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 5,327 | 147.31 | 784,720.37 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 37,583 | 269.97 | 10,146,282.51 | |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD | 33,900 | 7.11 | 241,029.00 | |
| KROGER CO | 68,147 | 21.71 | 1,479,471.37 | |
| SYSCO CORP | 42,872 | 71.49 | 3,064,919.28 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 67,407 | 55.50 | 3,741,088.50 | |
| WALMART INC | 122,729 | 112.88 | 13,853,649.52 | |
| ALTRIA GROUP INC | 158,456 | 48.35 | 7,661,347.60 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 47,798 | 41.77 | 1,996,522.46 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 22,040 | 56.04 | 1,235,121.60 | |
| BUNGE LIMITED | 11,767 | 57.29 | 674,131.43 | |
| CAMPBELL SOUP CO (US) | 14,072 | 41.46 | 583,425.12 | |
| COCA-COLA CO | 342,026 | 51.59 | 17,645,121.34 | |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 17,076 | 57.31 | 978,625.56 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 39,943 | 28.00 | 1,118,404.00 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 14,018 | 198.04 | 2,776,124.72 | |
| GENERAL MILLS INC | 50,246 | 53.31 | 2,678,614.26 | |
| HERSHEY FOODS CORPORATION | 12,521 | 138.62 | 1,735,661.02 | |
| HORMEL FOODS CORP | 23,465 | 41.18 | 966,288.70 | |
| INGREDION INC | 5,835 | 82.46 | 481,154.10 | |
| JM SMUCKER CO | 9,442 | 118.77 | 1,121,426.34 | |
| KELLOGG CO | 21,051 | 54.85 | 1,154,647.35 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 53,058 | 30.50 | 1,618,269.00 | |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 12,924 | 65.08 | 841,093.92 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 9,976 | 158.07 | 1,576,906.32 | |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 15,100 | 55.54 | 838,654.00 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 122,234 | 55.38 | 6,769,318.92 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 34,932 | 64.76 | 2,262,196.32 | |
| PEPSICO INC | 119,352 | 131.74 | 15,723,432.48 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 130,717 | 79.44 | 10,384,158.48 | |
| TYSON FOODS INC | 24,363 | 82.15 | 2,001,420.45 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 21,264 | 73.69 | 1,566,944.16 | |
| CLOROX COMPANY | 10,995 | 155.45 | 1,709,172.75 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 68,386 | 73.11 | 4,999,700.46 | |
| COTY INC-CL A | 30,534 | 11.42 | 348,698.28 | |
| ESTEE LAUDER CO-CL A | 18,908 | 183.90 | 3,477,181.20 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 29,423 | 136.87 | 4,027,126.01 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 210,947 | 112.91 | 23,818,025.77 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ABBOTT LABORATORIES | 148,700 | 85.27 | 12,679,649.00 | |
| ABIOMED INC | 3,502 | 257.30 | 901,064.60 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 6,264 | 275.41 | 1,725,168.24 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 12,847 | 88.23 | 1,133,490.81 | |
| ANTHEM INC | 21,803 | 284.16 | 6,195,540.48 | |
| BAXTER INTERNATIONAL | 40,492 | 81.40 | 3,296,048.80 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 22,592 | 251.72 | 5,686,858.24 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 116,205 | 43.06 | 5,003,787.30 | |
| CARDINAL HEALTH | 25,252 | 47.20 | 1,191,894.40 | |
| CENTENE CORP | 35,914 | 50.45 | 1,811,861.30 | |
| CERNER CORP | 25,778 | 74.99 | 1,933,092.22 | |
| CIGNA CORP | 32,709 | 159.73 | 5,224,608.57 | |
| CVS HEALTH CORP | 111,050 | 54.83 | 6,088,871.50 | |
| DANAHER CORP | 54,225 | 142.29 | 7,715,675.25 | |
| DAVITA INC | 11,875 | 52.55 | 624,031.25 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 17,834 | 57.57 | 1,026,703.38 | |
| DEXCOM INC | 7,827 | 147.78 | 1,156,674.06 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 17,839 | 189.99 | 3,389,231.61 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 22,986 | 134.99 | 3,102,880.14 | |
| HENRY SCHEIN INC | 12,492 | 68.90 | 860,698.80 | |
| HOLOGIC INC | 24,459 | 47.81 | 1,169,384.79 | |
| HUMANA INC | 11,247 | 260.14 | 2,925,794.58 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 7,205 | 279.55 | 2,014,157.75 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 9,805 | 528.27 | 5,179,687.35 | |
| LABORATORY CRP OF AMER | 8,827 | 174.70 | 1,542,076.90 | |
| MCKESSON CORP | 16,655 | 139.24 | 2,319,042.20 | |
| MEDTRONIC PLC | 113,614 | 98.44 | 11,184,162.16 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 12,284 | 102.01 | 1,253,090.84 | |
| RESMED INC | 12,398 | 124.02 | 1,537,599.96 | |
| STERIS PLC | 7,229 | 152.49 | 1,102,350.21 | |
| STRYKER CORP | 28,121 | 208.97 | 5,876,445.37 | |
| TELEFLEX INC | 3,697 | 335.34 | 1,239,751.98 | |
| THE COOPER COS INC | 4,135 | 332.92 | 1,376,624.20 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 81,621 | 246.00 | 20,078,766.00 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 7,248 | 128.89 | 934,194.72 | |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 8,237 | 138.10 | 1,137,529.70 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 10,212 | 171.91 | 1,755,544.92 | |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC | 4,403 | 277.85 | 1,223,373.55 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 17,342 | 120.69 | 2,093,005.98 | |
| ABBVIE INC | 124,089 | 71.24 | 8,840,100.36 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES | 27,387 | 73.45 | 2,011,575.15 | |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 19,048 | 125.72 | 2,394,714.56 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ALKERMES PLC | 12,547 | 22.70 | 284,816.90 | |
| ALLERGAN PLC | 27,804 | 166.45 | 4,627,975.80 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 7,399 | 73.24 | 541,902.76 | |
| AMGEN | 52,414 | 181.59 | 9,517,858.26 | |
| BEIGENE LTD-ADR | 2,369 | 128.65 | 304,771.85 | |
| BIOGEN INC | 16,410 | 234.22 | 3,843,550.20 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 16,192 | 83.13 | 1,346,040.96 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 140,314 | 46.04 | 6,460,056.56 | |
| CELGENE CORP | 59,466 | 93.81 | 5,578,505.46 | |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 23,667 | 34.07 | 806,334.69 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 10,748 | 120.31 | 1,293,091.88 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 107,207 | 67.75 | 7,263,274.25 | |
| ILLUMINA INC | 12,711 | 377.24 | 4,795,097.64 | |
| INCYTE CORP | 16,120 | 83.82 | 1,351,178.40 | |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 11,236 | 65.59 | 736,969.24 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 14,255 | 158.54 | 2,259,987.70 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 4,971 | 142.71 | 709,411.41 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 225,369 | 141.41 | 31,869,430.29 | |
| LILLY (ELI) & CO | 75,567 | 113.08 | 8,545,116.36 | |
| MERCK & CO | 218,110 | 84.86 | 18,508,814.60 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 2,025 | 861.55 | 1,744,638.75 | |
| MYLAN NV | 42,644 | 19.62 | 836,675.28 | |
| NEKTAR THERAPEUTICS | 13,507 | 34.84 | 470,583.88 | |
| PERKINELMER INC | 9,475 | 96.20 | 911,495.00 | |
| PERRIGO CO PLC | 11,333 | 51.01 | 578,096.33 | |
| PFIZER | 467,485 | 43.37 | 20,274,824.45 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 6,921 | 307.97 | 2,131,460.37 | |
| SEATTLE GENETICS INC | 9,601 | 69.89 | 671,013.89 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 80,690 | 9.37 | 756,065.30 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 33,612 | 296.90 | 9,979,402.80 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 21,634 | 178.46 | 3,860,803.64 | |
| WATERS CORP | 6,513 | 216.99 | 1,413,255.87 | |
| ZOETIS INC | 40,026 | 113.26 | 4,533,344.76 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 774,070 | 29.35 | 22,718,954.50 | |
| BB&T CORP | 64,191 | 50.05 | 3,212,759.55 | |
| CIT GROUP INC | 10,713 | 51.74 | 554,290.62 | |
| CITIGROUP | 197,425 | 71.56 | 14,127,733.00 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 40,010 | 35.99 | 1,439,959.90 | |
| COMERICA INC | 14,360 | 72.65 | 1,043,254.00 | |
| EAST WEST BANCORP INC | 13,827 | 45.97 | 635,627.19 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 58,217 | 28.26 | 1,645,212.42 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 14,126 | 101.00 | 1,426,726.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 85,663 | 13.85 | 1,186,432.55 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 276,755 | 113.35 | 31,370,179.25 | |
| KEY CORP | 87,033 | 17.84 | 1,552,668.72 | |
| M & T BANK CORP | 11,745 | 174.24 | 2,046,448.80 | |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 36,720 | 16.80 | 616,896.00 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 39,173 | 140.79 | 5,515,166.67 | |
| REGIONS FINL CORP | 83,851 | 15.31 | 1,283,758.81 | |
| SIGNATURE BANK | 4,354 | 125.09 | 544,641.86 | |
| SUNTRUST BANKS | 38,353 | 64.37 | 2,468,782.61 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 4,390 | 217.74 | 955,878.60 | |
| US BANCORP | 129,139 | 53.34 | 6,888,274.26 | |
| WELLS FARGO & CO | 363,409 | 47.83 | 17,381,852.47 | |
| ZIONS BANCORPORATION | 15,186 | 45.93 | 697,492.98 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 4,433 | 90.42 | 400,831.86 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 36,028 | 31.40 | 1,131,279.20 | |
| AMERICAN EXPRESS | 61,108 | 125.90 | 7,693,497.20 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 11,850 | 150.20 | 1,779,870.00 | |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC | 22,694 | 21.90 | 496,998.60 | |
| BANK NEW YORK CO | 71,617 | 43.40 | 3,108,177.80 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 109,623 | 214.75 | 23,541,539.25 | |
| BLACKROCK INC | 9,909 | 473.82 | 4,695,082.38 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 39,520 | 92.29 | 3,647,300.80 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 9,470 | 110.98 | 1,050,980.60 | |
| CME GROUP INC | 30,723 | 201.99 | 6,205,738.77 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 26,947 | 80.52 | 2,169,772.44 | |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 21,108 | 45.30 | 956,192.40 | |
| EATON VANCE CORP | 10,061 | 43.28 | 435,440.08 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 3,260 | 291.01 | 948,692.60 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 26,070 | 34.92 | 910,364.40 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 28,130 | 207.77 | 5,844,570.10 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 47,352 | 89.60 | 4,242,739.20 | |
| INVESCO LTD | 30,943 | 20.63 | 638,354.09 | |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN | 25,706 | 21.43 | 550,879.58 | |
| KKR & CO INC -A | 44,859 | 26.09 | 1,170,371.31 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 3,212 | 342.90 | 1,101,394.80 | |
| MOODY'S CORP | 15,058 | 198.05 | 2,982,236.90 | |
| MORGAN STANLEY | 108,193 | 43.78 | 4,736,689.54 | |
| MSCI INC | 6,854 | 238.00 | 1,631,252.00 | |
| NASDAQ INC | 9,070 | 101.61 | 921,602.70 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 17,320 | 91.59 | 1,586,338.80 | |
| PRICE T ROWE GROUP INC | 20,066 | 109.82 | 2,203,648.12 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 11,870 | 85.03 | 1,009,306.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| S&P GLOBAL INC | 20,750 | 231.48 | 4,803,210.00 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 101,845 | 40.27 | 4,101,298.15 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 10,802 | 55.99 | 604,803.98 | |
| STATE STREET CORP | 32,349 | 55.07 | 1,781,459.43 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 53,095 | 35.76 | 1,898,677.20 | |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 23,404 | 51.25 | 1,199,455.00 | |
| VOYA FINANCIAL INC | 14,081 | 56.43 | 794,590.83 | |
| AFLAC | 65,227 | 56.53 | 3,687,282.31 | |
| ALLEGHANY CORP | 1,276 | 710.66 | 906,802.16 | |
| ALLSTATE CORP | 27,449 | 104.66 | 2,872,812.34 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 7,013 | 105.59 | 740,502.67 | |
| AMERICAN INT'L GROUP | 72,339 | 55.52 | 4,016,261.28 | |
| AON PLC | 20,104 | 196.55 | 3,951,441.20 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 34,551 | 38.42 | 1,327,449.42 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 14,972 | 90.76 | 1,358,858.72 | |
| ASSURANT INC | 4,769 | 110.68 | 527,832.92 | |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 13,347 | 43.12 | 575,522.64 | |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 10,416 | 37.57 | 391,329.12 | |
| CHUBB LTD | 38,690 | 149.25 | 5,774,482.50 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 12,413 | 107.50 | 1,334,397.50 | |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 2,166 | 265.26 | 574,553.16 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 3,353 | 257.39 | 863,028.67 | |
| FNF GROUP | 24,961 | 41.25 | 1,029,641.25 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS | 31,710 | 57.08 | 1,810,006.80 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 17,790 | 65.41 | 1,163,643.90 | |
| LOEWS CORP | 22,051 | 55.49 | 1,223,609.99 | |
| MARKEL CORP | 1,132 | 1,122.27 | 1,270,409.64 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 42,543 | 102.03 | 4,340,662.29 | |
| METLIFE INC | 67,515 | 50.38 | 3,401,405.70 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 23,155 | 58.47 | 1,353,872.85 | |
| PROGRESSIVE CORP | 48,681 | 83.48 | 4,063,889.88 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 35,290 | 101.59 | 3,585,111.10 | |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 5,431 | 158.52 | 860,922.12 | |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 3,249 | 184.73 | 600,187.77 | |
| TORCHMARK CORP | 8,473 | 91.54 | 775,618.42 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 22,051 | 153.45 | 3,383,725.95 | |
| UNUM GROUP | 18,574 | 34.55 | 641,731.70 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 10,930 | 195.25 | 2,134,082.50 | |
| WR BERKLEY CORP | 13,990 | 67.79 | 948,382.10 | |
| CBRE GROUP INC-A | 26,855 | 52.25 | 1,403,173.75 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 98,700 | 6.57 | 648,459.00 | |
| JONES LANG LASALLE INC | 3,673 | 137.27 | 504,192.71 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WEYERHAEUSER CO | 62,107 | 26.29 | 1,632,793.03 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 53,858 | 191.09 | 10,291,725.22 | |
| ADOBE INC | 41,223 | 304.20 | 12,540,036.60 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES,INC | 14,178 | 81.36 | 1,153,522.08 | |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 4,016 | 148.01 | 594,408.16 | |
| ANSYS INC | 6,865 | 206.72 | 1,419,132.80 | |
| AUTODESK INC | 18,213 | 171.35 | 3,120,797.55 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 36,793 | 163.54 | 6,017,127.22 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC | 9,650 | 131.06 | 1,264,729.00 | |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS | 25,271 | 74.49 | 1,882,436.79 | |
| CDK GLOBAL INC | 10,687 | 50.15 | 535,953.05 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 10,801 | 120.21 | 1,298,388.21 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 11,352 | 98.96 | 1,123,393.92 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 48,363 | 64.38 | 3,113,609.94 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 3,100 | 129.72 | 402,132.00 | |
| DOCUSIGN INC | 8,693 | 52.00 | 452,036.00 | |
| DROPBOX INC-CLASS A | 16,247 | 25.21 | 409,586.87 | |
| DXC TECHNOLOGY CO | 23,498 | 55.55 | 1,305,313.90 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 4,620 | 187.01 | 863,986.20 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 27,276 | 127.00 | 3,464,052.00 | |
| FIRST DATA CORP- CLASS A | 47,683 | 27.88 | 1,329,402.04 | |
| FISERV INC | 33,784 | 93.84 | 3,170,290.56 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 7,292 | 294.46 | 2,147,202.32 | |
| FORTINET INC | 12,963 | 80.55 | 1,044,169.65 | |
| GARTNER INC | 8,145 | 167.58 | 1,364,939.10 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 13,947 | 164.78 | 2,298,186.66 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 14,919 | 70.57 | 1,052,833.83 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 74,826 | 139.33 | 10,425,506.58 | |
| INTUIT INC | 22,104 | 270.68 | 5,983,110.72 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 7,223 | 136.68 | 987,239.64 | |
| LEIDOS HOLDINGS | 10,999 | 81.52 | 896,638.48 | |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 76,988 | 273.34 | 21,043,899.92 | |
| MICROSOFT CORP | 616,239 | 136.46 | 84,091,973.94 | |
| MONGODB INC | 2,694 | 157.72 | 424,897.68 | |
| OKTA INC | 8,635 | 133.90 | 1,156,226.50 | |
| ORACLE CORP | 210,752 | 59.60 | 12,560,819.20 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 8,064 | 215.34 | 1,736,501.76 | |
| PAYCHEX INC | 27,697 | 85.21 | 2,360,061.37 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 4,238 | 239.92 | 1,016,780.96 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 94,486 | 118.37 | 11,184,307.82 | |
| PTC INC | 9,984 | 89.57 | 894,266.88 | |
| SABRE CORP | 24,114 | 22.98 | 554,139.72 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SALESFORCE.COM INC | 64,577 | 153.95 | 9,941,629.15 | |
| SERVICENOW INC | 14,979 | 298.02 | 4,464,041.58 | |
| SPLUNK INC | 13,187 | 132.36 | 1,745,431.32 | |
| SQUARE INC - A | 27,989 | 77.96 | 2,182,022.44 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 20,656 | 58.10 | 1,200,113.60 | |
| SYMANTEC CORP | 58,346 | 25.56 | 1,491,323.76 | |
| SYNOPSYS INC | 12,264 | 135.86 | 1,666,187.04 | |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | 6,719 | 168.95 | 1,135,175.05 | |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 14,218 | 132.50 | 1,883,885.00 | |
| TWILIO INC - A | 8,003 | 145.25 | 1,162,435.75 | |
| VERISIGN INC | 9,541 | 217.48 | 2,074,976.68 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 147,712 | 177.73 | 26,252,853.76 | |
| VMWARE INC-CLASS A | 6,787 | 163.24 | 1,107,909.88 | |
| WESTERN UNION CO | 38,757 | 20.65 | 800,332.05 | |
| WIX.COM LTD | 3,961 | 145.27 | 575,414.47 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 12,522 | 218.74 | 2,739,062.28 | |
| WORLDPAY INC-CLASS A | 25,793 | 128.60 | 3,316,979.80 | |
| AMPHENOL CORPORATION | 26,216 | 97.58 | 2,558,157.28 | |
| APPLE INC | 398,652 | 201.24 | 80,224,728.48 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 4,324 | 270.55 | 1,169,858.20 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 6,666 | 68.95 | 459,620.70 | |
| CDW CORP/DE | 12,482 | 112.76 | 1,407,470.32 | |
| CISCO SYSTEMS | 371,319 | 56.34 | 20,920,112.46 | |
| COGNEX CORP | 16,230 | 43.08 | 699,188.40 | |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC | 14,933 | 15.66 | 233,850.78 | |
| CORNING | 66,228 | 33.03 | 2,187,510.84 | |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 13,890 | 51.10 | 709,779.00 | |
| F5 NETWORKS INC | 5,350 | 142.68 | 763,338.00 | |
| FLEX LTD | 40,465 | 9.72 | 393,319.80 | |
| FLIR SYSTEMS INC | 11,686 | 54.15 | 632,796.90 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 112,105 | 14.87 | 1,667,001.35 | |
| HP INC | 134,066 | 20.63 | 2,765,781.58 | |
| IPG PHOTONICS CORP | 3,207 | 140.93 | 451,962.51 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 31,304 | 26.31 | 823,608.24 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 15,853 | 90.05 | 1,427,562.65 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 13,936 | 170.35 | 2,373,997.60 | |
| NETAPP INC | 20,586 | 60.15 | 1,238,247.90 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 22,836 | 46.04 | 1,051,369.44 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 28,434 | 93.99 | 2,672,511.66 | |
| TRIMBLE IMS HOLDINGS | 20,622 | 45.15 | 931,083.30 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 23,577 | 51.48 | 1,213,743.96 | |
| XEROX CORP | 16,718 | 35.95 | 601,012.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 4,600 | 211.72 | 973,912.00 | |
| AT&T INC | 616,020 | 33.54 | 20,661,310.80 | |
| CENTURYLINK INC | 83,301 | 11.78 | 981,285.78 | |
| SPRINT CORP | 64,825 | 6.84 | 443,403.00 | |
| T-MOBILE US INC | 28,273 | 75.15 | 2,124,715.95 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 349,784 | 56.41 | 19,731,315.44 | |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 15,289 | 33.42 | 510,958.38 | |
| AES CORP | 52,646 | 17.06 | 898,140.76 | |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 19,256 | 50.11 | 964,918.16 | |
| AMEREN CORPORATION | 21,002 | 76.61 | 1,608,963.22 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 41,422 | 90.36 | 3,742,891.92 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 16,134 | 118.29 | 1,908,490.86 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 9,385 | 106.98 | 1,004,007.30 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 42,792 | 29.09 | 1,244,819.28 | |
| CMS ENERGY CORP | 24,527 | 58.88 | 1,444,149.76 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 27,494 | 88.72 | 2,439,267.68 | |
| DOMINION ENERGY INC | 68,162 | 78.22 | 5,331,631.64 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 15,603 | 131.22 | 2,047,425.66 | |
| DUKE ENERGY CORP | 59,862 | 89.40 | 5,351,662.80 | |
| EDISON INTL | 28,962 | 69.72 | 2,019,230.64 | |
| ENTERGY CORP | 15,636 | 104.24 | 1,629,896.64 | |
| EVERGY INC | 21,330 | 61.45 | 1,310,728.50 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 28,103 | 76.96 | 2,162,806.88 | |
| EXELON CORP | 80,900 | 48.98 | 3,962,482.00 | |
| FIRSTENERGY CORP | 43,246 | 43.54 | 1,882,930.84 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 40,931 | 208.16 | 8,520,196.96 | |
| NISOURCE INC | 32,308 | 29.56 | 955,024.48 | |
| NRG ENERGY INC | 26,737 | 35.59 | 951,569.83 | |
| OGE ENERGY CORP | 15,686 | 43.16 | 677,007.76 | |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 9,416 | 95.52 | 899,416.32 | |
| PPL CORPORATION | 59,613 | 30.69 | 1,829,522.97 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 44,554 | 60.02 | 2,674,131.08 | |
| SEMPRA ENERGY | 23,257 | 139.05 | 3,233,885.85 | |
| SOUTHERN CO | 88,512 | 56.56 | 5,006,238.72 | |
| UGI CORP | 13,950 | 53.04 | 739,908.00 | |
| VISTRA ENERGY CORP | 29,561 | 22.42 | 662,757.62 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 27,947 | 85.70 | 2,395,057.90 | |
| XCEL ENERGY INC | 44,934 | 60.89 | 2,736,031.26 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 78,474 | 33.15 | 2,601,413.10 | |
| ANALOG DEVICES | 30,576 | 113.29 | 3,463,955.04 | |
| APPLIED MATERIALS | 80,718 | 43.97 | 3,549,170.46 | |
| BROADCOM INC | 33,711 | 275.53 | 9,288,391.83 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INTEL CORP | 379,126 | 47.75 | 18,103,266.50 | |
| | KLA-TENCOR CORP | 13,856 | 117.78 | 1,631,959.68 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 12,864 | 183.08 | 2,355,141.12 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 54,737 | 24.56 | 1,344,340.72 | |
| | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 24,692 | 60.57 | 1,495,594.44 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 20,744 | 89.22 | 1,850,779.68 | |
| | MICRON TECHNOLOGY | 95,275 | 41.35 | 3,939,621.25 | |
| | NVIDIA CORP | 48,914 | 157.31 | 7,694,661.34 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 25,078 | 95.92 | 2,405,481.76 | |
| | ON SEMICONDUCTOR CORP | 35,996 | 19.64 | 706,961.44 | |
| | QORVO INC | 10,609 | 69.63 | 738,704.67 | |
| | QUALCOMM | 102,656 | 76.55 | 7,858,316.80 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 14,510 | 79.76 | 1,157,317.60 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS | 78,827 | 115.78 | 9,126,590.06 | |
| | XILINX INC | 22,116 | 117.34 | 2,595,091.44 | |
| **アメリカドル 小計** | | 25,712,811 | | 2,156,649,514.97<br>(235,096,363,626) | |
| **カナダドル** | CAMECO CORP | 28,709 | 14.22 | 408,241.98 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 103,328 | 35.19 | 3,636,112.32 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 96,666 | 11.96 | 1,156,125.36 | |
| | ENBRIDGE | 173,856 | 47.99 | 8,343,349.44 | |
| | ENCANA CORP | 138,637 | 6.34 | 878,958.58 | |
| | HUSKY ENERGY INC | 31,439 | 12.46 | 391,729.94 | |
| | IMPERIAL OIL | 24,763 | 36.79 | 911,030.77 | |
| | INTER PIPELINE LTD | 30,317 | 22.12 | 670,612.04 | |
| | KEYERA CORP | 14,929 | 34.31 | 512,213.99 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 42,276 | 49.55 | 2,094,775.80 | |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 18,350 | 18.52 | 339,842.00 | |
| | SUNCOR ENERGY | 134,430 | 42.15 | 5,666,224.50 | |
| | TC ENERGY CORP | 76,314 | 65.65 | 5,010,014.10 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 19,965 | 16.43 | 328,024.95 | |
| | VERMILION ENERGY INC | 10,067 | 28.40 | 285,902.80 | |
| | AGNICO EAGLE MINES | 21,459 | 67.80 | 1,454,920.20 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 149,092 | 21.09 | 3,144,350.28 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 13,139 | 65.50 | 860,604.50 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 56,900 | 10.80 | 614,520.00 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 16,758 | 111.80 | 1,873,544.40 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 107,615 | 5.15 | 554,217.25 | |
| | KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 17,033 | 54.52 | 928,639.16 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 62,243 | 6.78 | 422,007.54 | |
| | METHANEX CORP | 7,099 | 56.79 | 403,152.21 | |
| | NUTRIEN LTD | 51,428 | 67.53 | 3,472,932.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 45,677 | 28.05 | 1,281,239.85 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 4,327 | 56.28 | 243,523.56 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 36,838 | 31.18 | 1,148,608.84 | |
| BOMBARDIER B | 151,366 | 2.22 | 336,032.52 | |
| CAE INC | 25,999 | 35.82 | 931,284.18 | |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 14,713 | 24.59 | 361,792.67 | |
| WSP GLOBAL INC | 9,471 | 72.90 | 690,435.90 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 16,142 | 87.04 | 1,404,999.68 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 61,174 | 123.03 | 7,526,237.22 | |
| CP RAILWAY LIMITED | 11,825 | 313.33 | 3,705,127.25 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 27,978 | 61.35 | 1,716,450.30 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 17,659 | 51.27 | 905,376.93 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 21,365 | 92.49 | 1,976,048.85 | |
| STARS GROUP INC/THE | 11,841 | 21.18 | 250,792.38 | |
| QUEBECOR INC -CL B | 15,200 | 32.00 | 486,400.00 | |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 35,947 | 26.58 | 955,471.26 | |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 5,409 | 143.45 | 775,921.05 | |
| DOLLARAMA INC | 26,700 | 49.75 | 1,328,325.00 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 36,158 | 83.75 | 3,028,232.50 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 11,499 | 32.93 | 378,662.07 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 15,618 | 67.05 | 1,047,186.90 | |
| METRO INC | 19,179 | 49.24 | 944,373.96 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 6,883 | 100.12 | 689,125.96 | |
| SAPUTO INC | 20,412 | 39.51 | 806,478.12 | |
| AURORA CANNABIS INC | 53,000 | 9.61 | 509,330.00 | |
| CANOPY GROWTH CORP | 16,400 | 51.37 | 842,468.00 | |
| CRONOS GROUP INC | 15,900 | 20.37 | 323,883.00 | |
| BANK MONTREAL | 55,382 | 100.95 | 5,590,812.90 | |
| BANK NOVA SCOTIA | 106,056 | 71.01 | 7,531,036.56 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK | 37,990 | 103.30 | 3,924,367.00 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 28,228 | 63.89 | 1,803,486.92 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 120,650 | 105.52 | 12,730,988.00 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 154,324 | 76.84 | 11,858,256.16 | |
| BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A | 73,316 | 63.77 | 4,675,361.32 | |
| CI FINANCIAL CORP | 18,671 | 21.67 | 404,600.57 | |
| IGM FINANCIAL INC | 7,685 | 37.82 | 290,646.70 | |
| ONEX CORP | 6,603 | 82.18 | 542,634.54 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 2,305 | 638.84 | 1,472,526.20 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 23,788 | 30.29 | 720,538.52 | |
| IA FINANCIAL CORP INC | 8,230 | 54.21 | 446,148.30 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 11,102 | 126.23 | 1,401,405.46 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 172,987 | 24.64 | 4,262,399.68 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | POWER CORP OF CANADA | 29,774 | 28.14 | 837,840.36 | |
| | POWER FINANCIAL CORP | 20,740 | 30.12 | 624,688.80 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 48,943 | 55.25 | 2,704,100.75 | |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 12,465 | 22.16 | 276,224.40 | |
| | BLACKBERRY LIMITED | 39,400 | 9.55 | 376,270.00 | |
| | CGI INC - CL A | 21,192 | 102.44 | 2,170,908.48 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,701 | 1,243.79 | 2,115,686.79 | |
| | OPEN TEXT CORP | 24,643 | 55.73 | 1,373,354.39 | |
| | SHOPIFY INC - CLASS A | 8,392 | 422.74 | 3,547,634.08 | |
| | BCE INC | 12,539 | 60.56 | 759,361.84 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 32,095 | 70.65 | 2,267,511.75 | |
| | TELUS CORP | 16,454 | 49.04 | 806,904.16 | |
| | ALTAGAS INCOME LTD | 31,487 | 19.94 | 627,850.78 | |
| | ATCO LTD -CLASS I | 5,241 | 44.51 | 233,276.91 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 10,324 | 36.46 | 376,413.04 | |
| | EMERA INC | 4,086 | 54.38 | 222,196.68 | |
| | FORTIS INC | 38,447 | 52.49 | 2,018,083.03 | |
| | HYDRO ONE LTD | 32,299 | 23.28 | 751,920.72 | |
| **カナダドル 小計** | | 3,399,031 | | 158,701,290.69<br>(13,173,794,140) | |
| ユーロ | ENAGAS | 18,299 | 19.54 | 357,562.46 | |
| | ENI | 216,297 | 14.55 | 3,147,121.35 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 39,867 | 13.48 | 537,606.49 | |
| | NESTE OIL OYJ | 33,258 | 29.41 | 978,117.78 | |
| | OMV AG | 12,139 | 43.31 | 525,740.09 | |
| | REPSOL SA | 129,100 | 13.69 | 1,768,024.50 | |
| | SNAM SPA | 163,694 | 4.54 | 744,480.31 | |
| | TENARIS SA | 40,648 | 11.81 | 480,052.88 | |
| | TOTAL SA | 200,017 | 49.51 | 9,902,841.67 | |
| | VOPAK | 6,360 | 42.21 | 268,455.60 | |
| | AIR LIQUIDE | 36,297 | 122.40 | 4,442,752.80 | |
| | AKZO NOBEL | 19,742 | 82.00 | 1,618,844.00 | |
| | ARCELORMITTAL | 53,985 | 14.55 | 785,913.63 | |
| | ARKEMA | 5,335 | 79.20 | 422,532.00 | |
| | BASF SE | 77,211 | 60.51 | 4,672,037.61 | |
| | COVESTRO AG | 16,178 | 41.59 | 672,843.02 | |
| | CRH PLC | 71,124 | 29.28 | 2,082,510.72 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 13,454 | 25.18 | 338,771.72 | |
| | FUCHS PETROLUB SE -PREF | 5,762 | 34.24 | 197,290.88 | |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 13,833 | 66.86 | 924,874.38 | |
| | IMERYS SA | 3,000 | 44.52 | 133,560.00 | |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 15,234 | 110.55 | 1,684,118.70 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LANXESS | 7,293 | 53.10 | 387,258.30 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 19,565 | 27.46 | 537,254.90 | |
| SOLVAY SA | 6,906 | 86.98 | 600,683.88 | |
| STORA ENSO OYJ R | 47,237 | 10.07 | 475,676.59 | |
| SYMRISE AG | 11,581 | 82.78 | 958,675.18 | |
| THYSSEN KRUPP | 33,044 | 11.70 | 386,614.80 | |
| UMICORE | 17,605 | 26.89 | 473,398.45 | |
| UPM KYMMENE OYJ | 43,990 | 22.62 | 995,053.80 | |
| VOESTALPINE AG | 8,140 | 25.54 | 207,895.60 | |
| ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 21,695 | 37.07 | 804,233.65 | |
| AIRBUS SE | 48,982 | 124.10 | 6,078,666.20 | |
| ALSTOM | 13,816 | 41.89 | 578,752.24 | |
| ANDRITZ AG | 5,242 | 31.58 | 165,542.36 | |
| BOUYGUES ORD | 16,815 | 32.20 | 541,443.00 | |
| BRENNTAG AG | 11,626 | 42.53 | 494,453.78 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 93,026 | 9.23 | 859,002.08 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 213 | 1,181.00 | 251,553.00 | |
| EIFFAGE | 6,079 | 88.14 | 535,803.06 | |
| FERROVIAL SA | 39,067 | 22.60 | 882,914.20 | |
| GEA GROUP AG | 13,382 | 22.99 | 307,652.18 | |
| HOCHTIEF AG | 1,354 | 109.00 | 147,586.00 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 11,813 | 46.50 | 549,304.50 | |
| KION GROUP AG | 5,887 | 52.48 | 308,949.76 | |
| KNORR-BREMSE AG | 4,123 | 94.67 | 390,324.41 | |
| KONE OYJ-B | 30,120 | 51.22 | 1,542,746.40 | |
| LEGRAND SA | 21,794 | 62.92 | 1,371,278.48 | |
| LEONARDO SPA | 35,425 | 11.33 | 401,542.37 | |
| METSO OYJ | 9,561 | 34.57 | 330,523.77 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 4,753 | 213.80 | 1,016,191.40 | |
| PRYSMIAN SPA | 25,673 | 18.10 | 464,681.30 | |
| SAFRAN SA | 27,260 | 128.95 | 3,515,177.00 | |
| SAINT-GOBAIN | 40,731 | 33.38 | 1,359,804.43 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 47,763 | 76.94 | 3,674,885.22 | |
| SIEMENS | 65,680 | 101.30 | 6,653,384.00 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 17,491 | 14.90 | 260,615.90 | |
| THALES SA | 9,665 | 102.80 | 993,562.00 | |
| VINCI S.A. | 43,091 | 90.84 | 3,914,386.44 | |
| WARTSILA OYJ | 34,386 | 12.24 | 420,884.64 | |
| BUREAU VERITAS SA | 19,558 | 21.77 | 425,777.66 | |
| EDENRED | 18,941 | 44.75 | 847,609.75 | |
| RANDSTAD NV | 9,588 | 45.69 | 438,075.72 | |
| SOCIETE BIC SA | 2,424 | 70.75 | 171,498.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TELEPERFORMANCE | 4,523 | 173.30 | 783,835.90 | |
| WOLTERS KLUWER | 22,886 | 64.64 | 1,479,351.04 | |
| ADP | 2,382 | 157.50 | 375,165.00 | |
| AENA SME SA | 5,610 | 173.80 | 975,018.00 | |
| ATLANTIA SPA | 42,039 | 23.42 | 984,553.38 | |
| BOLLORE | 61,805 | 3.93 | 243,140.87 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 23,272 | 14.92 | 347,334.60 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 84,986 | 29.24 | 2,484,990.64 | |
| FRAPORT AG | 3,561 | 74.30 | 264,582.30 | |
| GETLINK | 36,478 | 13.78 | 502,666.84 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 28,946 | 66.17 | 1,915,356.82 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 4,991 | 56.50 | 281,991.50 | |
| CONTINENTAL AG | 9,928 | 120.06 | 1,191,955.68 | |
| DAIMLER AG | 78,530 | 47.77 | 3,751,378.10 | |
| FAURECIA | 5,945 | 36.86 | 219,132.70 | |
| FERRARI NV | 9,947 | 147.15 | 1,463,701.05 | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 96,379 | 12.43 | 1,198,762.00 | |
| MICHELIN | 15,337 | 108.50 | 1,664,064.50 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 10,292 | 27.32 | 281,177.44 | |
| PEUGEOT SA | 52,883 | 21.62 | 1,143,330.46 | |
| PIRELLI & C SPA | 39,097 | 5.32 | 208,152.42 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 14,028 | 59.06 | 828,493.68 | |
| RENAULT SA | 17,362 | 52.39 | 909,595.18 | |
| VALEO SA | 19,350 | 25.71 | 497,488.50 | |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 15,999 | 153.96 | 2,463,206.04 | |
| VOLKSWAGEN STAMM | 2,594 | 156.00 | 404,664.00 | |
| ADIDAS AG | 15,081 | 281.70 | 4,248,317.70 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 23,316 | 115.20 | 2,686,003.20 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,600 | 642.80 | 1,671,280.00 | |
| HUGO BOSS AG | 4,852 | 56.98 | 276,466.96 | |
| KERING | 6,332 | 522.10 | 3,305,937.20 | |
| LVMH | 23,422 | 383.00 | 8,970,626.00 | |
| MONCLER SPA | 15,736 | 38.25 | 601,902.00 | |
| PUMA SE | 7,720 | 60.25 | 465,130.00 | |
| SEB SA | 2,075 | 160.50 | 333,037.50 | |
| ACCOR | 17,931 | 38.12 | 683,529.72 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 7,143 | 74.04 | 528,867.72 | |
| SODEXO | 8,135 | 101.75 | 827,736.25 | |
| AXEL SPRINGER SE | 3,827 | 61.95 | 237,082.65 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 11,976 | 17.13 | 205,148.88 | |
| JC DECAUX SA | 4,674 | 25.66 | 119,934.84 | |
| PUBLICIS GROUPE | 17,601 | 47.56 | 837,103.56 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| RTL GROUP | 3,513 | 45.90 | 161,246.70 | |
| SES | 31,369 | 13.65 | 428,343.69 | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 4,998 | 44.40 | 221,911.20 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 6,830 | 71.22 | 486,432.60 | |
| VIVENDI | 77,307 | 24.97 | 1,930,355.79 | |
| DELIVERY HERO SE | 8,671 | 39.33 | 341,030.43 | |
| INDITEX | 93,820 | 27.19 | 2,550,965.80 | |
| ZALANDO SE | 9,155 | 41.20 | 377,186.00 | |
| CARREFOUR | 53,759 | 17.50 | 940,782.50 | |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 3,687 | 31.39 | 115,734.93 | |
| COLRUYT SA | 4,160 | 50.80 | 211,328.00 | |
| JERONIMO MARTINS | 20,234 | 14.32 | 289,750.88 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 98,234 | 20.00 | 1,964,680.00 | |
| METRO AG | 13,712 | 15.83 | 217,129.52 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 64,009 | 81.89 | 5,241,697.01 | |
| DANONE (GROUPE) | 52,307 | 75.12 | 3,929,301.84 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 42,526 | 8.79 | 373,803.54 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 10,701 | 95.00 | 1,016,595.00 | |
| HEINEKEN NV | 22,649 | 100.55 | 2,277,356.95 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 13,146 | 106.00 | 1,393,476.00 | |
| PERNOD-RICARD | 18,484 | 162.45 | 3,002,725.80 | |
| REMY COINTREAU | 1,575 | 127.40 | 200,655.00 | |
| BEIERSDORF AG | 9,190 | 106.65 | 980,113.50 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,618 | 81.75 | 704,521.50 | |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD | 15,736 | 88.34 | 1,390,118.24 | |
| LOREAL | 21,190 | 253.70 | 5,375,903.00 | |
| UNILEVER NV | 123,171 | 54.25 | 6,682,026.75 | |
| BIOMERIEUX | 3,246 | 72.90 | 236,633.40 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 3,430 | 86.20 | 295,666.00 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | 17,996 | 66.64 | 1,199,253.44 | |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 36,747 | 45.84 | 1,684,482.48 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS | 80,612 | 39.20 | 3,159,990.40 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 3,246 | 179.00 | 581,034.00 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 12,500 | 37.83 | 472,875.00 | |
| BAYER | 78,314 | 59.80 | 4,683,177.20 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 971 | 392.00 | 380,632.00 | |
| GRIFOLS SA | 27,685 | 27.97 | 774,349.45 | |
| IPSEN | 2,722 | 117.20 | 319,018.40 | |
| MERCK KGAA | 10,480 | 92.94 | 974,011.20 | |
| ORION OYJ-CLASS B | 7,975 | 33.64 | 268,279.00 | |
| QIAGEN N.V. | 21,801 | 35.59 | 775,897.59 | |
| RECORDATI SPA | 7,493 | 37.72 | 282,635.96 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SANOFI | 94,252 | 77.49 | 7,303,587.48 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 3,004 | 136.60 | 410,346.40 | |
| UCB (GROUPE) | 10,465 | 73.76 | 771,898.40 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 33,189 | 19.10 | 633,909.90 | |
| AIB GROUP PLC | 70,200 | 3.70 | 260,161.20 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA | 556,129 | 4.95 | 2,753,394.67 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 442,961 | 0.92 | 409,827.51 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,366,379 | 4.14 | 5,660,908.19 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 84,000 | 4.67 | 392,784.00 | |
| BANKIA SA | 110,053 | 2.06 | 227,369.49 | |
| BANKINTER SA | 58,881 | 6.30 | 371,421.34 | |
| BNP PARIBAS | 94,302 | 42.57 | 4,014,907.65 | |
| CAIXABANK | 286,347 | 2.53 | 726,175.99 | |
| COMMERZBANK AG | 80,494 | 6.26 | 503,892.44 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 92,834 | 10.93 | 1,015,139.79 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 27,560 | 33.39 | 920,228.40 | |
| FINECOBANK SPA | 44,137 | 10.11 | 446,225.07 | |
| ING GROEP NV-CVA | 332,029 | 10.21 | 3,390,016.09 | |
| INTESA SANPAOLO | 1,286,795 | 2.00 | 2,581,954.16 | |
| KBC GROEP NV | 22,703 | 59.12 | 1,342,201.36 | |
| MEDIOBANCA | 53,990 | 9.31 | 502,754.88 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 12,490 | 20.83 | 260,166.70 | |
| SOCIETE GENERALE | 63,719 | 22.25 | 1,417,747.75 | |
| UNICREDIT SPA | 177,131 | 11.38 | 2,016,105.04 | |
| AMUNDI SA | 4,764 | 60.40 | 287,745.60 | |
| DEUTSCHE BANK NAMEN | 161,156 | 6.50 | 1,048,319.78 | |
| DEUTSCHE BOERSE | 15,674 | 128.35 | 2,011,757.90 | |
| EURAZEO SA | 3,357 | 61.30 | 205,784.10 | |
| EXOR NV | 10,345 | 63.26 | 654,424.70 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 6,247 | 86.40 | 539,740.80 | |
| NATIXIS | 69,996 | 3.62 | 253,945.48 | |
| WENDEL | 2,023 | 120.70 | 244,176.10 | |
| AEGON | 166,267 | 4.59 | 764,495.66 | |
| AGEAS | 16,065 | 47.89 | 769,352.85 | |
| ALLIANZ SE-REG | 35,781 | 218.15 | 7,805,625.15 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 89,649 | 17.16 | 1,538,825.08 | |
| AXA | 165,661 | 23.74 | 3,933,620.44 | |
| CNP ASSURANCES | 11,830 | 20.66 | 244,407.80 | |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 4,706 | 145.40 | 684,252.40 | |
| MAPFRE SA | 90,939 | 2.68 | 243,807.45 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICH. | 12,665 | 227.20 | 2,877,488.00 | |
| NN GROUP NV | 27,631 | 35.86 | 990,847.66 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| POSTE ITALIANE SPA | 46,035 | 9.65 | 444,421.89 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 39,991 | 42.06 | 1,682,021.46 | |
| SCOR SE | 13,354 | 39.57 | 528,417.78 | |
| AROUNDTOWN SA | 59,250 | 7.74 | 458,595.00 | |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 29,009 | 33.80 | 980,504.20 | |
| VONOVIA SE | 43,942 | 44.89 | 1,972,556.38 | |
| ADYEN NV | 884 | 648.60 | 573,362.40 | |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS | 36,510 | 72.08 | 2,631,640.80 | |
| ATOS SE | 7,634 | 76.92 | 587,207.28 | |
| CAPGEMINI SA | 13,238 | 113.70 | 1,505,160.60 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 11,783 | 139.75 | 1,646,674.25 | |
| SAP SE | 82,678 | 123.00 | 10,169,394.00 | |
| WIRECARD AG | 9,864 | 149.35 | 1,473,188.40 | |
| WORLDLINE SA | 7,022 | 62.80 | 440,981.60 | |
| INGENICO GROUP | 4,681 | 74.78 | 350,045.18 | |
| NOKIA OYJ | 489,813 | 4.43 | 2,170,851.21 | |
| 1&1 DRILLISCH AG | 3,773 | 31.22 | 117,793.06 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 16,559 | 33.85 | 560,522.15 | |
| DEUTSCHE TELEKOM | 279,433 | 15.46 | 4,320,034.18 | |
| ELISA A | 11,722 | 43.30 | 507,562.60 | |
| ILIAD SA | 2,053 | 98.92 | 203,082.76 | |
| KPN (KON.) | 261,596 | 2.70 | 707,355.58 | |
| ORANGE | 176,815 | 13.85 | 2,449,771.82 | |
| PROXIMUS | 13,141 | 24.89 | 327,079.49 | |
| TELECOM ITALIA ORD | 852,552 | 0.49 | 419,540.83 | |
| TELECOM ITALIA RNC | 470,147 | 0.46 | 218,994.47 | |
| TELEFONICA | 410,000 | 7.45 | 3,055,320.00 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 66,967 | 2.44 | 164,002.18 | |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 9,513 | 28.55 | 271,596.15 | |
| E.ON SE | 183,255 | 9.67 | 1,772,075.85 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 49,736 | 11.11 | 552,566.96 | |
| ENDESA | 24,774 | 22.96 | 568,811.04 | |
| ENEL | 681,211 | 6.40 | 4,365,881.29 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 235,913 | 3.37 | 796,442.28 | |
| ENGIE | 162,096 | 13.92 | 2,257,186.80 | |
| FORTUM OYJ | 38,328 | 19.42 | 744,329.76 | |
| IBERDROLA SA | 490,125 | 8.59 | 4,212,134.25 | |
| IBERDROLA SA-RTS | 490,125 | 0.20 | 98,025.00 | |
| INNOGY SE | 11,000 | 42.64 | 469,040.00 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 23,130 | 22.83 | 528,057.90 | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 39,632 | 17.75 | 703,468.00 | |
| RWE STAMM | 42,828 | 22.75 | 974,337.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SUEZ | 28,043 | 13.10 | 367,363.30 | |
| | TERNA SPA | 130,230 | 5.81 | 757,157.22 | |
| | UNIPER SE | 14,751 | 27.73 | 409,045.23 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 45,742 | 22.43 | 1,025,993.06 | |
| | VERBUND AG | 7,463 | 46.56 | 347,477.28 | |
| | ASML HOLDING NV | 35,211 | 183.92 | 6,476,007.12 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES | 99,840 | 15.68 | 1,566,289.92 | |
| | STMICROELECTRONICS | 57,598 | 15.52 | 893,920.96 | |
| ユーロ 小計 | | 16,832,549 | | 328,416,698.27<br>(40,106,247,192) | |
| イギリスポンド | BP PLC | 1,694,881 | 5.46 | 9,260,829.78 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 372,635 | 25.89 | 9,647,520.15 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 314,963 | 25.95 | 8,173,289.85 | |
| | WOOD GROUP (JOHN) PLC | 54,000 | 4.79 | 258,930.00 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 87,419 | 21.29 | 1,861,150.51 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 35,856 | 8.48 | 304,058.88 | |
| | BHP GROUP PLC | 179,682 | 19.75 | 3,548,719.50 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 9,999 | 48.34 | 483,351.66 | |
| | EVRAZ PLC | 43,000 | 6.25 | 268,836.00 | |
| | FRESNILLO PLC | 17,743 | 8.90 | 157,983.67 | |
| | GLENCORE PLC | 941,686 | 2.66 | 2,506,768.13 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 12,160 | 33.15 | 403,104.00 | |
| | MONDI PLC | 34,071 | 17.42 | 593,687.17 | |
| | RIO TINTO PLC REG | 97,151 | 48.04 | 4,667,619.79 | |
| | ASHTEAD GROUP PLC | 42,021 | 22.64 | 951,355.44 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 282,016 | 4.87 | 1,375,956.06 | |
| | BUNZL PLC | 27,712 | 21.16 | 586,385.92 | |
| | DCC PLC | 9,127 | 69.18 | 631,405.86 | |
| | FERGUSON PLC | 19,208 | 56.50 | 1,085,252.00 | |
| | MEGGITT PLC | 66,268 | 5.28 | 350,425.18 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 408,486 | 1.79 | 731,598.42 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 149,025 | 8.55 | 1,274,163.75 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 37,146 | 15.72 | 583,935.12 | |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 6,277 | 88.85 | 557,711.45 | |
| | WEIR GROUP PLC/THE | 18,586 | 14.87 | 276,373.82 | |
| | EXPERIAN PLC | 74,903 | 23.90 | 1,790,181.70 | |
| | G4S PLC | 132,555 | 1.97 | 262,392.62 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 14,722 | 55.98 | 824,137.56 | |
| | RELX PLC | 163,442 | 19.62 | 3,206,732.04 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 157,705 | 4.09 | 646,275.09 | |
| | EASYJET PLC | 11,633 | 9.83 | 114,398.92 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 96,469 | 5.76 | 556,047.31 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BURBERRY GROUP PLC | 35,328 | 19.36 | 684,126.72 | |
| PERSIMMON PLC | 26,389 | 18.72 | 494,002.08 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 270,596 | 1.58 | 427,541.68 | |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 10,599 | 37.18 | 394,070.82 | |
| CARNIVAL PLC | 13,721 | 35.36 | 485,174.56 | |
| COMPASS GROUP PLC | 136,301 | 19.42 | 2,647,646.92 | |
| GVC HOLDINGS PLC | 42,500 | 6.06 | 257,635.00 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 16,041 | 53.55 | 858,995.55 | |
| MERLIN ENTERTAINME | 65,098 | 4.48 | 292,224.92 | |
| TUI AG-DI | 37,945 | 7.68 | 291,569.38 | |
| WHITBREAD PLC | 14,664 | 47.95 | 703,138.80 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 80,010 | 5.58 | 446,775.84 | |
| INFORMA PLC | 100,899 | 8.45 | 852,798.34 | |
| ITV PLC | 295,435 | 1.09 | 324,683.06 | |
| PEARSON | 66,305 | 8.45 | 560,542.47 | |
| WPP PLC | 113,065 | 9.80 | 1,108,715.39 | |
| KINGFISHER PLC | 170,994 | 2.17 | 371,398.96 | |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 135,263 | 2.09 | 283,781.77 | |
| NEXT PLC | 11,202 | 54.20 | 607,148.40 | |
| OCADO GROUP PLC | 38,762 | 12.36 | 479,292.13 | |
| MORRISON SUPERMARKETS | 168,125 | 2.07 | 348,859.37 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 148,335 | 2.01 | 298,153.35 | |
| TESCO | 856,393 | 2.33 | 2,000,534.04 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 28,845 | 23.86 | 688,241.70 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 197,242 | 29.64 | 5,847,239.09 | |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 17,960 | 27.82 | 499,647.20 | |
| DIAGEO | 204,601 | 34.51 | 7,060,780.51 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 83,245 | 19.81 | 1,649,083.45 | |
| RECKITT BENCKISER PLC | 60,995 | 64.20 | 3,915,879.00 | |
| UNILEVER PLC | 93,214 | 50.38 | 4,696,121.32 | |
| NMC HEALTH PLC | 9,509 | 23.02 | 218,897.18 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 71,027 | 17.41 | 1,236,935.20 | |
| ASTRAZENECA | 105,675 | 64.76 | 6,843,513.00 | |
| GLAXOSMITHKLINE | 425,464 | 16.40 | 6,978,460.52 | |
| BARCLAYS | 1,471,691 | 1.56 | 2,302,313.40 | |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 1,693,900 | 6.70 | 11,360,987.30 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 5,968,726 | 0.57 | 3,449,326.75 | |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND | 395,524 | 2.28 | 902,585.76 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 233,519 | 7.36 | 1,720,567.99 | |
| 3I GROUP PLC | 79,251 | 11.27 | 893,158.77 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 27,021 | 19.77 | 534,205.17 | |
| INVESTEC PLC | 54,280 | 5.03 | 273,136.96 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 26,296 | 56.78 | 1,493,086.88 | |
| | SCHRODERS PLC | 8,614 | 29.95 | 257,989.30 | |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 44,750 | 11.39 | 509,926.25 | |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 193,491 | 2.99 | 578,925.07 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 16,255 | 22.91 | 372,402.05 | |
| | AVIVA PIC | 348,023 | 4.27 | 1,487,798.32 | |
| | DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 113,715 | 3.39 | 385,607.56 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP | 490,014 | 2.71 | 1,330,878.02 | |
| | PRUDENTIAL | 217,306 | 17.55 | 3,814,806.83 | |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 86,538 | 5.86 | 507,112.68 | |
| | MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 29,065 | 19.86 | 577,230.90 | |
| | SAGE GROUP PLC | 89,321 | 8.10 | 724,214.66 | |
| | HALMA PLC | 32,374 | 20.15 | 652,336.10 | |
| | BT GROUP PLC | 730,298 | 1.95 | 1,430,507.72 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 2,309,362 | 1.33 | 3,090,388.22 | |
| | CENTRICA PLC | 440,558 | 0.87 | 386,633.70 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 283,108 | 8.54 | 2,418,591.64 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 18,112 | 20.78 | 376,367.36 | |
| | SSE PLC | 93,277 | 11.46 | 1,069,420.80 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 58,890 | 7.94 | 467,704.38 | |
| イギリスポンド 小計 | | 25,317,573 | | 156,162,395.61<br>(21,199,045,204) | |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 17,398 | 18.92 | 329,170.16 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 672 | 581.50 | 390,768.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 813 | 2,738.00 | 2,225,994.00 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 40,334 | 47.92 | 1,932,805.28 | |
| | SIKA AG-BR | 10,500 | 161.50 | 1,695,750.00 | |
| | ABB LTD | 153,407 | 18.62 | 2,856,438.34 | |
| | GEBERIT AG-REG | 3,021 | 457.80 | 1,383,013.80 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,479 | 210.00 | 310,590.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 3,768 | 214.60 | 808,612.80 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 13,224 | 53.66 | 709,599.84 | |
| | SGS SA | 437 | 2,465.00 | 1,077,205.00 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 5,067 | 143.00 | 724,581.00 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 44,744 | 81.94 | 3,666,323.36 | |
| | SWATCH GROUP AG(BEARER) | 2,483 | 274.50 | 681,583.50 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 3,938 | 52.00 | 204,776.00 | |
| | DUFRY AG-REG | 2,548 | 83.08 | 211,687.84 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 160 | 1,975.00 | 316,000.00 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 8 | 79,200.00 | 633,600.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 104 | 7,150.00 | 743,600.00 | |
| | NESTLE SA - REGISTERED | 258,550 | 103.00 | 26,630,650.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ALCON INC | 37,545 | 60.27 | 2,262,837.15 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 5,104 | 216.10 | 1,102,974.40 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 779 | 845.20 | 658,410.80 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 6,507 | 327.40 | 2,130,391.80 | |
| | NOVARTIS | 184,125 | 90.80 | 16,718,550.00 | |
| | ROCHE HOLDING GENUSS | 59,430 | 276.25 | 16,417,537.50 | |
| | VIFOR PHARMA AG | 3,601 | 140.20 | 504,860.20 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG | 224,271 | 11.89 | 2,667,703.54 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 21,177 | 42.01 | 889,645.77 | |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 3,397 | 74.85 | 254,265.45 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,491 | 774.20 | 1,154,332.20 | |
| | UBS GROUP AG | 334,926 | 11.84 | 3,967,198.47 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 3,877 | 176.60 | 684,678.20 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 2,949 | 491.10 | 1,448,253.90 | |
| | SWISS RE LTD | 26,239 | 100.00 | 2,623,900.00 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 12,661 | 346.80 | 4,390,834.80 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 6,277 | 87.60 | 549,865.20 | |
| | TEMENOS AG - REG | 5,252 | 174.45 | 916,211.40 | |
| | SWISSCOM | 2,064 | 487.20 | 1,005,580.80 | |
| スイスフラン 小計 | | 1,504,327 | | 107,880,780.50<br>(11,831,285,197) | |
| スウェーデンクローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 14,191 | 304.60 | 4,322,578.60 | |
| | BOLIDEN AB | 15,315 | 221.05 | 3,385,380.75 | |
| | ALFA LAVAL AB | 25,639 | 202.40 | 5,189,333.60 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 88,864 | 213.20 | 18,945,804.80 | |
| | ATLAS COPCO A | 59,675 | 287.40 | 17,150,595.00 | |
| | ATLAS COPCO B | 36,538 | 256.70 | 9,379,304.60 | |
| | EPIROC AB-A | 53,833 | 92.08 | 4,956,942.64 | |
| | EPIROC AB-B | 29,972 | 88.64 | 2,656,718.08 | |
| | SANDVIK AB | 100,730 | 161.40 | 16,257,822.00 | |
| | SKANSKA B | 28,530 | 173.80 | 4,958,514.00 | |
| | SKF AB-B | 28,335 | 158.35 | 4,486,847.25 | |
| | VOLVO B | 125,906 | 146.50 | 18,445,229.00 | |
| | SECURITAS B | 22,844 | 165.55 | 3,781,824.20 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 18,170 | 239.80 | 4,357,166.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 38,712 | 85.10 | 3,294,391.20 | |
| | HENNES & MAURITZ B | 73,962 | 169.70 | 12,551,351.40 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 5,730 | 407.10 | 2,332,683.00 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 15,149 | 417.70 | 6,327,737.30 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 54,928 | 293.20 | 16,104,889.60 | |
| | NORDEA BANK ABP | 250,593 | 70.40 | 17,641,747.20 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 138,710 | 90.36 | 12,533,835.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SVENSKA HANDELSBK A | 136,386 | 97.54 | 13,303,090.44 | |
| | SWEDBANK AB-A | 80,216 | 145.35 | 11,659,395.60 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 12,792 | 215.20 | 2,752,838.40 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 40,438 | 461.00 | 18,641,918.00 | |
| | KINNEVIK AB - B | 18,104 | 246.10 | 4,455,394.40 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 7,280 | 357.40 | 2,601,872.00 | |
| | ERICSSON (LM) B | 268,755 | 89.16 | 23,962,195.80 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 21,504 | 469.60 | 10,098,278.40 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 6,194 | 547.50 | 3,391,215.00 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 38,012 | 135.25 | 5,141,123.00 | |
| | TELIA CO AB | 235,437 | 43.58 | 10,260,344.46 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 2,091,444 | | 295,328,361.32<br>(3,399,229,438) | |
| ノルウェークローネ | AKER BP ASA | 10,311 | 255.30 | 2,632,398.30 | |
| | EQUINOR ASA | 80,907 | 169.55 | 13,717,781.85 | |
| | NORSK HYDRO | 106,150 | 30.60 | 3,248,190.00 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 13,470 | 389.10 | 5,241,177.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 6,971 | 217.80 | 1,518,283.80 | |
| | MOWI ASA | 40,968 | 217.10 | 8,894,152.80 | |
| | ORKLA | 69,804 | 78.46 | 5,476,821.84 | |
| | DNB ASA | 80,217 | 164.05 | 13,159,598.85 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 18,574 | 172.55 | 3,204,943.70 | |
| | TELENOR ASA | 60,821 | 184.30 | 11,209,310.30 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 488,193 | | 68,302,658.44<br>(860,613,496) | |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 9,079 | 604.20 | 5,485,531.80 | |
| | NOVOZYMES A/S | 17,687 | 307.00 | 5,429,909.00 | |
| | VESTAS WIND SYSYEMS | 17,720 | 586.60 | 10,394,552.00 | |
| | ISS A/S | 14,253 | 192.00 | 2,736,576.00 | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 299 | 7,245.00 | 2,166,255.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 508 | 7,674.00 | 3,898,392.00 | |
| | DSV A/S | 14,436 | 625.20 | 9,025,387.20 | |
| | PANDORA A/S | 8,431 | 254.80 | 2,148,218.80 | |
| | CARLSBERG AS-B | 9,692 | 918.00 | 8,897,256.00 | |
| | COLOPLAST-B | 9,476 | 807.00 | 7,647,132.00 | |
| | DEMANT A/S | 7,420 | 201.10 | 1,492,162.00 | |
| | GENMAB A/S | 4,888 | 1,191.50 | 5,824,052.00 | |
| | H LUNDBECK A/S | 4,871 | 259.00 | 1,261,589.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 144,978 | 335.45 | 48,632,870.10 | |
| | DANSKE BANK A/S | 59,378 | 101.50 | 6,026,867.00 | |
| | TRYG A/S | 9,828 | 224.00 | 2,201,472.00 | |
| | ORSTED A/S | 15,908 | 601.20 | 9,563,889.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| デンマーククローネ 小計 | | 348,852 | | 132,832,111.50<br>(2,173,133,344) | |
| オーストラリアドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 20,629 | 25.60 | 528,102.40 | |
| | OIL SEARCH LTD | 118,781 | 6.95 | 825,527.95 | |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 165,595 | 7.42 | 1,228,714.90 | |
| | SANTOS | 156,437 | 6.84 | 1,070,029.08 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 12,813 | 22.50 | 288,292.50 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 83,590 | 36.08 | 3,015,927.20 | |
| | WORLEYPARSONS LTD | 34,596 | 15.13 | 523,437.48 | |
| | ALUMINA LIMITED | 170,458 | 2.28 | 388,644.24 | |
| | BHP GROUP LTD | 253,437 | 41.03 | 10,398,520.11 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 49,328 | 11.72 | 578,124.16 | |
| | BORAL LIMITED | 81,732 | 5.47 | 447,074.04 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 134,676 | 8.93 | 1,202,656.68 | |
| | INCITEC PIVOT LTD | 150,599 | 3.26 | 490,952.74 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 37,363 | 18.53 | 692,336.39 | |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 70,314 | 31.36 | 2,205,047.04 | |
| | ORICA LTD | 29,211 | 20.49 | 598,533.39 | |
| | RIO TINTO LTD | 32,522 | 104.35 | 3,393,670.70 | |
| | SOUTH32 LTD | 408,172 | 3.14 | 1,281,660.08 | |
| | CIMIC GROUP LIMITED | 9,220 | 45.06 | 415,453.20 | |
| | BRAMBLES LTD | 129,297 | 12.31 | 1,591,646.07 | |
| | SEEK LTD | 26,358 | 21.62 | 569,859.96 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 159,487 | 5.50 | 877,178.50 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 220,227 | 15.18 | 3,343,045.86 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 52,752 | 29.10 | 1,535,083.20 | |
| | CROWN RESORTS LTD | 30,328 | 12.73 | 386,075.44 | |
| | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 5,523 | 40.32 | 222,687.36 | |
| | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 3,263 | 42.99 | 140,276.37 | |
| | TABCORP HOLDINGS LTD | 166,846 | 4.68 | 780,839.28 | |
| | REA GROUP LTD | 3,593 | 97.33 | 349,706.69 | |
| | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 45,163 | 4.13 | 186,523.19 | |
| | WESFARMERS LTD | 100,277 | 37.07 | 3,717,268.39 | |
| | COLES GROUP LTD | 93,277 | 13.92 | 1,298,415.84 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 103,697 | 34.14 | 3,540,215.58 | |
| | COCA-COLA AMATIL LIMITED | 46,130 | 10.40 | 479,752.00 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 58,375 | 15.63 | 912,401.25 | |
| | COCHLEAR LIMITED | 4,811 | 214.95 | 1,034,124.45 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 12,248 | 72.50 | 887,980.00 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 32,669 | 27.42 | 895,783.98 | |
| | CSL LIMITED | 38,043 | 220.00 | 8,369,460.00 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 248,111 | 27.69 | 6,870,193.59 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANK OF QUEENSLAND LTD | 35,600 | 9.35 | 332,860.00 | |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 42,434 | 11.38 | 482,898.92 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 151,029 | 80.97 | 12,228,818.13 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 237,761 | 26.68 | 6,343,463.48 | |
| | WESTPAC BANKING | 288,399 | 27.89 | 8,043,448.11 | |
| | AMP LTD | 244,230 | 2.14 | 522,652.20 | |
| | ASX LTD | 15,814 | 86.41 | 1,366,487.74 | |
| | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 44,068 | 6.72 | 296,136.96 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 26,817 | 127.74 | 3,425,603.58 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GRP. | 209,355 | 8.50 | 1,779,517.50 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 214,512 | 3.64 | 780,823.68 | |
| | QBE INSURANCE GROUP | 113,093 | 11.91 | 1,346,937.63 | |
| | SUNCORP GROUP LIMITED | 102,921 | 13.43 | 1,382,229.03 | |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 44,376 | 16.48 | 731,316.48 | |
| | TELSTRA CORP | 342,339 | 3.88 | 1,328,275.32 | |
| | TPG TELECOM LTD | 31,475 | 6.55 | 206,161.25 | |
| | AGL ENERGY LTD | 51,344 | 20.28 | 1,041,256.32 | |
| | AUSNET SERVICES | 120,230 | 1.90 | 228,437.00 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 5,915,745 | | 109,428,544.61<br>(8,260,760,832) | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 76,644 | 5.06 | 387,818.64 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 84,950 | 9.40 | 798,530.00 | |
| | A2 MILK CO LTD | 66,854 | 15.25 | 1,019,523.50 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 45,508 | 15.85 | 721,301.80 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 36,317 | 12.36 | 448,878.12 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 145,449 | 3.98 | 578,887.02 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 110,544 | 4.81 | 531,716.64 | |
| ニュージーランドドル 小計 | | 566,266 | | 4,486,655.72<br>(322,814,879) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 233,996 | 75.90 | 17,760,296.40 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 163,000 | 15.86 | 2,585,180.00 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 119,000 | 58.80 | 6,997,200.00 | |
| | MTR CORP | 142,000 | 53.30 | 7,568,600.00 | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 68,500 | 22.35 | 1,530,975.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 198,000 | 54.60 | 10,810,800.00 | |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 67,200 | 13.94 | 936,768.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 202,800 | 39.55 | 8,020,740.00 | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 98,000 | 9.82 | 962,360.00 | |
| | SJM HOLDINGS LTD | 132,000 | 9.25 | 1,221,000.00 | |
| | WYNN MACAU LTD | 140,800 | 18.84 | 2,652,672.00 | |
| | VITASOY INTL HOLDINGS LTD | 64,000 | 36.65 | 2,345,600.00 | |
| | WH GROUP LTD | 699,000 | 7.57 | 5,291,430.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANK EAST ASIA | 109,160 | 22.00 | 2,401,520.00 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS -R | 310,000 | 30.65 | 9,501,500.00 | |
| | HANG SENG BANK | 68,000 | 193.60 | 13,164,800.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 103,000 | 270.60 | 27,871,800.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 1,015,800 | 83.85 | 85,174,830.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 215,996 | 60.05 | 12,970,559.80 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 173,000 | 18.76 | 3,245,480.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMEN | 125,228 | 42.55 | 5,328,451.40 | |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 59,000 | 40.50 | 2,389,500.00 | |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 64,500 | 32.50 | 2,096,250.00 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 491,500 | 12.20 | 5,996,300.00 | |
| | SINO LAND CO | 315,400 | 13.14 | 4,144,356.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 128,500 | 131.40 | 16,884,900.00 | |
| | SWIRE PACIFIC A | 40,500 | 94.60 | 3,831,300.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 96,200 | 31.20 | 3,001,440.00 | |
| | WHARF HOLDINGS | 91,000 | 20.60 | 1,874,600.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 95,000 | 52.65 | 5,001,750.00 | |
| | WHEELOCK & CO LTD | 65,000 | 55.00 | 3,575,000.00 | |
| | PCCW LTD | 357,000 | 4.49 | 1,602,930.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 50,000 | 62.75 | 3,137,500.00 | |
| | CLP HOLDINGS | 148,000 | 87.30 | 12,920,400.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 897,504 | 17.52 | 15,724,270.08 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 111,000 | 56.85 | 6,310,350.00 | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 23,700 | 77.60 | 1,839,120.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 7,482,284 | | 318,672,528.68<br>(4,445,481,775) | |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 112,300 | 6.50 | 729,950.00 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 107,000 | 2.39 | 255,730.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 109,000 | 4.25 | 463,250.00 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 199,900 | 1.49 | 297,851.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 166,500 | 2.84 | 472,860.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES | 43,333 | 9.46 | 409,930.18 | |
| | SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S | 51,200 | 5.29 | 270,848.00 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 425,000 | 0.91 | 388,875.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 127,100 | 2.51 | 319,021.00 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 9,900 | 36.14 | 357,786.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 419,000 | 0.29 | 123,605.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 178,600 | 3.78 | 675,108.00 | |
| | DBS GROUP | 156,300 | 25.32 | 3,957,516.00 | |
| | OCBC BANK | 264,200 | 11.40 | 3,011,880.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 103,300 | 26.22 | 2,708,526.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 62,300 | 7.95 | 495,285.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CAPITALAND LTD | 187,100 | 3.69 | 690,399.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 31,200 | 9.47 | 295,464.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 47,500 | 7.58 | 360,050.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 25,700 | 15.20 | 390,640.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 667,443 | 3.46 | 2,309,352.78 | |
| シンガポールドル 小計 | | 3,493,876 | | 18,983,926.96<br>(1,519,473,513) | |
| イスラエルシェケル | ISRAEL CHEMICALS LTD | 67,756 | 18.30 | 1,239,934.80 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 1,460 | 545.00 | 795,700.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 84,067 | 27.99 | 2,353,035.33 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 140,655 | 25.95 | 3,649,997.25 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 99,500 | 14.84 | 1,476,580.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 8,200 | 84.37 | 691,834.00 | |
| | AZRIELI GROUP | 4,323 | 231.80 | 1,002,071.40 | |
| | NICE LTD | 4,894 | 516.50 | 2,527,751.00 | |
| イスラエルシェケル 小計 | | 410,855 | | 13,736,903.78<br>(419,250,303) | |
| 合　計 | | 93,563,806 | | 342,807,492,939<br>(342,807,492,939) | |

### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | オーストラリアドル | APA GROUP | 89,571 | 980,802.45 | |
| | | LENDLEASE GROUP | 44,009 | 609,524.65 | |
| | | SYDNEY AIRPORT | 89,860 | 717,981.40 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 223,440 | 2,308,308.50<br>(174,254,208) | |
| | 香港ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 220,500 | 1,761,795.00 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD | 375,000 | 4,732,500.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 595,500 | 6,494,295.00<br>(90,595,415) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 818,940 | 264,849,623<br>(264,849,623) | |
| 投資証券 | アメリカドル | AGNC INVESTMENT CORP | 46,260 | 789,658.20 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9,814 | 1,452,275.72 | |
| | | AMERICAN TOWER CORPORATION | 37,095 | 7,838,544.45 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 112,760 | 1,039,647.20 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,733 | 2,481,646.83 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 13,590 | 1,794,559.50 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 8,788 | 957,628.36 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 34,765 | 4,704,399.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 17,027 | 2,071,845.36 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 29,929 | 987,357.71 | |
| | | EQUINIX INC | 6,911 | 3,604,086.50 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 7,285 | 929,784.55 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 31,274 | 2,480,653.68 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST | 5,691 | 1,737,917.58 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 10,092 | 1,115,771.52 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6,029 | 799,988.01 | |
| | | HCP INC | 41,014 | 1,357,973.54 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 67,709 | 1,224,178.72 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 38,000 | 1,062,100.00 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 24,669 | 779,540.40 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 35,407 | 659,986.48 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 11,822 | 609,778.76 | |
| | | MACERICH CO/THE | 10,128 | 341,313.60 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 10,237 | 1,253,827.76 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 14,182 | 768,948.04 | |
| | | PROLOGIS INC | 53,238 | 4,398,523.56 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 13,613 | 3,369,353.63 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 24,440 | 1,728,152.40 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 14,271 | 990,550.11 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 9,366 | 2,198,668.50 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP | 25,938 | 4,267,579.14 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 8,067 | 655,201.74 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 7,365 | 998,252.10 | |
| | | UDR INC | 24,799 | 1,156,873.35 | |
| | | VENTAS INC | 30,413 | 2,140,466.94 | |
| | | VEREIT INC | 77,798 | 710,295.74 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 15,390 | 1,015,893.90 | |
| | | WELLTOWER INC | 31,753 | 2,733,933.30 | |
| | | WP CAREY INC | 13,017 | 1,100,587.35 | |
| | アメリカドル 小計 | | 991,679 | 70,307,744.03<br>(7,664,247,176) | |
| | カナダドル | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 9,455 | 221,436.10 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 15,490 | 411,724.20 | |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 5,631 | 189,877.32 | |
| | カナダドル 小計 | | 30,576 | 823,037.62<br>(68,320,352) | |
| | ユーロ | COVIVIO(FP) | 3,578 | 338,121.00 | |
| | | GECINA SA | 4,459 | 595,276.50 | |
| | | ICADE | 2,845 | 229,164.75 | |
| | | KLEPIERRE | 17,225 | 513,994.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 12,040 | 1,591,688.00 | |
| | ユーロ 小計 | | 40,147 | 3,268,244.25<br>(399,117,987) | |
| | イギリスポンド | BRITISH LAND CO PLC | 79,414 | 437,253.48 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 58,550 | 499,314.40 | |
| | | SEGRO PLC | 102,202 | 774,077.94 | |
| | イギリスポンド 小計 | | 240,166 | 1,710,645.82<br>(232,220,170) | |
| | オーストラリアドル | DEXUS | 94,090 | 1,269,274.10 | |
| | | GOODMAN GROUP | 140,271 | 2,178,408.63 | |
| | | GPT GROUP | 136,015 | 850,093.75 | |
| | | MIRVAC GROUP | 306,089 | 991,728.36 | |
| | | SCENTRE GROUP | 486,663 | 1,970,985.15 | |
| | | STOCKLAND | 207,412 | 927,131.64 | |
| | | VICINITY CENTERS | 291,115 | 762,721.30 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 1,661,655 | 8,950,342.93<br>(675,661,387) | |
| | 香港ドル | LINK REIT | 179,500 | 17,474,325.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 179,500 | 17,474,325.00<br>(243,766,833) | |
| | シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 197,500 | 606,325.00 | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 243,000 | 529,740.00 | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 200,300 | 526,789.00 | |
| | | SUNTEC REIT | 173,000 | 337,350.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | | 813,800 | 2,000,204.00<br>(160,096,328) | |
| 投資証券合計 | | | 3,957,523 | 9,443,430,233<br>(9,443,430,233) | |
| 合計 | | | | 9,708,279,856<br>(9,708,279,856) | |

(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<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカドル | 株式　615銘柄 | 96.8% | — | — | 66.7% |
| | 投資証券　39銘柄 | — | — | 3.2% | 2.2% |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| カナダドル | 株式　85銘柄 | 99.5% | — | — | 3.7% |
| | 投資証券　3銘柄 | — | — | 0.5% | 0.0% |
| ユーロ | 株式　240銘柄 | 99.0% | — | — | 11.4% |
| | 投資証券　5銘柄 | — | — | 1.0% | 0.1% |
| イギリスポンド | 株式　94銘柄 | 98.9% | — | — | 6.0% |
| | 投資証券　3銘柄 | — | — | 1.1% | 0.1% |
| スイスフラン | 株式　39銘柄 | 100.0% | — | — | 3.4% |
| スウェーデンクローナ | 株式　32銘柄 | 100.0% | — | — | 1.0% |
| ノルウェークローネ | 株式　10銘柄 | 100.0% | — | — | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式　17銘柄 | 100.0% | — | — | 0.6% |
| オーストラリアドル | 株式　58銘柄 | 90.7% | — | — | 2.3% |
| | 投資信託受益証券　3銘柄 | — | 1.9% | — | 0.0% |
| | 投資証券　7銘柄 | — | — | 7.4% | 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　37銘柄 | 93.0% | — | — | 1.3% |
| | 投資信託受益証券　2銘柄 | — | 1.9% | — | 0.0% |
| | 投資証券　1銘柄 | — | — | 5.1% | 0.1% |
| シンガポールドル | 株式　21銘柄 | 90.5% | — | — | 0.4% |
| | 投資証券　4銘柄 | — | — | 9.5% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式　8銘柄 | 100.0% | — | — | 0.1% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 217,852,662 |
| コール・ローン | 1,999,855,222 |
| 国債証券 | 374,550,445,173 |
| 派生商品評価勘定 | 14,144,236 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 未収入金 | 834,975 |
| 未収利息 | 2,138,806,249 |
| 前払費用 | 504,163,257 |
| 差入委託証拠金 | 246,648,883 |
| 流動資産合計 | 379,672,750,657 |
| 資産合計 | 379,672,750,657 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 5,145,791 |
| 前受金 | 3,700,012 |
| 未払金 | 7,840,485 |
| 未払解約金 | 203,092,778 |
| 未払利息 | 5,519 |
| その他未払費用 | 96 |
| 流動負債合計 | 219,784,681 |
| 負債合計 | 219,784,681 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 135,846,616,975 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 243,606,349,001 |
| 元本等合計 | 379,452,965,976 |
| 純資産合計 | 379,452,965,976 |
| 負債純資産合計 | 379,672,750,657 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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。<br>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。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |

| | 2019年 7月10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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 135,846,616,975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 2.7932円<br>(1万口当たり純資産額) (27,932円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>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。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 93,020,665,782円 |
| 期中追加設定元本額 | 60,204,833,185円 |
| 期中一部解約元本額 | 17,378,881,992円 |
| 期末元本額 | 135,846,616,975円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,792,851,111円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 729,450,401円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 488,819,106円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,997,471,529円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 7,877,704円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン | 6,164,396,890円 |
| 世界経済インデックスファンド | 6,546,760,306円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,658,674,411円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 1,263,990,675円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 807,538,077円 |
| ＤＣ外国債券インデックス・オープン | 1,863,602,918円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 672,702,477円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 517,747,749円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 231,304,675円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 50,732,800円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 65,642,344円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 31,315,315円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 5,711,615,459円 |
| 外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 617,007,503円 |
| 外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用） | 41,633,723円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,814,559円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,021,753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） | 57,968,845円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 117,772,689円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 181,377,774円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 158,048,512円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 437,965,711円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,202,216,092円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 615,775,064円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,186,192,823円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 878,582,701円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 87,177,234円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 623,978,361円 |
| グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用） | 38,054,503円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 241,562,308円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 298,953,104円 |
| ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 1,000,513,871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） | 783,713,381円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 843,186,808円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ１ | 471,263,268円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,410,439,035円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 3,735,282,821円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 1,251,239,893円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 3,134,446,524円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 258,591,281円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 2,639,813,752円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 633,079,220円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 236,730,528円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 110,743,570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） | 1,065,511,385円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 236,243,459円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 24,334,812,827円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 63,549,267円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 90,016,615円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 124,922,878円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 1,218,175円 |
| グローバル経済コア | 943,115,085円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 5,480,654円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 103,814円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 185,396,092円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 17,043,568円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 16,800円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 22,219円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 27,638円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 32,515円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 867,152,388円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 11,430,618,407円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用） | 351,239,920円 |
| 外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 40,229,452,111円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 6,522,454,271 |
| 合計 | 6,522,454,271 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**債券関連**

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 1,449,608,410 | － | 1,453,308,422 | 3,700,012 |
| 合計 | | 1,449,608,410 | － | 1,453,308,422 | 3,700,012 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**通貨関連**

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,737,947,117 | － | 1,743,245,550 | 5,298,433 |
| | アメリカドル | 836,499,415 | － | 844,689,350 | 8,189,935 |
| | カナダドル | 77,894,311 | － | 78,831,000 | 936,689 |
| | ユーロ | 697,266,441 | － | 694,862,800 | △2,403,641 |
| | イギリスポンド | 126,286,950 | － | 124,862,400 | △1,424,550 |
| 合計 | | 1,737,947,117 | － | 1,743,245,550 | 5,298,433 |

(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。

①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。

②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。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカドル | T 1.125% 02/28/21 | 6,500,000.00 | 6,412,021.46 | |
| | | T 1.125% 06/30/21 | 9,800,000.00 | 9,650,894.56 | |
| | | T 1.125% 07/31/21 | 5,000,000.00 | 4,920,117.20 | |
| | | T 1.125% 09/30/21 | 2,800,000.00 | 2,753,296.86 | |
| | | T 1.25% 03/31/21 | 3,500,000.00 | 3,458,027.33 | |
| | | T 1.25% 07/31/23 | 4,550,000.00 | 4,439,982.41 | |
| | | T 1.25% 10/31/21 | 10,000,000.00 | 9,853,906.30 | |
| | | T 1.375% 01/31/21 | 11,000,000.00 | 10,898,164.08 | |
| | | T 1.375% 04/30/21 | 9,500,000.00 | 9,404,257.86 | |
| | | T 1.375% 05/31/21 | 7,700,000.00 | 7,620,443.36 | |
| | | T 1.375% 06/30/23 | 5,000,000.00 | 4,905,273.45 | |
| | | T 1.375% 08/31/23 | 2,500,000.00 | 2,450,781.25 | |
| | | T 1.375% 09/30/20 | 15,970,000.00 | 15,845,234.37 | |
| | | T 1.375% 09/30/23 | 8,000,000.00 | 7,838,750.00 | |
| | | T 1.375% 10/31/20 | 6,000,000.00 | 5,951,015.64 | |
| | | T 1.5% 01/31/22 | 4,500,000.00 | 4,457,285.14 | |
| | | T 1.5% 02/28/23 | 7,800,000.00 | 7,699,148.41 | |
| | | T 1.5% 03/31/23 | 4,000,000.00 | 3,947,031.24 | |
| | | T 1.5% 07/15/20 | 7,200,000.00 | 7,162,031.23 | |
| | | T 1.5% 08/15/20 | 10,000,000.00 | 9,943,945.30 | |
| | | T 1.5% 08/15/26 | 13,200,000.00 | 12,793,687.50 | |
| | | T 1.625% 02/15/26 | 8,100,000.00 | 7,937,367.22 | |
| | | T 1.625% 04/30/23 | 3,500,000.00 | 3,468,417.96 | |
| | | T 1.625% 05/15/26 | 8,270,000.00 | 8,093,616.44 | |
| | | T 1.625% 05/31/23 | 5,000,000.00 | 4,954,296.90 | |
| | | T 1.625% 06/30/20 | 3,000,000.00 | 2,987,519.52 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 1.625% 07/31/20 | 24,000,000.00 | 23,898,750.00 | |
| | | T 1.625% 08/15/22 | 2,500,000.00 | 2,481,250.00 | |
| | | T 1.625% 08/31/22 | 15,000,000.00 | 14,885,742.15 | |
| | | T 1.625% 10/15/20 | 7,500,000.00 | 7,463,378.92 | |
| | | T 1.625% 10/31/23 | 9,000,000.00 | 8,907,539.04 | |
| | | T 1.625% 11/15/22 | 12,150,000.00 | 12,054,128.96 | |
| | | T 1.625% 11/30/20 | 3,050,000.00 | 3,034,392.57 | |
| | | T 1.75% 01/31/23 | 7,550,000.00 | 7,519,033.22 | |
| | | T 1.75% 02/28/22 | 2,500,000.00 | 2,491,406.25 | |
| | | T 1.75% 03/31/22 | 9,550,000.00 | 9,516,798.85 | |
| | | T 1.75% 04/30/22 | 11,200,000.00 | 11,162,375.05 | |
| | | T 1.75% 05/15/22 | 3,800,000.00 | 3,786,789.07 | |
| | | T 1.75% 05/15/23 | 17,500,000.00 | 17,423,437.50 | |
| | | T 1.75% 05/31/22 | 9,550,000.00 | 9,515,679.68 | |
| | | T 1.75% 06/30/22 | 7,000,000.00 | 6,976,757.83 | |
| | | T 1.75% 09/30/22 | 10,150,000.00 | 10,111,144.58 | |
| | | T 1.75% 10/31/20 | 4,000,000.00 | 3,986,328.12 | |
| | | T 1.75% 11/30/21 | 15,050,000.00 | 15,000,029.33 | |
| | | T 1.75% 12/31/20 | 8,200,000.00 | 8,171,011.68 | |
| | | T 1.875% 01/31/22 | 12,000,000.00 | 11,994,843.72 | |
| | | T 1.875% 02/28/22 | 2,500,000.00 | 2,499,121.10 | |
| | | T 1.875% 03/31/22 | 5,500,000.00 | 5,500,644.54 | |
| | | T 1.875% 04/30/22 | 10,450,000.00 | 10,447,550.83 | |
| | | T 1.875% 06/30/20 | 3,750,000.00 | 3,743,701.16 | |
| | | T 1.875% 07/31/22 | 9,000,000.00 | 9,000,351.54 | |
| | | T 1.875% 08/31/22 | 4,000,000.00 | 4,000,156.24 | |
| | | T 1.875% 10/31/22 | 14,650,000.00 | 14,652,289.06 | |
| | | T 1.875% 11/30/21 | 5,400,000.00 | 5,397,257.82 | |
| | | T 1.875% 12/15/20 | 10,000,000.00 | 9,983,593.80 | |
| | | T 2.125% 01/31/21 | 3,000,000.00 | 3,006,445.32 | |
| | | T 2.125% 02/29/24 | 9,100,000.00 | 9,199,531.25 | |
| | | T 2.125% 03/31/24 | 7,400,000.00 | 7,481,226.54 | |
| | | T 2.125% 05/15/25 | 12,000,000.00 | 12,132,656.28 | |
| | | T 2.125% 06/30/21 | 7,500,000.00 | 7,531,054.72 | |
| | | T 2.125% 06/30/22 | 2,100,000.00 | 2,115,339.84 | |
| | | T 2.125% 07/31/24 | 4,800,000.00 | 4,854,375.02 | |
| | | T 2.125% 08/15/21 | 6,100,000.00 | 6,126,210.96 | |
| | | T 2.125% 08/31/20 | 6,500,000.00 | 6,508,632.84 | |
| | | T 2.125% 09/30/21 | 10,300,000.00 | 10,349,488.30 | |
| | | T 2.125% 09/30/24 | 8,000,000.00 | 8,090,312.48 | |
| | | T 2.125% 11/30/23 | 12,680,000.00 | 12,814,229.71 | |
| | | T 2.125% 12/31/21 | 18,500,000.00 | 18,606,230.51 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.125% 12/31/22 | 5,320,000.00 | 5,365,926.54 | |
| | | T 2.25% 01/31/24 | 4,000,000.00 | 4,064,687.52 | |
| | | T 2.25% 02/15/27 | 8,950,000.00 | 9,121,308.63 | |
| | | T 2.25% 03/31/21 | 3,050,000.00 | 3,064,952.13 | |
| | | T 2.25% 04/15/22 | 10,000,000.00 | 10,098,046.90 | |
| | | T 2.25% 04/30/21 | 3,500,000.00 | 3,518,662.10 | |
| | | T 2.25% 04/30/24 | 15,000,000.00 | 15,256,054.65 | |
| | | T 2.25% 07/31/21 | 3,000,000.00 | 3,019,804.68 | |
| | | T 2.25% 08/15/27 | 8,550,000.00 | 8,710,980.51 | |
| | | T 2.25% 08/15/46 | 19,200,000.00 | 18,112,500.09 | |
| | | T 2.25% 10/31/24 | 6,300,000.00 | 6,410,742.21 | |
| | | T 2.25% 11/15/24 | 10,150,000.00 | 10,328,418.01 | |
| | | T 2.25% 11/15/25 | 4,400,000.00 | 4,480,265.63 | |
| | | T 2.25% 11/15/27 | 14,650,000.00 | 14,918,964.91 | |
| | | T 2.25% 12/31/23 | 11,500,000.00 | 11,683,730.44 | |
| | | T 2.25% 12/31/24 | 8,400,000.00 | 8,550,609.39 | |
| | | T 2.375% 01/31/23 | 15,000,000.00 | 15,258,984.45 | |
| | | T 2.375% 04/15/21 | 11,500,000.00 | 11,583,554.74 | |
| | | T 2.375% 05/15/27 | 18,750,000.00 | 19,281,738.37 | |
| | | T 2.375% 05/15/29 | 3,960,000.00 | 4,070,446.89 | |
| | | T 2.375% 08/15/24 | 12,500,000.00 | 12,793,457.00 | |
| | | T 2.375% 12/31/20 | 11,000,000.00 | 11,059,726.59 | |
| | | T 2.5% 01/15/22 | 15,000,000.00 | 15,221,484.45 | |
| | | T 2.5% 01/31/24 | 6,300,000.00 | 6,470,296.87 | |
| | | T 2.5% 01/31/25 | 5,000,000.00 | 5,155,859.40 | |
| | | T 2.5% 02/15/22 | 7,800,000.00 | 7,920,046.91 | |
| | | T 2.5% 02/15/45 | 6,300,000.00 | 6,269,484.37 | |
| | | T 2.5% 02/15/46 | 16,500,000.00 | 16,391,718.75 | |
| | | T 2.5% 03/31/23 | 4,050,000.00 | 4,141,283.19 | |
| | | T 2.5% 05/15/24 | 2,900,000.00 | 2,983,035.14 | |
| | | T 2.5% 05/15/46 | 16,000,000.00 | 15,890,000.00 | |
| | | T 2.5% 06/30/20 | 6,500,000.00 | 6,527,548.82 | |
| | | T 2.5% 08/15/23 | 4,550,000.00 | 4,663,572.27 | |
| | | T 2.5% 12/31/20 | 10,000,000.00 | 10,072,460.90 | |
| | | T 2.625% 01/31/26 | 18,000,000.00 | 18,743,906.34 | |
| | | T 2.625% 02/15/29 | 15,000,000.00 | 15,737,109.45 | |
| | | T 2.625% 02/28/23 | 1,400,000.00 | 1,436,859.38 | |
| | | T 2.625% 03/31/25 | 7,250,000.00 | 7,527,539.06 | |
| | | T 2.625% 05/15/21 | 10,580,000.00 | 10,710,803.50 | |
| | | T 2.625% 06/30/23 | 6,200,000.00 | 6,378,492.17 | |
| | | T 2.625% 07/15/21 | 3,350,000.00 | 3,396,324.23 | |
| | | T 2.625% 07/31/20 | 12,700,000.00 | 12,777,638.65 | |
| | | T 2.625% 08/15/20 | 5,500,000.00 | 5,535,986.33 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.625% 11/15/20 | 11,000,000.00 | 11,088,945.34 | |
| | | T 2.625% 12/31/23 | 11,500,000.00 | 11,866,113.31 | |
| | | T 2.625% 12/31/25 | 16,700,000.00 | 17,385,613.32 | |
| | | T 2.75% 02/15/24 | 3,000,000.00 | 3,115,898.43 | |
| | | T 2.75% 02/15/28 | 10,400,000.00 | 11,000,437.55 | |
| | | T 2.75% 04/30/23 | 7,600,000.00 | 7,843,437.50 | |
| | | T 2.75% 05/31/23 | 20,000,000.00 | 20,653,906.20 | |
| | | T 2.75% 06/30/25 | 10,500,000.00 | 10,986,855.49 | |
| | | T 2.75% 07/31/23 | 6,000,000.00 | 6,204,140.64 | |
| | | T 2.75% 08/15/21 | 11,000,000.00 | 11,187,343.75 | |
| | | T 2.75% 08/15/42 | 3,000,000.00 | 3,142,734.39 | |
| | | T 2.75% 08/15/47 | 9,950,000.00 | 10,368,210.93 | |
| | | T 2.75% 08/31/25 | 6,900,000.00 | 7,225,324.23 | |
| | | T 2.75% 09/30/20 | 11,100,000.00 | 11,196,908.21 | |
| | | T 2.75% 11/15/23 | 6,900,000.00 | 7,152,281.25 | |
| | | T 2.75% 11/15/42 | 4,200,000.00 | 4,395,562.50 | |
| | | T 2.75% 11/15/47 | 9,050,000.00 | 9,431,796.87 | |
| | | T 2.875% 04/30/25 | 10,000,000.00 | 10,522,265.60 | |
| | | T 2.875% 05/15/28 | 14,260,000.00 | 15,234,804.75 | |
| | | T 2.875% 05/15/43 | 11,500,000.00 | 12,283,437.50 | |
| | | T 2.875% 05/31/25 | 5,800,000.00 | 6,106,085.95 | |
| | | T 2.875% 07/31/25 | 9,460,000.00 | 9,969,583.61 | |
| | | T 2.875% 08/15/28 | 15,920,000.00 | 17,021,962.50 | |
| | | T 2.875% 08/15/45 | 10,900,000.00 | 11,634,046.87 | |
| | | T 2.875% 09/30/23 | 4,750,000.00 | 4,941,484.37 | |
| | | T 2.875% 10/15/21 | 12,250,000.00 | 12,512,226.56 | |
| | | T 2.875% 10/31/20 | 13,000,000.00 | 13,140,917.92 | |
| | | T 2.875% 10/31/23 | 11,000,000.00 | 11,451,171.93 | |
| | | T 2.875% 11/15/21 | 8,350,000.00 | 8,536,570.31 | |
| | | T 2% 02/15/22 | 2,500,000.00 | 2,507,617.20 | |
| | | T 2% 02/15/23 | 12,000,000.00 | 12,054,374.99 | |
| | | T 2% 02/15/25 | 8,400,000.00 | 8,437,406.29 | |
| | | T 2% 02/28/21 | 4,000,000.00 | 4,001,796.88 | |
| | | T 2% 04/30/24 | 10,000,000.00 | 10,053,906.30 | |
| | | T 2% 05/31/21 | 3,800,000.00 | 3,804,527.35 | |
| | | T 2% 05/31/24 | 8,000,000.00 | 8,048,437.52 | |
| | | T 2% 06/30/24 | 10,500,000.00 | 10,557,011.74 | |
| | | T 2% 07/31/20 | 5,200,000.00 | 5,199,187.50 | |
| | | T 2% 07/31/22 | 3,000,000.00 | 3,011,132.82 | |
| | | T 2% 08/15/25 | 12,300,000.00 | 12,345,644.56 | |
| | | T 2% 08/31/21 | 6,800,000.00 | 6,811,953.10 | |
| | | T 2% 09/30/20 | 5,000,000.00 | 4,999,316.40 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2% 10/31/21 | 5,650,000.00 | 5,663,021.49 | |
| | | T 2% 11/15/21 | 2,400,000.00 | 2,406,843.74 | |
| | | T 2% 11/15/26 | 10,220,000.00 | 10,240,759.37 | |
| | | T 2% 11/30/20 | 5,500,000.00 | 5,499,462.87 | |
| | | T 2% 11/30/22 | 2,000,000.00 | 2,008,359.38 | |
| | | T 2% 12/31/21 | 2,200,000.00 | 2,206,273.43 | |
| | | T 3.125% 02/15/42 | 2,350,000.00 | 2,622,820.31 | |
| | | T 3.125% 02/15/43 | 5,000,000.00 | 5,567,578.15 | |
| | | T 3.125% 05/15/21 | 5,300,000.00 | 5,413,349.61 | |
| | | T 3.125% 05/15/48 | 4,700,000.00 | 5,266,203.12 | |
| | | T 3.125% 08/15/44 | 12,000,000.00 | 13,371,562.56 | |
| | | T 3.125% 11/15/28 | 14,400,000.00 | 15,712,875.07 | |
| | | T 3.125% 11/15/41 | 3,250,000.00 | 3,628,828.12 | |
| | | T 3.375% 05/15/44 | 6,610,000.00 | 7,672,247.68 | |
| | | T 3.375% 11/15/48 | 8,300,000.00 | 9,753,796.87 | |
| | | T 3.5% 02/15/39 | 3,930,000.00 | 4,652,137.50 | |
| | | T 3.625% 02/15/21 | 11,100,000.00 | 11,386,388.65 | |
| | | T 3.625% 02/15/44 | 7,500,000.00 | 9,050,976.60 | |
| | | T 3.625% 08/15/43 | 2,000,000.00 | 2,411,250.00 | |
| | | T 3.75% 08/15/41 | 2,000,000.00 | 2,450,000.00 | |
| | | T 3.75% 11/15/43 | 12,500,000.00 | 15,368,164.12 | |
| | | T 3.875% 08/15/40 | 3,150,000.00 | 3,923,964.85 | |
| | | T 3% 02/15/48 | 4,450,000.00 | 4,867,187.50 | |
| | | T 3% 02/15/49 | 14,970,000.00 | 16,413,201.55 | |
| | | T 3% 05/15/42 | 1,950,000.00 | 2,131,746.10 | |
| | | T 3% 05/15/45 | 3,500,000.00 | 3,822,656.25 | |
| | | T 3% 05/15/47 | 7,750,000.00 | 8,475,351.56 | |
| | | T 3% 08/15/48 | 9,550,000.00 | 10,458,742.18 | |
| | | T 3% 09/30/25 | 15,000,000.00 | 15,931,640.70 | |
| | | T 3% 10/31/25 | 10,000,000.00 | 10,626,171.90 | |
| | | T 3% 11/15/44 | 6,050,000.00 | 6,600,171.87 | |
| | | T 4.25% 05/15/39 | 900,000.00 | 1,173,304.69 | |
| | | T 4.25% 11/15/40 | 4,350,000.00 | 5,692,722.67 | |
| | | T 4.375% 02/15/38 | 1,000,000.00 | 1,317,343.75 | |
| | | T 4.375% 05/15/40 | 1,900,000.00 | 2,522,992.19 | |
| | | T 4.375% 05/15/41 | 2,650,000.00 | 3,529,882.81 | |
| | | T 4.375% 11/15/39 | 2,700,000.00 | 3,578,765.62 | |
| | | T 4.5% 02/15/36 | 3,840,000.00 | 5,045,700.01 | |
| | | T 4.5% 05/15/38 | 1,600,000.00 | 2,142,000.00 | |
| | | T 4.5% 08/15/39 | 1,700,000.00 | 2,289,023.44 | |
| | | T 4.625% 02/15/40 | 8,700,000.00 | 11,911,523.48 | |
| | | T 4.75% 02/15/41 | 2,950,000.00 | 4,117,324.23 | |
| | | T 5.0% 05/15/37 | 1,100,000.00 | 1,545,070.31 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | T 5.25% 02/15/29 | 1,250,000.00 | 1,597,460.93 | |
| | T 5.25% 11/15/28 | 1,300,000.00 | 1,654,148.44 | |
| | T 5.375% 02/15/31 | 3,300,000.00 | 4,408,078.12 | |
| | T 5.5% 08/15/28 | 1,200,000.00 | 1,544,906.25 | |
| | T 6.0% 02/15/26 | 1,700,000.00 | 2,125,929.69 | |
| | T 6.125% 11/15/27 | 1,450,000.00 | 1,907,996.10 | |
| | T 6.25% 05/15/30 | 1,900,000.00 | 2,666,531.25 | |
| | T 6.25% 08/15/23 | 1,650,000.00 | 1,934,109.37 | |
| | T 8.0% 11/15/21 | 1,700,000.00 | 1,935,277.34 | |
| **アメリカドル 小計** | | 1,568,040,000.00 | 1,618,648,946.15<br>(176,448,921,619) | |
| **カナダドル** | CAN 0.5% 03/01/22 | 3,100,000.00 | 3,012,564.50 | |
| | CAN 0.75% 03/01/21 | 5,690,000.00 | 5,606,214.75 | |
| | CAN 0.75% 09/01/20 | 5,320,000.00 | 5,262,304.60 | |
| | CAN 0.75% 09/01/21 | 1,630,000.00 | 1,600,660.00 | |
| | CAN 1.5% 06/01/23 | 3,200,000.00 | 3,189,696.00 | |
| | CAN 1.5% 06/01/26 | 2,300,000.00 | 2,291,329.00 | |
| | CAN 1.5% 09/01/24 | 600,000.00 | 598,335.00 | |
| | CAN 1.75% 03/01/23 | 4,000,000.00 | 4,022,380.00 | |
| | CAN 1.75% 05/01/21 | 2,700,000.00 | 2,705,319.00 | |
| | CAN 1% 06/01/27 | 1,970,000.00 | 1,887,151.65 | |
| | CAN 1% 09/01/22 | 1,500,000.00 | 1,473,180.00 | |
| | CAN 2.25% 03/01/24 | 2,300,000.00 | 2,369,908.50 | |
| | CAN 2.25% 06/01/25 | 2,850,000.00 | 2,960,309.25 | |
| | CAN 2.25% 06/01/29 | 2,860,000.00 | 3,036,447.70 | |
| | CAN 2.5% 06/01/24 | 3,060,000.00 | 3,195,206.10 | |
| | CAN 2.75% 06/01/22 | 4,910,000.00 | 5,069,697.75 | |
| | CAN 2.75% 12/01/48 | 2,870,000.00 | 3,545,899.35 | |
| | CAN 2.75% 12/01/64 | 790,000.00 | 1,055,463.70 | |
| | CAN 2% 06/01/28 | 2,140,000.00 | 2,215,531.30 | |
| | CAN 2% 09/01/23 | 2,110,000.00 | 2,145,205.35 | |
| | CAN 2% 11/01/20 | 2,110,000.00 | 2,118,239.55 | |
| | CAN 2% 12/01/51 | 950,000.00 | 1,016,671.00 | |
| | CAN 3.25% 06/01/21 | 5,630,000.00 | 5,798,562.20 | |
| | CAN 3.5% 12/01/45 | 3,330,000.00 | 4,568,626.80 | |
| | CAN 4.0% 06/01/41 | 2,730,000.00 | 3,851,374.80 | |
| | CAN 5.75% 06/01/29 | 2,170,000.00 | 2,989,109.90 | |
| | CAN 5.75% 06/01/33 | 1,750,000.00 | 2,640,426.25 | |
| | CAN 5% 06/01/37 | 2,320,000.00 | 3,497,295.60 | |
| | CAN 8.0% 06/01/27 | 1,850,000.00 | 2,728,703.75 | |
| **カナダドル 小計** | | 78,740,000.00 | 86,451,813.35<br>(7,176,365,026) | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 16,950,000.00 | 20,495,516.25 | |
| | MBONO 10% 12/05/24 | 38,840,000.00 | 43,317,281.00 | |
| | MBONO 5.75% 03/05/26 | 38,070,000.00 | 34,661,592.90 | |
| | MBONO 6.5% 06/09/22 | 46,700,000.00 | 45,528,297.00 | |
| | MBONO 6.5% 06/10/21 | 63,590,000.00 | 62,496,252.00 | |
| | MBONO 7.25% 12/09/21 | 25,330,000.00 | 25,196,130.95 | |
| | MBONO 7.5% 06/03/27 | 54,070,000.00 | 54,018,092.80 | |
| | MBONO 7.75% 05/29/31 | 33,600,000.00 | 33,984,384.00 | |
| | MBONO 7.75% 11/13/42 | 32,690,000.00 | 32,204,390.05 | |
| | MBONO 7.75% 11/23/34 | 19,630,000.00 | 19,748,368.90 | |
| | MBONO 8.5% 05/31/29 | 27,230,000.00 | 29,051,142.40 | |
| | MBONO 8.5% 11/18/38 | 24,110,000.00 | 25,694,991.40 | |
| | MBONO 8% 09/05/24 | 10,400,000.00 | 10,648,820.00 | |
| | MBONO 8% 11/07/47 | 18,970,000.00 | 19,133,900.80 | |
| | MBONO 8% 12/07/23 | 45,700,000.00 | 46,666,555.00 | |
| メキシコペソ 小計 | | 495,880,000.00 | 502,845,715.45<br>(2,866,220,578) | |
| ユーロ | BGB 0.2% 10/22/23 | 2,200,000.00 | 2,269,938.00 | |
| | BGB 0.5% 10/22/24 | 2,270,000.00 | 2,382,115.30 | |
| | BGB 0.8% 06/22/25 | 3,100,000.00 | 3,315,636.00 | |
| | BGB 0.8% 06/22/27 | 3,110,000.00 | 3,353,777.35 | |
| | BGB 0.8% 06/22/28 | 3,160,000.00 | 3,410,414.20 | |
| | BGB 0.9% 06/22/29 | 2,040,000.00 | 2,219,530.20 | |
| | BGB 1.25% 04/22/33 | 850,000.00 | 960,202.50 | |
| | BGB 1.45% 06/22/37 | 800,000.00 | 921,888.00 | |
| | BGB 1.6% 06/22/47 | 2,260,000.00 | 2,658,415.40 | |
| | BGB 1.7% 06/22/50 | 1,250,000.00 | 1,489,418.75 | |
| | BGB 1.9% 06/22/38 | 1,100,000.00 | 1,357,229.50 | |
| | BGB 1% 06/22/26 | 2,930,000.00 | 3,192,615.90 | |
| | BGB 1% 06/22/31 | 1,490,000.00 | 1,635,692.20 | |
| | BGB 2.15% 06/22/66 | 1,000,000.00 | 1,332,205.00 | |
| | BGB 2.25% 06/22/23 | 2,660,000.00 | 2,962,375.50 | |
| | BGB 2.25% 06/22/57 | 800,000.00 | 1,073,628.00 | |
| | BGB 2.6% 06/22/24 | 2,140,000.00 | 2,469,977.30 | |
| | BGB 3.75% 06/22/45 | 1,600,000.00 | 2,707,440.00 | |
| | BGB 3.75% 09/28/20 | 3,270,000.00 | 3,444,356.40 | |
| | BGB 3% 06/22/34 | 2,050,000.00 | 2,840,562.00 | |
| | BGB 4.25% 03/28/41 | 3,370,000.00 | 5,791,210.20 | |
| | BGB 4.25% 09/28/21 | 2,350,000.00 | 2,608,488.25 | |
| | BGB 4.25% 09/28/22 | 3,290,000.00 | 3,813,274.50 | |
| | BGB 4.5% 03/28/26 | 2,420,000.00 | 3,209,633.90 | |
| | BGB 4% 03/28/22 | 3,100,000.00 | 3,495,777.00 | |
| | BGB 4% 03/28/32 | 1,580,000.00 | 2,338,068.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BGB 5.5% 03/28/28 | 2,780,000.00 | 4,150,943.10 | |
| | | BGB 5% 03/28/35 | 3,580,000.00 | 6,085,695.70 | |
| | | BKO 0% 03/12/21 | 2,960,000.00 | 2,996,733.60 | |
| | | BTPS 0.05% 04/15/21 | 7,190,000.00 | 7,187,159.95 | |
| | | BTPS 0.2% 10/15/20 | 1,390,000.00 | 1,394,705.15 | |
| | | BTPS 0.35% 11/01/21 | 2,580,000.00 | 2,585,856.60 | |
| | | BTPS 0.45% 06/01/21 | 1,400,000.00 | 1,409,338.00 | |
| | | BTPS 0.65% 10/15/23 | 4,150,000.00 | 4,132,258.75 | |
| | | BTPS 0.65% 11/01/20 | 1,550,000.00 | 1,564,508.00 | |
| | | BTPS 0.9% 08/01/22 | 3,180,000.00 | 3,213,056.10 | |
| | | BTPS 0.95% 03/01/23 | 3,500,000.00 | 3,531,710.00 | |
| | | BTPS 0.95% 03/15/23 | 6,500,000.00 | 6,561,067.50 | |
| | | BTPS 1.2% 04/01/22 | 1,450,000.00 | 1,478,507.00 | |
| | | BTPS 1.25% 12/01/26 | 4,200,000.00 | 4,186,791.00 | |
| | | BTPS 1.35% 04/15/22 | 2,900,000.00 | 2,968,121.00 | |
| | | BTPS 1.45% 05/15/25 | 2,300,000.00 | 2,337,605.00 | |
| | | BTPS 1.45% 09/15/22 | 1,050,000.00 | 1,078,308.00 | |
| | | BTPS 1.45% 11/15/24 | 1,300,000.00 | 1,326,728.00 | |
| | | BTPS 1.5% 06/01/25 | 2,910,000.00 | 2,966,032.05 | |
| | | BTPS 1.6% 06/01/26 | 3,600,000.00 | 3,681,792.00 | |
| | | BTPS 1.65% 03/01/32 | 5,250,000.00 | 5,110,350.00 | |
| | | BTPS 1.75% 07/01/24 | 4,000,000.00 | 4,141,720.00 | |
| | | BTPS 1.85% 05/15/24 | 2,000,000.00 | 2,086,240.00 | |
| | | BTPS 1% 07/15/22 | 3,600,000.00 | 3,647,232.00 | |
| | | BTPS 2.05% 08/01/27 | 3,850,000.00 | 4,025,598.50 | |
| | | BTPS 2.15% 12/15/21 | 2,500,000.00 | 2,608,362.50 | |
| | | BTPS 2.2% 06/01/27 | 6,300,000.00 | 6,660,328.50 | |
| | | BTPS 2.25% 09/01/36 | 2,650,000.00 | 2,688,027.50 | |
| | | BTPS 2.3% 10/15/21 | 2,700,000.00 | 2,822,188.50 | |
| | | BTPS 2.45% 09/01/33 | 2,500,000.00 | 2,624,037.50 | |
| | | BTPS 2.45% 10/01/23 | 3,000,000.00 | 3,199,290.00 | |
| | | BTPS 2.5% 11/15/25 | 2,950,000.00 | 3,173,418.25 | |
| | | BTPS 2.5% 12/01/24 | 6,400,000.00 | 6,875,040.00 | |
| | | BTPS 2.7% 03/01/47 | 3,000,000.00 | 3,104,130.00 | |
| | | BTPS 2.8% 03/01/67 | 1,320,000.00 | 1,315,413.00 | |
| | | BTPS 2.8% 12/01/28 | 5,700,000.00 | 6,289,921.50 | |
| | | BTPS 2.95% 09/01/38 | 2,540,000.00 | 2,770,911.40 | |
| | | BTPS 2% 02/01/28 | 1,650,000.00 | 1,720,413.75 | |
| | | BTPS 2% 12/01/25 | 3,150,000.00 | 3,298,081.50 | |
| | | BTPS 3.1% 03/01/40 | 750,000.00 | 826,440.00 | |
| | | BTPS 3.25% 09/01/46 | 3,500,000.00 | 3,972,010.00 | |
| | | BTPS 3.35% 03/01/35 | 3,390,000.00 | 3,903,652.80 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 3.45% 03/01/48 | 2,530,000.00 | 2,960,074.70 | |
| | | BTPS 3.5% 03/01/30 | 6,430,000.00 | 7,466,966.10 | |
| | | BTPS 3.75% 03/01/21 | 3,800,000.00 | 4,031,895.00 | |
| | | BTPS 3.75% 05/01/21 | 3,100,000.00 | 3,303,933.50 | |
| | | BTPS 3.75% 08/01/21 | 7,990,000.00 | 8,565,719.45 | |
| | | BTPS 3.75% 09/01/24 | 2,150,000.00 | 2,438,626.75 | |
| | | BTPS 3.85% 09/01/49 | 2,270,000.00 | 2,796,413.00 | |
| | | BTPS 3% 08/01/29 | 2,100,000.00 | 2,346,718.50 | |
| | | BTPS 4.5% 03/01/24 | 4,650,000.00 | 5,398,301.25 | |
| | | BTPS 4.5% 03/01/26 | 6,160,000.00 | 7,419,288.80 | |
| | | BTPS 4.5% 05/01/23 | 3,900,000.00 | 4,447,930.50 | |
| | | BTPS 4.75% 08/01/23 | 4,200,000.00 | 4,863,390.00 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/21 | 3,950,000.00 | 4,326,968.25 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/28 | 3,490,000.00 | 4,452,751.40 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/44 | 2,940,000.00 | 4,081,131.60 | |
| | | BTPS 4% 02/01/37 | 5,470,000.00 | 6,817,561.85 | |
| | | BTPS 4% 09/01/20 | 4,400,000.00 | 4,603,632.00 | |
| | | BTPS 5.0% 08/01/39 | 4,300,000.00 | 6,029,825.50 | |
| | | BTPS 5.25% 11/01/29 | 4,760,000.00 | 6,306,976.20 | |
| | | BTPS 5.5% 09/01/22 | 3,400,000.00 | 3,917,735.00 | |
| | | BTPS 5.5% 11/01/22 | 3,450,000.00 | 3,994,772.25 | |
| | | BTPS 5.75% 02/01/33 | 3,350,000.00 | 4,790,751.25 | |
| | | BTPS 5% 03/01/22 | 6,600,000.00 | 7,388,568.00 | |
| | | BTPS 5% 03/01/25 | 2,650,000.00 | 3,207,745.50 | |
| | | BTPS 5% 08/01/34 | 3,690,000.00 | 5,034,654.45 | |
| | | BTPS 5% 09/01/40 | 4,020,000.00 | 5,625,829.20 | |
| | | BTPS 6.5% 11/01/27 | 5,620,000.00 | 7,810,760.30 | |
| | | BTPS 6% 05/01/31 | 4,800,000.00 | 6,852,168.00 | |
| | | BTPS 7.25% 11/01/26 | 1,400,000.00 | 1,969,016.00 | |
| | | BTPS 9% 11/01/23 | 800,000.00 | 1,075,056.00 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/27 | 4,190,000.00 | 4,439,053.60 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/29 | 3,510,000.00 | 3,718,546.65 | |
| | | DBR 0.25% 08/15/28 | 4,160,000.00 | 4,409,808.00 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/25 | 3,790,000.00 | 4,035,459.35 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/26 | 5,000,000.00 | 5,363,700.00 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/28 | 5,820,000.00 | 6,302,710.80 | |
| | | DBR 0.5% 08/15/27 | 4,650,000.00 | 5,028,835.50 | |
| | | DBR 0% 08/15/26 | 4,960,000.00 | 5,157,556.80 | |
| | | DBR 1.25% 08/15/48 | 2,740,000.00 | 3,507,734.30 | |
| | | DBR 1.5% 02/15/23 | 5,270,000.00 | 5,701,902.85 | |
| | | DBR 1.5% 05/15/23 | 2,950,000.00 | 3,206,532.00 | |
| | | DBR 1.5% 05/15/24 | 2,290,000.00 | 2,536,232.25 | |
| | | DBR 1.5% 09/04/22 | 2,800,000.00 | 3,002,034.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DBR 1.75% 02/15/24 | 1,650,000.00 | 1,838,553.75 | |
| | | DBR 1.75% 07/04/22 | 3,650,000.00 | 3,926,542.25 | |
| | | DBR 1% 08/15/24 | 3,200,000.00 | 3,476,112.00 | |
| | | DBR 1% 08/15/25 | 4,920,000.00 | 5,412,984.00 | |
| | | DBR 2.25% 09/04/20 | 2,500,000.00 | 2,585,937.50 | |
| | | DBR 2.25% 09/04/21 | 1,950,000.00 | 2,077,179.00 | |
| | | DBR 2.5% 01/04/21 | 2,900,000.00 | 3,042,999.00 | |
| | | DBR 2.5% 07/04/44 | 5,520,000.00 | 8,644,982.40 | |
| | | DBR 2.5% 08/15/46 | 5,090,000.00 | 8,145,043.45 | |
| | | DBR 2% 01/04/22 | 3,300,000.00 | 3,529,201.50 | |
| | | DBR 2% 08/15/23 | 3,850,000.00 | 4,285,935.50 | |
| | | DBR 3.25% 07/04/21 | 10,190,000.00 | 11,004,639.55 | |
| | | DBR 3.25% 07/04/42 | 2,600,000.00 | 4,449,185.00 | |
| | | DBR 3% 07/04/20 | 9,950,000.00 | 10,313,473.50 | |
| | | DBR 4.0% 01/04/37 | 4,060,000.00 | 6,940,468.50 | |
| | | DBR 4.25% 07/04/39 | 2,700,000.00 | 4,964,193.00 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/28 | 2,550,000.00 | 3,766,005.75 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/34 | 4,130,000.00 | 7,189,627.90 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/40 | 3,210,000.00 | 6,359,668.05 | |
| | | DBR 5.5% 01/04/31 | 3,430,000.00 | 5,766,241.60 | |
| | | DBR 5.625% 01/04/28 | 2,460,000.00 | 3,762,791.40 | |
| | | DBR 6.25% 01/04/24 | 2,000,000.00 | 2,635,120.00 | |
| | | DBR 6.25% 01/04/30 | 1,250,000.00 | 2,136,631.25 | |
| | | DBR 6.5% 07/04/27 | 650,000.00 | 1,020,922.50 | |
| | | FRTR 0.25% 11/25/20 | 5,000,000.00 | 5,061,225.00 | |
| | | FRTR 0.25% 11/25/26 | 4,850,000.00 | 5,049,359.25 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/25 | 6,890,000.00 | 7,271,189.25 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/26 | 9,280,000.00 | 9,823,808.00 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/29 | 7,000,000.00 | 7,384,510.00 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/28 | 8,430,000.00 | 9,113,546.55 | |
| | | FRTR 0.75% 11/25/28 | 7,510,000.00 | 8,116,695.35 | |
| | | FRTR 0% 02/25/21 | 6,000,000.00 | 6,066,060.00 | |
| | | FRTR 0% 03/25/23 | 11,000,000.00 | 11,260,150.00 | |
| | | FRTR 0% 03/25/24 | 11,240,000.00 | 11,524,709.20 | |
| | | FRTR 0% 03/25/25 | 2,530,000.00 | 2,592,048.25 | |
| | | FRTR 0% 05/25/21 | 4,100,000.00 | 4,151,127.00 | |
| | | FRTR 0% 05/25/22 | 5,550,000.00 | 5,657,531.25 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/34 | 3,950,000.00 | 4,495,455.50 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/36 | 6,420,000.00 | 7,286,828.40 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/31 | 8,820,000.00 | 10,279,224.90 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/50 | 2,020,000.00 | 2,354,188.80 | |
| | | FRTR 1.75% 05/25/23 | 4,590,000.00 | 5,017,833.90 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRTR 1.75% 05/25/66 | 1,860,000.00 | 2,330,961.30 | |
| | | FRTR 1.75% 06/25/39 | 4,040,000.00 | 4,969,846.40 | |
| | | FRTR 1.75% 11/25/24 | 8,710,000.00 | 9,772,881.30 | |
| | | FRTR 1% 05/25/27 | 6,650,000.00 | 7,311,043.25 | |
| | | FRTR 1% 11/25/25 | 7,200,000.00 | 7,846,884.00 | |
| | | FRTR 2.25% 05/25/24 | 3,100,000.00 | 3,527,366.00 | |
| | | FRTR 2.25% 10/25/22 | 5,740,000.00 | 6,296,693.90 | |
| | | FRTR 2.5% 05/25/30 | 7,960,000.00 | 10,116,762.00 | |
| | | FRTR 2.5% 10/25/20 | 5,450,000.00 | 5,671,787.75 | |
| | | FRTR 2.75% 10/25/27 | 5,000,000.00 | 6,258,475.00 | |
| | | FRTR 2% 05/25/48 | 4,840,000.00 | 6,302,575.40 | |
| | | FRTR 3.25% 05/25/45 | 5,070,000.00 | 8,102,823.30 | |
| | | FRTR 3.25% 10/25/21 | 10,850,000.00 | 11,838,163.75 | |
| | | FRTR 3.5% 04/25/26 | 5,670,000.00 | 7,194,039.30 | |
| | | FRTR 3.75% 04/25/21 | 11,370,000.00 | 12,277,553.40 | |
| | | FRTR 3% 04/25/22 | 8,520,000.00 | 9,404,674.20 | |
| | | FRTR 4.25% 10/25/23 | 6,250,000.00 | 7,573,625.00 | |
| | | FRTR 4.5% 04/25/41 | 6,640,000.00 | 12,018,765.20 | |
| | | FRTR 4.75% 04/25/35 | 4,200,000.00 | 7,100,436.00 | |
| | | FRTR 4% 04/25/55 | 2,900,000.00 | 5,599,798.50 | |
| | | FRTR 4% 04/25/60 | 2,450,000.00 | 4,921,915.25 | |
| | | FRTR 4% 10/25/38 | 4,880,000.00 | 8,074,618.80 | |
| | | FRTR 5.5% 04/25/29 | 4,050,000.00 | 6,289,994.25 | |
| | | FRTR 5.75% 10/25/32 | 5,410,000.00 | 9,415,861.55 | |
| | | FRTR 6.0% 10/25/25 | 1,900,000.00 | 2,676,492.00 | |
| | | FRTR 8.5% 04/25/23 | 1,000,000.00 | 1,351,730.00 | |
| | | IRISH 0.8% 03/15/22 | 2,040,000.00 | 2,112,991.20 | |
| | | IRISH 0.9% 05/15/28 | 1,710,000.00 | 1,847,851.65 | |
| | | IRISH 0% 10/18/22 | 1,340,000.00 | 1,361,594.10 | |
| | | IRISH 1.1% 05/15/29 | 790,000.00 | 865,618.80 | |
| | | IRISH 1.3% 05/15/33 | 780,000.00 | 864,470.10 | |
| | | IRISH 1.35% 03/18/31 | 730,000.00 | 819,596.55 | |
| | | IRISH 1.5% 05/15/50 | 870,000.00 | 973,764.90 | |
| | | IRISH 1.7% 05/15/37 | 940,000.00 | 1,099,898.70 | |
| | | IRISH 1% 05/15/26 | 2,040,000.00 | 2,206,780.20 | |
| | | IRISH 2.4% 05/15/30 | 1,630,000.00 | 2,014,557.75 | |
| | | IRISH 2% 02/18/45 | 1,480,000.00 | 1,865,739.80 | |
| | | IRISH 3.4% 03/18/24 | 1,470,000.00 | 1,733,872.35 | |
| | | IRISH 3.9% 03/20/23 | 1,290,000.00 | 1,500,005.55 | |
| | | IRISH 5.4% 03/13/25 | 2,370,000.00 | 3,139,278.30 | |
| | | IRISH 5% 10/18/20 | 230,000.00 | 246,431.20 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/25 | 2,880,000.00 | 3,012,696.00 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/29 | 1,600,000.00 | 1,672,608.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | NETHER 0.5% 01/15/40 | 1,280,000.00 | 1,350,265.60 | |
| | | NETHER 0.5% 07/15/26 | 2,620,000.00 | 2,795,409.00 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/27 | 4,530,000.00 | 4,935,253.80 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/28 | 2,540,000.00 | 2,780,906.30 | |
| | | NETHER 0% 01/15/22 | 3,500,000.00 | 3,562,440.00 | |
| | | NETHER 0% 01/15/24 | 3,410,000.00 | 3,504,098.95 | |
| | | NETHER 1.75% 07/15/23 | 2,950,000.00 | 3,239,808.00 | |
| | | NETHER 2.25% 07/15/22 | 1,660,000.00 | 1,810,570.30 | |
| | | NETHER 2.5% 01/15/33 | 2,430,000.00 | 3,267,827.55 | |
| | | NETHER 2.75% 01/15/47 | 2,680,000.00 | 4,449,269.00 | |
| | | NETHER 2% 07/15/24 | 2,750,000.00 | 3,111,528.75 | |
| | | NETHER 3.25% 07/15/21 | 2,050,000.00 | 2,215,301.75 | |
| | | NETHER 3.5% 07/15/20 | 3,640,000.00 | 3,794,336.00 | |
| | | NETHER 3.75% 01/15/23 | 3,170,000.00 | 3,673,142.40 | |
| | | NETHER 3.75% 01/15/42 | 2,900,000.00 | 5,185,113.00 | |
| | | NETHER 4% 01/15/37 | 2,740,000.00 | 4,615,461.50 | |
| | | NETHER 5.5% 01/15/28 | 1,140,000.00 | 1,717,786.20 | |
| | | NETHER 7.5% 01/15/23 | 200,000.00 | 258,571.00 | |
| | | OBL 0.25% 10/16/20 | 2,250,000.00 | 2,277,652.50 | |
| | | OBL 0% 04/05/24 | 5,900,000.00 | 6,090,186.50 | |
| | | OBL 0% 04/09/21 | 4,450,000.00 | 4,507,872.25 | |
| | | OBL 0% 04/14/23 | 2,220,000.00 | 2,281,982.40 | |
| | | OBL 0% 10/07/22 | 3,490,000.00 | 3,576,133.20 | |
| | | OBL 0% 10/08/21 | 2,600,000.00 | 2,644,278.00 | |
| | | OBL 0% 10/13/23 | 2,930,000.00 | 3,019,907.05 | |
| | | RAGB 0.5% 02/20/29 | 780,000.00 | 825,045.00 | |
| | | RAGB 0.5% 04/20/27 | 2,100,000.00 | 2,229,360.00 | |
| | | RAGB 0.75% 02/20/28 | 2,870,000.00 | 3,108,611.80 | |
| | | RAGB 0.75% 10/20/26 | 3,310,000.00 | 3,570,712.15 | |
| | | RAGB 0% 07/15/23 | 1,380,000.00 | 1,412,643.90 | |
| | | RAGB 0% 09/20/22 | 1,100,000.00 | 1,122,533.50 | |
| | | RAGB 1.2% 10/20/25 | 1,710,000.00 | 1,887,275.70 | |
| | | RAGB 1.5% 02/20/47 | 1,130,000.00 | 1,384,069.20 | |
| | | RAGB 1.5% 11/02/86 | 640,000.00 | 805,260.80 | |
| | | RAGB 1.65% 10/21/24 | 1,870,000.00 | 2,085,199.60 | |
| | | RAGB 1.75% 10/20/23 | 2,330,000.00 | 2,565,260.10 | |
| | | RAGB 2.1% 09/20/17 | 770,000.00 | 1,226,044.05 | |
| | | RAGB 2.4% 05/23/34 | 1,320,000.00 | 1,738,882.20 | |
| | | RAGB 3.15% 06/20/44 | 1,330,000.00 | 2,150,470.35 | |
| | | RAGB 3.4% 11/22/22 | 2,550,000.00 | 2,899,643.25 | |
| | | RAGB 3.5% 09/15/21 | 2,170,000.00 | 2,369,770.20 | |
| | | RAGB 3.65% 04/20/22 | 1,800,000.00 | 2,017,575.00 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RAGB 3.8% 01/26/62 | 640,000.00 | 1,344,214.40 | |
| | | RAGB 3.9% 07/15/20 | 3,000,000.00 | 3,138,240.00 | |
| | | RAGB 4.15% 03/15/37 | 2,640,000.00 | 4,371,853.20 | |
| | | RAGB 4.85% 03/15/26 | 2,120,000.00 | 2,875,334.80 | |
| | | RAGB 6.25% 07/15/27 | 130,000.00 | 199,135.95 | |
| | | RFGB 0.375% 09/15/20 | 1,330,000.00 | 1,346,259.25 | |
| | | RFGB 0.5% 04/15/26 | 1,100,000.00 | 1,165,296.00 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/27 | 1,050,000.00 | 1,115,210.25 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/28 | 670,000.00 | 712,293.75 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/29 | 430,000.00 | 455,595.75 | |
| | | RFGB 0.75% 04/15/31 | 870,000.00 | 944,406.75 | |
| | | RFGB 0.875% 09/15/25 | 690,000.00 | 745,858.95 | |
| | | RFGB 0% 04/15/22 | 850,000.00 | 865,487.00 | |
| | | RFGB 0% 09/15/23 | 1,460,000.00 | 1,495,996.30 | |
| | | RFGB 1.125% 04/15/34 | 770,000.00 | 875,848.05 | |
| | | RFGB 1.375% 04/15/47 | 550,000.00 | 677,806.25 | |
| | | RFGB 1.5% 04/15/23 | 650,000.00 | 702,442.00 | |
| | | RFGB 1.625% 09/15/22 | 1,430,000.00 | 1,534,182.65 | |
| | | RFGB 2.625% 07/04/42 | 920,000.00 | 1,378,445.20 | |
| | | RFGB 2.75% 07/04/28 | 920,000.00 | 1,167,411.00 | |
| | | RFGB 2% 04/15/24 | 600,000.00 | 673,914.00 | |
| | | RFGB 3.5% 04/15/21 | 800,000.00 | 859,344.00 | |
| | | RFGB 4% 07/04/25 | 1,130,000.00 | 1,437,501.25 | |
| | | SPGB 0.05% 01/31/21 | 3,600,000.00 | 3,628,782.00 | |
| | | SPGB 0.05% 10/31/21 | 4,700,000.00 | 4,754,731.50 | |
| | | SPGB 0.25% 07/30/24 | 450,000.00 | 459,893.25 | |
| | | SPGB 0.35% 07/30/23 | 4,780,000.00 | 4,900,599.40 | |
| | | SPGB 0.4% 04/30/22 | 3,280,000.00 | 3,356,489.60 | |
| | | SPGB 0.45% 10/31/22 | 2,850,000.00 | 2,927,976.00 | |
| | | SPGB 0.6% 10/31/29 | 870,000.00 | 886,273.35 | |
| | | SPGB 0.75% 07/30/21 | 2,200,000.00 | 2,255,209.00 | |
| | | SPGB 1.15% 07/30/20 | 3,000,000.00 | 3,051,150.00 | |
| | | SPGB 1.3% 10/31/26 | 5,090,000.00 | 5,535,731.30 | |
| | | SPGB 1.4% 04/30/28 | 6,230,000.00 | 6,858,420.10 | |
| | | SPGB 1.4% 07/30/28 | 5,900,000.00 | 6,488,023.50 | |
| | | SPGB 1.45% 04/30/29 | 6,540,000.00 | 7,223,822.40 | |
| | | SPGB 1.45% 10/31/27 | 2,600,000.00 | 2,866,773.00 | |
| | | SPGB 1.5% 04/30/27 | 3,050,000.00 | 3,368,770.75 | |
| | | SPGB 1.6% 04/30/25 | 4,910,000.00 | 5,392,481.15 | |
| | | SPGB 1.85% 07/30/35 | 2,030,000.00 | 2,322,969.60 | |
| | | SPGB 1.95% 04/30/26 | 4,820,000.00 | 5,447,805.00 | |
| | | SPGB 1.95% 07/30/30 | 3,270,000.00 | 3,783,095.70 | |
| | | SPGB 2.15% 10/31/25 | 3,370,000.00 | 3,832,128.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SPGB 2.35% 07/30/33 | 3,540,000.00 | 4,300,533.60 | |
| | SPGB 2.7% 10/31/48 | 2,320,000.00 | 3,059,349.20 | |
| | SPGB 2.75% 10/31/24 | 4,400,000.00 | 5,081,978.00 | |
| | SPGB 2.9% 10/31/46 | 3,100,000.00 | 4,210,916.00 | |
| | SPGB 3.45% 07/30/66 | 1,850,000.00 | 2,896,221.25 | |
| | SPGB 3.8% 04/30/24 | 3,310,000.00 | 3,951,660.05 | |
| | SPGB 4.2% 01/31/37 | 3,350,000.00 | 5,147,995.25 | |
| | SPGB 4.4% 10/31/23 | 4,250,000.00 | 5,105,631.25 | |
| | SPGB 4.65% 07/30/25 | 3,970,000.00 | 5,105,936.10 | |
| | SPGB 4.7% 07/30/41 | 3,980,000.00 | 6,777,343.00 | |
| | SPGB 4.8% 01/31/24 | 3,050,000.00 | 3,754,306.00 | |
| | SPGB 4.85% 10/31/20 | 3,950,000.00 | 4,225,236.00 | |
| | SPGB 4.9% 07/30/40 | 3,300,000.00 | 5,687,995.50 | |
| | SPGB 5.15% 10/31/28 | 3,240,000.00 | 4,683,841.20 | |
| | SPGB 5.15% 10/31/44 | 2,400,000.00 | 4,442,052.00 | |
| | SPGB 5.4% 01/31/23 | 4,860,000.00 | 5,856,129.90 | |
| | SPGB 5.5% 04/30/21 | 5,980,000.00 | 6,627,185.50 | |
| | SPGB 5.75% 07/30/32 | 4,300,000.00 | 7,084,809.00 | |
| | SPGB 5.85% 01/31/22 | 4,050,000.00 | 4,706,120.25 | |
| | SPGB 5.9% 07/30/26 | 3,480,000.00 | 4,909,531.80 | |
| | SPGB 6.0% 01/31/29 | 1,050,000.00 | 1,614,327.75 | |
| **ユーロ 小計** | | 999,860,000.00 | 1,183,768,068.40<br>(144,561,756,513) | |
| **イギリスポンド** | UKT 0.5% 07/22/22 | 5,730,000.00 | 5,732,607.15 | |
| | UKT 0.75% 07/22/23 | 5,930,000.00 | 5,986,809.40 | |
| | UKT 1.25% 07/22/27 | 4,900,000.00 | 5,135,543.00 | |
| | UKT 1.5% 01/22/21 | 3,120,000.00 | 3,165,770.40 | |
| | UKT 1.5% 07/22/26 | 4,100,000.00 | 4,360,596.00 | |
| | UKT 1.5% 07/22/47 | 5,040,000.00 | 5,213,678.40 | |
| | UKT 1.625% 10/22/28 | 5,750,000.00 | 6,218,107.50 | |
| | UKT 1.625% 10/22/54 | 1,330,000.00 | 1,448,363.35 | |
| | UKT 1.625% 10/22/71 | 1,200,000.00 | 1,369,470.00 | |
| | UKT 1.75% 01/22/49 | 910,000.00 | 997,883.25 | |
| | UKT 1.75% 07/22/57 | 2,530,000.00 | 2,881,543.50 | |
| | UKT 1.75% 09/07/22 | 3,400,000.00 | 3,534,317.00 | |
| | UKT 1.75% 09/07/37 | 4,920,000.00 | 5,335,051.20 | |
| | UKT 1% 04/22/24 | 5,030,000.00 | 5,142,948.65 | |
| | UKT 2.25% 09/07/23 | 2,500,000.00 | 2,679,650.00 | |
| | UKT 2.5% 07/22/65 | 4,170,000.00 | 5,955,364.65 | |
| | UKT 2.75% 09/07/24 | 2,200,000.00 | 2,448,886.00 | |
| | UKT 2% 07/22/20 | 4,360,000.00 | 4,422,391.60 | |
| | UKT 2% 09/07/25 | 2,170,000.00 | 2,364,475.40 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | UKT 3.25% 01/22/44 | 4,670,000.00 | 6,530,294.50 | |
| | UKT 3.5% 01/22/45 | 3,360,000.00 | 4,922,568.00 | |
| | UKT 3.5% 07/22/68 | 3,670,000.00 | 6,637,415.20 | |
| | UKT 3.75% 07/22/52 | 3,280,000.00 | 5,419,839.20 | |
| | UKT 3.75% 09/07/20 | 8,060,000.00 | 8,352,658.60 | |
| | UKT 3.75% 09/07/21 | 3,770,000.00 | 4,032,806.70 | |
| | UKT 4.25% 03/07/36 | 4,290,000.00 | 6,313,957.65 | |
| | UKT 4.25% 06/07/32 | 3,000,000.00 | 4,202,205.00 | |
| | UKT 4.25% 09/07/39 | 2,190,000.00 | 3,360,456.45 | |
| | UKT 4.25% 12/07/27 | 670,000.00 | 869,783.95 | |
| | UKT 4.25% 12/07/40 | 3,050,000.00 | 4,744,427.50 | |
| | UKT 4.25% 12/07/46 | 3,950,000.00 | 6,572,247.00 | |
| | UKT 4.25% 12/07/49 | 2,170,000.00 | 3,746,461.60 | |
| | UKT 4.25% 12/07/55 | 2,740,000.00 | 5,080,699.80 | |
| | UKT 4.5% 09/07/34 | 2,930,000.00 | 4,334,978.95 | |
| | UKT 4.5% 12/07/42 | 3,910,000.00 | 6,424,638.30 | |
| | UKT 4.75% 12/07/30 | 2,710,000.00 | 3,870,123.90 | |
| | UKT 4.75% 12/07/38 | 1,900,000.00 | 3,062,648.00 | |
| | UKT 4% 01/22/60 | 2,950,000.00 | 5,484,330.25 | |
| | UKT 4% 03/07/22 | 1,950,000.00 | 2,131,164.75 | |
| | UKT 5% 03/07/25 | 2,500,000.00 | 3,123,087.50 | |
| | UKT 6.0% 12/07/28 | 1,250,000.00 | 1,855,100.00 | |
| | UKT 8% 06/07/21 | 740,000.00 | 845,487.00 | |
| イギリスポンド 小計 | | 139,000,000.00 | 176,310,836.25<br>(23,934,196,020) | |
| スウェーデンクローナ | SGB 0.75% 05/12/28 | 7,490,000.00 | 8,052,648.80 | |
| | SGB 0.75% 11/12/29 | 7,590,000.00 | 8,145,170.55 | |
| | SGB 1.5% 11/13/23 | 16,970,000.00 | 18,443,420.25 | |
| | SGB 1% 11/12/26 | 11,970,000.00 | 13,045,145.40 | |
| | SGB 2.5% 05/12/25 | 10,690,000.00 | 12,471,381.60 | |
| | SGB 3.5% 03/30/39 | 8,460,000.00 | 13,153,058.10 | |
| | SGB 3.5% 06/01/22 | 17,590,000.00 | 19,667,115.15 | |
| | SGB 5% 12/01/20 | 18,910,000.00 | 20,389,045.65 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 99,670,000.00 | 113,366,985.50<br>(1,304,854,003) | |
| ノルウェークローネ | NGB 1.5% 02/19/26 | 6,850,000.00 | 6,911,376.00 | |
| | NGB 1.75% 02/17/27 | 7,460,000.00 | 7,659,778.80 | |
| | NGB 1.75% 03/13/25 | 5,800,000.00 | 5,932,936.00 | |
| | NGB 1.75% 09/06/29 | 5,140,000.00 | 5,288,854.40 | |
| | NGB 2% 04/26/28 | 5,730,000.00 | 6,010,483.50 | |
| | NGB 2% 05/24/23 | 13,440,000.00 | 13,799,587.20 | |
| | NGB 3.75% 05/25/21 | 16,040,000.00 | 16,770,541.80 | |
| | NGB 3% 03/14/24 | 9,950,000.00 | 10,708,090.50 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ノルウェークローネ 小計 | | 70,410,000.00 | 73,081,648.20<br>(920,828,767) | |
| デンマーククローネ | DGB 0.25% 11/15/20 | 9,400,000.00 | 9,527,135.00 | |
| | DGB 0.5% 11/15/27 | 17,460,000.00 | 18,857,149.20 | |
| | DGB 0.5% 11/15/29 | 3,550,000.00 | 3,838,650.50 | |
| | DGB 1.5% 11/15/23 | 13,990,000.00 | 15,336,047.85 | |
| | DGB 1.75% 11/15/25 | 10,930,000.00 | 12,568,898.85 | |
| | DGB 3% 11/15/21 | 12,960,000.00 | 14,109,681.60 | |
| | DGB 4.5% 11/15/39 | 24,490,000.00 | 46,769,655.05 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 92,780,000.00 | 121,007,218.05<br>(1,979,678,087) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 1.75% 07/25/21 | 7,810,000.00 | 7,841,279.05 | |
| | POLGB 2.25% 04/25/22 | 4,710,000.00 | 4,789,716.75 | |
| | POLGB 2.5% 01/25/23 | 5,860,000.00 | 6,016,842.90 | |
| | POLGB 2.5% 04/25/24 | 6,160,000.00 | 6,351,175.60 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 7,410,000.00 | 7,621,110.90 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 6,770,000.00 | 6,957,224.35 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 6,000,000.00 | 6,284,850.00 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 1,940,000.00 | 2,039,502.60 | |
| | POLGB 2% 04/25/21 | 6,560,000.00 | 6,618,318.40 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 6,230,000.00 | 6,685,350.70 | |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 4,390,000.00 | 4,789,621.70 | |
| | POLGB 5.25% 10/25/20 | 5,520,000.00 | 5,798,428.80 | |
| | POLGB 5.75% 04/25/29 | 600,000.00 | 790,734.00 | |
| | POLGB 5.75% 09/23/22 | 3,600,000.00 | 4,053,618.00 | |
| | POLGB 5.75% 10/25/21 | 3,400,000.00 | 3,719,481.00 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 76,960,000.00 | 80,357,254.75<br>(2,298,217,485) | |
| オーストラリアドル | ACGB 1.5% 06/21/31 | 820,000.00 | 828,466.50 | |
| | ACGB 1.75% 11/21/20 | 6,600,000.00 | 6,668,442.00 | |
| | ACGB 2.25% 05/21/28 | 5,790,000.00 | 6,246,512.55 | |
| | ACGB 2.25% 11/21/22 | 1,970,000.00 | 2,054,178.10 | |
| | ACGB 2.5% 05/21/30 | 3,250,000.00 | 3,624,855.00 | |
| | ACGB 2.75% 04/21/24 | 6,060,000.00 | 6,551,344.80 | |
| | ACGB 2.75% 05/21/41 | 800,000.00 | 929,484.00 | |
| | ACGB 2.75% 06/21/35 | 1,430,000.00 | 1,664,491.40 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/27 | 5,750,000.00 | 6,421,197.50 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/28 | 4,700,000.00 | 5,288,299.00 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/29 | 4,460,000.00 | 5,064,776.00 | |
| | ACGB 2% 12/21/21 | 2,720,000.00 | 2,788,136.00 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/25 | 4,560,000.00 | 5,112,421.20 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/29 | 4,090,000.00 | 4,808,142.65 | |
| | ACGB 3.25% 06/21/39 | 1,570,000.00 | 1,962,295.90 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ACGB 3.75% 04/21/37 | 2,320,000.00 | 3,063,652.80 | |
| | ACGB 3% 03/21/47 | 2,480,000.00 | 3,033,114.40 | |
| | ACGB 4.25% 04/21/26 | 6,370,000.00 | 7,647,599.05 | |
| | ACGB 4.5% 04/21/33 | 2,650,000.00 | 3,653,594.75 | |
| | ACGB 4.75% 04/21/27 | 5,660,000.00 | 7,132,081.10 | |
| | ACGB 5.5% 04/21/23 | 4,000,000.00 | 4,672,180.00 | |
| | ACGB 5.75% 05/15/21 | 3,930,000.00 | 4,273,147.95 | |
| | ACGB 5.75% 07/15/22 | 5,330,000.00 | 6,087,179.80 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 87,310,000.00 | 99,575,592.45<br>(7,516,961,474) | |
| シンガポールドル | SIGB 1.25% 10/01/21 | 700,000.00 | 693,213.50 | |
| | SIGB 1.75% 02/01/23 | 1,090,000.00 | 1,090,942.85 | |
| | SIGB 1.75% 04/01/22 | 780,000.00 | 780,858.00 | |
| | SIGB 2.125% 06/01/26 | 850,000.00 | 864,428.75 | |
| | SIGB 2.25% 06/01/21 | 1,590,000.00 | 1,606,464.45 | |
| | SIGB 2.25% 08/01/36 | 700,000.00 | 703,111.50 | |
| | SIGB 2.375% 06/01/25 | 630,000.00 | 649,526.85 | |
| | SIGB 2.625% 05/01/28 | 1,050,000.00 | 1,106,012.25 | |
| | SIGB 2.75% 03/01/46 | 1,220,000.00 | 1,293,712.40 | |
| | SIGB 2.75% 04/01/42 | 830,000.00 | 888,100.00 | |
| | SIGB 2.75% 07/01/23 | 1,600,000.00 | 1,661,480.00 | |
| | SIGB 2.875% 07/01/29 | 560,000.00 | 604,730.00 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/30 | 670,000.00 | 723,583.25 | |
| | SIGB 2% 02/01/24 | 410,000.00 | 414,143.05 | |
| | SIGB 2% 07/01/20 | 880,000.00 | 882,244.00 | |
| | SIGB 3.125% 09/01/22 | 1,100,000.00 | 1,147,206.50 | |
| | SIGB 3.25% 09/01/20 | 1,070,000.00 | 1,088,708.95 | |
| | SIGB 3.375% 09/01/33 | 1,060,000.00 | 1,214,023.30 | |
| | SIGB 3.5% 03/01/27 | 1,190,000.00 | 1,325,826.60 | |
| | SIGB 3% 09/01/24 | 1,050,000.00 | 1,111,446.00 | |
| シンガポールドル 小計 | | 19,030,000.00 | 19,849,762.20<br>(1,588,774,966) | |
| マレーシアリンギット | MGS 3.418% 08/15/22 | 2,500,000.00 | 2,505,850.00 | |
| | MGS 3.48% 03/15/23 | 2,700,000.00 | 2,708,262.00 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 2,400,000.00 | 2,373,240.00 | |
| | MGS 3.62% 11/30/21 | 2,690,000.00 | 2,712,622.90 | |
| | MGS 3.659% 10/15/20 | 2,360,000.00 | 2,373,640.80 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 1,300,000.00 | 1,309,204.00 | |
| | MGS 3.757% 04/20/23 | 350,000.00 | 354,240.25 | |
| | MGS 3.795% 09/30/22 | 1,500,000.00 | 1,520,887.50 | |
| | MGS 3.8% 08/17/23 | 3,160,000.00 | 3,202,991.80 | |
| | MGS 3.844% 04/15/33 | 2,990,000.00 | 2,994,455.10 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MGS 3.882% 03/10/22 | 750,000.00 | 761,636.25 | |
| | | MGS 3.882% 03/14/25 | 500,000.00 | 509,855.00 | |
| | | MGS 3.889% 07/31/20 | 1,500,000.00 | 1,511,250.00 | |
| | | MGS 3.892% 03/15/27 | 1,130,000.00 | 1,150,063.15 | |
| | | MGS 3.899% 11/16/27 | 1,970,000.00 | 2,004,780.35 | |
| | | MGS 3.9% 11/30/26 | 3,560,000.00 | 3,629,348.80 | |
| | | MGS 3.955% 09/15/25 | 2,700,000.00 | 2,766,217.50 | |
| | | MGS 4.048% 09/30/21 | 2,050,000.00 | 2,083,978.75 | |
| | | MGS 4.059% 09/30/24 | 1,900,000.00 | 1,953,257.00 | |
| | | MGS 4.127% 04/15/32 | 2,050,000.00 | 2,111,336.00 | |
| | | MGS 4.16% 07/15/21 | 3,700,000.00 | 3,766,526.00 | |
| | | MGS 4.181% 07/15/24 | 1,550,000.00 | 1,601,374.75 | |
| | | MGS 4.232% 06/30/31 | 2,000,000.00 | 2,084,850.00 | |
| | | MGS 4.254% 05/31/35 | 1,400,000.00 | 1,454,516.00 | |
| | | MGS 4.392% 04/15/26 | 3,160,000.00 | 3,312,406.80 | |
| | | MGS 4.498% 04/15/30 | 3,040,000.00 | 3,246,963.20 | |
| | | MGS 4.642% 11/07/33 | 1,500,000.00 | 1,635,240.00 | |
| | | MGS 4.736% 03/15/46 | 1,490,000.00 | 1,603,850.90 | |
| | | MGS 4.762% 04/07/37 | 2,480,000.00 | 2,720,336.80 | |
| | | MGS 4.893% 06/08/38 | 800,000.00 | 895,572.00 | |
| | | MGS 4.921% 07/06/48 | 1,550,000.00 | 1,727,219.25 | |
| | | MGS 4.935% 09/30/43 | 1,440,000.00 | 1,604,311.20 | |
| | | MGS 5.248% 09/15/28 | 600,000.00 | 672,249.00 | |
| | マレーシアリンギット 小計 | | 64,770,000.00 | 66,862,533.05<br>(1,759,821,869) | |
| | 南アフリカランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 41,910,000.00 | 47,471,457.00 | |
| | | SAGB 6.25% 03/31/36 | 11,020,000.00 | 8,163,946.60 | |
| | | SAGB 6.5% 02/28/41 | 17,650,000.00 | 12,692,821.00 | |
| | | SAGB 6.75% 03/31/21 | 10,700,000.00 | 10,775,542.00 | |
| | | SAGB 7.75% 02/28/23 | 17,600,000.00 | 17,880,192.00 | |
| | | SAGB 7% 02/28/31 | 16,330,000.00 | 14,060,374.95 | |
| | | SAGB 8.25% 03/31/32 | 25,870,000.00 | 24,248,985.80 | |
| | | SAGB 8.5% 01/31/37 | 24,700,000.00 | 22,696,089.00 | |
| | | SAGB 8.75% 01/31/44 | 27,140,000.00 | 24,872,588.70 | |
| | | SAGB 8.75% 02/28/48 | 44,900,000.00 | 41,104,603.00 | |
| | | SAGB 8.875% 02/28/35 | 21,250,000.00 | 20,429,006.25 | |
| | | SAGB 8% 01/31/30 | 28,430,000.00 | 26,992,010.60 | |
| | | SAGB 9% 01/31/40 | 14,650,000.00 | 13,898,308.50 | |
| | 南アフリカランド 小計 | | 302,150,000.00 | 285,285,925.40<br>(2,193,848,766) | |
| 合計 | | | | 374,550,445,173<br>(374,550,445,173) | |

**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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 国債証券　205銘柄 | 100.0% | 47.1% |
| カナダドル | 国債証券　29銘柄 | 100.0% | 1.9% |
| メキシコペソ | 国債証券　15銘柄 | 100.0% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券　302銘柄 | 100.0% | 38.6% |
| イギリスポンド | 国債証券　42銘柄 | 100.0% | 6.4% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券　8銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| ノルウェークローネ | 国債証券　8銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| デンマーククローネ | 国債証券　7銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| ポーランドズロチ | 国債証券　15銘柄 | 100.0% | 0.6% |
| オーストラリアドル | 国債証券　23銘柄 | 100.0% | 2.0% |
| シンガポールドル | 国債証券　20銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　33銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| 南アフリカランド | 国債証券　13銘柄 | 100.0% | 0.6% |

**(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。**

## 第２　信用取引契約残高明細表

**該当事項はありません。**

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

**注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。**

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,316,215,471 |
| コール・ローン | 519,308,437 |
| 国債証券 | 48,305,380,240 |
| 未収利息 | 637,449,997 |
| 前払費用 | 39,172,413 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 流動資産合計 | 50,817,526,558 |
| 資産合計 | 50,817,526,558 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 122,132 |
| 前受収益 | 54,021 |
| 未払解約金 | 46,388,447 |
| 未払利息 | 1,433 |
| その他未払費用 | 24 |
| 流動負債合計 | 46,566,057 |
| 負債合計 | 46,566,057 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 29,419,157,992 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 21,351,802,509 |
| 元本等合計 | 50,770,960,501 |
| 純資産合計 | 50,770,960,501 |
| 負債純資産合計 | 50,817,526,558 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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。<br>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。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 29,419,157,992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　1.7258円<br>(1万口当たり純資産額)　(17,258円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

2．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 26,963,838,188円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,120,561,540円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,665,241,736円 |
| 期末元本額 | 29,419,157,992円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン | 4,149,500,778円 |
| 世界経済インデックスファンド | 5,447,698,300円 |
| ＤＣ新興国債券インデックス・オープン | 4,166,427,366円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 4,761,690,059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） | 1,873,035,884円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 138,847,350円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 492,238,225円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 98,018,950円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 143,981,727円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 456,719,090円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 216,305,394円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 2,213,284,724円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 79,323,611円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 201,983,279円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 92,077,131円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 203,862,631円 |
| 外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 3,438,187,297円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 76,440,384円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 107,912,639円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 147,758,212円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 2,004,302円 |
| グローバル経済コア | 769,141,300円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 15,860,308円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 1,981,020円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 22,339円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 23,809円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 25,278円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 26,454円 |
| ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 124,780,151円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 2,222,097,893 |
| 合計 | 2,222,097,893 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**通貨関連**

**（2019年 7月10日現在）**

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 61,672,001 | － | 61,794,133 | △122,132 |
| | マレーシアリンギット | 61,672,001 | － | 61,794,133 | △122,132 |
| 合計 | | 61,672,001 | － | 61,794,133 | △122,132 |

**(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。**

**①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。**

**②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。**

**附属明細表**

**第１　有価証券明細表**
**(1)株式**

**該当事項はありません。**

**(2)株式以外の有価証券**

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 31,200,000.00 | 37,726,260.00 | |
| | | MBONO 10% 12/05/24 | 82,250,000.00 | 91,731,368.75 | |
| | | MBONO 5.75% 03/05/26 | 47,200,000.00 | 42,974,184.00 | |
| | | MBONO 6.5% 06/09/22 | 81,200,000.00 | 79,162,692.00 | |
| | | MBONO 6.5% 06/10/21 | 91,700,000.00 | 90,122,760.00 | |
| | | MBONO 7.25% 12/09/21 | 64,300,000.00 | 63,960,174.50 | |
| | | MBONO 7.5% 06/03/27 | 85,300,000.00 | 85,218,112.00 | |
| | | MBONO 7.75% 05/29/31 | 49,800,000.00 | 50,369,712.00 | |
| | | MBONO 7.75% 11/13/42 | 61,500,000.00 | 60,586,417.50 | |
| | | MBONO 7.75% 11/23/34 | 24,000,000.00 | 24,144,720.00 | |
| | | MBONO 8.5% 05/31/29 | 63,700,000.00 | 67,960,256.00 | |
| | | MBONO 8.5% 11/18/38 | 48,350,000.00 | 51,528,529.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | MBONO 8% 09/05/24 | 25,000,000.00 | 25,598,125.00 | |
| | MBONO 8% 11/07/47 | 34,750,000.00 | 35,050,240.00 | |
| | MBONO 8% 12/07/23 | 77,600,000.00 | 79,241,240.00 | |
| メキシコペソ 小計 | | 867,850,000.00 | 885,374,790.75<br>(5,046,636,307) | |
| ブラジルレアル | BLTN 0% 01/01/22 | 35,400,000.00 | 30,622,780.61 | |
| | BLTN 0% 07/01/21 | 14,600,000.00 | 13,061,784.88 | |
| | BLTN 0% 07/01/22 | 13,250,000.00 | 11,074,326.15 | |
| | BLTN 0% 07/01/23 | 17,500,000.00 | 13,571,092.50 | |
| | BNTNF 10% 01/01/21 | 23,800,000.00 | 25,191,379.67 | |
| | BNTNF 10% 01/01/23 | 28,650,000.00 | 31,775,466.63 | |
| | BNTNF 10% 01/01/25 | 21,100,000.00 | 24,034,911.47 | |
| | BNTNF 10% 01/01/27 | 15,000,000.00 | 17,404,819.96 | |
| | BNTNF 10% 01/01/29 | 7,000,000.00 | 8,265,962.80 | |
| | BRAZIL 10.25% 01/10/28 | 1,400,000.00 | 1,619,625.00 | |
| | BRAZIL 12.5% 01/05/22 | 450,000.00 | 514,968.75 | |
| | BRAZIL 8.5% 01/05/24 | 1,900,000.00 | 2,019,937.50 | |
| ブラジルレアル 小計 | | 180,050,000.00 | 179,157,055.92<br>(5,143,599,075) | |
| チリペソ | CHILE 5.5% 08/05/20 | 9,530,000,000.00 | 9,785,118,100.00 | |
| チリペソ 小計 | | 9,530,000,000.00 | 9,785,118,100.00<br>(1,547,027,171) | |
| コロンビアペソ | COLOM 4.375% 03/21/23 | 23,650,000,000.00 | 23,092,214,750.00 | |
| | COLOM 7.75% 04/14/21 | 9,600,000,000.00 | 10,061,904,000.00 | |
| | COLOM 9.85% 06/28/27 | 54,750,000,000.00 | 69,341,970,000.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 88,000,000,000.00 | 102,496,088,750.00<br>(3,474,617,408) | |
| ペルーヌエボソル | PERUGB 5.7% 08/12/24 | 5,100,000.00 | 5,577,972.00 | |
| | PERUGB 5.94% 02/12/29 | 6,400,000.00 | 7,082,912.00 | |
| | PERUGB 6.15% 08/12/32 | 7,000,000.00 | 7,762,125.00 | |
| | PERUGB 6.35% 08/12/28 | 7,350,000.00 | 8,359,632.75 | |
| | PERUGB 6.9% 08/12/37 | 5,900,000.00 | 6,990,349.50 | |
| | PERUGB 6.95% 08/12/31 | 7,350,000.00 | 8,703,906.75 | |
| | PERUGB 8.2% 08/12/26 | 6,500,000.00 | 8,131,695.00 | |
| ペルーヌエボソル 小計 | | 45,600,000.00 | 52,608,593.00<br>(1,739,240,084) | |
| ウルグアイペソ | URUGUA 8.5% 03/15/28 | 15,600,000.00 | 13,679,952.00 | |
| | URUGUA 9.875% 06/20/22 | 17,350,000.00 | 17,288,494.25 | |
| ウルグアイペソ 小計 | | 32,950,000.00 | 30,968,446.25<br>(96,002,183) | |
| ドミニカペソ | DOMREP 8.9% 02/15/23 | 20,400,000.00 | 20,505,162.00 | |
| ドミニカペソ 小計 | | 20,400,000.00 | 20,505,162.00<br>(43,881,046) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トルコリラ | TURKGB 10.4% 03/20/24 | 3,450,000.00 | 2,716,650.75 | |
| | TURKGB 10.5% 08/11/27 | 8,050,000.00 | 5,932,085.25 | |
| | TURKGB 10.6% 02/11/26 | 9,750,000.00 | 7,457,628.75 | |
| | TURKGB 10.7% 02/17/21 | 6,700,000.00 | 6,013,484.50 | |
| | TURKGB 10.7% 08/17/22 | 10,750,000.00 | 9,051,338.75 | |
| | TURKGB 11% 02/24/27 | 9,300,000.00 | 7,058,700.00 | |
| | TURKGB 11% 03/02/22 | 5,600,000.00 | 4,819,388.00 | |
| | TURKGB 12.2% 01/18/23 | 9,900,000.00 | 8,635,968.00 | |
| | TURKGB 12.4% 03/08/28 | 5,200,000.00 | 4,258,904.00 | |
| | TURKGB 7.1% 03/08/23 | 6,200,000.00 | 4,546,274.00 | |
| | TURKGB 8.5% 09/14/22 | 6,500,000.00 | 5,205,070.00 | |
| | TURKGB 8.8% 09/27/23 | 6,050,000.00 | 4,599,905.75 | |
| | TURKGB 8% 03/12/25 | 6,100,000.00 | 4,175,297.50 | |
| | TURKGB 9.2% 09/22/21 | 10,850,000.00 | 9,237,907.00 | |
| | TURKGB 9.5% 01/12/22 | 3,000,000.00 | 2,512,455.00 | |
| | TURKGB 9% 07/24/24 | 7,250,000.00 | 5,388,018.75 | |
| トルコリラ 小計 | | 114,650,000.00 | 91,609,076.00<br>(1,743,320,716) | |
| チェココルナ | CZGB 0.25% 02/10/27 | 32,200,000.00 | 29,600,172.00 | |
| | CZGB 0.45% 10/25/23 | 22,400,000.00 | 21,545,664.00 | |
| | CZGB 0.95% 05/15/30 | 46,400,000.00 | 44,011,792.00 | |
| | CZGB 1% 06/26/26 | 35,800,000.00 | 34,877,613.00 | |
| | CZGB 2.4% 09/17/25 | 51,500,000.00 | 54,638,152.50 | |
| | CZGB 2.5% 08/25/28 | 48,800,000.00 | 53,482,604.00 | |
| | CZGB 2.75% 07/23/29 | 42,500,000.00 | 47,948,075.00 | |
| | CZGB 3.75% 09/12/20 | 36,500,000.00 | 37,508,495.00 | |
| | CZGB 3.85% 09/29/21 | 37,900,000.00 | 39,917,417.00 | |
| | CZGB 4.7% 09/12/22 | 32,000,000.00 | 35,224,800.00 | |
| | CZGB 5.7% 05/25/24 | 38,800,000.00 | 46,928,212.00 | |
| チェココルナ 小計 | | 424,800,000.00 | 445,682,996.50<br>(2,130,364,723) | |
| ハンガリーフォリント | HGB 0.5% 04/21/21 | 370,000,000.00 | 370,843,600.00 | |
| | HGB 1.75% 10/26/22 | 535,000,000.00 | 550,902,875.00 | |
| | HGB 2.5% 10/24/24 | 350,000,000.00 | 369,762,750.00 | |
| | HGB 2.5% 10/27/21 | 341,000,000.00 | 356,696,230.00 | |
| | HGB 2.75% 12/22/26 | 373,000,000.00 | 396,870,135.00 | |
| | HGB 3% 06/26/24 | 466,000,000.00 | 504,671,010.00 | |
| | HGB 3% 10/27/27 | 626,000,000.00 | 676,461,860.00 | |
| | HGB 5.5% 06/24/25 | 597,000,000.00 | 730,689,195.00 | |
| | HGB 6.0% 11/24/23 | 496,000,000.00 | 600,236,880.00 | |
| | HGB 6.75% 10/22/28 | 268,000,000.00 | 373,480,780.00 | |
| | HGB 7.5% 11/12/20 | 237,000,000.00 | 260,617,050.00 | |
| | HGB 7% 06/24/22 | 475,500,000.00 | 562,376,227.50 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ハンガリーフォリント 小計 | | 5,134,500,000.00 | 5,753,608,592.50<br>(2,157,027,861) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 1.75% 07/25/21 | 11,650,000.00 | 11,696,658.25 | |
| | POLGB 2.25% 04/25/22 | 10,800,000.00 | 10,982,790.00 | |
| | POLGB 2.5% 01/25/23 | 21,150,000.00 | 21,716,079.75 | |
| | POLGB 2.5% 04/25/24 | 6,500,000.00 | 6,701,727.50 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 13,950,000.00 | 14,347,435.50 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 14,000,000.00 | 14,387,170.00 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 10,950,000.00 | 11,469,851.25 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 4,400,000.00 | 4,625,676.00 | |
| | POLGB 2% 04/25/21 | 8,500,000.00 | 8,575,565.00 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 12,700,000.00 | 13,628,243.00 | |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 9,900,000.00 | 10,801,197.00 | |
| | POLGB 5.25% 10/25/20 | 7,200,000.00 | 7,563,168.00 | |
| | POLGB 5.75% 09/23/22 | 7,550,000.00 | 8,501,337.75 | |
| | POLGB 5.75% 10/25/21 | 7,150,000.00 | 7,821,849.75 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 146,400,000.00 | 152,818,748.75<br>(4,370,616,214) | |
| ロシアルーブル | RFLB 6.5% 02/28/24 | 135,100,000.00 | 132,248,714.50 | |
| | RFLB 6.9% 05/23/29 | 89,000,000.00 | 87,182,175.00 | |
| | RFLB 7.05% 01/19/28 | 177,000,000.00 | 175,607,895.00 | |
| | RFLB 7.1% 10/16/24 | 164,100,000.00 | 164,250,972.00 | |
| | RFLB 7.25% 05/10/34 | 64,000,000.00 | 63,432,960.00 | |
| | RFLB 7.4% 07/17/24 | 100,000,000.00 | 101,465,000.00 | |
| | RFLB 7.4% 12/07/22 | 172,900,000.00 | 174,981,716.00 | |
| | RFLB 7.5% 08/18/21 | 123,000,000.00 | 124,365,300.00 | |
| | RFLB 7.6% 04/14/21 | 44,400,000.00 | 44,893,950.00 | |
| | RFLB 7.6% 07/20/22 | 62,500,000.00 | 63,506,875.00 | |
| | RFLB 7.7% 03/23/33 | 174,200,000.00 | 179,448,646.00 | |
| | RFLB 7.75% 09/16/26 | 162,500,000.00 | 167,687,000.00 | |
| | RFLB 7.95% 10/07/26 | 147,000,000.00 | 153,220,305.00 | |
| | RFLB 7% 01/25/23 | 97,200,000.00 | 97,170,840.00 | |
| | RFLB 7% 08/16/23 | 107,200,000.00 | 107,010,256.00 | |
| | RFLB 7% 12/15/21 | 151,000,000.00 | 151,058,135.00 | |
| | RFLB 8.15% 02/03/27 | 176,000,000.00 | 186,160,480.00 | |
| | RFLB 8.5% 09/17/31 | 123,150,000.00 | 134,943,459.75 | |
| ロシアルーブル 小計 | | 2,270,250,000.00 | 2,308,634,679.25<br>(3,947,765,301) | |
| マレーシアリンギット | MGS 3.62% 11/30/21 | 7,800,000.00 | 7,865,598.00 | |
| | MGS 3.659% 10/15/20 | 10,800,000.00 | 10,862,424.00 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 10,250,000.00 | 10,322,570.00 | |
| | MGS 3.757% 04/20/23 | 4,850,000.00 | 4,908,757.75 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | MGS 3.8% 08/17/23 | 8,650,000.00 | 8,767,683.25 | |
| | MGS 3.885% 08/15/29 | 6,050,000.00 | 6,193,959.75 | |
| | MGS 3.899% 11/16/27 | 11,550,000.00 | 11,753,915.25 | |
| | MGS 3.9% 11/30/26 | 8,050,000.00 | 8,206,814.00 | |
| | MGS 3.906% 07/15/26 | 4,500,000.00 | 4,603,815.00 | |
| | MGS 3.955% 09/15/25 | 11,200,000.00 | 11,474,680.00 | |
| | MGS 4.059% 09/30/24 | 7,550,000.00 | 7,761,626.50 | |
| | MGS 4.16% 07/15/21 | 6,050,000.00 | 6,158,779.00 | |
| | MGS 4.181% 07/15/24 | 6,000,000.00 | 6,198,870.00 | |
| | MGS 4.762% 04/07/37 | 6,900,000.00 | 7,568,679.00 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | 110,200,000.00 | 112,648,171.50<br>(2,964,899,873) | |
| タイバーツ | THAIGB 1.875% 06/17/22 | 99,700,000.00 | 100,120,235.50 | |
| | THAIGB 2.125% 12/17/26 | 98,000,000.00 | 99,741,950.00 | |
| | THAIGB 2.4% 12/17/23 | 54,800,000.00 | 56,298,780.00 | |
| | THAIGB 2.875% 12/17/28 | 59,000,000.00 | 63,570,435.00 | |
| | THAIGB 2% 12/17/22 | 89,500,000.00 | 90,233,900.00 | |
| | THAIGB 3.3% 06/17/38 | 38,700,000.00 | 44,471,331.00 | |
| | THAIGB 3.4% 06/17/36 | 176,100,000.00 | 205,123,921.50 | |
| | THAIGB 3.625% 06/16/23 | 84,000,000.00 | 89,947,620.00 | |
| | THAIGB 3.65% 06/20/31 | 136,900,000.00 | 159,177,737.00 | |
| | THAIGB 3.65% 12/17/21 | 64,100,000.00 | 67,047,638.50 | |
| | THAIGB 3.775% 06/25/32 | 49,000,000.00 | 57,859,690.00 | |
| | THAIGB 3.85% 12/12/25 | 76,000,000.00 | 85,401,580.00 | |
| | THAIGB 4.875% 06/22/29 | 95,000,000.00 | 119,505,250.00 | |
| タイバーツ 小計 | | 1,120,800,000.00 | 1,238,500,068.50<br>(4,384,290,242) | |
| フィリピンペソ | PHILIP 3.9% 11/26/22 | 25,000,000.00 | 24,528,125.00 | |
| | PHILIP 4.95% 01/15/21 | 20,000,000.00 | 20,167,100.00 | |
| | PHILIP 6.25% 01/14/36 | 20,000,000.00 | 23,191,500.00 | |
| フィリピンペソ 小計 | | 65,000,000.00 | 67,886,725.00<br>(143,919,857) | |
| インドネシアルピア | INDOGB 10.5% 08/15/30 | 7,300,000,000.00 | 8,981,993,000.00 | |
| | INDOGB 11% 09/15/25 | 10,700,000,000.00 | 12,815,122,500.00 | |
| | INDOGB 11% 11/15/20 | 18,500,000,000.00 | 19,587,707,500.00 | |
| | INDOGB 12.8% 06/15/21 | 6,800,000,000.00 | 7,564,660,000.00 | |
| | INDOGB 5.625% 05/15/23 | 40,800,000,000.00 | 39,350,784,000.00 | |
| | INDOGB 6.125% 05/15/28 | 36,000,000,000.00 | 33,445,440,000.00 | |
| | INDOGB 6.625% 05/15/33 | 29,000,000,000.00 | 26,625,915,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 05/15/38 | 23,400,000,000.00 | 23,071,230,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 08/15/32 | 30,500,000,000.00 | 30,484,902,500.00 | |
| | INDOGB 7% 05/15/22 | 33,700,000,000.00 | 34,069,857,500.00 | |
| | INDOGB 7% 05/15/27 | 44,300,000,000.00 | 43,915,254,500.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | INDOGB 8.125% 05/15/24 | 26,000,000,000.00 | 27,478,100,000.00 | |
| | | INDOGB 8.25% 05/15/29 | 23,600,000,000.00 | 25,243,150,000.00 | |
| | | INDOGB 8.25% 05/15/36 | 33,200,000,000.00 | 35,123,110,000.00 | |
| | | INDOGB 8.25% 06/15/32 | 18,900,000,000.00 | 20,019,730,500.00 | |
| | | INDOGB 8.25% 07/15/21 | 31,800,000,000.00 | 32,823,960,000.00 | |
| | | INDOGB 8.375% 03/15/24 | 48,200,000,000.00 | 51,170,566,000.00 | |
| | | INDOGB 8.375% 03/15/34 | 32,500,000,000.00 | 34,788,325,000.00 | |
| | | INDOGB 8.375% 04/15/39 | 10,000,000,000.00 | 10,637,000,000.00 | |
| | | INDOGB 8.375% 09/15/26 | 45,000,000,000.00 | 48,009,150,000.00 | |
| | | INDOGB 8.75% 05/15/31 | 32,700,000,000.00 | 35,955,939,000.00 | |
| | | INDOGB 9.5% 07/15/31 | 11,400,000,000.00 | 13,208,097,000.00 | |
| | | INDOGB 9% 03/15/29 | 32,500,000,000.00 | 36,116,762,500.00 | |
| | インドネシアルピア 小計 | | 626,800,000,000.00 | 650,486,756,500.00<br>(5,008,748,025) | |
| | 南アフリカランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 86,950,000.00 | 98,488,265.00 | |
| | | SAGB 6.25% 03/31/36 | 34,700,000.00 | 25,706,801.00 | |
| | | SAGB 6.5% 02/28/41 | 52,700,000.00 | 37,898,678.00 | |
| | | SAGB 6.75% 03/31/21 | 16,600,000.00 | 16,717,196.00 | |
| | | SAGB 7.75% 02/28/23 | 42,500,000.00 | 43,176,600.00 | |
| | | SAGB 7% 02/28/31 | 41,800,000.00 | 35,990,427.00 | |
| | | SAGB 8.25% 03/31/32 | 40,850,000.00 | 38,290,339.00 | |
| | | SAGB 8.5% 01/31/37 | 46,800,000.00 | 43,003,116.00 | |
| | | SAGB 8.75% 01/31/44 | 53,500,000.00 | 49,030,342.50 | |
| | | SAGB 8.75% 02/28/48 | 74,400,000.00 | 68,110,968.00 | |
| | | SAGB 8.875% 02/28/35 | 31,250,000.00 | 30,042,656.25 | |
| | | SAGB 8% 01/31/30 | 50,300,000.00 | 47,755,826.00 | |
| | | SAGB 9% 01/31/40 | 35,000,000.00 | 33,204,150.00 | |
| | 南アフリカランド 小計 | | 607,350,000.00 | 567,415,364.75<br>(4,363,424,154) | |
| 合計 | | | | 48,305,380,240<br>(48,305,380,240) | |

**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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| メキシコペソ | 国債証券　　15銘柄 | 100.0% | 10.4% |
| ブラジルレアル | 国債証券　　12銘柄 | 100.0% | 10.6% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| チリペソ | 国債証券　1銘柄 | 100.0% | 3.2% |
| コロンビアペソ | 国債証券　3銘柄 | 100.0% | 7.2% |
| ペルーヌエボソル | 国債証券　7銘柄 | 100.0% | 3.6% |
| ウルグアイペソ | 国債証券　2銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| ドミニカペソ | 国債証券　1銘柄 | 100.0% | 0.1% |
| トルコリラ | 国債証券　16銘柄 | 100.0% | 3.6% |
| チェココルナ | 国債証券　11銘柄 | 100.0% | 4.4% |
| ハンガリーフォリント | 国債証券　12銘柄 | 100.0% | 4.5% |
| ポーランドズロチ | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 9.0% |
| ロシアルーブル | 国債証券　18銘柄 | 100.0% | 8.2% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 6.1% |
| タイバーツ | 国債証券　13銘柄 | 100.0% | 9.1% |
| フィリピンペソ | 国債証券　3銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| インドネシアルピア | 国債証券　23銘柄 | 100.0% | 10.4% |
| 南アフリカランド | 国債証券　13銘柄 | 100.0% | 9.0% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,802,796,161 |
| 投資証券 | 111,587,003,340 |
| 派生商品評価勘定 | 91,587,900 |
| 未収入金 | 3,083,174,841 |
| 未収配当金 | 891,325,113 |
| 差入委託証拠金 | 44,662,500 |
| 流動資産合計 | 117,500,549,855 |
| 資産合計 | 117,500,549,855 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 91,587,900 |
| 未払金 | 88,460,918 |
| 未払解約金 | 3,353,957,281 |
| 未払利息 | 4,975 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| その他未払費用 | 83 |
| 流動負債合計 | 3,534,011,157 |
| 負債合計 | 3,534,011,157 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 58,709,917,953 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 55,256,620,745 |
| 元本等合計 | 113,966,538,698 |
| 純資産合計 | 113,966,538,698 |
| 負債純資産合計 | 117,500,549,855 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>不動産投信指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。 |

**（貸借対照表に関する注記）**

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.　計算期間の末日における受益権の総数 | 58,709,917,953口 |

| | 2019年 7月10日現在 | |
|---|---|---|
| 2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.9412円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (19,412円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

2．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| ３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 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。<br><br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

**（関連当事者との取引に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（重要な後発事象に関する注記）**

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

**（その他の注記）**
**元本の移動**

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 62,907,925,650円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,571,061,108円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,769,068,805円 |
| 期末元本額 | 58,709,917,953円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,657,865,291円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 6,594,502円 |
| ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン | 11,487,297,960円 |
| Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 27,611,614,509円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 2,351,821,401円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 3,936,596,005円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 2,156,317,602円 |

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 3,395,232,444円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,037,555,577円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 32,374,697円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 632,893,658円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 1,870,067円 |
| グローバル経済コア | 330,260,970円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 4,325,957円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 270,142,312円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 32,880,956円 |
| ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 1,061,571,717円 |
| Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用） | 960,693,888円 |
| Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用） | 698,246,705円 |
| Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用） | 1,043,761,735円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 11,278,727,547 |
| 合計 | 11,278,727,547 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

**投資証券関連**

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,264,210,100 | － | 2,355,798,000 | 91,587,900 |
| 合計 | | 2,264,210,100 | － | 2,355,798,000 | 91,587,900 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**附属明細表**

**第１　有価証券明細表**
**(1)株式**

**該当事項はありません。**

**(2)株式以外の有価証券**

| 種類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額(円) | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 1,147 | 128,349,300 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 1,104 | 131,376,000 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3,712 | 2,353,408,000 | |
| | ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人 | 12,589 | 1,353,317,500 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 12,813 | 2,066,736,900 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 13,711 | 1,948,333,100 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 10,888 | 3,723,696,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 6,906 | 1,358,410,200 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 5,869 | 2,737,888,500 | |
| | ＧＬＰ投資法人 | 27,683 | 3,468,679,900 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 4,633 | 1,510,358,000 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 16,051 | 4,105,845,800 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 1,700 | 943,500,000 | |
| | Ｏｎｅリート投資法人 | 1,628 | 488,400,000 | |
| | イオンリート投資法人 | 11,468 | 1,626,162,400 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 9,031 | 1,730,339,600 | |
| | 日本リート投資法人 | 3,606 | 1,602,867,000 | |
| | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 68,091 | 1,282,834,440 | |
| | 日本ヘルスケア投資法人 | 512 | 91,340,800 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 32,667 | 2,698,294,200 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 2,151 | 263,282,400 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 4,095 | 1,113,430,500 | |
| | ヘルスケア＆メディカル投資法人 | 2,340 | 316,602,000 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 2,236 | 268,320,000 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 34,760 | 5,836,204,000 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 1,954 | 254,215,400 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 9,231 | 1,203,722,400 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 3,468 | 418,587,600 | |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 961 | 114,743,400 | |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 2,711 | 1,047,801,500 | |
| | 大江戸温泉リート投資法人 | 1,803 | 156,500,400 | |
| | さくら総合リート投資法人 | 2,417 | 230,581,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 投資法人みらい | 12,035 | 683,588,000 | |
| | 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 2,621 | 371,657,800 | |
| | 三菱地所物流リート投資法人 | 1,182 | 351,054,000 | |
| | ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人 | 1,149 | 141,212,100 | |
| | ザイマックス・リート投資法人 | 1,030 | 139,771,000 | |
| | タカラレーベン不動産投資法人 | 1,672 | 181,077,600 | |
| | 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 1,728 | 179,193,600 | |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 10,818 | 8,145,954,000 | |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 11,172 | 7,563,444,000 | |
| | 日本リテールファンド投資法人 | 21,114 | 4,615,520,400 | |
| | オリックス不動産投資法人 | 22,260 | 4,527,684,000 | |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 7,072 | 3,383,952,000 | |
| | プレミア投資法人 | 10,622 | 1,541,252,200 | |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 7,490 | 1,495,753,000 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 7,728 | 1,061,827,200 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 25,083 | 4,587,680,700 | |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 7,984 | 1,430,732,800 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 38,542 | 2,316,374,200 | |
| | フロンティア不動産投資法人 | 3,800 | 1,742,300,000 | |
| | 平和不動産リート投資法人 | 6,957 | 912,758,400 | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7,299 | 1,915,257,600 | |
| | 福岡リート投資法人 | 5,778 | 1,027,906,200 | |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 | 3,456 | 2,681,856,000 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 9,269 | 971,391,200 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 2,579 | 2,011,620,000 | |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 5,027 | 761,590,500 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 1,740 | 311,982,000 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 14,990 | 4,099,765,000 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 35,960 | 3,160,884,000 | |
| | 日本賃貸住宅投資法人 | 12,566 | 1,083,189,200 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 10,004 | 1,614,645,600 | |
| 合計 | | 624,663 | 111,587,003,340 | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 270,470,678 |
| コール・ローン | 253,465,901 |
| 投資証券 | 78,018,791,919 |
| 派生商品評価勘定 | 232,390 |
| 未収入金 | 184,240,073 |
| 未収配当金 | 320,836,747 |
| 流動資産合計 | 79,048,037,708 |
| 資産合計 | 79,048,037,708 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 250,780 |
| 未払解約金 | 575,527,244 |
| 未払利息 | 699 |
| 流動負債合計 | 575,778,723 |
| 負債合計 | 575,778,723 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 40,305,811,872 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 38,166,447,113 |
| 元本等合計 | 78,472,258,985 |
| 純資産合計 | 78,472,258,985 |
| 負債純資産合計 | 79,048,037,708 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。 |
| ２.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |

| | 2019年 7月10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。<br>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<br>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。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 40,305,811,872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　1.9469円<br>(1万口当たり純資産額)　(19,469円) |

（金融商品に関する注記）
1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>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。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 37,407,269,970円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,332,465,749円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,433,923,847円 |
| 期末元本額 | 40,305,811,872円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル３資産バランスオープン | 91,264,668円 |
| ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型） | 144,544,658円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,620,125,450円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 6,433,133円 |
| ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン | 8,953,815,357円 |
| グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 19,917,528,466円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,055,767,143円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,449,414,823円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 936,054,009円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 2,123,426,961円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 484,111,071円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 186,197,695円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 529,571,646円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 1,800,222円 |
| グローバル経済コア | 334,591,830円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 4,298,422円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 126,822,195円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 26,299,664円 |
| グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 720,792,940円 |
| ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 592,951,519円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 6,800,679,565 |

| 合計 | 6,800,679,565 |
|---|---|

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 356,649,910 | － | 356,668,300 | △18,390 |
| | アメリカドル | 187,239,200 | － | 187,480,000 | △240,800 |
| | カナダドル | 12,464,550 | － | 12,450,000 | 14,550 |
| | ユーロ | 61,050,020 | － | 61,060,000 | △9,980 |
| | イギリスポンド | 19,073,320 | － | 19,003,600 | 69,720 |
| | オーストラリアドル | 25,790,020 | － | 25,663,200 | 126,820 |
| | 香港ドル | 23,019,150 | － | 23,001,000 | 18,150 |
| | シンガポールドル | 28,013,650 | － | 28,010,500 | 3,150 |
| 合計 | | 356,649,910 | － | 356,668,300 | △18,390 |

(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。

①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。

②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。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカドル | ACADIA REALTY TRUST | 46,910 | 1,297,999.70 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 21,490 | 1,415,331.40 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 2,050 | 797,860.00 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 64,940 | 9,609,821.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 26,970 | 1,291,323.60 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 76,760 | 3,748,190.80 | |
| | | AMERICAN FINANCE TRUST INC | 31,600 | 366,560.00 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 144,870 | 3,691,287.60 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 106,670 | 3,681,181.70 | |
| | | APARTMENT INVEST & MGMT | 84,610 | 4,395,489.50 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 122,993 | 1,945,749.26 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 46,030 | 121,058.90 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 79,920 | 16,903,879.20 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 9,000 | 107,190.00 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 88,840 | 11,731,322.00 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 14,500 | 136,010.00 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 101,518 | 1,497,390.50 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 169,340 | 3,097,228.60 | |
| | | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 52,700 | 1,020,272.00 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 5,000 | 65,300.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 55,700 | 6,069,629.00 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 57,290 | 1,396,730.20 | |
| | | CBL & ASSOCIATES PRTYS | 99,840 | 117,811.20 | |
| | | CEDAR REALTY TRUST INC | 51,950 | 136,628.50 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 23,860 | 445,943.40 | |
| | | CHESAPEAKE LODGING TRUST | 34,960 | 985,172.80 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 20,000 | 249,000.00 | |
| | | CLIPPER REALTY INC | 7,300 | 82,490.00 | |
| | | COLONY CAPITAL INC | 282,000 | 1,460,760.00 | |
| | | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 71,160 | 1,524,247.20 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST | 9,700 | 401,095.00 | |
| | | CORECIVIC INC | 68,050 | 1,336,502.00 | |
| | | CORESITE REALTY CORP | 20,530 | 2,491,931.40 | |
| | | CORPORATE OFFICE PPTYS | 66,720 | 1,848,144.00 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 82,193 | 3,099,498.03 | |
| | | CUBESMART | 109,640 | 3,820,954.00 | |
| | | CYRUSONE INC | 63,060 | 3,777,924.60 | |
| | | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 120,700 | 1,238,382.00 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 118,310 | 14,395,960.80 | |
| | | DOUGLAS EMMETT INC-W/I | 90,100 | 3,704,011.00 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 203,230 | 6,704,557.70 | |
| | | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 39,300 | 730,587.00 | |
| | | EASTGROUP PROPERTIES,INC | 21,750 | 2,603,692.50 | |
| | | EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 82,810 | 1,258,712.00 | |
| | | EPR PROPERTIES | 41,890 | 3,217,570.90 | |
| | | EQUITY COMMONWEALTH | 72,400 | 2,413,092.00 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 50,860 | 6,491,261.80 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 210,600 | 16,704,792.00 | |
| | | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 28,500 | 574,845.00 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST | 37,260 | 11,378,458.80 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 72,200 | 7,982,432.00 | |
| | | FARMLAND PARTNERS INC | 19,000 | 125,590.00 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 43,270 | 5,741,496.30 | |
| | | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 70,790 | 2,668,783.00 | |
| | | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 37,890 | 1,056,752.10 | |
| | | FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 53,800 | 413,722.00 | |
| | | FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 27,000 | 328,860.00 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 114,470 | 4,582,234.10 | |
| | | GEO GROUP INC/THE | 69,850 | 1,427,734.00 | |
| | | GETTY REALTY CORP | 19,000 | 593,560.00 | |
| | | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 15,000 | 324,900.00 | |
| | | GLADSTONE LAND CORP | 5,000 | 57,950.00 | |
| | | GLOBAL MEDICAL REIT INC | 9,500 | 101,935.00 | |
| | | GLOBAL NET LEASE INC | 51,900 | 1,047,861.00 | |
| | | HCP INC | 273,990 | 9,071,808.90 | |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 74,700 | 2,453,895.00 | |
| | | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 114,780 | 3,212,692.20 | |
| | | HERSHA HOSPITALITY TRUST | 17,850 | 297,559.50 | |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 57,100 | 2,503,835.00 | |
| | | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 92,450 | 2,330,664.50 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 419,930 | 7,592,334.40 | |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 85,970 | 2,957,368.00 | |
| | | INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 50,000 | 600,000.00 | |
| | | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 37,160 | 801,912.80 | |
| | | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 5,500 | 727,595.00 | |
| | | INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 6,389 | 391,645.70 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 222,790 | 6,226,980.50 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 162,310 | 5,128,996.00 | |
| | | JBG SMITH PROPERTIES | 68,500 | 2,759,865.00 | |
| | | KILROY REALTY CORPORATION | 57,310 | 4,433,501.60 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 236,880 | 4,415,443.20 | |
| | | KITE REALTY GROUP TRUST | 49,930 | 776,411.50 | |
| | | LEXINGTON CORP PROPERTIES | 125,366 | 1,197,245.30 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 83,080 | 4,285,266.40 | |
| | | LIFE STORAGE INC | 27,070 | 2,720,264.30 | |
| | | LTC PROPERTIES INC | 23,290 | 1,098,123.50 | |
| | | MACERICH CO/THE | 59,540 | 2,006,498.00 | |
| | | MACK-CALI REALTY CORP | 55,140 | 1,315,089.00 | |
| | | MANULIFE US REAL ESTATE INV | 740,080 | 654,970.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 219,700 | 4,051,268.00 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 65,170 | 7,982,021.60 | |
| | | MONMOUTH REIT -CL A | 55,460 | 779,213.00 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 93,550 | 5,072,281.00 | |
| | | NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 31,620 | 938,165.40 | |
| | | NATL HEALTH INVESTORS INC | 24,730 | 1,977,658.10 | |
| | | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 40,000 | 274,800.00 | |
| | | NEXPOINT RESIDENTIAL | 13,000 | 562,900.00 | |
| | | NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 29,946 | 508,782.54 | |
| | | OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 28,230 | 787,334.70 | |
| | | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 122,626 | 4,659,788.00 | |
| | | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 8,000 | 233,200.00 | |
| | | PARAMOUNT GROUP INC | 121,410 | 1,732,520.70 | |
| | | PARK HOTELS & RESORTS INC-WI | 118,330 | 3,255,258.30 | |
| | | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 77,640 | 2,185,566.00 | |
| | | PENN REAL ESTATE INVEST TST | 31,970 | 210,042.90 | |
| | | PHYSICIANS REALTY TRUST | 104,360 | 1,846,128.40 | |
| | | PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST | 67,810 | 1,393,495.50 | |
| | | PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 23,000 | 346,150.00 | |
| | | PROLOGIS INC | 360,150 | 29,755,593.00 | |
| | | PS BUSINESS PARKS INC | 11,900 | 2,060,842.00 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 85,660 | 21,201,706.60 | |
| | | QTS REALTY TRUST INC | 33,510 | 1,549,502.40 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 179,860 | 12,717,900.60 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 94,000 | 6,524,540.00 | |
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 61,140 | 1,084,623.60 | |
| | | RETAIL PROPERTISE OF AME-A | 129,080 | 1,560,577.20 | |
| | | RETAIL VALUE | 8,630 | 302,999.30 | |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 60,880 | 2,553,916.00 | |
| | | RLJ LODGING TRUST | 99,770 | 1,778,899.10 | |
| | | RPT REALTY | 51,580 | 616,896.80 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 28,830 | 2,240,955.90 | |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 104,520 | 2,152,066.80 | |
| | | SAFEHOLD INC | 4,700 | 151,481.00 | |
| | | SAUL CENTERS INC | 6,700 | 375,200.00 | |
| | | SENIOR HOUSING PROP TRUST | 143,800 | 1,246,746.00 | |
| | | SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 15,700 | 675,100.00 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP | 176,410 | 29,024,737.30 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 84,059 | 1,134,796.50 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 48,540 | 3,942,418.80 | |
| | | SPIRIT MTA REIT | 23,901 | 204,592.56 | |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 47,730 | 2,108,711.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 68,370 | 2,118,102.60 | |
| | | STORE CAPITAL CORP | 112,680 | 3,878,445.60 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 65,470 | 753,559.70 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 51,510 | 6,981,665.40 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 137,090 | 1,890,471.10 | |
| | | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 55,170 | 904,236.30 | |
| | | TAUBMAN CENTERS INC | 34,900 | 1,445,907.00 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 34,490 | 1,720,361.20 | |
| | | UDR INC | 159,170 | 7,425,280.50 | |
| | | UMH PROPERTIES INC | 20,000 | 252,800.00 | |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 7,870 | 708,378.70 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 69,110 | 1,196,294.10 | |
| | | URSTADT BIDDLE - CL A | 16,500 | 350,130.00 | |
| | | VENTAS INC | 211,090 | 14,856,514.20 | |
| | | VEREIT INC | 545,380 | 4,979,319.40 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 205,000 | 4,559,200.00 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 99,150 | 6,544,891.50 | |
| | | WASHINGTON PRIME GROUP INC | 105,250 | 407,317.50 | |
| | | WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT | 47,080 | 1,302,232.80 | |
| | | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 66,570 | 1,853,974.50 | |
| | | WELLTOWER INC | 231,330 | 19,917,513.00 | |
| | | WHITESTONE REIT | 22,610 | 291,216.80 | |
| | | WP CAREY INC | 97,520 | 8,245,316.00 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 68,110 | 1,447,337.50 | |
| | アメリカドル 小計 | | 12,963,171 | 521,786,448.79<br>(56,879,940,782) | |
| | カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE | 33,590 | 1,629,115.00 | |
| | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 43,830 | 512,372.70 | |
| | | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 14,060 | 569,711.20 | |
| | | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 43,270 | 2,140,999.60 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 83,590 | 1,161,901.00 | |
| | | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 53,000 | 667,270.00 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 21,867 | 339,157.17 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 31,000 | 451,980.00 | |
| | | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 59,940 | 842,756.40 | |
| | | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 33,800 | 411,346.00 | |
| | | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 18,820 | 462,219.20 | |
| | | GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12,600 | 779,688.00 | |
| | | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 83,630 | 1,958,614.60 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 26,000 | 367,900.00 | |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 25,500 | 493,425.00 | |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 4,600 | 89,010.00 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL | 7,890 | 148,489.80 | |
| | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE | 15,863 | 431,473.60 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 33,000 | 398,970.00 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 82,380 | 2,189,660.40 | |
| | SLATE OFFICE REI | 17,000 | 100,300.00 | |
| | SLATE RETAIL REIT | 10,300 | 130,913.00 | |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 38,810 | 1,308,673.20 | |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 33,000 | 437,910.00 | |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 15,000 | 99,600.00 | |
| **カナダドル 小計** | | 842,340 | 18,123,455.87<br>(1,504,428,071) | |
| **ユーロ** | AEDIFICA | 13,866 | 1,243,780.20 | |
| | ALSTRIA OFFICE REIT -AG | 90,000 | 1,359,000.00 | |
| | ALTAREA | 2,000 | 355,200.00 | |
| | BEFIMMO S.C.A. | 11,960 | 630,292.00 | |
| | COFINIMMO | 12,400 | 1,465,680.00 | |
| | COVIVIO(FP) | 38,160 | 3,606,120.00 | |
| | EUROCOMMERCIAL | 21,040 | 507,484.80 | |
| | GECINA SA | 30,860 | 4,119,810.00 | |
| | GREEN REIT PLC | 377,170 | 690,221.10 | |
| | HAMBORNER REIT AG | 44,000 | 402,600.00 | |
| | HIBERNIA REIT PLC | 402,550 | 590,138.30 | |
| | ICADE | 25,220 | 2,031,471.00 | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 33,790 | 207,132.70 | |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 151,460 | 1,529,746.00 | |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 14,300 | 367,510.00 | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 225,021 | 387,036.12 | |
| | KLEPIERRE | 113,180 | 3,377,291.20 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 46,392 | 334,022.40 | |
| | MERCIALYS | 34,020 | 398,374.20 | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 211,470 | 2,664,522.00 | |
| | MONTEA | 5,900 | 460,200.00 | |
| | NSI NV | 11,700 | 442,845.00 | |
| | RETAIL ESTATES | 4,200 | 343,560.00 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 78,160 | 10,332,752.00 | |
| | VASTNED RETAIL | 8,500 | 240,975.00 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 10,350 | 1,620,810.00 | |
| | WERELDHAVE NV | 24,970 | 575,808.20 | |
| **ユーロ 小計** | | 2,042,639 | 40,284,382.22 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | | (4,919,528,756) | |
| イギリスポンド | ASSURA PLC | 1,400,150 | 904,496.90 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 92,570 | 959,950.90 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 540,830 | 2,977,809.98 | |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | 290,000 | 49,532.00 | |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 368,000 | 321,632.00 | |
| | DERWENT LONDON PLC | 62,900 | 1,980,092.00 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 360,000 | 333,360.00 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 153,000 | 1,080,180.00 | |
| | HAMMERSON PLC | 431,120 | 1,258,870.40 | |
| | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 263,580 | 259,626.30 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 521,960 | 418,925.09 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 428,830 | 3,657,062.24 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 474,110 | 1,007,957.86 | |
| | LXI REIT PLC | 297,000 | 378,972.00 | |
| | NEWRIVER REIT PL | 173,000 | 299,290.00 | |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 320,000 | 307,200.00 | |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 653,700 | 902,106.00 | |
| | RDI REIT PLC | 154,400 | 168,296.00 | |
| | REGIONAL REIT LTD | 170,000 | 182,920.00 | |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 124,000 | 797,940.00 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 250,000 | 142,500.00 | |
| | SEGRO PLC | 611,860 | 4,634,227.64 | |
| | SHAFTESBURY PLC | 132,430 | 1,079,304.50 | |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 223,286 | 183,987.66 | |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 996,780 | 1,590,860.88 | |
| | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 354,000 | 312,582.00 | |
| | UNITE GROUP PLC | 146,020 | 1,474,802.00 | |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 72,420 | 637,296.00 | |
| イギリスポンド 小計 | | 10,065,946 | 28,301,780.35<br>(3,841,966,682) | |
| オーストラリアドル | ABACUS PROPERTY GROUP | 174,440 | 734,392.40 | |
| | APN INDUSTRIA REIT | 75,000 | 223,500.00 | |
| | ARENA REIT | 141,000 | 386,340.00 | |
| | BWP TRUST | 298,560 | 1,149,456.00 | |
| | CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 130,800 | 495,732.00 | |
| | CHARTER HALL GROUP | 271,600 | 3,093,524.00 | |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 154,000 | 793,100.00 | |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 192,380 | 865,710.00 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 1,117,623 | 1,352,323.83 | |
| | DEXUS | 622,590 | 8,398,739.10 | |
| | GDI PROPERTY GROUP | 286,500 | 403,965.00 | |
| | GOODMAN GROUP | 905,710 | 14,065,676.30 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | GPT GROUP | 1,100,530 | 6,878,312.50 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUS | 142,860 | 615,726.60 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 78,000 | 276,900.00 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 124,000 | 404,240.00 | |
| | MIRVAC GROUP | 2,244,360 | 7,271,726.40 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 380,000 | 670,700.00 | |
| | RURAL FUNDS GROUP | 189,816 | 436,576.80 | |
| | SCENTRE GROUP | 3,056,490 | 12,378,784.50 | |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 514,230 | 1,301,001.90 | |
| | STOCKLAND | 1,376,580 | 6,153,312.60 | |
| | VICINITY CENTERS | 1,802,480 | 4,722,497.60 | |
| | VIVA ENERGY REIT | 290,000 | 759,800.00 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 15,669,549 | 73,832,037.53<br>(5,573,580,513) | |
| ニュージーランドドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 495,000 | 705,375.00 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 630,000 | 1,253,700.00 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 780,000 | 1,255,800.00 | |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 615,000 | 1,079,325.00 | |
| | STRIDE STAPLED GROUP | 228,000 | 515,280.00 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 187,460 | 472,399.20 | |
| ニュージーランドドル 小計 | | 2,935,460 | 5,281,879.20<br>(380,031,208) | |
| 香港ドル | CHAMPION REIT | 1,133,000 | 7,477,800.00 | |
| | FORTUNE REIT | 758,000 | 8,398,640.00 | |
| | LINK REIT | 1,207,500 | 117,550,125.00 | |
| | PROSPERITY REIT | 782,000 | 2,776,100.00 | |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 636,000 | 3,949,560.00 | |
| | YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT | 740,000 | 4,040,400.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 5,256,500 | 144,192,625.00<br>(2,011,487,118) | |
| シンガポールドル | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 340,000 | 499,800.00 | |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 435,000 | 452,400.00 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 1,436,566 | 4,410,257.62 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 691,000 | 898,300.00 | |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 711,000 | 561,690.00 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,554,528 | 3,388,871.04 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 1,569,600 | 4,128,048.00 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 367,460 | 584,261.40 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 458,300 | 756,195.00 | |
| | ESR REIT | 1,130,579 | 604,859.76 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 480,000 | 324,000.00 | |
| | | 338,000 | 358,280.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | | |
| | | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 366,829 | 972,096.85 | |
| | | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 360,000 | 601,200.00 | |
| | | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 460,000 | 328,900.00 | |
| | | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 977,820 | 1,212,496.80 | |
| | | KEPPEL DC REIT | 519,460 | 867,498.20 | |
| | | KEPPEL REIT | 1,074,800 | 1,364,996.00 | |
| | | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 954,000 | 224,190.00 | |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,035,830 | 2,123,451.50 | |
| | | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 774,860 | 1,751,183.60 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,387,152 | 2,219,443.20 | |
| | | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 1,251,800 | 1,840,146.00 | |
| | | OUE HOSPITALITY TRUST | 680,000 | 493,000.00 | |
| | | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 250,000 | 762,500.00 | |
| | | SABANA SHARIAH COMP IND REI | 478,540 | 222,521.10 | |
| | | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 321,200 | 200,750.00 | |
| | | SPH REIT | 322,300 | 357,753.00 | |
| | | STARHILL GLOBAL REIT | 706,300 | 557,977.00 | |
| | | SUNTEC REIT | 1,224,500 | 2,387,775.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | | 22,657,424 | 35,454,841.07<br>(2,837,805,479) | |
| | 韓国ウォン | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 17,500 | 122,325,000.00 | |
| | 韓国ウォン 小計 | | 17,500 | 122,325,000.00<br>(11,302,830) | |
| | イスラエルシェケル | REIT 1 LTD | 104,000 | 1,924,000.00 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | | 104,000 | 1,924,000.00<br>(58,720,480) | |
| 合計 | | | 72,554,529 | 78,018,791,919<br>(78,018,791,919) | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 投資証券　　155銘柄 | 100.0% | 72.9% |
| カナダドル | 投資証券　　25銘柄 | 100.0% | 1.9% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ユーロ | 投資証券　27銘柄 | 100.0% | 6.3% |
| イギリスポンド | 投資証券　28銘柄 | 100.0% | 4.9% |
| オーストラリアドル | 投資証券　24銘柄 | 100.0% | 7.1% |
| ニュージーランドドル | 投資証券　6銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| 香港ドル | 投資証券　6銘柄 | 100.0% | 2.6% |
| シンガポールドル | 投資証券　30銘柄 | 100.0% | 3.6% |
| 韓国ウォン | 投資証券　1銘柄 | 100.0% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 投資証券　1銘柄 | 100.0% | 0.1% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

#### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 217,623,399 |
| コール・ローン | 282,156,650 |
| 社債券 | 21,156,514,726 |
| 流動資産合計 | 21,656,294,775 |
| 資産合計 | 21,656,294,775 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 10,631,000 |
| 未払利息 | 778 |
| その他未払費用 | 13 |
| 流動負債合計 | 10,631,791 |
| 負債合計 | 10,631,791 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 73,105,674,107 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | △51,460,011,123 |
| 元本等合計 | 21,645,662,984 |
| 純資産合計 | 21,645,662,984 |
| 負債純資産合計 | 21,656,294,775 |

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 社債券<br>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。<br>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。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>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。 |
| 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。<br>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 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 73,105,674,107口 |
| 2. | 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 51,460,011,123円 |
| 3. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 0.2961円<br>(1万口当たり純資産額) (2,961円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 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。<br>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。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 67,315,635,483円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,376,369,298円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,586,330,674円 |
| 期末元本額 | 73,105,674,107円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用） | 43,266,111,288円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 4,857,394,473円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 7,100,972,041円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 3,774,797,834円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 5,246,151,503円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 2,038,753,933円 |
| ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン | 1,179,362,511円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 551,722,299円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 44,774,527円 |
| コモディティ・オープン（適格機関投資家専用） | 2,980,363,270円 |
| ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 2,065,270,428円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 社債券 | 142,072,733 |
| 合計 | 142,072,733 |

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

**（デリバティブ取引に関する注記）**

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 社債券 | アメリカドル | BAR USD COM 036 10/31/19 | 8,000,000.00 | 7,831,360.00 | |
| | | CS USD COM 015 09/30/19 | 12,000,000.00 | 11,116,800.00 | |
| | | ETFS ALL COMMODITIES | 40,000,000.00 | 3,236,000.00 | |
| | | IPATH DOW COMM 06/12/36 | 15,000,000.00 | 3,322,500.00 | |
| | | SG ISSUER 012 08/30/19 | 30,000,000.00 | 28,818,000.00 | |
| | | SG ISSUER 013 01/31/20 | 21,000,000.00 | 20,336,400.00 | |
| | | SG ISSUER 014 03/31/20 | 15,000,000.00 | 14,190,000.00 | |
| | | SG ISSUER 015 05/29/20 | 20,000,000.00 | 20,202,000.00 | |
| | | STAR HELIOS 006 11/08/19 | 88,000,000.00 | 85,025,600.00 | |
| | アメリカドル 小計 | | 249,000,000.00 | 194,078,660.00<br>(21,156,514,726) | |
| 合計 | | | | 21,156,514,726<br>(21,156,514,726) | |

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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 社債券　　9銘柄 | 100.0% | 100.0% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 16,505,373 |
| コール・ローン | 52,468,116 |
| 投資信託受益証券 | 27,130,055,607 |
| 未収入金 | 305,276,113 |
| 流動資産合計 | 27,504,305,209 |
| 資産合計 | 27,504,305,209 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 214,560,724 |
| 未払金 | 2,271,659 |
| 未払解約金 | 106,626,205 |
| 未払利息 | 144 |
| その他未払費用 | 2 |
| 流動負債合計 | 323,458,734 |
| 負債合計 | 323,458,734 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 26,646,828,989 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 534,017,486 |
| 元本等合計 | 27,180,846,475 |
| 純資産合計 | 27,180,846,475 |
| 負債純資産合計 | 27,504,305,209 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>為替予約取引 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 26,646,828,989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 1.0200円<br>(1万口当たり純資産額) (10,200円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

### （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 18,399,141,774円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,171,053,620円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,923,366,405円 |
| 期末元本額 | 26,646,828,989円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 4,482,658,735円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 6,422,936,334円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 3,950,942,438円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 5,527,441,751円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,969,262,226円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 1,137,684,749円 |
| グローバル経済コア | 2,453,663,972円 |
| ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 130,154,089円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 525,100,453円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 46,984,242円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資信託受益証券 | 2,518,059,053 |
| 合計 | 2,518,059,053 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 7月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 27,329,747,800 | － | 27,544,308,524 | △214,560,724 |
| | アメリカドル | 27,329,747,800 | － | 27,544,308,524 | △214,560,724 |
| 合計 | | 27,329,747,800 | － | 27,544,308,524 | △214,560,724 |

(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。

①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。

②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。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | ISHARES GOLD TRUST | 18,628,500 | 248,876,760.00 | |
| | アメリカドル 小計 | | 18,628,500 | 248,876,760.00<br>(27,130,055,607) | |
| 合計 | | | 18,628,500 | 27,130,055,607<br>(27,130,055,607) | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 米国株式ＬＳマザーファンド

#### 貸借対照表

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 955,473,367 |
| 社債券 | 26,610,575,974 |
| 流動資産合計 | 27,566,049,341 |
| 資産合計 | 27,566,049,341 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 302,942,500 |
| 未払解約金 | 1,710,000 |
| 未払利息 | 2,636 |
| その他未払費用 | 33 |
| 流動負債合計 | 304,655,169 |
| 負債合計 | 304,655,169 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 25,568,959,929 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 1,692,434,243 |
| 元本等合計 | 27,261,394,172 |
| 純資産合計 | 27,261,394,172 |
| 負債純資産合計 | 27,566,049,341 |

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 社債券<br>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。<br>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。<br><br>為替予約取引 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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 | 為替予約取引による為替差損益<br>約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 25,568,959,929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 1.0662円<br>(1万口当たり純資産額) (10,662円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 3 .金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。<br>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 .時価の算定方法 | (1)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

### （関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2018年 7月11日 |
| 期首元本額 | 13,969,559,644円 |
| 期中追加設定元本額 | 15,651,378,795円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,051,978,510円 |
| 期末元本額 | 25,568,959,929円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 2,452,677,413円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,648,762,542円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,088,610,280円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 605,632,502円 |
| ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 16,949,217,699円 |
| 米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用） | 576,731,857円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 337,513,201円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 16,003,112円 |
| ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用） | 893,811,323円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 2019年 7月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 社債券 | 2,336,060,318 |
| 合計 | 2,336,060,318 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 7月10日現在）

| | | | | |
|---|---|---|---|---|

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 26,340,807,500 | － | 26,643,750,000 | △302,942,500 |
| | アメリカドル | 26,340,807,500 | － | 26,643,750,000 | △302,942,500 |
| 合計 | | 26,340,807,500 | － | 26,643,750,000 | △302,942,500 |

(注)時価の算定方法

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

①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。

②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。

## 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 社債券 | アメリカドル | STAR HELIOS 004 10/18/22 | 217,000,000.00 | 244,111,329.00 | |
| | アメリカドル 小計 | | 217,000,000.00 | 244,111,329.00<br>(26,610,575,974) | |
| 合計 | | | | 26,610,575,974<br>(26,610,575,974) | |

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 社債券　　1銘柄 | 100.0% | 100.0% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第２　信用取引契約残高明細表

**該当事項はありません。**

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

**注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。**

## 2【ファンドの現況】

### 【コア投資戦略ファンド（切替型）】

#### 【純資産額計算書】

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 31,647,887,703円 |
| Ⅱ　負債総額 | 103,881,911円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 31,544,005,792円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 28,980,380,844口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0885円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,885円） |

（参考）

**国内株式インデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 289,464,789,619円 |
| Ⅱ　負債総額 | 2,010,844,651円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 287,453,944,968円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 199,320,879,203口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.4422円 |
| （1万口当たり純資産額） | （14,422円） |

**外国株式インデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 357,998,886,385円 |
| Ⅱ　負債総額 | 169,015,640円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 357,829,870,745円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 135,330,410,830口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.6441円 |
| （1万口当たり純資産額） | （26,441円） |

**外国債券インデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

**（2019年 7月31日現在）**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **383,767,143,447円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **138,929,495円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **383,628,213,952円** |
| **Ⅳ　発行済口数** | **137,835,192,991口** |
| **Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **2.7832円** |
| **（1万口当たり純資産額）** | **（27,832円）** |

**新興国債券インデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

**（2019年 7月31日現在）**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **51,258,259,112円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **21,442,821円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **51,236,816,291円** |
| **Ⅳ　発行済口数** | **29,596,079,595口** |
| **Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **1.7312円** |
| **（1万口当たり純資産額）** | **（17,312円）** |

**Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

**（2019年 7月31日現在）**

| | |
|---|---|
| **Ⅰ　資産総額** | **117,185,159,065円** |
| **Ⅱ　負債総額** | **1,900,521,902円** |
| **Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）** | **115,284,637,163円** |
| **Ⅳ　発行済口数** | **58,588,082,292口** |
| **Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）** | **1.9677円** |
| **（1万口当たり純資産額）** | **（19,677円）** |

**グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 76,878,125,039円 |
| Ⅱ　負債総額 | 24,189,950円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 76,853,935,089円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 40,268,375,731口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.9085円 |
| （1万口当たり純資産額） | （19,085円） |

**グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 22,342,604,675円 |
| Ⅱ　負債総額 | 15,610,735円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 22,326,993,940円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 75,653,960,456口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 0.2951円 |
| （1万口当たり純資産額） | （2,951円） |

**ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 27,436,486,367円 |
| Ⅱ　負債総額 | 187,934,025円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 27,248,552,342円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 26,112,096,733口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0435円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,435円） |

**米国株式ＬＳマザーファンド**

**純資産額計算書**

（2019年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 28,169,072,065円 |
| Ⅱ　負債総額 | 265,824,691円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 27,903,247,374円 |

| | |
|---|---|
| Ⅳ　発行済口数 | 25,904,679,717口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0772円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,772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。

①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。

②受益権の譲渡

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

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

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

③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。

④受益権の再分割

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

⑤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。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

# 第二部【委託会社等の情報】

## 第１【委託会社等の概況】

### １【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年 7月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間に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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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。

［DO（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－DO－CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2019年10月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7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 | 520 | 12,316,102 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 89 | 366,936 |
| 単位型公社債投資信託 | 4 | 30,821 |
| 合計 | 613 | 12,713,859 |

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

**（1）【貸借対照表】**

（単位：千円）

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

（単位：千円）

| | 前事業年度<br>（2018年3月31日現在） | 当事業年度<br>（2019年3月31日現在） |
|---|---|---|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 24,591 | 38,118 |
| 未払金 | 2,950,503 | 5,327,037 |
| 未払収益分配金 | 45 | 115 |
| 未払手数料 | 2,160,863 | 2,718,199 |
| その他未払金 | 789,595 | 2,608,722 |
| 未払費用 | 74,279 | 178,529 |
| 未払法人税等 | 838,596 | 1,992,137 |
| 賞与引当金 | 106,177 | 132,159 |
| その他 | 74,131 | 395,910 |
| 流動負債合計 | 4,068,279 | 8,063,893 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 496,696 | 537,798 |
| 資産除去債務 | 13,374 | 131,970 |
| その他 | 1,074 | 82 |
| 固定負債合計 | 511,145 | 669,852 |
| 負債合計 | 4,579,425 | 8,733,745 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 300,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 350,000 | 17,239,438 |
| 資本剰余金合計 | 350,000 | 17,239,438 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 74,500 | 75,000 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 2,100,000 | 2,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | 22,767,534 | 28,501,567 |
| 利益剰余金合計 | 24,942,034 | 30,676,567 |
| 株主資本合計 | 25,592,034 | 49,916,006 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 182 | 393,355 |
| 繰延ヘッジ損益 | － | 133,049 |
| 評価・換算差額等合計 | 182 | 526,404 |
| 純資産合計 | 25,592,216 | 50,442,411 |
| 負債・純資産合計 | 30,171,641 | 59,176,157 |

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|---|---|---|

| | （自　2017年4月1日<br>至　2018年3月31日） | （自　2018年4月1日<br>至　2019年3月31日） |
|---|---|---|
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 2,136 | 11,327 |
| 収益分配金 | 116 | 8,610 |
| 投資有価証券売却益 | 499 | 46,789 |
| デリバティブ利益 | － | 250,343 |
| 貸倒引当金戻入 | 2,750 | 17,088 |
| その他 | 4,351 | 6,090 |
| 営業外収益合計 | 9,854 | 340,249 |
| 営業外費用 | | |
| 投資有価証券売却損 | 2,224 | 34,437 |
| 固定資産除却損 | 7,891 | 7,868 |
| 為替差損 | － | 198,670 |
| その他 | 1,182 | 4,509 |
| 営業外費用合計 | 11,298 | 245,485 |
| 経常利益 | 5,514,818 | 8,649,651 |
| 特別損失 | | |
| 統合関連費用 | 51,569 | 335,911 |
| 特別損失合計 | 51,569 | 355,911 |
| 税引前当期純利益 | 5,463,248 | 8,313,740 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,739,837 | 2,674,603 |
| 法人税等調整額 | △50,178 | △125,397 |
| 法人税等合計 | 1,689,659 | 2,549,206 |
| 当期純利益 | 3,773,589 | 5,764,533 |

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年4月1日　至　2018年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | |
|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | |
| | | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 300,000 | 350,000 | 350,000 |
| 当期変動額 | | | |
| その他資本剰余金から資本金への振替 | | | |
| 会社分割による増加 | | | |
| 剰余金の配当 | | | |
| 当期純利益 | | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | |
| 当期変動額合計 | － | － | － |
| 当期末残高 | 300,000 | 350,000 | 350,000 |

| | 株主資本 | | |
|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | | |
| | その他利益剰余金 | | |

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

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | △1,134 | － | △1,134 | 21,847,309 |
| 当期変動額 | | | | |
| その他資本剰余金から資本金への振替 | | | | － |
| 会社分割による増加 | | | | － |
| 剰余金の配当 | | | | △30,000 |
| 当期純利益 | | | | 3,773,589 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 1,317 | | 1,317 | 1,317 |
| 当期変動額合計 | 1,317 | － | 1,317 | 3,744,907 |
| 当期末残高 | 182 | － | 182 | 25,592,216 |

当事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | |
|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | |
| | | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 300,000 | 350,000 | 350,000 |
| 当期変動額 | | | |
| その他資本剰余金から資本金への振替 | 1,700,000 | △1,700,000 | △1,700,000 |
| 会社分割による増加 | | 18,589,438 | 18,589,438 |
| 剰余金の配当 | | | |
| 当期純利益 | | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | |
| 当期変動額合計 | 1,700,000 | 16,889,438 | 16,889,438 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 17,239,438 | 17,239,438 |

| | 株主資本 | |
|---|---|---|
| | 利益剰余金 | |

| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | 株主資本合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 74,500 | 2,100,000 | 22,767,534 | 24,942,034 | 25,592,034 |
| 当期変動額 | | | | | |
| その他資本剰余金から資本金への振替 | | | | | － |
| 会社分割による増加 | | | | | 18,589,438 |
| 剰余金の配当 | 500 | | △30,500 | △30,000 | △30,000 |
| 当期純利益 | | | 5,764,533 | 5,764,533 | 5,764,533 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | 500 | － | 5,734,033 | 5,734,533 | 24,323,972 |
| 当期末残高 | 75,000 | 2,100,000 | 28,501,567 | 30,676,567 | 49,916,006 |

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

**重要な会計方針**

**１．有価証券の評価基準及び評価方法**

**（1）子会社株式**

移動平均法による原価法によっております。

**（2）その他有価証券**

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

**２．デリバティブの評価基準及び評価方法**

時価法によっております。

**３．固定資産の減価償却の方法**

**（1）有形固定資産**

定額法によっております。

**（2）無形固定資産**

定額法によっております。

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

ております。

４．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

５．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

６．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

７．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。
この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。
この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

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

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

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

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

## 注記事項

**（貸借対照表関係）**

**※1有形固定資産の減価償却累計額**

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

**（株主資本等変動計算書関係）**

**前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）**

**１．発行済株式の種類及び総数に関する事項**

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

**２．自己株式の種類及び株式数に関する事項**

**該当事項はありません。**

**３．剰余金の配当に関する事項**

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(千円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2017年6月30日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 30,000 | 10,000 | 2017年3月31日 | 2017年6月30日 |

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

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(千円) | 配当金の原資 | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|---|

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

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| 決議 | 株式の<br>種類 | 配当金の<br>総額(千円) | 配当金の<br>原資 | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2019年6月27日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 2,305,812 | 利益<br>剰余金 | 768,604 | 2019年3月31日 | 2019年6月28日 |

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため有価証券及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

| | 貸借対照表計上額（*） | 時価（*） | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1) 現金及び預金 | 23,973,152 | 23,973,152 | ― |
| (2) 未収委託者報酬 | 5,373,307 | 5,373,307 | ― |
| (3) 未収運用受託報酬 | ― | ― | ― |
| (4) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 42,799 | 42,799 | ― |
| (5) 未払金 | (2,950,503) | (2,950,503) | ― |
| (6) 未払法人税等 | (838,596) | (838,596) | ― |
| (7) デリバティブ取引 | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | ― | ― | ― |
| ヘッジ会計が適用されているもの | ― | ― | ― |
| デリバティブ取引計 | ― | ― | ― |

(*) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

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

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

（*1）負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。
（注1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）有価証券及び投資有価証券
これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（7）デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位:千円）

| 区分 | 前事業年度<br>2018年3月31日 | 当事業年度<br>2019年3月31日 |
|---|---|---|
| 非上場株式 | 3 | 3 |

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金及び預金 | 23,973,152 | － | － | － |
| 未収委託者報酬 | 5,373,307 | － | － | － |
| 未収運用受託報酬 | － | － | － | － |
| 有価証券及び投資有価証券<br>投資信託 | － | 12,846 | 21,065 | 496 |

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金及び預金 | 23,830,484 | － | － | － |
| 未収委託者報酬 | 6,351,590 | － | － | － |
| 未収運用受託報酬 | 5,525,778 | － | － | － |
| 有価証券及び投資有価証券<br>投資信託 | 2,268,127 | 491,940 | 7,800,848 | 508 |

**（有価証券関係）**

**１．子会社株式**

**前事業年度（2018年3月31日）**

**該当事項はありません。**

**当事業年度（2019年3月31日）**

**時価のある子会社株式はありません。**

**なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。**

**（単位:千円）**

| | 貸借対照表計上額 |
|---|---|
| 子会社株式 | 4,663,000 |

**２．その他有価証券**

**前事業年度（2018年3月31日）** **（単位:千円）**

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

**当事業年度（2019年3月31日）** **（単位:千円）**

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

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

**３．事業年度中に売却したその他有価証券**

**前事業年度（2018年3月31日）** **（単位:千円）**

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|
| 62,968 | 499 | 2,224 |

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|
| 1,538,203 | 46,789 | 34,437 |

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2．時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的処理方法 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | 米ドル | | 3,432,867 | － | 13,731 |
| | 英ポンド | | 2,575,513 | － | 50,256 |
| | カナダドル | 有価証券 | 40,963 | － | 566 |
| | スイスフラン | 投資有価証券 | 34,448 | － | △132 |
| | 香港ドル | 子会社株式 | 566,113 | － | 2,528 |
| | 人民元 | | 1,725,146 | － | 9,137 |
| | ユーロ | | 262,583 | － | 6,080 |
| | 買建 | | | | |
| | ユーロ | | 6,313 | － | △86 |
| 合計 | | | 8,643,951 | － | 82,081 |

（注）　1．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項　（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項　（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

**（企業結合等関係）**

**共通支配下の取引等**

**(1)取引の概要**

**①対象となった事業の名称及びその事業の内容**

**事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業**

**事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供**

**②企業結合日**

**2018年10月1日**

**③企業結合の法的形式**

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

**④結合後企業の名称**

**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 （当社）**

**⑤その他取引の概要に関する事項**

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

**(2)実施した会計処理の概要**

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

**（資産除去債務関係）**

**重要性が乏しいため、記載を省略しております。**

**（セグメント情報等）**

**［セグメント情報］**

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

**［関連情報］**

**１．製品及びサービスごとの情報**

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

**２．地域ごとの情報**

**（1）営業収益**

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

**（2）有形固定資産**

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

**３．主要な顧客ごとの情報**

**前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）**

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

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

**当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）**

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 4,679,437千円 |

**［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］**

**該当事項はありません。**

**（持分法損益等）**

**該当事項はありません。**

**（関連当事者情報）**

**１．関連当事者との取引**

**財務諸表提出会社と関連当事者の取引**

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

**（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等**
**重要性が乏しいため、記載を省略しております。**
**（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等**

**前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）**

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 兄弟会社 | 三井住友信託銀行㈱ | 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<br>役員の兼任 | 投信販売代行手数料等 | 9,571,581 | 未払手数料 | 1,568,277 |
| | | | | | | | 投資助言費用 | 4,809,206 | その他未払金 | 424,421 |

**（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。**
**２．取引条件及び取引条件の決定方針等**
**① 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。**
**② 投資助言費用**

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有（被所有）割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 兄弟会社 | 三井住友信託銀行㈱ | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | ― | 営業上の取引役員の兼任 | 運用受託報酬 | 4,540,311 | 未収運用受託報酬 | 4,903,536 |
| | | | | | | | 投信販売代行手数料等 | 9,564,223 | 未払手数料 | 1,774,045 |
| | | | | | | | 投資助言費用 | 3,357,115 | その他未払金 | 182,885 |
| | | | | | | | 吸収分割による承継<br><br>(承継資産合計)<br>うち、投資有価証券<br>うち、関係会社株式<br>(承継負債合計)<br>(差引純資産)<br>(分割対価) | <br><br>18,603,427<br>13,907,536<br>4,663,000<br>13,989<br>18,589,438<br>無対価 | ― | ― |

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

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

③ 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。

④ 吸収分割

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

（１株当たり情報）

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

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

２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度<br>（自　2017年4月1日 | 当事業年度<br>（自　2018年4月1日 |
|---|---|---|

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

## 4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常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

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年10月10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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

③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）<br>（2019年3月末日現在） | 事業の内容 |
|---|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。 |

### 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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末日現在）

④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。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第３【参考情報】

**ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。**

| 提出年月日 | 提出書類 |
|---|---|
| 2018年10月10日 | 有価証券届出書 |
| 2018年10月10日 | 有価証券報告書 |
| 2019年 4月10日 | 有価証券届出書 |
| 2019年 4月10日 | 半期報告書 |

# 独立監査人の監査報告書

2019年６月５日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

２０１９年9月１０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）の２０１８年7月１１日から２０１９年7月１０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型）の２０１９年7月１０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。