

【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11月28日提出
【計算期間】	第1期(自 2019年3月20日至 2019年8月28日)
【ファンド名】	DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060
【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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定され

る旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

1. 投資対象ファンド[※]への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券に分散投資します。

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。投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

? DR(預託証券)とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは、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」をご覧ください。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各投資対象ファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

3.

ターゲット・イヤー[※]に近づくにしたがい、原則として1年に1回、各資産の基本組入比率を変更します。

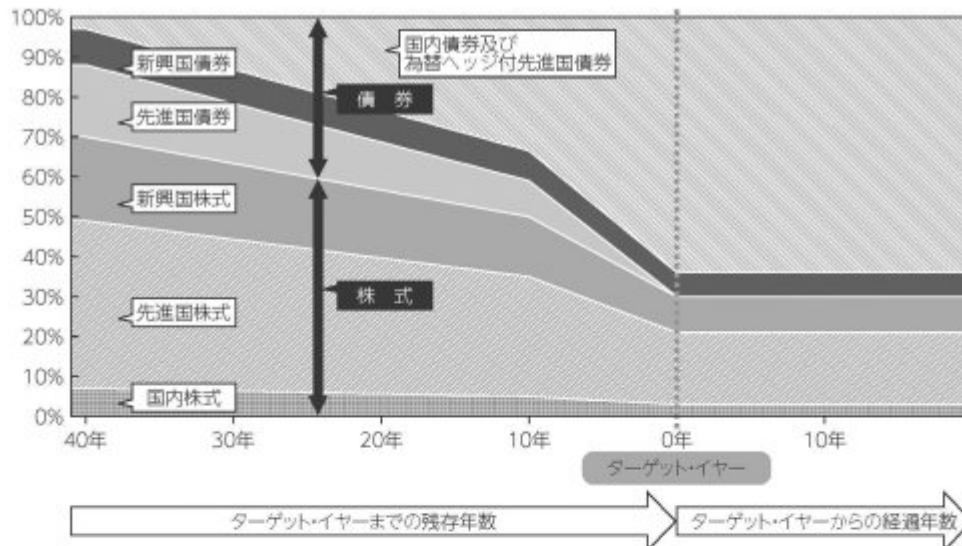
※ターゲット・イヤーとは、ファンドごとにあらかじめ定めた基準日(特定の決算日の翌日)をいいます。

- 定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。
- ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。
- 基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

各ファンドのターゲット・イヤー

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2030年8月の決算日の翌日(第13計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2040年8月の決算日の翌日(第23計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2050年8月の決算日の翌日(第33計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2060年8月の決算日の翌日(第43計算期間開始日)

基本組入比率の推移のイメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

<ご参考>

■ 当初設定時(2019年3月)

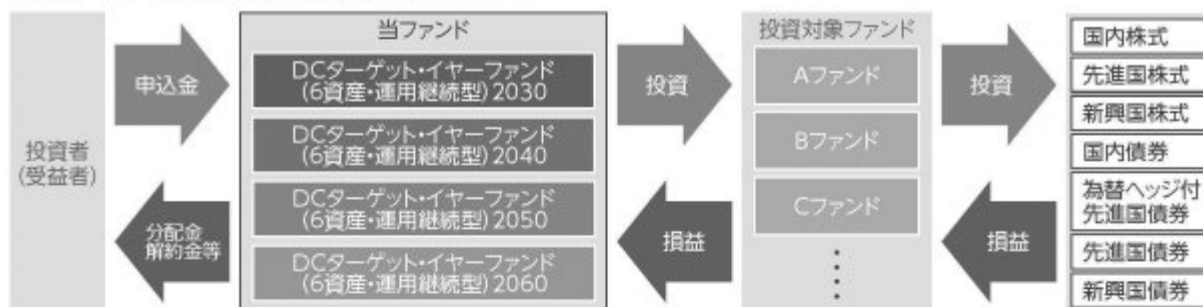
	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

■ 2019年9月末現在

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

- 原則として毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 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。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。

※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。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質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。

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。

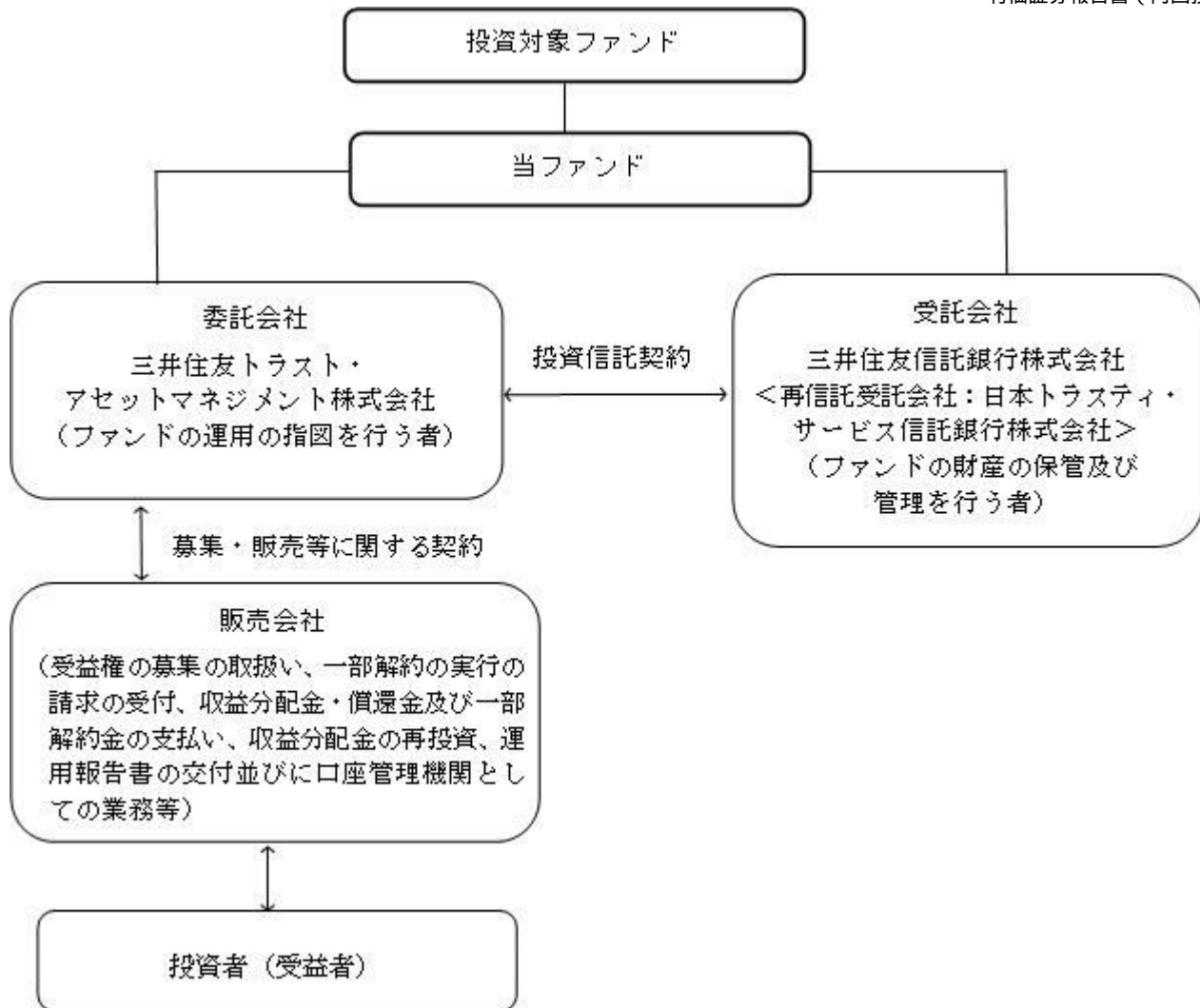
(2) 【ファンドの沿革】

2019年 3月20日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の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。

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」ということがあります。）を投資対象とします。

投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）及び債券に分散投資します。

ロ．当初設定時の各資産の基本組入比率は以下のとおりとします。

	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2030	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2040	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2050	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2060
国内株式	5.1%	5.7%	6.4%	7.0%
先進国株式	30.4%	34.4%	38.4%	42.0%
新興国株式	15.2%	17.2%	19.2%	21.0%
国内債券 及び為替ヘッジ 付先進国債券	32.4%	22.3%	12.1%	3.0%
先進国債券	9.3%	12.3%	15.3%	18.0%
新興国債券	7.6%	8.1%	8.6%	9.0%

ハ．（１）年8月の決算日の翌日（第（２）計算期間開始日）（以下、「ターゲット・イヤー」といいます。）に近づくにしたいが、定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。なお、基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

上記、（１）及び（２）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	（ 1）	（ 2）
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2030	13
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2040	23
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2050	33
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2060	43

ニ．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。

ホ．投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ヘ．為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

ト．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記

の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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

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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）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。

金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

・全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

以下の内容は、2019年 9月30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. 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	<p>原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

2. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
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。

3. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
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。

4.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	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>

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。

5. 外国債券パッシブファンド私募A（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、長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）に採用されている国の国債等に分散投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化を図るため、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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、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。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年2回：6月・12月の各10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。</p> <p>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。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年0.209%（税抜 年0.19%）
信託財産留保額	一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2014年5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

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。

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

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

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
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。

7. 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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

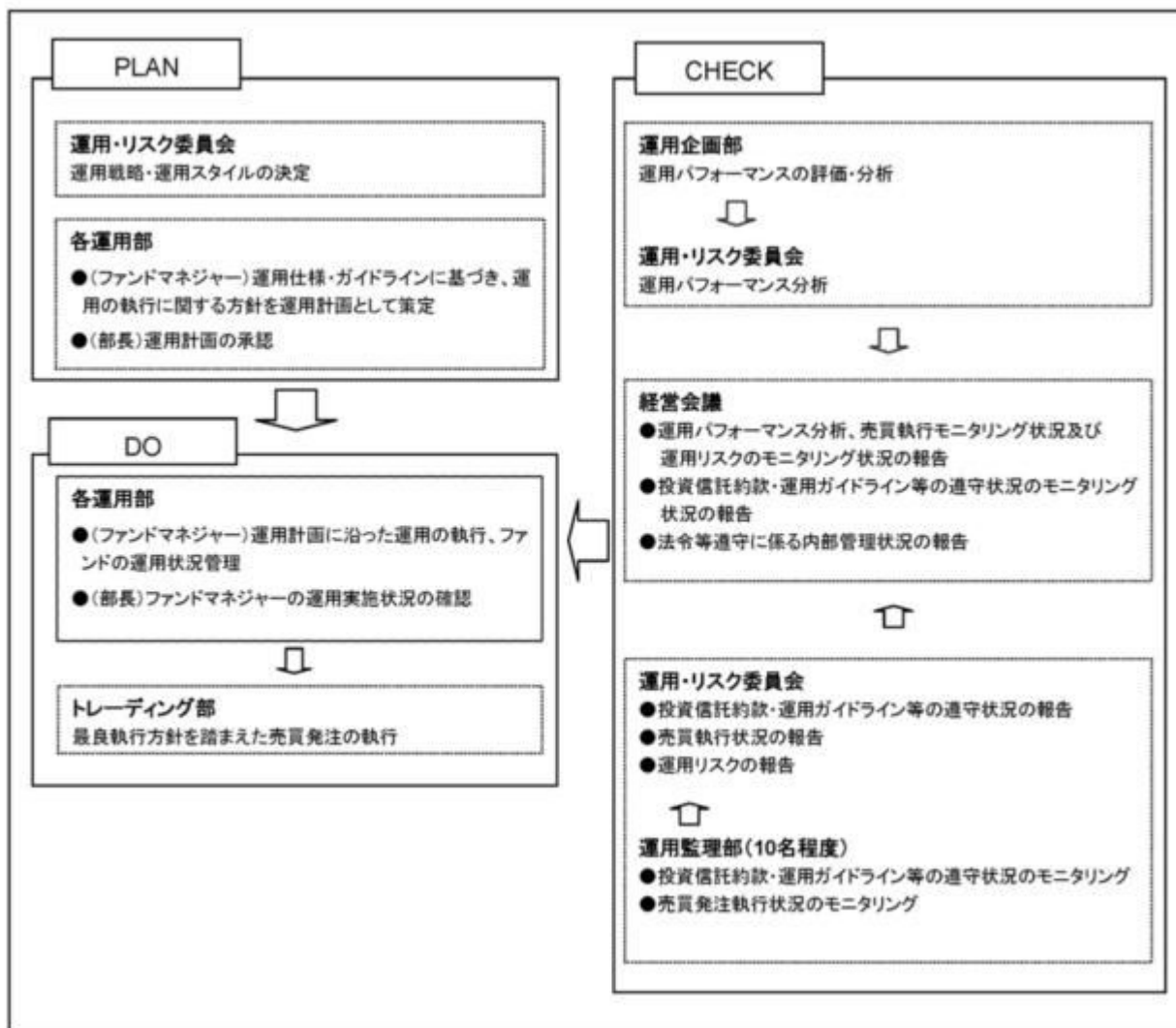
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。</p>
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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（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・マーケット・グローバル・ディバースファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティ

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。

（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）【配分方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です

- ・ 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。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。
- ・ 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．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。

ニ．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。

ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ．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。

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

（二）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じ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。

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

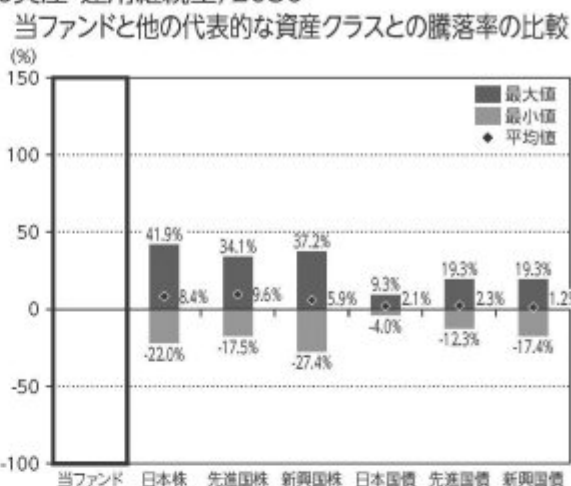
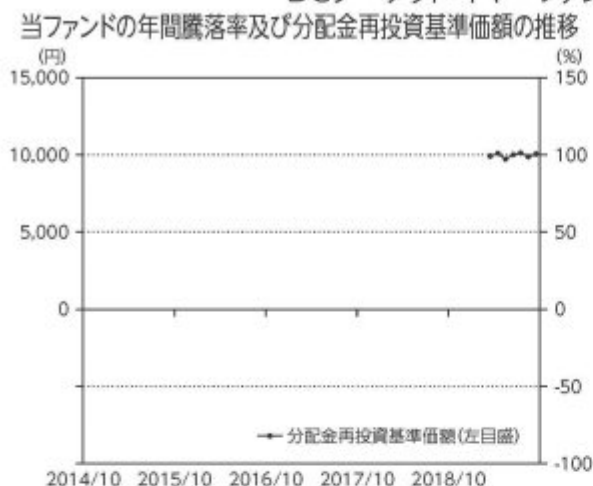
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

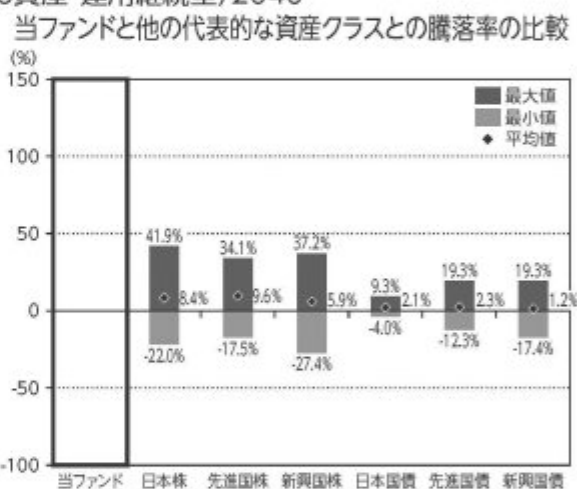
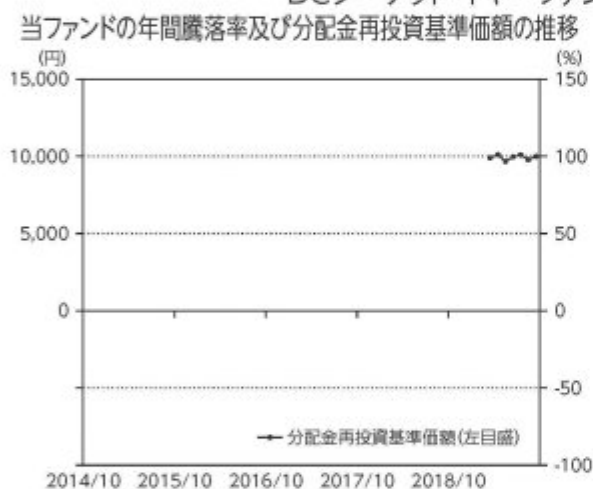
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

〔参考情報〕

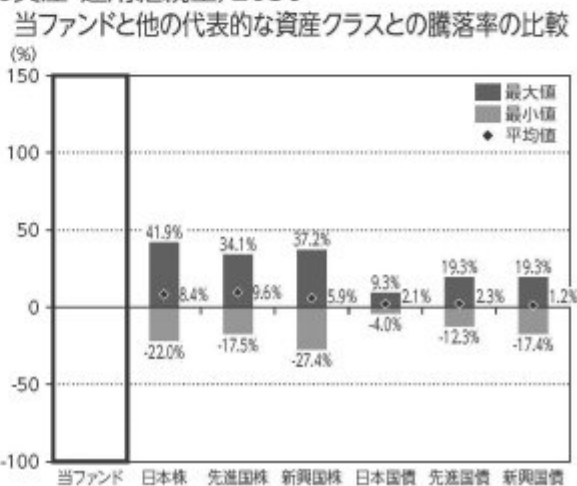
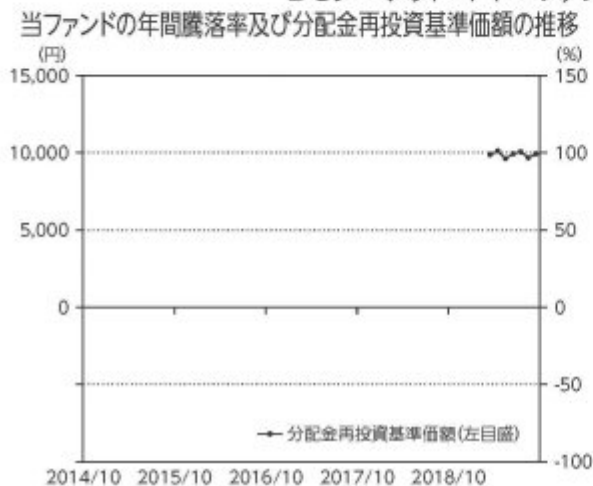
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030



DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

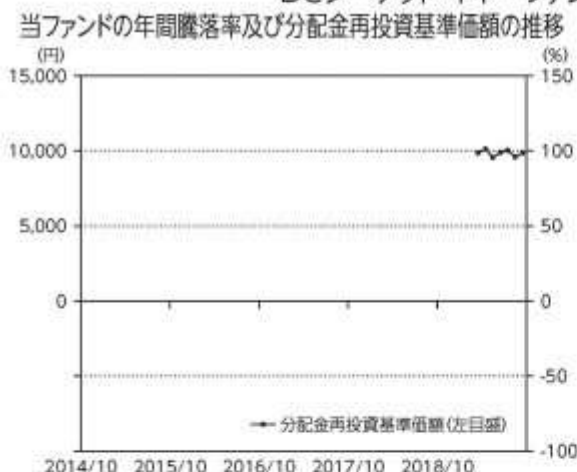


DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050



【参考情報】

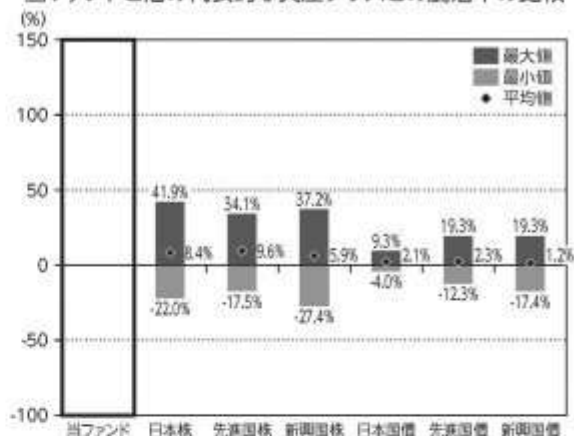
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2014年10月～2019年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 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国内普通株式全部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 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 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 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率国債の市場全体の動き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 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発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、本ファンドの推薦、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、遅延または遅延につき自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 JPMorgan EMBI Global Bond Index(配当込み、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諾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】

ありません。

(2) 【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.44%（税抜 0.4%）（ ）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 0.198% (税抜 0.18%)	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 0.198% (税抜 0.18%)	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 0.044% (税抜 0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

信託報酬に係る消費税等相当額を、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
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式インデックス 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。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	年率 0.209% (税抜 0.19%)
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

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。

実質的な信託報酬率：上限 年率0.649%（税抜 上限0.59%）
（投資対象とする投資信託証券：上限 年率0.209%（税抜 上限0.19%））

（４）【その他の手数料等】

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

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

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、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があります。）。

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2019年 9月30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9月30日現在の状況について記載してあります。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

（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	136,472	27.16
親投資信託受益証券	日本	360,528	71.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,397	1.07
合計(純資産総額)		502,397	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	58,867	2.4583	144,712	2.5933	152,659	30.39
日本	投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	131,832	1.0424	137,421	1.0352	136,472	27.16
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	26,252	2.5155	66,036	2.6692	70,071	13.95
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	16,800	2.7849	46,786	2.8139	47,273	9.41
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	22,339	1.6434	36,711	1.6965	37,898	7.54
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	18,784	1.4499	27,234	1.4359	26,971	5.37
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	17,365	1.3733	23,847	1.4775	25,656	5.11

(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	27.16
親投資信託受益証券	71.76
合計	98.93

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	488,321	488,321	9,766	9,766
2019年 3月末日	495,440		9,909	
4月末日	504,261		10,085	
5月末日	486,091		9,722	
6月末日	499,843		9,997	
7月末日	505,475		10,110	
8月末日	493,431		9,869	
9月末日	502,397		10,048	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	2.3

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

（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	89,413	17.91
親投資信託受益証券	日本	405,000	81.11
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,895	0.98
合計（純資産総額）		499,308	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	66,613	2.4583	163,754	2.5933	172,747	34.60
日本	投資信託受益証券	外国債券バッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	86,373	1.0424	90,035	1.0352	89,413	17.91
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	29,706	2.5155	74,725	2.6692	79,291	15.88
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	22,219	2.7849	61,877	2.8139	62,522	12.52
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	23,809	1.6434	39,127	1.6965	40,391	8.09
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	19,408	1.3733	26,653	1.4775	28,675	5.74
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	14,886	1.4499	21,583	1.4359	21,374	4.28

(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	17.91
親投資信託受益証券	81.11
合計	99.02

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	482,826	482,826	9,657	9,657
	2019年 3月末日	494,440		9,889	
	4月末日	504,845		10,097	
	5月末日	483,374		9,667	
	6月末日	497,946		9,959	
	7月末日	504,037		10,081	
	8月末日	488,570		9,771	
	9月末日	499,308		9,986	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	3.4

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

（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	42,354	8.54
親投資信託受益証券	日本	449,462	90.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,400	0.89
合計(純資産総額)		496,216	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	74,359	2.4583	182,796	2.5933	192,835	38.86
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	33,160	2.5155	83,413	2.6692	88,510	17.84
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	27,638	2.7849	76,969	2.8139	77,770	15.67
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	25,278	1.6434	41,541	1.6965	42,884	8.64
日本	投資信託受益証券	外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	40,914	1.0424	42,648	1.0352	42,354	8.54
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	21,791	1.3733	29,925	1.4775	32,196	6.49
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	10,633	1.4499	15,416	1.4359	15,267	3.08

(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	8.54
親投資信託受益証券	90.58
合計	99.11

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	477,285	477,285	9,546	9,546
	2019年 3月末日	493,433		9,869	
	4月末日	505,439		10,109	
	5月末日	480,627		9,613	
	6月末日	496,034		9,921	
	7月末日	502,583		10,052	
	8月末日	483,674		9,673	
	9月末日	496,216		9,924	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	4.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）

第1期計算期間	2019年 3月20日 ~ 2019年 8月28日	500,000		500,000
---------	---------------------------	---------	--	---------

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	489,487	99.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,956	0.80
合計(純資産総額)		493,443	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	81,330	2.4583	199,933	2.5933	210,913	42.74
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	36,269	2.5155	91,234	2.6692	96,809	19.62
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	32,515	2.7849	90,551	2.8139	91,493	18.54
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	26,454	1.6434	43,474	1.6965	44,879	9.10
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	23,834	1.3733	32,731	1.4775	35,214	7.14
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	7,089	1.4499	10,278	1.4359	10,179	2.06

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.20
合計	99.20

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	472,333	472,333	9,447	9,447
	2019年 3月末日	492,536		9,851	
	4月末日	505,980		10,120	
	5月末日	478,180		9,564	
	6月末日	494,328		9,887	
	7月末日	501,283		10,026	
	8月末日	479,296		9,586	
	9月末日	493,443		9,869	

【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	5.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000

(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	301,610,113,430	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,644,409,912	1.84
合計(純資産総額)		307,254,523,342	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（％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,685,040,000	1.85

(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	1,478,800	6,620.83	9,790,883,404	7,216.00	10,671,020,800	3.47
日本	株式	ソニー	電気機器	890,600	5,385.08	4,795,952,248	6,347.00	5,652,638,200	1.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,009,800	506.91	4,567,157,718	548.40	4,940,974,320	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	890,700	4,931.39	4,392,389,073	5,156.00	4,592,449,200	1.49
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,033,300	5,224.96	5,398,951,168	4,240.00	4,381,192,000	1.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	65,100	62,796.56	4,088,056,056	66,900.00	4,355,190,000	1.42
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,158,500	3,830.71	4,437,877,535	3,690.00	4,274,865,000	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	922,400	3,803.35	3,508,210,040	3,695.00	3,408,268,000	1.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,119,500	2,750.86	3,079,587,770	2,798.50	3,132,920,750	1.02

日本	株式	任天堂	その他製品	75,900	39,070.09	2,965,419,831	40,020.00	3,037,518,000	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,067,600	2,790.04	2,978,646,704	2,825.00	3,015,970,000	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	908,400	3,599.89	3,270,140,076	3,286.00	2,985,002,400	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,784,900	155.43	2,764,307,007	165.60	2,945,179,440	0.96
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	468,000	5,559.68	2,601,930,240	5,779.00	2,704,572,000	0.88
日本	株式	信越化学工業	化学	229,000	9,369.27	2,145,562,830	11,560.00	2,647,240,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	118,800	22,644.36	2,690,149,968	22,220.00	2,639,736,000	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	379,700	5,518.30	2,095,298,510	6,804.00	2,583,478,800	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	181,200	13,786.22	2,498,063,064	14,180.00	2,569,416,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	126,100	18,404.28	2,320,779,708	20,340.00	2,564,874,000	0.83
日本	株式	花王	化学	317,700	8,612.72	2,736,261,144	7,984.00	2,536,516,800	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	149,900	13,568.50	2,033,918,150	16,440.00	2,464,356,000	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	917,200	2,834.79	2,600,069,388	2,651.00	2,431,497,200	0.79
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	233,600	10,412.18	2,432,285,248	10,310.00	2,408,416,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	597,400	3,777.18	2,256,487,332	4,023.00	2,403,340,200	0.78
日本	株式	HOYA	精密機器	267,200	7,935.09	2,120,256,048	8,819.00	2,356,436,800	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	159,700	13,735.61	2,193,576,917	14,520.00	2,318,844,000	0.75
日本	株式	資生堂	化学	263,700	8,055.62	2,124,266,994	8,629.00	2,275,467,300	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	824,600	2,523.32	2,080,729,672	2,753.00	2,270,123,800	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	547,900	3,760.81	2,060,547,799	4,132.00	2,263,922,800	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	417,800	4,677.16	1,954,117,448	5,185.00	2,166,293,000	0.71

(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	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.84
		食料品	3.99
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.14
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.73
金属製品	0.55		

機械	4.95
電気機器	13.78
輸送用機器	7.71
精密機器	2.21
その他製品	2.21
電気・ガス業	1.62
陸運業	4.63
海運業	0.16
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.39
卸売業	4.77
小売業	4.72
銀行業	5.77
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	2.28
その他金融業	1.10
不動産業	2.50
サービス業	5.11
小計	98.16
合計	98.16

(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	358	円	5,642,407,100	5,685,040,000	1.85

(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	226,145,962,337	62.37
	イギリス	21,217,148,625	5.85
	カナダ	13,804,350,391	3.81
	スイス	13,501,047,592	3.72
	フランス	13,355,572,842	3.68
	ドイツ	11,102,457,859	3.06
	オーストラリア	8,203,554,961	2.26
	オランダ	6,820,679,089	1.88
	アイルランド	6,581,931,932	1.82
	スペイン	3,765,879,995	1.04
	香港	3,089,260,786	0.85
	スウェーデン	3,050,525,845	0.84
	イタリア	2,504,394,376	0.69
	デンマーク	2,293,485,382	0.63
	シンガポール	1,518,050,317	0.42
	フィンランド	1,475,260,826	0.41
	バミューダ	1,439,442,122	0.40
	ベルギー	1,331,209,845	0.37
	ジャージー	961,964,131	0.27
	ノルウェー	862,577,696	0.24
	ケイマン	765,860,083	0.21
	イスラエル	739,544,374	0.20
	キュラソー	455,783,420	0.13
	ルクセンブルク	362,017,385	0.10
	ニュージーランド	304,829,618	0.08
	オーストリア	289,466,636	0.08
	ポルトガル	200,014,543	0.06
	リベリア	176,621,411	0.05
	パナマ	165,202,973	0.05
	パプアニューギニア	63,627,181	0.02
マン島	41,843,791	0.01	
英ヴァージン諸島	40,649,486	0.01	
モーリシャス	7,524,570	0.00	
	小計	346,637,742,420	95.60
投資信託受益証券	オーストラリア	196,544,145	0.05
	香港	86,557,555	0.02
		小計	283,101,700
投資証券	アメリカ	8,247,175,581	2.27
	オーストラリア	636,620,926	0.18
	フランス	390,551,193	0.11
	イギリス	228,836,587	0.06
	香港	211,425,152	0.06

	シンガポール	154,682,648	0.04
	カナダ	66,059,002	0.02
	小計	9,935,351,089	2.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,738,844,550	1.58
合計(純資産総額)		362,595,039,759	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	6,780,889,875	1.87
	買建	カナダ	406,146,160	0.11
	買建	ドイツ	1,638,693,776	0.45
	買建	イギリス	666,658,444	0.18
	買建	オーストラリア	414,741,860	0.11

(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		4,921,536,170	1.36

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	403,446	19,357.94	7,809,886,568	23,615.05	9,527,399,237	2.63
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	638,320	13,669.75	8,725,680,905	14,863.82	9,487,874,604	2.62
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,704	197,668.76	7,255,234,348	186,210.56	6,834,672,541	1.88

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	210,848	19,859.35	4,187,305,814	19,112.63	4,029,860,232	1.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,512	122,749.84	3,377,093,649	132,211.71	3,637,408,643	1.00
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	284,755	11,736.48	3,342,024,195	12,704.34	3,617,625,020	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	26,286	123,326.10	3,241,750,086	132,304.52	3,477,756,718	0.96
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	233,555	14,751.01	3,445,173,640	13,878.51	3,241,395,870	0.89
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	269,186	10,803.84	2,908,244,858	11,726.37	3,156,576,250	0.87
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	220,272	11,379.98	2,506,691,178	13,443.59	2,961,247,426	0.82
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	152,715	17,725.23	2,706,909,942	18,778.07	2,867,694,487	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	371,576	7,820.45	2,905,894,854	7,714.12	2,866,382,448	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	641,062	3,470.83	2,225,019,099	4,039.44	2,589,535,075	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	114,181	21,573.56	2,463,291,353	22,388.00	2,556,284,685	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	793,510	3,014.46	2,392,005,725	3,167.45	2,513,404,837	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	96,670	20,785.09	2,009,295,006	24,806.49	2,398,043,504	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	363,367	6,339.19	2,303,455,179	6,507.57	2,364,638,368	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	79,856	27,446.96	2,191,805,199	29,044.50	2,319,378,359	0.64
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	158,140	14,308.36	2,262,725,492	14,025.28	2,217,958,285	0.61
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	393,448	4,729.81	1,860,934,459	5,480.17	2,156,164,916	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	167,394	12,762.20	2,136,316,529	12,799.31	2,142,528,033	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	356,211	5,328.56	1,898,093,274	5,861.13	2,087,800,831	0.58
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	375,317	4,935.44	1,852,357,373	5,472.62	2,053,968,522	0.57
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	226,750	8,682.06	1,968,659,217	8,947.64	2,028,879,003	0.56
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	376,282	5,805.87	2,184,646,263	5,270.81	1,983,311,982	0.55
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	83,701	26,008.13	2,176,906,838	23,230.85	1,944,446,146	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	61,860	29,348.61	1,815,505,529	31,422.76	1,943,812,428	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	46,987	38,389.27	1,803,796,867	41,318.25	1,941,420,669	0.54
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	398,164	4,594.17	1,829,237,080	4,835.89	1,925,479,376	0.53
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	489,061	4,484.70	2,193,293,193	3,908.86	1,911,672,154	0.53

(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	5.55
		素材	4.25
		資本財	6.94
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.07
		耐久消費財・アパレル	1.89
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	5.81
		小売	4.80
		食品・生活必需品小売り	1.56
		食品・飲料・タバコ	4.96
		家庭用品・パーソナル用品	2.22
		ヘルスケア機器・サービス	4.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.87
		銀行	7.79
		各種金融	4.23
		保険	3.90
		不動産	0.55
		ソフトウェア・サービス	9.27
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.25		
電気通信サービス	2.45		
公益事業	3.64		
半導体・半導体製造装置	3.01		
		小計	95.60
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.74
合計			98.42

(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	424	アメリカドル	63,659,393	6,870,121,692	62,832,560	6,780,889,875	1.87
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	5,015,224.5	408,690,645	4,984,000	406,146,160	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	3,292,161	358,450,489	3,303,630	359,699,234	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	307	ユーロ	10,768,761.5	1,270,929,232	10,837,100	1,278,994,542	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	34	オーストラリアドル	5,681,238	414,048,625	5,690,750	414,741,860	0.11
	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	68	イギリスポンド	4,953,585	657,291,193	5,024,180	666,658,444	0.18

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

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

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	31,523,000.00	3,400,944,400	3,401,370,430	0.94
	カナダドル	買建	2,187,000.00	178,142,782	178,196,760	0.05
	ユーロ	買建	4,617,000.00	544,716,675	544,898,340	0.15
	イギリスポンド	買建	2,060,000.00	273,333,200	273,320,800	0.08
	スイスフラン	買建	1,737,000.00	188,975,268	189,124,560	0.05
	スウェーデンクローナ	買建	4,478,000.00	49,364,414	49,347,560	0.01
	ノルウェークローネ	買建	996,000.00	11,835,468	11,822,520	0.00
	デンマーククローネ	買建	2,397,000.00	37,862,640	37,896,570	0.01
	オーストラリアドル	買建	2,133,000.00	155,385,208	155,431,710	0.04
	香港ドル	買建	4,090,000.00	56,289,443	56,237,500	0.02
	シンガポールドル	買建	306,000.00	23,892,786	23,889,420	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	8,723,248,868	15.38

	韓国	6,468,638,797	11.41
	中国	6,453,056,455	11.38
	台湾	6,071,774,852	10.71
	インド	4,814,755,337	8.49
	ブラジル	3,964,424,380	6.99
	南アフリカ	2,414,374,416	4.26
	ロシア	2,103,970,651	3.71
	香港	1,675,869,107	2.95
	タイ	1,599,199,046	2.82
	サウジアラビア	1,387,322,964	2.45
	メキシコ	1,291,554,362	2.28
	インドネシア	1,123,255,961	1.98
	マレーシア	1,116,917,643	1.97
	フィリピン	581,852,418	1.03
	カタール	547,162,957	0.96
	チリ	527,422,824	0.93
	ポーランド	527,018,934	0.93
	バミューダ	496,972,934	0.88
	アラブ首長国連邦	389,482,869	0.69
	トルコ	311,303,296	0.55
	コロンビア	213,737,459	0.38
	アメリカ	181,447,288	0.32
	ギリシャ	162,989,278	0.29
	ハンガリー	148,907,139	0.26
	チェコ	82,903,837	0.15
	エジプト	72,959,028	0.13
	アルゼンチン	65,296,976	0.12
	ルクセンブルク	53,872,679	0.09
	ジャージー	40,671,608	0.07
	シンガポール	32,041,880	0.06
	マン島	29,650,706	0.05
	ペルー	28,703,515	0.05
	パキスタン	17,894,987	0.03
	小計	53,720,655,451	94.72
投資信託受益証券	ブラジル	148,928,150	0.26
	メキシコ	28,341,200	0.05
	小計	177,269,350	0.31
投資証券	南アフリカ	107,802,786	0.19
	メキシコ	48,622,220	0.09
	小計	156,425,006	0.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,659,837,251	4.69
合計(純資産総額)		56,714,187,058	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	3,346,243,064	5.90

(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		960,329,000	1.69

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	530,400	3,893.47	2,065,099,797	4,532.54	2,404,061,338	4.24
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	132,184	16,019.55	2,117,529,032	17,912.56	2,367,754,042	4.17
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,277,389	806.62	1,837,004,108	946.56	2,155,685,332	3.80
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	441,054	3,982.92	1,756,685,856	4,351.16	1,919,096,523	3.38
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,846,620	88.25	780,793,538	81.45	720,638,588	1.27
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	41,274	12,913.22	532,980,597	16,515.05	681,642,322	1.20

中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	512,000	1,077.46	551,663,335	1,236.33	633,004,032	1.12
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	266,443	1,705.47	454,410,545	2,015.93	537,132,302	0.95
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信 サービス	582,000	1,002.27	583,324,396	880.64	512,532,480	0.90
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	154,909	2,828.30	438,130,094	3,135.28	485,684,019	0.86
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,109,515	73.75	450,598,726	71.41	436,307,348	0.77
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	466,981	883.52	412,591,685	922.00	430,558,116	0.76
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	326,529	1,031.87	336,936,992	1,204.58	393,332,915	0.69
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	493,504	487.79	240,730,462	764.07	377,073,378	0.66
ブラジル	株式	VALE SA	素材	302,478	1,405.52	425,139,254	1,236.77	374,097,833	0.66
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	50,048	6,508.82	325,753,525	7,317.85	366,244,257	0.65
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	233,869	1,289.64	301,607,752	1,548.11	362,055,498	0.64
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	36,794	8,152.27	299,954,873	9,119.24	335,533,317	0.59
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	365,953	778.75	284,987,688	895.27	327,628,572	0.58
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	46.09	341,488,388	41.96	310,907,338	0.55
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	1,196,248	264.05	315,878,249	254.73	304,727,431	0.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	26,753	19,170.39	512,865,634	10,922.58	292,211,868	0.52
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	402,440	667.02	268,438,811	717.77	288,862,176	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	79,690	3,360.25	267,778,462	3,533.06	281,550,348	0.50
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,626,000	185.31	301,322,448	164.56	267,590,170	0.47
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信 サービス	3,304,240	79.80	263,685,093	79.13	261,468,476	0.46
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	80,692	2,940.16	237,248,036	3,166.47	255,508,878	0.45
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	412,820	566.91	234,034,651	566.97	234,059,032	0.41
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲 料・タバコ	438,500	417.21	182,949,727	504.72	221,323,009	0.39

ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	278,100	727.12	202,213,317	789.39	219,531,862	0.39
------	----	---------------------------	-------	---------	--------	-------------	--------	-------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.45
		素材	7.03
		資本財	3.04
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	2.21
		耐久消費財・アパレル	1.26
		消費者サービス	1.34
		メディア・娯楽	6.59
		小売	7.49
		食品・生活必需品小売り	1.65
		食品・飲料・タバコ	3.74
		家庭用品・パーソナル用品	1.09
		ヘルスケア機器・サービス	0.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.84
		銀行	17.25
		各種金融	2.43
		保険	3.83
		不動産	2.39
		ソフトウェア・サービス	1.83
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.93		
電気通信サービス	4.48		
公益事業	2.56		
半導体・半導体製造装置	5.57		
		小計	94.72
投資信託受益証券			0.31
投資証券			0.28
合計			95.31

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	インター コンチ ネンタ ル取引 所	MSCI EMERG M	買建	622	アメリ カド ル	31,760,149	3,427,555,280	31,006,700	3,346,243,064	5.90

(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	8,900,000.00	960,120,000	960,329,000	1.69

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	455,999,926,450	83.67
地方債証券	日本	28,757,304,488	5.28
特殊債券	日本	37,353,125,858	6.85
社債券	日本	19,217,283,220	3.53
	フランス	1,605,371,000	0.29
	オーストラリア	704,440,000	0.13
	アメリカ	210,338,000	0.04
	イギリス	100,668,000	0.02
	小計	21,838,100,220	4.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,020,096,955	0.19
合計(純資産総額)		544,968,553,971	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	155,020,000	0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,710,000,000	101.37	9,843,793,200	101.94	9,899,150,800	0.100	2023/12/20	1.82
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,830,000,000	101.59	6,938,836,600	101.85	6,956,491,600	0.100	2023/9/20	1.28
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,550,000,000	102.61	6,721,481,900	103.65	6,789,337,000	0.100	2028/3/20	1.25
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	104.63	6,612,995,200	0.400	2025/9/20	1.21
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	6,040,000,000	101.95	6,158,233,800	102.20	6,173,302,800	0.100	2024/6/20	1.13
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,890,000,000	103.97	6,124,268,300	104.43	6,151,280,400	0.400	2025/6/20	1.13
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,970,000,000	101.28	6,046,822,900	101.49	6,059,430,600	0.100	2022/12/20	1.11
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	101.20	5,971,154,000	101.79	6,005,610,000	0.100	2023/6/20	1.10
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	5,760,000,000	102.45	5,901,365,400	103.07	5,937,350,400	0.100	2026/3/20	1.09
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,770,000,000	101.51	5,857,410,400	102.08	5,890,419,900	0.100	2024/3/20	1.08
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	101.13	5,744,240,800	101.63	5,772,697,600	0.100	2023/3/20	1.06
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.81	5,585,261,800	101.09	5,600,607,600	0.100	2022/3/20	1.03
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	5,090,000,000	103.13	5,249,515,800	103.22	5,254,305,200	0.100	2029/6/20	0.96
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,890,000,000	102.42	5,008,771,900	103.54	5,063,252,700	0.100	2028/9/20	0.93
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.89	4,842,768,000	101.22	4,858,560,000	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.50	4,804,234,600	100.60	4,808,823,400	0.100	2021/3/20	0.88
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	100.98	4,786,546,800	101.36	4,804,701,000	0.100	2022/9/20	0.88

日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	102.96	4,705,317,700	1.000	2021/12/20	0.86
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,400,000,000	102.02	4,488,880,000	103.44	4,551,756,000	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,110,000,000	103.24	4,243,537,400	103.64	4,259,850,600	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,940,000,000	102.12	4,023,833,200	103.34	4,071,714,200	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,830,000,000	102.44	3,923,615,400	103.62	3,968,914,100	0.100	2028/6/20	0.73
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	102.14	3,891,876,900	101.84	3,880,142,100	1.200	2020/12/20	0.71
日本	国債証券	第403回利付国債（2年）	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.77	3,799,179,800	0.100	2021/8/1	0.70
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	3,620,000,000	103.72	3,754,953,600	104.35	3,777,506,200	0.500	2024/9/20	0.69
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	3,620,000,000	102.59	3,714,041,800	103.28	3,739,025,600	0.100	2026/9/20	0.69
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	104.23	3,575,123,300	0.300	2025/12/20	0.66
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,380,000,000	102.78	3,473,997,800	103.51	3,498,638,000	0.300	2024/12/20	0.64
日本	国債証券	第401回利付国債（2年）	3,460,000,000	100.59	3,480,483,800	100.69	3,484,012,400	0.100	2021/6/1	0.64
日本	国債証券	第398回利付国債（2年）	3,460,000,000	100.47	3,476,284,000	100.58	3,480,137,200	0.100	2021/3/1	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.67
地方債証券	5.28
特殊債券	6.85
社債券	4.01
合計	99.81

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		155,170,324	155,020,000	0.03

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	183,969,770,015	46.77
	フランス	38,149,766,634	9.70
	イタリア	35,079,099,720	8.92
	イギリス	24,667,174,312	6.27
	ドイツ	24,665,452,961	6.27
	スペイン	21,632,329,690	5.50
	ベルギー	9,641,402,603	2.45
	オーストラリア	7,632,007,071	1.94
	カナダ	7,410,044,328	1.88
	オランダ	7,142,336,212	1.82
	オーストリア	5,347,433,738	1.36
	メキシコ	3,027,865,537	0.77
	アイルランド	2,776,488,940	0.71
	フィンランド	2,207,857,172	0.56
	ポーランド	2,200,710,389	0.56
	南アフリカ	2,085,338,649	0.53
	デンマーク	2,032,236,564	0.52
	マレーシア	1,778,929,838	0.45
	シンガポール	1,586,933,809	0.40
	スウェーデン	1,287,591,863	0.33
ノルウェー	891,001,357	0.23	
	小計	385,211,771,402	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,178,396,750	2.08
合計(純資産総額)		393,390,168,152	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	2,965,660,996	0.75
	買建	ドイツ	3,625,930,820	0.92

(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		8,576,044,400	2.18

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,154.17	2,230,835,904	11,237.17	2,247,434,000	2.750	2023/5/31	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,029.37	2,068,007,712	11,368.69	2,131,630,781	2.375	2027/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	19,200,000	9,948.77	1,910,165,451	11,051.68	2,121,923,040	2.250	2046/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,266.88	2,029,166,866	11,452.16	2,062,535,262	2.375	2029/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,217.20	2,019,096,864	11,441.20	2,059,417,125	2.625	2026/1/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,862.25	2,009,516,603	10,906.66	2,017,733,025	2.125	2021/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,616.05	1,738,922,740	12,845.85	1,923,024,119	3.000	2049/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,378.86	1,712,513,343	11,602.24	1,914,370,124	2.500	2046/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,106.48	1,854,783,108	11,434.46	1,909,555,028	2.625	2025/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,664.26	1,866,246,643	10,851.44	1,899,002,049	1.750	2023/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,347.61	1,806,541,012	11,857.71	1,887,747,432	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,372.12	1,659,539,800	11,607.30	1,857,168,309	2.500	2046/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	15,000,000	11,256.91	1,688,537,904	11,673.06	1,750,959,852	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,339.60	1,700,941,458	11,643.55	1,746,533,438	3.000	2025/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,583.69	1,668,051,998	12,108.11	1,743,569,018	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/20	15,970,000	10,704.03	1,709,434,262	10,745.62	1,716,076,819	1.375	2020/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,344.24	1,617,689,611	11,836.63	1,687,903,712	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	10,976.54	1,646,481,480	11,113.65	1,667,047,832	2.250	2024/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,005.78	1,650,868,428	11,063.06	1,659,459,707	2.375	2023/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,811.39	1,583,868,917	11,283.54	1,653,038,892	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	10,908.35	1,636,252,688	10,997.72	1,649,658,375	2.500	2022/1/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,101.33	1,620,794,387	11,296.18	1,649,243,557	2.375	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/47	12,750,000	12,115.71	1,544,753,257	12,768.28	1,627,956,337	3.000	2047/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,763.40	1,619,891,881	10,814.34	1,627,558,589	1.750	2021/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	10,867.04	1,624,622,673	10,877.57	1,626,197,792	2.125	2021/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,734.47	1,610,171,796	10,799.16	1,619,874,980	1.625	2022/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,729.18	1,571,825,926	10,884.74	1,594,614,959	1.875	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,776.95	1,413,235,063	12,914.98	1,549,798,650	3.125	2044/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000	20,225.15	1,387,445,541	22,455.90	1,540,474,839	4.500	2041/4/25	0.39

アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,618.42	1,388,401,864	12,816.34	1,531,553,010	3.000	2048/8/15	0.39
------	------	---------------	------------	-----------	---------------	-----------	---------------	-------	-----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.92
合計	97.92

(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	99	アメリカ ドル	11,832,872.38	1,277,003,587	11,800,335.69	1,273,492,227	0.32
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	58	アメリカ ドル	7,592,450.97	819,377,309	7,562,656.54	816,161,894	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	50	アメリカ ドル	8,174,918.75	882,237,231	8,117,187.5	876,006,875	0.22
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	46	ユーロ	5,170,639	610,238,815	5,166,950	609,803,439	0.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	51	ユーロ	6,928,874	817,745,709	6,915,600	816,179,112	0.21
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	107	ユーロ	18,687,298	2,205,474,910	18,640,470	2,199,948,269	0.56

(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	39,740,000.00	4,274,877,309	4,284,369,400	1.09
	カナダドル	買建	4,230,000.00	344,431,908	344,406,600	0.09
	ユーロ	買建	28,670,000.00	3,393,611,939	3,383,633,400	0.86
	イギリスポンド	買建	4,250,000.00	564,937,302	563,635,000	0.14

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	5,117,654,081	9.99
	ブラジル	5,069,295,638	9.89
	インドネシア	4,973,111,946	9.70
	タイ	4,733,386,197	9.24
	ポーランド	4,370,862,445	8.53
	南アフリカ	4,262,677,509	8.32
	ロシア	4,102,043,902	8.00
	コロンビア	3,238,564,173	6.32
	マレーシア	3,079,293,493	6.01
	ハンガリー	2,127,281,049	4.15
	チェコ	1,963,382,278	3.83
	ペルー	1,919,420,049	3.75
	トルコ	1,873,795,123	3.66
	チリ	1,743,975,872	3.40
	フィリピン	144,553,760	0.28
	ドミニカ共和国	95,220,550	0.19
	ウルグアイ	90,395,954	0.18
	小計	48,904,914,019	95.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,345,874,180	4.58
合計(純資産総額)		51,250,788,199	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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	55,500,000,000	3.85	2,139,212,857	3.96	2,201,764,032	9.850	2027/6/28	4.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000	2,678.97	853,255,038	2,886.81	919,450,480	10.000	2023/1/1	1.79
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	35,400,000	2,119.10	750,164,847	2,296.18	812,848,010	0.000	2022/1/1	1.59

タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	361.99	637,466,661	451.53	795,151,515	3.400	2036/6/17	1.55
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	94,850,000	770.30	730,637,249	795.70	754,727,406	10.500	2026/12/21	1.47
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	2.94	697,071,546	3.06	724,830,592	4.375	2023/3/21	1.41
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	23,450,000	2,717.58	637,273,636	2,976.87	698,076,932	10.000	2025/1/1	1.36
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	23,750,000	2,701.97	641,718,775	2,745.48	652,053,433	10.000	2021/1/1	1.27
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	372.49	509,942,863	434.84	595,300,040	3.650	2031/6/20	1.16
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	19,350,000	2,681.02	518,778,304	3,045.68	589,340,651	10.000	2027/1/1	1.15
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,726.35	576,623,127	2,770.79	586,022,607	2.500	2023/1/25	1.14
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	509.85	469,834,460	571.55	526,688,651	7.500	2027/6/3	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	582.14	478,818,204	628.01	516,545,595	10.000	2024/12/5	1.01
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	521.45	478,171,612	546.72	501,342,625	6.500	2021/6/10	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000	629.87	468,628,114	634.03	471,725,433	8.750	2048/2/28	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	77,600,000	535.47	415,527,397	574.41	445,744,954	8.000	2023/12/7	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	512.74	416,346,310	546.44	443,716,718	6.500	2022/6/9	0.87
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	415.69	394,910,364	461.52	438,449,444	4.875	2029/6/22	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000	630.78	430,197,426	635.82	433,631,367	8.750	2044/1/31	0.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	20,600,000	2,004.13	412,851,005	2,065.01	425,392,429	0.000	2023/7/1	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000	2,570.18	359,826,420	2,802.08	392,291,659	2.500	2027/7/25	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	58,800,000	642.82	377,983,092	665.37	391,240,312	8.000	2030/1/31	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	13,950,000	2,600.51	362,771,831	2,796.12	390,060,071	2.500	2026/7/25	0.76
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000	0.76	370,696,962	0.80	389,462,266	8.375	2024/3/15	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	63,700,000	553.81	352,781,943	610.42	388,842,738	8.500	2029/5/31	0.76
チリ	国債証券	BTPCL 5% 03/01/35	2,060,000,000	18.77	386,720,984	18.74	386,146,338	5.000	2035/3/1	0.75
チリ	国債証券	BTPCL 6% 01/01/43	1,675,000,000	22.32	373,920,900	22.52	377,270,388	6.000	2043/1/1	0.74
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,762.98	350,898,484	2,903.37	368,728,965	3.250	2025/7/25	0.72
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.76	346,440,870	0.81	365,746,770	8.375	2026/9/15	0.71
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000	339.02	332,247,391	370.53	363,122,899	2.125	2026/12/17	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.42
合計	95.42

(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。

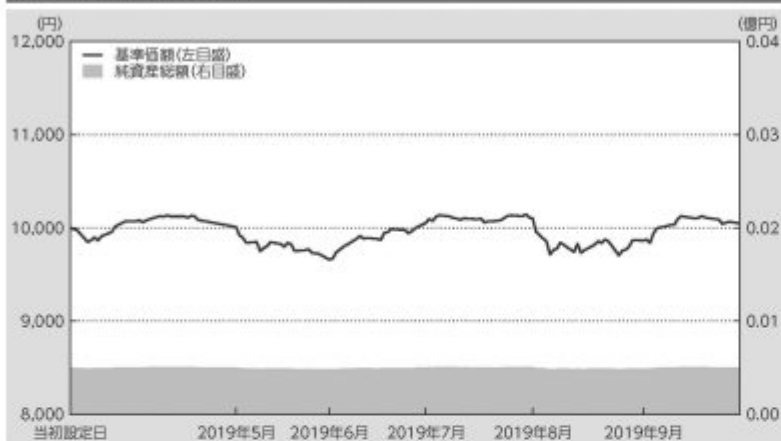
参考情報

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：2019年3月20日

作成基準日：2019年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030**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	10,048円
純資産総額	0.01億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

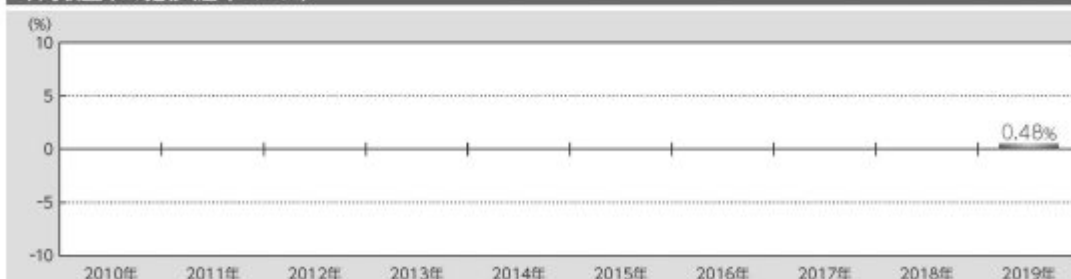
決算期	分配金
2019年8月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来 分配金合計額	0円

※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
外国株式インデックス マザーファンド	30.4%
外国債券パッシブファンド私専A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	27.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	13.9%
外国債券インデックス マザーファンド	9.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.5%
国内債券インデックス マザーファンド	5.4%
国内株式インデックス マザーファンド	5.1%

※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)

※2019年は当初設定日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。

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2019年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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	9,986円
純資産総額	0.00億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	0円
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来 分配金合計額	0円

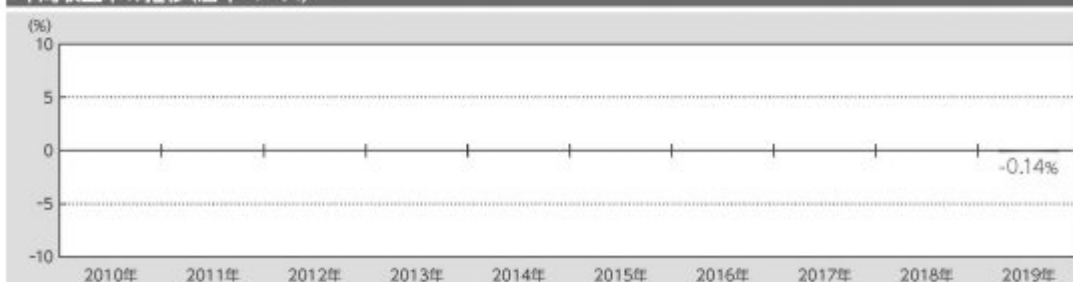
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	34.6%
外国債券バシプファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	17.9%
新興国株式インデックス マザーファンド	15.9%
外国債券インデックス マザーファンド	12.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.1%
国内株式インデックス マザーファンド	5.7%
国内債券インデックス マザーファンド	4.3%

※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)



※2019年は当初設定日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。

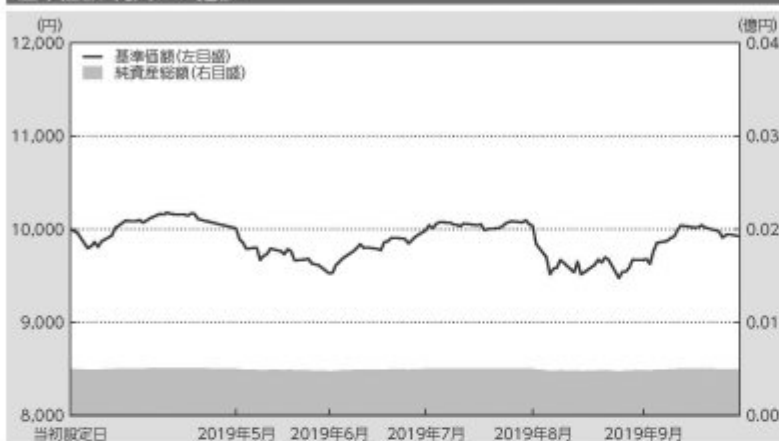
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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。


運用実績

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2019年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050**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	9,924円
純資産総額	0.00億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

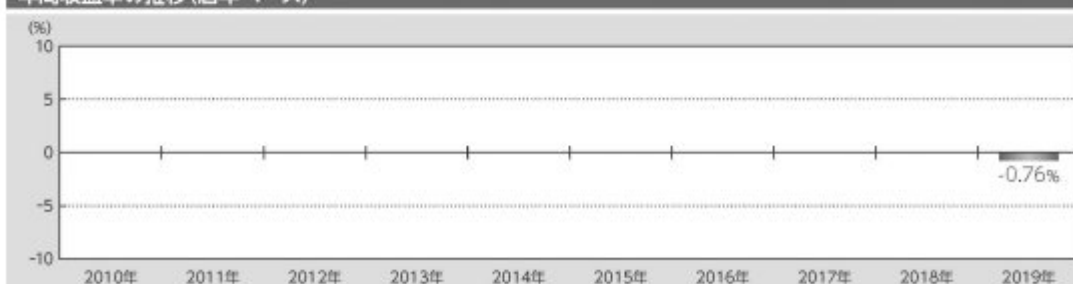
決算期	分配金
2019年8月	0円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来 分配金合計額	0円

※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
外国株式インデックス マザーファンド	38.9%
新興国株式インデックス マザーファンド	17.8%
外国債券インデックス マザーファンド	15.7%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.6%
外国債券バシプファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	8.5%
国内株式インデックス マザーファンド	6.5%
国内債券インデックス マザーファンド	3.1%

※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)

※2019年は当初設定日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。

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2019年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

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	9,869円
純資産総額	0.00億円

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	0円
-	-
-	-
-	-
-	-
設定来 分配金合計額	0円

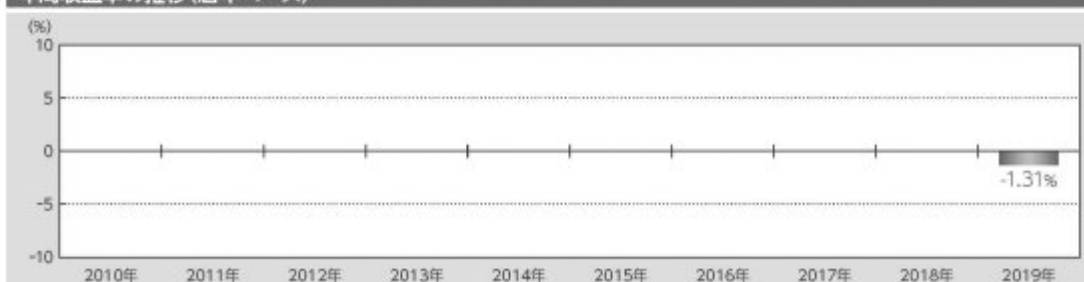
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	42.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	19.6%
外国債券インデックス マザーファンド	18.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.1%
国内株式インデックス マザーファンド	7.1%
国内債券インデックス マザーファンド	2.1%

※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)



※2019年は当初設定日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 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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 >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「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 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

当初自己設定：受益権1口当たり1円とします。

継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<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 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、支払は翌営業日となります。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

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、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）

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

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。

< 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。（2019年3月20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8月29日から翌年8月28日までとします。

ただし、第1計算期間は2019年3月20日から2019年8月28日までとします。

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

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年3月20日から2019年8月28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)【貸借対照表】

(単位:円)

第1期
(2019年8月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,435
投資信託受益証券	137,421
親投資信託受益証券	345,326
流動資産合計	489,182
資産合計	489,182
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	133
未払委託者報酬	728
流動負債合計	861
負債合計	861
純資産の部	
元本等	
元本	500,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	11,679
(分配準備積立金)	5,460
元本等合計	488,321
純資産合計	488,321
負債純資産合計	489,182

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 2019年 3月20日
	至 2019年 8月28日
営業収益	
受取配当金	1,437
有価証券売買等損益	12,253
営業収益合計	10,816
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	133
委託者報酬	728
営業費用合計	863
営業利益又は営業損失（ ）	11,679
経常利益又は経常損失（ ）	11,679
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,679
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,679

（ 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
3. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2019年 3月20日から2019年8月28日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		500,000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	11,679円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9766円 (9,766円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,460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	- 円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,460円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	109円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第1期 (2019年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)
	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	6,921
親投資信託受益証券	19,174

合計	12,253
----	--------

（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	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	131,832	137,421	
投資信託受益証券合計		131,832	137,421	
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	26,252	66,036	
	国内株式インデックス マザーファンド	17,365	23,847	
	外国株式インデックス マザーファンド	58,867	144,712	
	国内債券インデックス マザーファンド	18,784	27,234	
	外国債券インデックス マザーファンド	16,800	46,786	
	新興国債券インデックス マザーファンド	22,339	36,711	
親投資信託受益証券合計		160,407	345,326	
合計			482,747	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年3月20日から2019年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

第1期
(2019年 8月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,939
投資信託受益証券	90,035
親投資信託受益証券	387,719
流動資産合計	483,693
資産合計	483,693
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	133
未払委託者報酬	734
流動負債合計	867
負債合計	867
純資産の部	
元本等	
元本	500,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	17,174
(分配準備積立金)	5,588
元本等合計	482,826
純資産合計	482,826
負債純資産合計	483,693

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 2019年 3月20日
	至 2019年 8月28日
営業収益	
受取配当金	941
有価証券売買等損益	17,246
営業収益合計	16,305
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	133
委託者報酬	734
営業費用合計	869
営業利益又は営業損失（ ）	17,174
経常利益又は経常損失（ ）	17,174
当期純利益又は当期純損失（ ）	17,174
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,174

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
3. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2019年 3月20日から2019年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		500,000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	17,174円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9657円 (9,657円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,588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	- 円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,588円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	111円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第1期 (2019年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)
	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	4,535
親投資信託受益証券	21,781

合計	17,246
----	--------

（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	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	86,373	90,035	
投資信託受益証券合計		86,373	90,035	
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	29,706	74,725	
	国内株式インデックス マザーファンド	19,408	26,653	
	外国株式インデックス マザーファンド	66,613	163,754	
	国内債券インデックス マザーファンド	14,886	21,583	
	外国債券インデックス マザーファンド	22,219	61,877	
	新興国債券インデックス マザーファンド	23,809	39,127	
親投資信託受益証券合計		176,641	387,719	
合計			477,754	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年3月20日から2019年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

第1期
(2019年 8月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,444
投資信託受益証券	42,648
親投資信託受益証券	430,060
流動資産合計	478,152
資産合計	
478,152	
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	133
未払委託者報酬	734
流動負債合計	867
負債合計	
867	
純資産の部	
元本等	
元本	500,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	22,715
(分配準備積立金)	5,724
元本等合計	477,285
純資産合計	
477,285	
負債純資産合計	
478,152	

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 2019年 3月20日
	至 2019年 8月28日
営業収益	
受取配当金	446
有価証券売買等損益	22,292
営業収益合計	21,846
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	133
委託者報酬	734
営業費用合計	869
営業利益又は営業損失（ ）	22,715
経常利益又は経常損失（ ）	22,715
当期純利益又は当期純損失（ ）	22,715
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,715

（ 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
3. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2019年 3月20日から2019年8月28日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

	第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		500,000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	22,715円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9546円 (9,546円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,724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	- 円

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	5,724円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	114円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第1期 (2019年 8月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)
	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	2,148
親投資信託受益証券	24,440

合計	22,292
----	--------

（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	外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	40,914	42,648	
投資信託受益証券合計		40,914	42,648	
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	33,160	83,413	
	国内株式インデックス マザーファンド	21,791	29,925	
	外国株式インデックス マザーファンド	74,359	182,796	
	国内債券インデックス マザーファンド	10,633	15,416	
	外国債券インデックス マザーファンド	27,638	76,969	
	新興国債券インデックス マザーファンド	25,278	41,541	
親投資信託受益証券合計		192,859	430,060	
合計			472,708	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年3月20日から2019年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2019年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,998
親投資信託受益証券		468,201
流動資産合計		473,199
資産合計		473,199
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		133
未払委託者報酬		733
流動負債合計		866
負債合計		866
純資産の部		
元本等		
元本		500,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		27,667
(分配準備積立金)		5,917
元本等合計		472,333
純資産合計		472,333
負債純資産合計		473,199

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 2019年 3月20日
	至 2019年 8月28日
営業収益	
有価証券売買等損益	26,799
営業収益合計	26,799
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	133
委託者報酬	733
営業費用合計	868
営業利益又は営業損失（ ）	27,667
経常利益又は経常損失（ ）	27,667
当期純利益又は当期純損失（ ）	27,667
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,667

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2019年 3月20日から2019年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 8月28日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		500,000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	27,667円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9447円 (9,447円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,917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	- 円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,917円
当ファンドの期末残存口数	F	500,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	118円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2019年 8月28日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期
	自 2019年 3月20日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	- 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,799
合計	26,799

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表
(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	36,269	91,234	
	国内株式インデックス マザーファンド	23,834	32,731	
	外国株式インデックス マザーファンド	81,330	199,933	
	国内債券インデックス マザーファンド	7,089	10,278	
	外国債券インデックス マザーファンド	32,515	90,551	
	新興国債券インデックス マザーファンド	26,454	43,474	
合計		207,491	468,201	

(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 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,174,269,738
株式	280,845,503,060
派生商品評価勘定	1,823,120
未収配当金	369,676,178
前払金	76,007,500
差入委託証拠金	99,650,000
流動資産合計	284,566,929,596
資産合計	284,566,929,596
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,873,820
未払金	500,020,849

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
未払解約金	38,325,390
未払利息	4,981
その他未払費用	9
流動負債合計	616,225,049
負債合計	616,225,049
純資産の部	
元本等	
元本	206,771,932,531
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,178,772,016
元本等合計	283,950,704,547
純資産合計	283,950,704,547
負債純資産合計	284,566,929,596

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	206,771,932,531口

	2019年 8月28日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3733円 (13,733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 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2019年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	189,590,159,162円
期中追加設定元本額	24,139,815,772円
期中一部解約元本額	6,958,042,403円
期末元本額	206,771,932,531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）	597,854,247円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,054,931,766円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,911,204円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,031,535,899円
世界経済インデックスファンド	2,070,483,978円
日本株式インデックス・オープン	5,361,945,007円
DCマイセレクション25	6,870,858,628円

区分	2019年 8月28日現在
DCマイセレクション50	19,430,562,309円
DCマイセレクション75	17,832,471,188円
DC日本株式インデックス・オープン	5,678,381,702円
DCマイセレクションS25	2,745,227,771円
DCマイセレクションS50	7,846,564,207円
DCマイセレクションS75	5,103,149,155円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,553,949,031円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	385,571,700円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	688,458,665円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	451,580,222円
DC世界経済インデックスファンド	1,819,333,000円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,215,445,055円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,912,032円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	39,491,701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）	290,300,038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）	85,156,892円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	345,109,389円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	63,345,357円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	497,310,509円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,824,271,319円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	740,005,408円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,285,667,019円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	674,073,258円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	47,417,537円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	815,686,647円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,105,366円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	468,106,663円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	592,592,979円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	55,461,567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）	908,284,741円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,999,477,195円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,515,480,646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	4,133,636,875円
分散投資コア戦略ファンドS	8,517,291,268円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,004,601円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	275,032,457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）	222,244,885円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,359,382円

区分	2019年 8月28日現在
SMT インデックスバランス・オープン	75,678,742円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,317,569,938円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	680,819,456円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,235,353円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	57,993,473円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	8,499,630円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,530,677円
グローバル経済コア	317,728,126円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,452,524円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	48,555,076円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,393,739円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	187,768,232円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,579,192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)	56,493,410,459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)	646,253,664円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	6,518,624円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,593,554,544
合計	8,593,554,544

(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 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,163,412,500	-	76,007,500
			3,087,405,000	76,007,500
合計		3,163,412,500	-	76,007,500

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	2,770.00	16,066,000	
日本水産	178,700	587.00	104,896,900	
マルハニチロ	25,800	2,680.00	69,144,000	
カネコ種苗	5,400	1,126.00	6,080,400	
サカタのタネ	21,800	3,405.00	74,229,000	
ホクト	15,000	1,863.00	27,945,000	
ホクリヨウ	2,400	595.00	1,428,000	
住石ホールディングス	38,500	126.00	4,851,000	
日鉄鉱業	4,100	3,840.00	15,744,000	
三井松島ホールディングス	7,500	1,126.00	8,445,000	
国際石油開発帝石	717,000	898.00	643,866,000	
石油資源開発	25,700	2,540.00	65,278,000	
K&Oエナジーグループ	8,700	1,378.00	11,988,600	
ヒノキヤグループ	4,800	1,805.00	8,664,000	
ショーボンドホールディングス	25,500	3,660.00	93,330,000	
ミライト・ホールディングス	50,300	1,533.00	77,109,900	
タマホーム	8,600	1,494.00	12,848,400	
サンヨーホームズ	2,600	618.00	1,606,800	
日本アクア	7,100	499.00	3,542,900	
ファーストコーポレーション	5,500	588.00	3,234,000	
ベステラ	3,400	1,236.00	4,202,400	
T A T E R U	36,300	163.00	5,916,900	
スペースバリューホールディングス	21,800	439.00	9,570,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	671.00	2,281,400	
第一カッター興業	2,200	1,600.00	3,520,000	
安藤・間	114,600	698.00	79,990,800	
東急建設	52,300	686.00	35,877,800	
コムシスホールディングス	63,400	2,980.00	188,932,000	
ミサワホーム	14,200	1,049.00	14,895,800	
ピーアールホールディングス	19,500	345.00	6,727,500	

高松コンストラクショングループ	11,100	2,205.00	24,475,500
東建コーポレーション	5,500	6,150.00	33,825,000
ソネック	1,800	849.00	1,528,200
ヤマウラ	7,500	845.00	6,337,500
大成建設	146,800	3,645.00	535,086,000
大林組	442,200	967.00	427,607,400
清水建設	451,000	868.00	391,468,000
飛島建設	12,700	1,077.00	13,677,900
長谷工コーポレーション	184,300	1,113.00	205,125,900
松井建設	16,700	662.00	11,055,400
銭高組	1,800	3,865.00	6,957,000
鹿島建設	345,600	1,282.00	443,059,200
不動テトラ	10,300	1,104.00	11,371,200
大末建設	5,800	898.00	5,208,400
鉄建建設	9,000	2,609.00	23,481,000
西松建設	31,800	1,870.00	59,466,000
三井住友建設	106,300	501.00	53,256,300
大豊建設	10,000	2,561.00	25,610,000
前田建設工業	105,100	823.00	86,497,300
佐田建設	11,100	388.00	4,306,800
ナカノフドー建設	12,500	407.00	5,087,500
奥村組	24,300	2,749.00	66,800,700
東鉄工業	17,700	3,060.00	54,162,000
イチケン	3,000	1,557.00	4,671,000
富士ピー・エス	6,100	457.00	2,787,700
浅沼組	5,000	3,465.00	17,325,000
戸田建設	171,400	564.00	96,669,600
熊谷組	21,000	2,866.00	60,186,000
青木あすなろ建設	7,800	1,208.00	9,422,400
北野建設	3,200	1,984.00	6,348,800
植木組	2,100	2,292.00	4,813,200
矢作建設工業	20,000	648.00	12,960,000
ピーエス三菱	16,100	680.00	10,948,000
日本ハウスホールディングス	28,200	417.00	11,759,400
大東建託	52,500	13,670.00	717,675,000
新日本建設	17,700	767.00	13,575,900
N I P P O	39,000	1,824.00	71,136,000
東亜道路工業	2,800	2,926.00	8,192,800
前田道路	46,200	2,308.00	106,629,600
日本道路	4,000	5,830.00	23,320,000
東亜建設工業	12,900	1,256.00	16,202,400
日本国土開発	24,100	509.00	12,266,900

若築建設	7,400	1,455.00	10,767,000
東洋建設	54,000	424.00	22,896,000
五洋建設	175,300	536.00	93,960,800
世紀東急工業	21,500	663.00	14,254,500
福田組	4,800	3,740.00	17,952,000
住友林業	104,500	1,266.00	132,297,000
日本基礎技術	15,100	303.00	4,575,300
巴コーポレーション	19,400	345.00	6,693,000
大和ハウス工業	408,300	3,332.00	1,360,455,600
ライト工業	28,300	1,350.00	38,205,000
積水ハウス	451,500	1,869.00	843,853,500
日特建設	12,600	631.00	7,950,600
北陸電気工事	7,100	891.00	6,326,100
ユアテック	23,600	638.00	15,056,800
四電工	2,200	2,672.00	5,878,400
中電工	19,000	2,161.00	41,059,000
関電工	67,100	880.00	59,048,000
きんでん	98,000	1,538.00	150,724,000
東京エネシス	15,200	809.00	12,296,800
トーエネック	4,100	3,100.00	12,710,000
住友電設	10,200	1,970.00	20,094,000
日本電設工業	25,100	1,971.00	49,472,100
協和エクシオ	57,800	2,496.00	144,268,800
新日本空調	11,900	1,689.00	20,099,100
九電工	29,100	3,175.00	92,392,500
三機工業	33,300	1,243.00	41,391,900
日揮	127,000	1,218.00	154,686,000
中外炉工業	4,400	1,396.00	6,142,400
ヤマト	14,000	642.00	8,988,000
太平電業	10,000	2,292.00	22,920,000
高砂熱学工業	35,800	1,667.00	59,678,600
三晃金属工業	2,000	2,259.00	4,518,000
朝日工業社	3,200	2,831.00	9,059,200
明星工業	26,700	695.00	18,556,500
大気社	20,100	3,055.00	61,405,500
ダイダン	9,900	2,039.00	20,186,100
日比谷総合設備	13,300	1,790.00	23,807,000
東芝プラントシステム	31,900	1,716.00	54,740,400
OSJBホールディングス	65,100	225.00	14,647,500
東洋エンジニアリング	17,300	561.00	9,705,300
レイズネクスト	26,500	1,122.00	29,733,000
日本製粉	41,900	1,620.00	67,878,000

日清製粉グループ本社	149,200	1,978.00	295,117,600
日東富士製粉	1,000	6,300.00	6,300,000
昭和産業	12,100	3,005.00	36,360,500
鳥越製粉	11,700	801.00	9,371,700
中部飼料	16,100	1,085.00	17,468,500
フィード・ワン	88,700	158.00	14,014,600
東洋精糖	2,000	1,044.00	2,088,000
日本甜菜製糖	7,500	1,741.00	13,057,500
三井製糖	10,400	2,118.00	22,027,200
塩水港精糖	14,300	204.00	2,917,200
日新製糖	6,300	1,865.00	11,749,500
森永製菓	33,200	5,070.00	168,324,000
中村屋	3,400	4,125.00	14,025,000
江崎グリコ	39,700	4,575.00	181,627,500
名糖産業	6,300	1,269.00	7,994,700
井村屋グループ	5,600	1,986.00	11,121,600
不二家	7,400	1,942.00	14,370,800
山崎製パン	99,000	1,884.00	186,516,000
第一屋製パン	2,300	910.00	2,093,000
モロゾフ	2,200	4,720.00	10,384,000
亀田製菓	8,200	4,640.00	38,048,000
寿スピリッツ	14,000	6,780.00	94,920,000
カルビー	60,200	3,185.00	191,737,000
森永乳業	26,500	4,180.00	110,770,000
六甲バター	9,300	1,601.00	14,889,300
ヤクルト本社	97,800	6,000.00	586,800,000
明治ホールディングス	93,600	7,270.00	680,472,000
雪印メグミルク	31,800	2,368.00	75,302,400
プリマハム	18,600	2,057.00	38,260,200
日本ハム	54,700	3,995.00	218,526,500
林兼産業	4,400	554.00	2,437,600
丸大食品	14,100	2,064.00	29,102,400
S Foods	11,900	3,070.00	36,533,000
伊藤ハム米久ホールディングス	85,000	636.00	54,060,000
サッポロホールディングス	45,100	2,495.00	112,524,500
アサヒグループホールディングス	276,600	4,915.00	1,359,489,000
キリンホールディングス	560,200	2,061.50	1,154,852,300
宝ホールディングス	98,900	1,011.00	99,987,900
オエノンホールディングス	36,000	359.00	12,924,000
養命酒製造	4,000	1,856.00	7,424,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	92,700	2,255.00	209,038,500
サントリー食品インターナショナル	88,400	4,540.00	401,336,000

ダイドーグループホールディングス	7,400	4,250.00	31,450,000
伊藤園	40,100	4,740.00	190,074,000
キーコーヒー	13,000	2,097.00	27,261,000
ユニカフェ	3,500	973.00	3,405,500
ジャパンフーズ	1,900	1,171.00	2,224,900
日清オイリオグループ	17,000	3,175.00	53,975,000
不二製油グループ本社	32,200	2,878.00	92,671,600
かどや製油	1,400	3,515.00	4,921,000
J・オイルミルズ	6,800	3,925.00	26,690,000
キッコーマン	87,100	4,765.00	415,031,500
味の素	291,700	1,933.50	564,001,950
キューピー	73,500	2,469.00	181,471,500
ハウス食品グループ本社	49,400	3,950.00	195,130,000
カゴメ	52,900	2,619.00	138,545,100
焼津水産化学工業	6,400	1,024.00	6,553,600
アリアケジャパン	12,100	8,430.00	102,003,000
ピエトロ	1,700	1,590.00	2,703,000
エバラ食品工業	3,200	2,027.00	6,486,400
やまみ	600	1,890.00	1,134,000
ニチレイ	68,600	2,419.00	165,943,400
東洋水産	68,000	4,275.00	290,700,000
イトアンド	4,600	1,680.00	7,728,000
大冷	1,500	1,998.00	2,997,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,600	793.00	2,854,800
日清食品ホールディングス	56,100	7,040.00	394,944,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,975.00	13,825,000
一正蒲鉾	5,100	1,053.00	5,370,300
フジッコ	14,300	1,876.00	26,826,800
ロック・フィールド	14,200	1,335.00	18,957,000
日本たばこ産業	762,700	2,230.50	1,701,202,350
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,181.00	16,139,400
わらべや日洋ホールディングス	8,600	1,663.00	14,301,800
なとり	7,400	1,550.00	11,470,000
イフジ産業	2,300	699.00	1,607,700
ピククルスコーポレーション	3,100	2,229.00	6,909,900
北の達人コーポレーション	51,900	707.00	36,693,300
ユーグレナ	56,300	857.00	48,249,100
ミヨシ油脂	5,100	1,065.00	5,431,500
理研ビタミン	6,200	3,300.00	20,460,000
片倉工業	19,000	1,207.00	22,933,000
ゲンゼ	8,800	4,365.00	38,412,000
東洋紡	54,900	1,283.00	70,436,700

ユニチカ	39,100	308.00	12,042,800
富士紡ホールディングス	6,900	2,504.00	17,277,600
倉敷紡績	12,500	1,869.00	23,362,500
シキボウ	6,800	886.00	6,024,800
日本毛織	42,900	889.00	38,138,100
トーア紡コーポレーション	5,300	472.00	2,501,600
帝国繊維	14,700	1,646.00	24,196,200
帝人	105,400	1,888.00	198,995,200
東レ	1,000,400	753.50	753,801,400
サカイオーベックス	3,400	1,589.00	5,402,600
住江織物	3,800	2,754.00	10,465,200
日本フェルト	8,200	455.00	3,731,000
イチカワ	2,100	1,343.00	2,820,300
日東製網	1,500	1,362.00	2,043,000
アツギ	10,800	801.00	8,650,800
ダイニック	5,200	672.00	3,494,400
セーレン	32,100	1,185.00	38,038,500
ソトー	5,200	964.00	5,012,800
東海染工	1,900	1,113.00	2,114,700
小松マテーレ	21,300	711.00	15,144,300
ワコールホールディングス	36,500	2,390.00	87,235,000
ホギメディカル	16,100	2,875.00	46,287,500
レナウン	37,300	107.00	3,991,100
クラウディアホールディングス	3,400	535.00	1,819,000
T S Iホールディングス	47,800	519.00	24,808,200
マツオカコーポレーション	4,100	2,005.00	8,220,500
ワールド	16,900	2,237.00	37,805,300
三陽商会	7,500	1,237.00	9,277,500
ナイガイ	5,000	386.00	1,930,000
オンワードホールディングス	77,700	486.00	37,762,200
ルックホールディングス	4,600	1,003.00	4,613,800
ゴールドウイン	11,700	14,540.00	170,118,000
デサント	31,500	1,405.00	44,257,500
キング	7,100	482.00	3,422,200
ヤマトインターナショナル	8,100	428.00	3,466,800
特種東海製紙	8,200	3,510.00	28,782,000
王子ホールディングス	580,200	482.00	279,656,400
日本製紙	61,700	1,738.00	107,234,600
三菱製紙	21,000	491.00	10,311,000
北越コーポレーション	85,500	512.00	43,776,000
中越パルプ工業	5,500	1,450.00	7,975,000
巴川製紙所	4,200	791.00	3,322,200

大王製紙	62,800	1,243.00	78,060,400
阿波製紙	3,300	403.00	1,329,900
レンゴー	132,900	766.00	101,801,400
トーモク	7,900	1,451.00	11,462,900
ザ・パック	9,800	3,240.00	31,752,000
クラレ	203,000	1,204.00	244,412,000
旭化成	916,900	943.10	864,728,390
共和レザー	8,000	696.00	5,568,000
昭和電工	91,800	2,632.00	241,617,600
住友化学	1,014,600	461.00	467,730,600
住友精化	6,300	3,040.00	19,152,000
日産化学	78,600	4,530.00	356,058,000
ラサ工業	4,500	1,131.00	5,089,500
クレハ	11,900	5,580.00	66,402,000
多木化学	3,800	4,285.00	16,283,000
テイカ	10,500	1,830.00	19,215,000
石原産業	24,800	837.00	20,757,600
片倉コープアグリ	3,700	1,046.00	3,870,200
日本曹達	20,300	2,373.00	48,171,900
東ソー	199,200	1,346.00	268,123,200
トクヤマ	37,100	2,120.00	78,652,000
セントラル硝子	28,100	2,141.00	60,162,100
東亜合成	80,900	1,012.00	81,870,800
大阪ソーダ	14,000	2,433.00	34,062,000
関東電化工業	30,600	698.00	21,358,800
デンカ	50,700	2,740.00	138,918,000
信越化学工業	227,100	10,475.00	2,378,872,500
日本カーバイド工業	4,400	1,146.00	5,042,400
堺化学工業	8,600	2,241.00	19,272,600
第一稀元素化学工業	14,000	777.00	10,878,000
エア・ウォーター	105,500	1,800.00	189,900,000
大陽日酸	106,200	2,103.00	223,338,600
日本化学工業	4,400	2,044.00	8,993,600
東邦アセチレン	1,900	1,221.00	2,319,900
日本パーカライズン	70,400	1,128.00	79,411,200
高压ガス工業	20,400	748.00	15,259,200
チタン工業	1,600	2,660.00	4,256,000
四国化成工業	21,700	1,005.00	21,808,500
戸田工業	2,700	2,016.00	5,443,200
ステラ ケミファ	7,600	2,527.00	19,205,200
保土谷化学工業	4,500	2,544.00	11,448,000
日本触媒	21,700	6,000.00	130,200,000

大日精化工業	10,600	2,653.00	28,121,800
カネカ	33,300	3,115.00	103,729,500
三菱瓦斯化学	131,000	1,232.00	161,392,000
三井化学	117,000	2,223.00	260,091,000
J S R	129,300	1,725.00	223,042,500
東京応化工業	22,100	3,410.00	75,361,000
大阪有機化学工業	11,900	924.00	10,995,600
三菱ケミカルホールディングス	861,600	716.80	617,594,880
K Hネオケム	22,700	2,148.00	48,759,600
ダイセル	189,900	801.00	152,109,900
住友ベークライト	22,300	3,635.00	81,060,500
積水化学工業	277,100	1,512.00	418,975,200
日本ゼオン	116,200	1,202.00	139,672,400
アイカ工業	38,700	2,949.00	114,126,300
宇部興産	65,100	1,991.00	129,614,100
積水樹脂	21,300	1,831.00	39,000,300
タキロンシーアイ	27,900	627.00	17,493,300
旭有機材	8,900	1,192.00	10,608,800
日立化成	59,600	3,230.00	192,508,000
ニチバン	6,800	1,472.00	10,009,600
リケンテクノス	35,100	442.00	15,514,200
大倉工業	6,300	1,510.00	9,513,000
積水化成成品工業	19,200	691.00	13,267,200
群栄化学工業	3,300	2,235.00	7,375,500
タイガースポリマー	6,800	511.00	3,474,800
ミライアル	3,700	1,302.00	4,817,400
ダイキアクシス	4,600	704.00	3,238,400
ダイキョーニシカワ	27,200	700.00	19,040,000
竹本容器	4,600	859.00	3,951,400
森六ホールディングス	6,900	2,328.00	16,063,200
日本化薬	79,800	1,148.00	91,610,400
カーリットホールディングス	13,800	535.00	7,383,000
日本精化	10,400	1,031.00	10,722,400
扶桑化学工業	13,100	2,196.00	28,767,600
トリケミカル研究所	2,900	5,040.00	14,616,000
A D E K A	63,500	1,233.00	78,295,500
日油	48,500	3,390.00	164,415,000
新日本理化	23,300	183.00	4,263,900
ハリマ化成グループ	10,700	1,141.00	12,208,700
花王	319,500	7,708.00	2,462,706,000
第一工業製薬	4,800	2,635.00	12,648,000
石原ケミカル	3,200	1,528.00	4,889,600

日華化学	4,300	778.00	3,345,400
ニイタカ	2,000	1,425.00	2,850,000
三洋化成工業	8,700	4,495.00	39,106,500
有機合成薬品工業	9,900	226.00	2,237,400
大日本塗料	14,600	950.00	13,870,000
日本ペイントホールディングス	106,400	4,905.00	521,892,000
関西ペイント	144,800	2,145.00	310,596,000
神東塗料	10,100	156.00	1,575,600
中国塗料	42,300	822.00	34,770,600
日本特殊塗料	9,600	1,004.00	9,638,400
藤倉化成	17,400	522.00	9,082,800
太陽ホールディングス	10,600	3,135.00	33,231,000
D I C	54,400	2,609.00	141,929,600
サカタインクス	28,100	869.00	24,418,900
東洋インキＳＣホールディングス	27,200	2,104.00	57,228,800
T & K T O K A	10,000	871.00	8,710,000
富士フィルムホールディングス	273,300	4,506.00	1,231,489,800
資生堂	261,500	8,770.00	2,293,355,000
ライオン	171,100	2,083.00	356,401,300
高砂香料工業	9,100	2,411.00	21,940,100
マンダム	29,600	2,555.00	75,628,000
ミルボン	17,600	5,260.00	92,576,000
ファンケル	58,600	2,498.00	146,382,800
コーセー	22,300	18,410.00	410,543,000
コタ	6,900	1,154.00	7,962,600
シーボン	1,600	2,332.00	3,731,200
ポーラ・オルビスホールディングス	56,200	2,519.00	141,567,800
ノエビアホールディングス	12,600	5,230.00	65,898,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	926.00	2,685,400
エステー	9,400	1,520.00	14,288,000
アグロ カネショウ	5,100	1,342.00	6,844,200
コニシ	23,300	1,402.00	32,666,600
長谷川香料	17,400	1,999.00	34,782,600
星光P M C	8,400	723.00	6,073,200
小林製薬	36,900	7,660.00	282,654,000
荒川化学工業	11,800	1,319.00	15,564,200
メック	9,000	1,290.00	11,610,000
日本高純度化学	3,600	2,377.00	8,557,200
タカラバイオ	34,400	2,220.00	76,368,000
J C U	17,100	1,754.00	29,993,400
新田ゼラチン	8,300	626.00	5,195,800
O A T アグリオ	2,300	1,319.00	3,033,700

デクセリアルズ	33,900	700.00	23,730,000
アース製薬	9,900	4,960.00	49,104,000
北興化学工業	13,500	436.00	5,886,000
大成ラミック	4,300	2,697.00	11,597,100
クミアイ化学工業	54,400	920.00	50,048,000
日本農薬	23,400	429.00	10,038,600
アキレス	9,600	1,619.00	15,542,400
有沢製作所	20,700	983.00	20,348,100
日東電工	90,800	4,850.00	440,380,000
レック	14,000	955.00	13,370,000
三光合成	15,000	336.00	5,040,000
きもと	22,400	165.00	3,696,000
藤森工業	11,800	2,869.00	33,854,200
前澤化成工業	9,000	1,065.00	9,585,000
未来工業	7,100	1,799.00	12,772,900
ウェーブロックホールディングス	3,600	724.00	2,606,400
J S P	7,700	1,650.00	12,705,000
エフピコ	14,500	6,830.00	99,035,000
天馬	8,800	1,863.00	16,394,400
信越ポリマー	23,600	660.00	15,576,000
東リ	32,800	240.00	7,872,000
ニフコ	52,700	2,429.00	128,008,300
バルカー	10,700	2,044.00	21,870,800
ユニ・チャーム	253,700	3,203.00	812,601,100
ショーエイコーポレーション	1,000	791.00	791,000
協和キリン	132,400	1,909.00	252,751,600
武田薬品工業	1,148,900	3,450.00	3,963,705,000
アステラス製薬	1,157,600	1,443.50	1,670,995,600
大日本住友製薬	97,500	1,840.00	179,400,000
塩野義製薬	168,300	5,708.00	960,656,400
田辺三菱製薬	137,600	1,156.00	159,065,600
わかもと製薬	15,700	248.00	3,893,600
あすか製薬	16,200	1,018.00	16,491,600
日本新薬	34,400	8,770.00	301,688,000
バイオフェルミン製薬	2,200	2,060.00	4,532,000
中外製薬	137,200	7,480.00	1,026,256,000
科研製薬	22,500	5,030.00	113,175,000
エーザイ	157,500	5,305.00	835,537,500
ロート製薬	67,500	2,606.00	175,905,000
小野薬品工業	310,800	1,975.00	613,830,000
久光製薬	38,900	4,225.00	164,352,500
持田製薬	19,900	4,000.00	79,600,000

参天製薬	245,100	1,851.00	453,680,100
扶桑薬品工業	4,600	1,884.00	8,666,400
日本ケミファ	1,700	2,839.00	4,826,300
ツムラ	40,800	2,781.00	113,464,800
日医工	34,600	1,090.00	37,714,000
キッセイ薬品工業	23,300	2,351.00	54,778,300
生化学工業	25,500	1,087.00	27,718,500
栄研化学	23,100	1,537.00	35,504,700
日水製薬	5,500	1,163.00	6,396,500
鳥居薬品	8,200	2,656.00	21,779,200
JCRファーマ	9,300	7,940.00	73,842,000
東和薬品	18,900	2,326.00	43,961,400
富士製薬工業	8,900	1,248.00	11,107,200
沢井製薬	27,000	5,510.00	148,770,000
ゼリア新薬工業	26,000	1,825.00	47,450,000
第一三共	376,600	6,906.00	2,600,799,600
キョーリン製薬ホールディングス	29,000	1,723.00	49,967,000
大幸薬品	5,900	2,202.00	12,991,800
ダイト	7,700	2,997.00	23,076,900
大塚ホールディングス	250,700	4,373.00	1,096,311,100
大正製薬ホールディングス	27,800	7,340.00	204,052,000
ペプチドリーム	66,600	5,600.00	372,960,000
日本コークス工業	111,200	84.00	9,340,800
ニチレキ	16,800	1,021.00	17,152,800
ユシロ化学工業	6,800	1,255.00	8,534,000
ビーピー・カストロール	4,700	1,271.00	5,973,700
富士石油	31,900	225.00	7,177,500
MORESCO	4,800	1,307.00	6,273,600
出光興産	151,900	2,701.00	410,281,900
JXTGホールディングス	2,213,500	424.70	940,073,450
コスモエネルギーホールディングス	38,100	1,843.00	70,218,300
横浜ゴム	76,200	2,004.00	152,704,800
TOYO TIRE	75,600	1,272.00	96,163,200
ブリヂストン	404,500	3,977.00	1,608,696,500
住友ゴム工業	118,200	1,179.00	139,357,800
藤倉コンポジット	11,500	383.00	4,404,500
オカモト	8,800	3,920.00	34,496,000
フコク	5,800	653.00	3,787,400
ニッタ	14,800	2,631.00	38,938,800
住友理工	25,500	738.00	18,819,000
三ツ星ベルト	17,300	1,693.00	29,288,900
バンドー化学	25,100	782.00	19,628,200

日東紡績	19,600	2,712.00	53,155,200
A G C	130,100	2,978.00	387,437,800
日本板硝子	62,900	606.00	38,117,400
石塚硝子	2,200	1,810.00	3,982,000
日本山村硝子	5,500	1,210.00	6,655,000
日本電気硝子	52,900	2,161.00	114,316,900
オハラ	5,200	1,223.00	6,359,600
住友大阪セメント	26,600	4,420.00	117,572,000
太平洋セメント	83,100	2,666.00	221,544,600
日本ヒューム	13,200	632.00	8,342,400
日本コンクリート工業	28,500	232.00	6,612,000
三谷セキサン	6,100	2,675.00	16,317,500
アジアパイルホールディングス	18,700	483.00	9,032,100
東海カーボン	137,900	1,004.00	138,451,600
日本カーボン	6,800	3,525.00	23,970,000
東洋炭素	7,700	1,869.00	14,391,300
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	3,740.00	29,546,000
T O T O	101,200	3,815.00	386,078,000
日本碍子	160,600	1,402.00	225,161,200
日本特殊陶業	111,000	1,778.00	197,358,000
M A R U W A	4,600	5,430.00	24,978,000
品川リフラクトリーズ	3,500	2,521.00	8,823,500
黒崎播磨	2,600	5,060.00	13,156,000
ヨータイ	11,600	517.00	5,997,200
イソライト工業	6,800	410.00	2,788,000
東京窯業	16,900	273.00	4,613,700
ニッカトー	6,000	600.00	3,600,000
フジミインコーポレーテッド	11,700	2,309.00	27,015,300
クニミネ工業	5,900	847.00	4,997,300
エーアンドエーマテリアル	2,500	963.00	2,407,500
ニチアス	36,000	1,656.00	59,616,000
ニチハ	18,300	2,638.00	48,275,400
日本製鉄	604,700	1,446.00	874,396,200
神戸製鋼所	238,300	538.00	128,205,400
中山製鋼所	18,200	434.00	7,898,800
合同製鐵	6,300	1,988.00	12,524,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	351,500	1,199.50	421,624,250
東京製鐵	69,800	818.00	57,096,400
共英製鋼	14,700	1,637.00	24,063,900
大和工業	27,700	2,546.00	70,524,200
東京鐵鋼	5,400	1,128.00	6,091,200
大阪製鐵	8,700	1,295.00	11,266,500

淀川製鋼所	17,600	1,757.00	30,923,200
丸一鋼管	46,100	2,569.00	118,430,900
モリ工業	3,900	1,760.00	6,864,000
大同特殊鋼	21,300	3,835.00	81,685,500
日本高周波鋼業	4,900	403.00	1,974,700
日本冶金工業	107,900	200.00	21,580,000
山陽特殊製鋼	16,400	1,337.00	21,926,800
愛知製鋼	7,300	2,977.00	21,732,100
日立金属	140,200	1,096.00	153,659,200
日本金属	3,000	749.00	2,247,000
大太平洋金属	8,800	1,798.00	15,822,400
新日本電工	84,200	149.00	12,545,800
栗本鐵工所	6,600	1,319.00	8,705,400
虹技	2,000	1,218.00	2,436,000
三菱製鋼	9,700	1,026.00	9,952,200
日亜鋼業	19,200	268.00	5,145,600
日本精線	1,900	2,342.00	4,449,800
エンビプロ・ホールディングス	5,000	574.00	2,870,000
シンニッタン	20,300	400.00	8,120,000
新家工業	3,000	1,324.00	3,972,000
大紀アルミニウム工業所	21,600	651.00	14,061,600
日本軽金属ホールディングス	355,400	180.00	63,972,000
三井金属鉱業	35,200	2,110.00	74,272,000
東邦亜鉛	7,300	1,772.00	12,935,600
三菱マテリアル	86,000	2,542.00	218,612,000
住友金属鉱山	178,300	2,915.00	519,744,500
D O W A ホールディングス	30,400	3,375.00	102,600,000
古河機械金属	21,600	1,278.00	27,604,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	1,459.00	22,030,900
東邦チタニウム	23,500	729.00	17,131,500
U A C J	19,900	1,440.00	28,656,000
C K サンエツ	2,500	2,840.00	7,100,000
古河電気工業	37,600	2,271.00	85,389,600
住友電気工業	486,700	1,213.50	590,610,450
フジクラ	157,600	325.00	51,220,000
昭和電線ホールディングス	15,100	738.00	11,143,800
東京特殊電線	1,800	1,715.00	3,087,000
タツタ電線	26,200	421.00	11,030,200
カナレ電気	2,200	1,725.00	3,795,000
平河ヒューテック	5,500	1,003.00	5,516,500
リョービ	16,100	1,533.00	24,681,300
アーレスティ	16,300	518.00	8,443,400

アサヒホールディングス	24,500	2,180.00	53,410,000
稲葉製作所	7,300	1,322.00	9,650,600
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,406.00	5,624,000
トーカロ	33,600	759.00	25,502,400
アルファＣｏ	4,600	1,141.00	5,248,600
SUMCO	155,800	1,256.00	195,684,800
川田テクノロジーズ	2,900	6,290.00	18,241,000
RS Technologies	3,700	2,785.00	10,304,500
信和	6,900	937.00	6,465,300
東洋製罐グループホールディングス	82,900	1,518.00	125,842,200
ホッカンホールディングス	6,600	1,434.00	9,464,400
コロナ	7,200	987.00	7,106,400
横河ブリッジホールディングス	24,200	1,477.00	35,743,400
駒井ハルテック	2,500	1,388.00	3,470,000
高田機工	1,200	2,402.00	2,882,400
三和ホールディングス	134,400	1,157.00	155,500,800
文化シャッター	38,400	852.00	32,716,800
三協立山	18,100	1,109.00	20,072,900
アルインコ	10,300	893.00	9,197,900
東洋シャッター	3,200	674.00	2,156,800
LIXILグループ	192,000	1,706.00	327,552,000
日本フィルコン	10,000	470.00	4,700,000
ノーリツ	27,900	1,109.00	30,941,100
長府製作所	13,200	2,121.00	27,997,200
リンナイ	23,200	6,710.00	155,672,000
ダイニチ工業	7,100	591.00	4,196,100
日東精工	18,000	505.00	9,090,000
三洋工業	1,700	1,757.00	2,986,900
岡部	26,400	786.00	20,750,400
ジーテクト	14,400	1,480.00	21,312,000
東プレ	24,300	1,561.00	37,932,300
高周波熱錬	25,100	765.00	19,201,500
東京製綱	8,000	871.00	6,968,000
サンコール	7,400	437.00	3,233,800
モリテック スチール	10,200	317.00	3,233,400
パイオラックス	20,900	1,712.00	35,780,800
エイチワン	12,800	604.00	7,731,200
日本発條	129,700	734.00	95,199,800
中央発條	1,600	2,739.00	4,382,400
アドバネクス	1,700	1,632.00	2,774,400
立川ブラインド工業	5,700	1,335.00	7,609,500
三益半導体工業	11,600	1,738.00	20,160,800

日本ドライケミカル	3,600	1,130.00	4,068,000
日本製鋼所	39,500	1,761.00	69,559,500
三浦工業	56,400	2,849.00	160,683,600
タクマ	47,600	1,180.00	56,168,000
ツガミ	29,400	792.00	23,284,800
オークマ	16,600	5,080.00	84,328,000
東芝機械	14,800	1,995.00	29,526,000
アマダホールディングス	195,600	1,081.00	211,443,600
アイダエンジニアリング	35,300	771.00	27,216,300
滝澤鉄工所	4,100	1,173.00	4,809,300
F U J I	52,000	1,363.00	70,876,000
牧野フライス製作所	15,300	4,150.00	63,495,000
オーエスジー	60,200	1,975.00	118,895,000
ダイジェット工業	1,600	1,457.00	2,331,200
旭ダイヤモンド工業	34,300	591.00	20,271,300
D M G 森精機	82,400	1,405.00	115,772,000
ソディック	30,700	712.00	21,858,400
ディスコ	17,600	18,760.00	330,176,000
日東工器	7,200	2,002.00	14,414,400
日進工具	3,900	1,800.00	7,020,000
パンチ工業	9,200	440.00	4,048,000
富士ダイス	5,900	561.00	3,309,900
豊和工業	7,300	726.00	5,299,800
O K K	5,500	696.00	3,828,000
東洋機械金属	9,500	543.00	5,158,500
津田駒工業	2,800	1,174.00	3,287,200
エンシュウ	3,500	1,000.00	3,500,000
島精機製作所	18,000	2,451.00	44,118,000
オプトラン	14,500	2,905.00	42,122,500
N C ホールディングス	4,400	438.00	1,927,200
イワキポンプ	5,600	907.00	5,079,200
フリー	10,500	966.00	10,143,000
ヤマシンフィルタ	22,800	623.00	14,204,400
日阪製作所	16,200	786.00	12,733,200
やまびこ	25,300	976.00	24,692,800
平田機工	6,200	6,570.00	40,734,000
ペガサスミシン製造	12,400	476.00	5,902,400
マルマエ	5,400	834.00	4,503,600
タツモ	6,200	950.00	5,890,000
ナプテスコ	76,700	2,895.00	222,046,500
三井海洋開発	13,900	2,260.00	31,414,000
レオン自動機	12,800	1,430.00	18,304,000

S M C	38,500	39,020.00	1,502,270,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,100	379.00	3,827,900	
ホソカワミクロン	4,600	3,595.00	16,537,000	
ユニオンツール	5,500	3,055.00	16,802,500	
オイレス工業	18,300	1,460.00	26,718,000	
日精エー・エス・ビー機械	4,400	2,966.00	13,050,400	
サトーホールディングス	15,700	2,572.00	40,380,400	
技研製作所	11,400	3,200.00	36,480,000	
日本エアテック	4,200	565.00	2,373,000	
カワタ	3,600	905.00	3,258,000	
日精樹脂工業	11,100	889.00	9,867,900	
オカダアイオン	4,500	1,090.00	4,905,000	
ワイエイシイホールディングス	5,200	575.00	2,990,000	
小松製作所	595,900	2,212.00	1,318,130,800	
住友重機械工業	75,400	3,065.00	231,101,000	
日立建機	52,800	2,228.00	117,638,400	
日工	3,600	3,300.00	11,880,000	
巴工業	5,600	2,318.00	12,980,800	
井関農機	13,200	1,316.00	17,371,200	
T O W A	11,400	674.00	7,683,600	
丸山製作所	3,000	1,123.00	3,369,000	
北川鉄工所	6,000	1,760.00	10,560,000	
ローツェ	5,800	2,147.00	12,452,600	
タカキタ	4,800	502.00	2,409,600	
クボタ	705,100	1,498.00	1,056,239,800	
荏原実業	3,700	1,908.00	7,059,600	
三菱化工機	4,600	1,603.00	7,373,800	
月島機械	26,200	1,285.00	33,667,000	
帝国電機製作所	9,300	1,077.00	10,016,100	
新東工業	31,400	864.00	27,129,600	
澁谷工業	11,500	2,617.00	30,095,500	
アイチ コーポレーション	22,900	617.00	14,129,300	
小森コーポレーション	33,500	1,012.00	33,902,000	
鶴見製作所	10,300	1,814.00	18,684,200	
住友精密工業	2,200	2,825.00	6,215,000	
日本ギア工業	4,100	484.00	1,984,400	
酒井重工業	2,500	2,650.00	6,625,000	
荏原製作所	58,400	2,452.00	143,196,800	
石井鐵工所	2,100	1,966.00	4,128,600	
西島製作所	13,600	996.00	13,545,600	
北越工業	13,600	1,140.00	15,504,000	
ダイキン工業	179,600	13,365.00	2,400,354,000	

オルガノ	4,800	4,070.00	19,536,000
トーヨーカネツ	5,000	1,676.00	8,380,000
栗田工業	71,300	2,724.00	194,221,200
椿本チエイン	17,200	3,070.00	52,804,000
大同工業	6,400	775.00	4,960,000
木村化工機	11,300	348.00	3,932,400
アネスト岩田	20,600	865.00	17,819,000
ダイフク	72,400	4,955.00	358,742,000
サムコ	3,700	776.00	2,871,200
加藤製作所	6,800	1,635.00	11,118,000
油研工業	2,300	1,549.00	3,562,700
タダノ	63,600	916.00	58,257,600
フジテック	47,900	1,230.00	58,917,000
C K D	36,700	1,000.00	36,700,000
キトー	10,000	1,391.00	13,910,000
平和	36,700	2,113.00	77,547,100
理想科学工業	11,700	1,716.00	20,077,200
S A N K Y O	33,000	3,640.00	120,120,000
日本金銭機械	14,600	926.00	13,519,600
マースグループホールディングス	8,400	1,826.00	15,338,400
福島工業	8,100	2,921.00	23,660,100
オーイズミ	5,800	377.00	2,186,600
ダイコク電機	6,100	1,473.00	8,985,300
竹内製作所	22,100	1,534.00	33,901,400
アマノ	37,600	3,145.00	118,252,000
J U K I	18,300	785.00	14,365,500
蛇の目ミシン工業	12,200	379.00	4,623,800
マックス	20,100	1,629.00	32,742,900
グローリー	36,500	2,819.00	102,893,500
新晃工業	12,300	1,718.00	21,131,400
大和冷機工業	19,100	1,052.00	20,093,200
セガサミーホールディングス	130,600	1,470.00	191,982,000
日本ピストンリング	4,900	1,194.00	5,850,600
リケン	6,100	3,580.00	21,838,000
T P R	17,800	1,564.00	27,839,200
ツバキ・ナカシマ	26,900	1,520.00	40,888,000
ホシザキ	38,500	7,350.00	282,975,000
大豊工業	10,900	748.00	8,153,200
日本精工	270,400	821.00	221,998,400
N T N	283,100	271.00	76,720,100
ジェイテクト	126,300	1,124.00	141,961,200
不二越	12,200	4,010.00	48,922,000

日本トムソン	39,300	407.00	15,995,100
THK	76,600	2,356.00	180,469,600
ユーシン精機	10,300	873.00	8,991,900
前澤給装工業	5,200	1,915.00	9,958,000
イーグル工業	16,400	934.00	15,317,600
前澤工業	9,000	310.00	2,790,000
日本ピラー工業	13,400	1,035.00	13,869,000
キット	53,500	660.00	35,310,000
マキタ	160,200	2,997.00	480,119,400
日立造船	104,700	332.00	34,760,400
三菱重工業	220,600	3,923.00	865,413,800
IHI	101,200	2,026.00	205,031,200
スター精密	21,600	1,431.00	30,909,600
日清紡ホールディングス	87,900	776.00	68,210,400
イビデン	80,800	2,018.00	163,054,400
コニカミノルタ	288,000	743.00	213,984,000
ブラザー工業	171,600	1,799.00	308,708,400
ミネベアミツミ	244,500	1,577.00	385,576,500
日立製作所	592,500	3,569.00	2,114,632,500
三菱電機	1,316,100	1,253.00	1,649,073,300
富士電機	85,400	2,958.00	252,613,200
東洋電機製造	5,300	1,488.00	7,886,400
安川電機	152,600	3,420.00	521,892,000
シンフォニアテクノロジー	18,400	1,066.00	19,614,400
明電舎	26,100	1,702.00	44,422,200
オリジン	3,700	1,316.00	4,869,200
山洋電気	6,500	4,010.00	26,065,000
デンヨー	12,200	1,507.00	18,385,400
東芝テック	16,500	3,100.00	51,150,000
芝浦メカトロニクス	2,500	2,696.00	6,740,000
マブチモーター	36,500	3,660.00	133,590,000
日本電産	158,400	13,590.00	2,152,656,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,600	711.00	5,403,600
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,054.00	6,534,800
東光高岳	7,000	1,059.00	7,413,000
ダブル・スコープ	18,500	592.00	10,952,000
ダイヘン	14,400	2,905.00	41,832,000
ヤーマン	19,500	785.00	15,307,500
JVCケンウッド	101,800	296.00	30,132,800
ミマキエンジニアリング	12,500	482.00	6,025,000
第一精工	5,500	1,949.00	10,719,500
日新電機	30,900	1,218.00	37,636,200

大崎電気工業	26,400	652.00	17,212,800
オムロン	139,900	5,050.00	706,495,000
日東工業	21,200	1,923.00	40,767,600
I D E C	17,700	1,668.00	29,523,600
正興電機製作所	3,600	716.00	2,577,600
不二電機工業	1,700	1,184.00	2,012,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,500	1,749.00	83,077,500
サクサホールディングス	3,400	1,708.00	5,807,200
メルコホールディングス	5,600	2,722.00	15,243,200
テクノメディカ	3,100	2,000.00	6,200,000
日本電気	170,300	4,660.00	793,598,000
富士通	126,900	8,258.00	1,047,940,200
沖電気工業	57,100	1,465.00	83,651,500
岩崎通信機	6,200	763.00	4,730,600
電気興業	7,000	2,812.00	19,684,000
サンケン電気	15,500	1,807.00	28,008,500
ナカヨ	2,600	1,616.00	4,201,600
アイホン	7,500	1,526.00	11,445,000
ルネサスエレクトロニクス	625,900	642.00	401,827,800
セイコーエプソン	163,400	1,403.00	229,250,200
ワコム	96,400	324.00	31,233,600
アルバック	26,200	4,190.00	109,778,000
アクセル	6,100	574.00	3,501,400
E I Z O	12,100	3,485.00	42,168,500
日本信号	33,600	1,137.00	38,203,200
京三製作所	28,600	333.00	9,523,800
能美防災	17,600	2,129.00	37,470,400
ホーチキ	8,600	1,321.00	11,360,600
星和電機	7,800	498.00	3,884,400
エレコム	12,600	4,185.00	52,731,000
パナソニック	1,503,600	816.20	1,227,238,320
シャープ	130,600	1,072.00	140,003,200
アンリツ	84,800	1,961.00	166,292,800
富士通ゼネラル	40,300	1,664.00	67,059,200
ソニー	883,200	5,893.00	5,204,697,600
T D K	68,900	8,130.00	560,157,000
帝国通信工業	6,100	1,063.00	6,484,300
タムラ製作所	51,000	502.00	25,602,000
アルプスアルパイン	137,200	1,730.00	237,356,000
池上通信機	4,200	1,006.00	4,225,200
鈴木	7,700	571.00	4,396,700
日本トリム	2,600	4,530.00	11,778,000

ローランド ディー・ジー・	7,400	1,981.00	14,659,400
フォスター電機	14,900	1,704.00	25,389,600
S M K	3,700	2,600.00	9,620,000
ヨコオ	9,500	2,604.00	24,738,000
ホシデン	39,100	945.00	36,949,500
ヒロセ電機	18,800	11,650.00	219,020,000
日本航空電子工業	30,300	1,362.00	41,268,600
T O A	14,200	1,176.00	16,699,200
マクセルホールディングス	28,600	1,395.00	39,897,000
古野電気	17,400	873.00	15,190,200
ユニデンホールディングス	3,900	1,646.00	6,419,400
スミダコーポレーション	11,100	969.00	10,755,900
アイコム	7,300	2,173.00	15,862,900
リオン	6,200	2,280.00	14,136,000
本多通信工業	12,000	444.00	5,328,000
横河電機	131,800	1,890.00	249,102,000
新電元工業	4,700	2,984.00	14,024,800
アズビル	83,100	2,653.00	220,464,300
東亜ディーケーケー	6,900	805.00	5,554,500
日本光電工業	58,100	2,927.00	170,058,700
チノー	4,600	1,239.00	5,699,400
共和電業	14,100	394.00	5,555,400
日本電子材料	5,500	458.00	2,519,000
堀場製作所	26,100	5,320.00	138,852,000
アドバンテスト	89,700	4,105.00	368,218,500
小野測器	6,500	489.00	3,178,500
エスベック	11,900	1,795.00	21,360,500
キーエンス	64,600	61,400.00	3,966,440,000
日置電機	7,000	3,160.00	22,120,000
シスメックス	102,600	6,577.00	674,800,200
日本マイクロニクス	23,400	742.00	17,362,800
メガチップス	10,600	1,490.00	15,794,000
O B A R A G R O U P	6,900	3,235.00	22,321,500
澤藤電機	1,800	1,629.00	2,932,200
原田工業	5,800	816.00	4,732,800
コーセル	17,100	983.00	16,809,300
イリソ電子工業	12,100	4,885.00	59,108,500
オブテックスグループ	22,500	1,368.00	30,780,000
千代田インテグレ	6,300	1,925.00	12,127,500
アイ・オー・データ機器	5,300	828.00	4,388,400
レーザーテック	27,000	5,870.00	158,490,000
スタンレー電気	93,000	2,600.00	241,800,000

岩崎電気	5,400	1,136.00	6,134,400
ウシオ電機	76,700	1,320.00	101,244,000
岡谷電機産業	10,400	362.00	3,764,800
ハリオス テクノ ホールディング	12,800	523.00	6,694,400
エノモト	4,100	847.00	3,472,700
日本セラミック	13,500	2,591.00	34,978,500
遠藤照明	7,200	635.00	4,572,000
古河電池	10,000	559.00	5,590,000
双信電機	7,200	416.00	2,995,200
山一電機	9,900	1,079.00	10,682,100
図研	8,800	1,772.00	15,593,600
日本電子	26,100	2,265.00	59,116,500
カシオ計算機	116,500	1,481.00	172,536,500
ファナック	125,100	17,845.00	2,232,409,500
日本シイエムケイ	34,200	468.00	16,005,600
エンプラス	6,100	2,880.00	17,568,000
大真空	5,200	919.00	4,778,800
ローム	63,000	7,490.00	471,870,000
浜松ホトニクス	94,500	3,705.00	350,122,500
三井ハイテック	14,800	1,156.00	17,108,800
新光電気工業	44,600	821.00	36,616,600
京セラ	200,600	6,300.00	1,263,780,000
太陽誘電	58,700	1,909.00	112,058,300
村田製作所	414,300	4,357.00	1,805,105,100
双葉電子工業	21,100	1,226.00	25,868,600
北陸電気工業	5,300	935.00	4,955,500
ニチコン	41,900	858.00	35,950,200
日本ケミコン	9,300	1,326.00	12,331,800
K O A	20,100	1,177.00	23,657,700
市光工業	20,200	682.00	13,776,400
小糸製作所	78,900	4,875.00	384,637,500
ミツバ	24,900	516.00	12,848,400
S C R E E Nホールディングス	22,900	6,100.00	139,690,000
キャノン電子	14,000	1,752.00	24,528,000
キャノン	708,500	2,738.50	1,940,227,250
リコー	395,800	965.00	381,947,000
象印マホービン	38,800	1,291.00	50,090,800
M U T O Hホールディングス	2,000	1,628.00	3,256,000
東京エレクトロン	87,800	18,855.00	1,655,469,000
トヨタ紡織	46,200	1,402.00	64,772,400
芦森工業	3,000	1,296.00	3,888,000
ユニプレス	25,700	1,611.00	41,402,700

豊田自動織機	106,600	5,800.00	618,280,000
モリタホールディングス	23,200	1,518.00	35,217,600
三櫻工業	17,400	425.00	7,395,000
デンソー	289,800	4,386.00	1,271,062,800
東海理化電機製作所	34,800	1,634.00	56,863,200
三井E & Sホールディングス	47,500	785.00	37,287,500
川崎重工業	102,400	2,048.00	209,715,200
名村造船所	39,500	229.00	9,045,500
日本車輛製造	4,800	2,171.00	10,420,800
三菱ロジスネクスト	15,700	1,142.00	17,929,400
近畿車輛	2,000	1,213.00	2,426,000
日産自動車	1,552,100	648.40	1,006,381,640
いすゞ自動車	416,000	1,112.50	462,800,000
トヨタ自動車	1,466,500	6,889.00	10,102,718,500
日野自動車	164,300	818.00	134,397,400
三菱自動車工業	487,100	432.00	210,427,200
エフテック	9,600	669.00	6,422,400
レシップホールディングス	4,700	761.00	3,576,700
G M B	3,000	724.00	2,172,000
ファルテック	2,700	701.00	1,892,700
武蔵精密工業	32,200	1,192.00	38,382,400
日産車体	25,700	950.00	24,415,000
新明和工業	55,100	1,219.00	67,166,900
極東開発工業	26,200	1,187.00	31,099,400
日信工業	24,300	1,327.00	32,246,100
トピー工業	11,000	1,776.00	19,536,000
ティラド	4,900	1,697.00	8,315,300
タチエス	21,900	1,148.00	25,141,200
N O K	71,000	1,413.00	100,323,000
フタバ産業	37,000	664.00	24,568,000
K Y B	13,700	2,884.00	39,510,800
大同メタル工業	21,900	585.00	12,811,500
プレス工業	65,900	424.00	27,941,600
ミクニ	17,700	296.00	5,239,200
太平洋工業	27,800	1,356.00	37,696,800
ケーヒン	30,400	1,397.00	42,468,800
河西工業	16,600	694.00	11,520,400
アイシン精機	108,500	3,075.00	333,637,500
マツダ	413,000	880.50	363,646,500
今仙電機製作所	12,600	814.00	10,256,400
本田技研工業	1,110,200	2,490.00	2,764,398,000
スズキ	240,800	4,085.00	983,668,000

S U B A R U	408,600	2,868.50	1,172,069,100
安永	6,600	1,218.00	8,038,800
ヤマハ発動機	171,600	1,718.00	294,808,800
ショーワ	31,300	1,301.00	40,721,300
T B K	16,400	371.00	6,084,400
エクセディ	18,000	1,928.00	34,704,000
豊田合成	42,700	1,923.00	82,112,100
愛三工業	21,100	688.00	14,516,800
盟和産業	2,300	994.00	2,286,200
日本プラスト	10,800	640.00	6,912,000
ヨロズ	12,500	1,206.00	15,075,000
エフ・シー・シー	23,800	1,883.00	44,815,400
シマノ	49,300	14,930.00	736,049,000
テイ・エス テック	30,700	2,808.00	86,205,600
ジャムコ	6,800	1,470.00	9,996,000
テルモ	372,400	3,094.00	1,152,205,600
クリエートメディック	4,400	893.00	3,929,200
日機装	40,800	1,085.00	44,268,000
島津製作所	169,400	2,548.00	431,631,200
J M S	12,200	584.00	7,124,800
長野計器	10,400	639.00	6,645,600
ブイ・テクノロジー	6,200	5,130.00	31,806,000
東京計器	8,400	858.00	7,207,200
愛知時計電機	1,700	3,850.00	6,545,000
インターアクション	7,100	1,787.00	12,687,700
オーバル	13,000	215.00	2,795,000
東京精密	23,800	2,669.00	63,522,200
マニー	17,500	7,330.00	128,275,000
ニコン	229,300	1,295.00	296,943,500
トプコン	70,700	1,177.00	83,213,900
オリンパス	784,200	1,181.00	926,140,200
理研計器	11,600	1,720.00	19,952,000
タムロン	11,200	2,175.00	24,360,000
H O Y A	264,900	8,585.00	2,274,166,500
シード	5,600	803.00	4,496,800
ノーリツ鋼機	10,400	1,742.00	18,116,800
エー・アンド・デイ	12,000	658.00	7,896,000
朝日インテック	111,700	2,355.00	263,053,500
シチズン時計	144,100	474.00	68,303,400
リズム時計工業	4,500	875.00	3,937,500
大研医器	10,500	523.00	5,491,500
メニコン	18,100	3,965.00	71,766,500

シンシア	1,900	649.00	1,233,100
松風	6,400	1,456.00	9,318,400
セイコーホールディングス	20,300	2,151.00	43,665,300
ニプロ	91,100	1,089.00	99,207,900
中本パックス	3,700	1,422.00	5,261,400
スノーピーク	5,800	1,268.00	7,354,400
パラマウントベッドホールディングス	15,100	3,850.00	58,135,000
トランザクション	8,400	1,050.00	8,820,000
S H O - B I	3,800	339.00	1,288,200
ニホンフラッシュ	5,600	2,429.00	13,602,400
前田工織	14,500	1,401.00	20,314,500
永大産業	17,200	300.00	5,160,000
アートネイチャー	14,100	622.00	8,770,200
バンダイナムコホールディングス	136,100	6,360.00	865,596,000
アイフィスジャパン	3,300	697.00	2,300,100
共立印刷	21,900	139.00	3,044,100
S H O E I	6,300	4,380.00	27,594,000
フランスベッドホールディングス	18,600	1,006.00	18,711,600
パイロットコーポレーション	23,000	3,570.00	82,110,000
萩原工業	7,300	1,308.00	9,548,400
トッパン・フォームズ	28,200	873.00	24,618,600
フジシールインターナショナル	29,500	2,886.00	85,137,000
タカラトミー	55,100	1,102.00	60,720,200
廣済堂	12,200	691.00	8,430,200
エステールホールディングス	3,500	603.00	2,110,500
アーク	50,200	89.00	4,467,800
タカノ	5,100	716.00	3,651,600
プロネクサス	11,300	998.00	11,277,400
ホクシン	8,100	144.00	1,166,400
ウッドワン	4,400	988.00	4,347,200
大建工業	10,000	1,808.00	18,080,000
凸版印刷	195,600	1,630.00	318,828,000
大日本印刷	185,500	2,251.00	417,560,500
共同印刷	4,100	2,661.00	10,910,100
N I S S H A	27,000	929.00	25,083,000
光村印刷	1,100	1,639.00	1,802,900
宝印刷	6,300	1,596.00	10,054,800
アシックス	108,600	1,359.00	147,587,400
ツツミ	4,100	1,924.00	7,888,400
小松ウオール工業	4,000	1,783.00	7,132,000
ヤマハ	78,300	4,500.00	352,350,000
河合楽器製作所	4,100	2,724.00	11,168,400

クリナップ	12,200	512.00	6,246,400
ピジョン	79,500	3,890.00	309,255,000
兼松サステック	800	1,638.00	1,310,400
キングジム	10,900	827.00	9,014,300
リンテック	31,300	2,008.00	62,850,400
イトーキ	28,000	405.00	11,340,000
任天堂	75,300	40,350.00	3,038,355,000
三菱鉛筆	21,700	1,652.00	35,848,400
タカラスタンダード	27,200	1,624.00	44,172,800
コクヨ	63,100	1,379.00	87,014,900
ナカバヤシ	12,900	502.00	6,475,800
グローブライド	6,400	2,903.00	18,579,200
オカムラ	45,900	1,000.00	45,900,000
美津濃	13,000	2,688.00	34,944,000
東京電力ホールディングス	1,050,600	505.00	530,553,000
中部電力	402,600	1,542.00	620,809,200
関西電力	537,000	1,266.00	679,842,000
中国電力	181,900	1,346.00	244,837,400
北陸電力	128,900	658.00	84,816,200
東北電力	308,200	1,053.00	324,534,600
四国電力	118,500	1,004.00	118,974,000
九州電力	271,200	1,036.00	280,963,200
北海道電力	123,200	525.00	64,680,000
沖縄電力	24,400	1,589.00	38,771,600
電源開発	104,700	2,410.00	252,327,000
エフオン	6,200	687.00	4,259,400
イーレックス	22,900	1,172.00	26,838,800
レノバ	21,600	821.00	17,733,600
東京瓦斯	258,200	2,664.00	687,844,800
大阪瓦斯	255,400	1,863.00	475,810,200
東邦瓦斯	65,200	3,965.00	258,518,000
北海道瓦斯	7,100	1,447.00	10,273,700
広島ガス	27,100	325.00	8,807,500
西部瓦斯	14,800	2,087.00	30,887,600
静岡ガス	38,900	839.00	32,637,100
メタウォーター	6,400	3,650.00	23,360,000
SBSホールディングス	12,500	1,463.00	18,287,500
東武鉄道	138,800	3,205.00	444,854,000
相鉄ホールディングス	45,100	2,753.00	124,160,300
東京急行電鉄	357,400	1,892.00	676,200,800
京浜急行電鉄	180,300	1,931.00	348,159,300
小田急電鉄	210,800	2,385.00	502,758,000

京王電鉄	73,500	6,710.00	493,185,000
京成電鉄	98,600	4,185.00	412,641,000
富士急行	17,900	4,415.00	79,028,500
新京成電鉄	3,400	2,012.00	6,840,800
東日本旅客鉄道	234,000	10,155.00	2,376,270,000
西日本旅客鉄道	118,000	8,887.00	1,048,666,000
東海旅客鉄道	117,800	20,890.00	2,460,842,000
西武ホールディングス	163,000	1,778.00	289,814,000
鴻池運輸	20,900	1,617.00	33,795,300
西日本鉄道	36,500	2,345.00	85,592,500
ハマキョウレックス	10,100	3,565.00	36,006,500
サカイ引越センター	6,900	6,260.00	43,194,000
近鉄グループホールディングス	124,600	5,220.00	650,412,000
阪急阪神ホールディングス	166,200	3,960.00	658,152,000
南海電気鉄道	55,600	2,707.00	150,509,200
京阪ホールディングス	55,500	4,410.00	244,755,000
神戸電鉄	3,200	3,875.00	12,400,000
名古屋鉄道	102,400	3,140.00	321,536,000
山陽電気鉄道	9,600	2,032.00	19,507,200
日本通運	48,000	5,390.00	258,720,000
ヤマトホールディングス	218,500	1,809.00	395,266,500
山九	34,600	5,530.00	191,338,000
丸運	7,100	248.00	1,760,800
丸全昭和運輸	10,100	3,040.00	30,704,000
センコーグループホールディングス	68,700	819.00	56,265,300
トナミホールディングス	3,000	4,005.00	12,015,000
ニッコンホールディングス	47,400	2,317.00	109,825,800
日本石油輸送	1,500	2,852.00	4,278,000
福山通運	16,000	3,575.00	57,200,000
セイノーホールディングス	93,300	1,352.00	126,141,600
エスライン	3,700	811.00	3,000,700
神奈川中央交通	3,100	3,700.00	11,470,000
日立物流	27,400	3,295.00	90,283,000
丸和運輸機関	6,600	5,330.00	35,178,000
C & F ロジホールディングス	12,600	1,146.00	14,439,600
九州旅客鉄道	104,600	3,200.00	334,720,000
S Gホールディングス	117,700	2,784.00	327,676,800
日本郵船	104,700	1,564.00	163,750,800
商船三井	74,200	2,498.00	185,351,600
川崎汽船	38,400	1,048.00	40,243,200
N S ユナイテッド海運	7,200	2,070.00	14,904,000
飯野海運	61,400	317.00	19,463,800

共栄タンカー	1,700	1,304.00	2,216,800
乾汽船	11,200	922.00	10,326,400
日本航空	228,200	3,266.00	745,301,200
A N Aホールディングス	227,800	3,611.00	822,585,800
パスコ	2,400	877.00	2,104,800
ランコム	3,500	5,700.00	19,950,000
日新	10,800	1,440.00	15,552,000
三菱倉庫	43,100	2,583.00	111,327,300
三井倉庫ホールディングス	15,300	1,533.00	23,454,900
住友倉庫	45,900	1,361.00	62,469,900
澁澤倉庫	6,800	1,787.00	12,151,600
東陽倉庫	22,500	287.00	6,457,500
日本トランスシティ	27,400	430.00	11,782,000
ケイヒン	2,400	1,180.00	2,832,000
中央倉庫	7,600	989.00	7,516,400
川西倉庫	2,500	1,029.00	2,572,500
安田倉庫	10,200	919.00	9,373,800
ファイズ	2,200	692.00	1,522,400
東洋埠頭	3,800	1,302.00	4,947,600
宇徳	10,700	500.00	5,350,000
上組	76,900	2,459.00	189,097,100
サンリツ	2,900	638.00	1,850,200
キムラユニティー	3,300	991.00	3,270,300
キューソー流通システム	3,100	1,753.00	5,434,300
近鉄エクスプレス	23,500	1,384.00	32,524,000
東海運	7,100	274.00	1,945,400
エーアイティー	8,100	913.00	7,395,300
内外トランスライン	4,400	1,187.00	5,222,800
日本コンセプト	4,400	1,381.00	6,076,400
N E C ネットエスアイ	14,300	2,702.00	38,638,600
クロスキャット	3,700	951.00	3,518,700
システナ	46,200	1,580.00	72,996,000
デジタルアーツ	7,000	7,540.00	52,780,000
日鉄ソリューションズ	19,400	3,545.00	68,773,000
キューブシステム	7,200	754.00	5,428,800
エイジア	2,700	1,286.00	3,472,200
コア	5,700	1,271.00	7,244,700
ソリトンシステムズ	7,200	934.00	6,724,800
ソフトクリエイイトホールディングス	5,800	1,688.00	9,790,400
T I S	43,100	6,240.00	268,944,000
ネオス	5,200	707.00	3,676,400
電算システム	5,000	2,764.00	13,820,000

グリー	89,600	468.00	41,932,800
コーエーテクモホールディングス	26,500	2,189.00	58,008,500
三菱総合研究所	5,600	3,565.00	19,964,000
電算	1,600	2,025.00	3,240,000
A G S	7,700	645.00	4,966,500
ファインデックス	11,100	1,059.00	11,754,900
ブレインパッド	2,500	6,560.00	16,400,000
K L a b	24,700	1,126.00	27,812,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	17,400	1,138.00	19,801,200
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,724.00	3,792,800
ネクソン	366,400	1,431.00	524,318,400
アイスタイル	33,500	633.00	21,205,500
エムアップ	4,600	1,957.00	9,002,200
エイチーム	9,100	1,093.00	9,946,300
エニグモ	9,400	1,148.00	10,791,200
テクノスジャパン	11,400	494.00	5,631,600
コロプラ	42,600	685.00	29,181,000
ブロードリーフ	64,500	551.00	35,539,500
クロス・マーケティンググループ	6,600	315.00	2,079,000
デジタルハーツホールディングス	6,100	958.00	5,843,800
システム情報	6,800	1,053.00	7,160,400
メディアドゥホールディングス	4,500	3,450.00	15,525,000
じげん	18,700	607.00	11,350,900
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	726.00	1,524,600
サイバーリンクス	2,200	1,036.00	2,279,200
フィックスターズ	13,900	1,546.00	21,489,400
C A R T A H O L D I N G S	6,500	941.00	6,116,500
オブティム	5,700	2,886.00	16,450,200
セレス	4,400	1,254.00	5,517,600
ティーガイア	9,300	2,127.00	19,781,100
セック	2,200	3,045.00	6,699,000
日本アジアグループ	13,600	318.00	4,324,800
豆蔵ホールディングス	8,900	1,587.00	14,124,300
テクマトリックス	9,200	2,398.00	22,061,600
プロシップ	3,900	1,165.00	4,543,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,200	2,436.00	76,003,200
G M O ペイメントゲートウェイ	21,300	7,940.00	169,122,000
ザッパラス	7,500	350.00	2,625,000
システムリサーチ	1,800	3,820.00	6,876,000
インターネットイニシアティブ	21,100	2,313.00	48,804,300
さくらインターネット	15,800	569.00	8,990,200
ヴィンクス	4,400	1,262.00	5,552,800

GMOクラウド	2,800	2,428.00	6,798,400
SRAホールディングス	7,000	2,372.00	16,604,000
Minorisソリューションズ	2,700	1,762.00	4,757,400
システムインテグレータ	4,000	693.00	2,772,000
朝日ネット	10,800	709.00	7,657,200
eBASE	8,000	911.00	7,288,000
アバント	4,700	1,906.00	8,958,200
アドソル日進	4,700	1,962.00	9,221,400
フリービット	7,900	993.00	7,844,700
コムチュア	7,300	3,810.00	27,813,000
サイバーコム	2,500	1,635.00	4,087,500
アステリア	9,000	637.00	5,733,000
マークラインズ	6,600	1,709.00	11,279,400
メディカル・データ・ビジョン	11,200	1,024.00	11,468,800
ショーケース	3,500	748.00	2,618,000
モバイルファクトリー	3,600	1,736.00	6,249,600
テラスカイ	2,200	1,768.00	3,889,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,616.00	9,534,400
PCIホールディングス	2,700	1,976.00	5,335,200
パイプドHD	2,200	1,188.00	2,613,600
アイビーシー	2,600	971.00	2,524,600
ネオジャパン	2,700	1,009.00	2,724,300
PR TIMES	1,200	2,923.00	3,507,600
ランドコンピュータ	2,200	979.00	2,153,800
ダブルスタンダード	1,200	4,365.00	5,238,000
オープンドア	6,500	2,268.00	14,742,000
マイネット	4,700	491.00	2,307,700
アカツキ	4,600	7,060.00	32,476,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,570.00	1,884,000
Ubicomホールディングス	2,500	1,628.00	4,070,000
LINE	29,600	3,710.00	109,816,000
カナミックネットワーク	2,800	1,795.00	5,026,000
ノムラシステムコーポレーション	3,500	386.00	1,351,000
チェンジ	2,700	1,788.00	4,827,600
シンクロ・フード	6,000	460.00	2,760,000
オークネット	8,100	1,178.00	9,541,800
セグエグループ	1,300	1,321.00	1,717,300
エイトレッド	1,500	1,996.00	2,994,000
AOI TYO Holdings	13,900	630.00	8,757,000
マクロミル	23,200	888.00	20,601,600
ビーグリー	3,400	833.00	2,832,200
オロ	3,500	2,334.00	8,169,000

テモナ	2,200	479.00	1,053,800
ニーズウェル	1,900	699.00	1,328,100
サインポスト	2,100	2,155.00	4,525,500
ソルクシーズ	5,800	854.00	4,953,200
フェイス	5,500	685.00	3,767,500
プロトコーポレーション	11,800	1,174.00	13,853,200
ハイマックス	1,700	1,812.00	3,080,400
野村総合研究所	246,500	2,092.00	515,678,000
サイバネットシステム	10,400	550.00	5,720,000
C Eホールディングス	3,900	1,035.00	4,036,500
日本システム技術	2,300	1,202.00	2,764,600
インテージホールディングス	16,400	844.00	13,841,600
東邦システムサイエンス	4,100	913.00	3,743,300
ソースネクスト	50,700	428.00	21,699,600
インフォコム	14,200	2,550.00	36,210,000
F I G	14,900	294.00	4,380,600
アルテリア・ネットワークス	14,500	1,424.00	20,648,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,669.00	5,173,900
フォーカスシステムズ	9,000	803.00	7,227,000
クレスコ	4,000	3,450.00	13,800,000
フジ・メディア・ホールディングス	134,200	1,363.00	182,914,600
オービック	44,800	12,210.00	547,008,000
ジャストシステム	18,400	4,035.00	74,244,000
T D Cソフト	11,700	714.00	8,353,800
ヤフー	843,000	261.00	220,023,000
トレンドマイクロ	57,500	5,040.00	289,800,000
I Dホールディングス	5,100	1,152.00	5,875,200
日本オラクル	26,200	9,140.00	239,468,000
アルファシステムズ	4,100	2,587.00	10,606,700
フューチャー	17,000	1,784.00	30,328,000
C A C Holdings	9,100	1,102.00	10,028,200
ソフトバンク・テクノロジー	5,600	1,980.00	11,088,000
トーセ	3,800	825.00	3,135,000
オービックビジネスコンサルタント	13,200	4,390.00	57,948,000
伊藤忠テクノソリューションズ	58,900	2,941.00	173,224,900
アイティフォー	15,900	860.00	13,674,000
東計電算	2,000	2,952.00	5,904,000
エクスネット	2,600	912.00	2,371,200
大塚商会	69,900	3,875.00	270,862,500
サイボウズ	15,300	1,108.00	16,952,400
ソフトブレーン	10,200	567.00	5,783,400
電通国際情報サービス	8,100	3,180.00	25,758,000

デジタルガレージ	25,200	3,335.00	84,042,000
E Mシステムズ	10,700	1,770.00	18,939,000
ウェザーニューズ	4,400	3,075.00	13,530,000
C I J	9,900	816.00	8,078,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	2,630.00	3,682,000
日本エンタープライズ	14,900	168.00	2,503,200
WOWOW	6,300	2,474.00	15,586,200
スカラ	9,200	1,082.00	9,954,400
インテリジェント ウェイブ	5,200	820.00	4,264,000
I M A G I C A G R O U P	11,500	452.00	5,198,000
ネットワンシステムズ	45,800	2,846.00	130,346,800
システムソフト	33,100	105.00	3,475,500
アルゴグラフィックス	11,100	2,616.00	29,037,600
マーベラス	20,000	770.00	15,400,000
エイベックス	22,300	1,261.00	28,120,300
日本ユニシス	40,400	3,445.00	139,178,000
兼松エレクトロニクス	7,100	2,949.00	20,937,900
東京放送ホールディングス	85,800	1,685.00	144,573,000
日本テレビホールディングス	118,800	1,384.00	164,419,200
朝日放送グループホールディングス	13,200	695.00	9,174,000
テレビ朝日ホールディングス	35,600	1,668.00	59,380,800
スカパーJ S A Tホールディングス	85,600	415.00	35,524,000
テレビ東京ホールディングス	10,700	2,088.00	22,341,600
日本BS放送	4,600	1,085.00	4,991,000
ビジョン	4,100	4,600.00	18,860,000
スマートバリュー	4,200	691.00	2,902,200
ワイヤレスゲート	6,500	774.00	5,031,000
コネクシオ	9,300	1,319.00	12,266,700
クロップス	2,800	576.00	1,612,800
日本電信電話	883,300	5,064.00	4,473,031,200
K D D I	1,058,700	2,868.00	3,036,351,600
ソフトバンク	1,369,300	1,494.50	2,046,418,850
光通信	15,200	24,660.00	374,832,000
N T T ドコモ	817,700	2,664.00	2,178,352,800
エムティーアイ	12,900	691.00	8,913,900
G M O インターネット	51,900	1,770.00	91,863,000
ファイバーゲート	1,300	3,170.00	4,121,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	519.00	1,712,700
K A D O K A W A	37,800	1,575.00	59,535,000
学研ホールディングス	4,400	5,040.00	22,176,000
ゼンリン	25,900	1,731.00	44,832,900
昭文社	6,700	348.00	2,331,600

インプレスホールディングス	10,700	136.00	1,455,200	
アイネット	7,500	1,325.00	9,937,500	
松竹	8,600	12,600.00	108,360,000	
東宝	85,000	4,525.00	384,625,000	
東映	5,400	15,020.00	81,108,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	344,000	1,376.00	473,344,000	
ピー・シー・エー	1,700	4,700.00	7,990,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,516.00	5,786,800	
D T S	29,000	2,207.00	64,003,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,100	4,445.00	267,144,500	
シーイーシー	13,900	2,241.00	31,149,900	
カプコン	55,400	2,926.00	162,100,400	
アイ・エス・ピー	2,700	1,371.00	3,701,700	
ジャステック	8,500	1,023.00	8,695,500	
S C S K	34,100	5,170.00	176,297,000	
日本システムウエア	4,400	2,381.00	10,476,400	
アイネス	16,600	1,081.00	17,944,600	
T K C	11,000	4,460.00	49,060,000	
富士ソフト	16,600	4,575.00	75,945,000	
N S D	21,300	3,160.00	67,308,000	
コナミホールディングス	52,800	4,735.00	250,008,000	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,070.00	9,108,000	
J B C Cホールディングス	10,300	1,431.00	14,739,300	
ミロク情報サービス	12,900	2,744.00	35,397,600	
ソフトバンクグループ	1,024,700	4,656.00	4,771,003,200	
ハウスイ	1,100	776.00	853,600	
高千穂交易	5,000	1,068.00	5,340,000	
伊藤忠食品	3,200	4,155.00	13,296,000	
エレマテック	12,100	936.00	11,325,600	
J A L U X	3,700	2,234.00	8,265,800	
あらた	9,600	3,505.00	33,648,000	
トーメンデバイス	2,000	2,206.00	4,412,000	
東京エレクトロン デバイス	4,700	1,888.00	8,873,600	
フィールズ	11,300	482.00	5,446,600	
双日	715,900	320.00	229,088,000	
アルフレッサ ホールディングス	144,000	2,362.00	340,128,000	
横浜冷凍	36,300	1,007.00	36,554,100	
神栄	1,800	828.00	1,490,400	
ラサ商事	6,900	803.00	5,540,700	
ラクーンホールディングス	6,300	632.00	3,981,600	
アルコニックス	13,800	1,104.00	15,235,200	
神戸物産	22,400	5,230.00	117,152,000	

あい ホールディングス	18,500	1,705.00	31,542,500
ディーブイエックス	5,100	748.00	3,814,800
ダイワボウホールディングス	11,800	4,085.00	48,203,000
マクニカ・富士エレホールディングス	35,900	1,287.00	46,203,300
ラクト・ジャパン	5,400	3,720.00	20,088,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,400	1,041.00	25,400,400
八洲電機	10,000	860.00	8,600,000
メディアスホールディングス	7,400	627.00	4,639,800
レスターホールディングス	14,200	1,657.00	23,529,400
ジューテックホールディングス	3,000	921.00	2,763,000
大光	5,500	640.00	3,520,000
OCHIホールディングス	3,800	1,101.00	4,183,800
TOKAIホールディングス	68,500	984.00	67,404,000
黒谷	3,000	466.00	1,398,000
Cominix	2,300	749.00	1,722,700
三洋貿易	6,500	2,080.00	13,520,000
ビューティガレージ	2,100	1,737.00	3,647,700
ウイン・パートナーズ	8,400	1,011.00	8,492,400
ミタチ産業	3,900	635.00	2,476,500
シップヘルスケアホールディングス	27,000	4,895.00	132,165,000
明治電機工業	4,100	1,265.00	5,186,500
デリカフーズホールディングス	2,300	1,450.00	3,335,000
スターティアホールディングス	2,600	483.00	1,255,800
コメダホールディングス	30,000	1,969.00	59,070,000
富士興産	5,000	705.00	3,525,000
協栄産業	1,600	1,314.00	2,102,400
小野建	11,600	1,262.00	14,639,200
南陽	2,700	1,471.00	3,971,700
佐島電機	9,600	752.00	7,219,200
エコートレーディング	3,000	521.00	1,563,000
伯東	8,900	1,050.00	9,345,000
コンドーテック	10,100	862.00	8,706,200
中山福	7,500	479.00	3,592,500
ナガイレーベン	18,800	2,135.00	40,138,000
三菱食品	14,300	2,565.00	36,679,500
松田産業	9,500	1,395.00	13,252,500
第一興商	19,300	4,665.00	90,034,500
メディバルホールディングス	139,900	2,217.00	310,158,300
S P K	2,800	2,430.00	6,804,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,715.00	13,032,000
アズワン	9,300	9,600.00	89,280,000
スズデン	4,500	1,234.00	5,553,000

尾家産業	4,200	1,128.00	4,737,600
シモジマ	8,000	1,010.00	8,080,000
ドウシシャ	12,200	1,707.00	20,825,400
小津産業	2,900	1,664.00	4,825,600
高速	7,700	1,142.00	8,793,400
たけびし	4,600	1,227.00	5,644,200
リックス	2,900	1,422.00	4,123,800
丸文	11,500	524.00	6,026,000
ハピネット	10,800	1,215.00	13,122,000
橋本総業ホールディングス	2,600	1,453.00	3,777,800
日本ライフライン	38,400	1,633.00	62,707,200
タカショー	6,300	445.00	2,803,500
エクセル	4,800	1,117.00	5,361,600
マルカ	4,600	1,806.00	8,307,600
I D O M	43,700	407.00	17,785,900
日本エム・ディ・エム	7,600	1,566.00	11,901,600
進和	7,700	2,167.00	16,685,900
エスケイジャパン	3,200	384.00	1,228,800
ダイトロン	5,700	1,161.00	6,617,700
シークス	16,500	1,297.00	21,400,500
田中商事	4,400	604.00	2,657,600
オーハシテクニカ	7,300	1,338.00	9,767,400
白銅	4,200	1,266.00	5,317,200
伊藤忠商事	906,600	2,083.00	1,888,447,800
丸紅	1,278,200	664.30	849,108,260
高島	2,100	1,523.00	3,198,300
長瀬産業	72,900	1,398.00	101,914,200
蝶理	8,300	1,582.00	13,130,600
豊田通商	144,700	3,230.00	467,381,000
三共生興	22,100	484.00	10,696,400
兼松	51,800	1,157.00	59,932,600
ツカモトコーポレーション	2,300	1,001.00	2,302,300
三井物産	1,067,900	1,627.00	1,737,473,300
日本紙パルプ商事	7,400	3,605.00	26,677,000
日立ハイテクノロジーズ	39,400	5,710.00	224,974,000
カメイ	16,900	981.00	16,578,900
東都水産	1,800	2,527.00	4,548,600
O U Gホールディングス	2,100	2,667.00	5,600,700
スターゼン	4,800	3,885.00	18,648,000
山善	50,600	902.00	45,641,200
椿本興業	2,900	3,110.00	9,019,000
住友商事	766,600	1,560.00	1,195,896,000

内田洋行	5,500	3,195.00	17,572,500
三菱商事	909,500	2,541.50	2,311,494,250
第一実業	5,900	2,600.00	15,340,000
キャノンマーケティングジャパン	37,000	2,128.00	78,736,000
西華産業	7,400	1,232.00	9,116,800
佐藤商事	11,600	757.00	8,781,200
菱洋エレクトロ	13,200	1,744.00	23,020,800
東京産業	12,900	460.00	5,934,000
ユアサ商事	13,300	2,824.00	37,559,200
神鋼商事	2,900	2,148.00	6,229,200
小林産業	7,800	268.00	2,090,400
阪和興業	22,500	2,752.00	61,920,000
正栄食品工業	8,700	2,907.00	25,290,900
カナデン	11,700	1,191.00	13,934,700
菱電商事	10,300	1,555.00	16,016,500
フルサト工業	7,200	1,340.00	9,648,000
岩谷産業	28,800	3,470.00	99,936,000
すてきナイスグループ	5,600	598.00	3,348,800
昭光通商	4,400	593.00	2,609,200
ニチモウ	2,000	1,632.00	3,264,000
極東貿易	4,000	1,718.00	6,872,000
イワキ	17,000	475.00	8,075,000
三愛石油	34,800	929.00	32,329,200
稲畑産業	31,200	1,200.00	37,440,000
G S I クレオス	3,500	988.00	3,458,000
明和産業	12,000	574.00	6,888,000
クワザワ	4,700	392.00	1,842,400
ワキタ	27,700	984.00	27,256,800
東邦ホールディングス	38,400	2,481.00	95,270,400
サンゲツ	38,500	1,946.00	74,921,000
ミツウロコグループホールディングス	17,200	901.00	15,497,200
シナネンホールディングス	5,300	1,710.00	9,063,000
伊藤忠エネクス	28,700	792.00	22,730,400
サンリオ	40,000	2,000.00	80,000,000
サンワテクノス	7,900	731.00	5,774,900
リョーサン	14,300	2,507.00	35,850,100
新光商事	12,200	1,860.00	22,692,000
トーホー	5,900	1,767.00	10,425,300
三信電気	8,900	1,472.00	13,100,800
東陽テクニカ	14,900	1,025.00	15,272,500
モスフードサービス	17,000	2,327.00	39,559,000
加賀電子	12,900	1,564.00	20,175,600

ソーダニッカ	13,400	508.00	6,807,200
立花エレテック	9,600	1,474.00	14,150,400
フォーバル	5,700	894.00	5,095,800
PALTAC	23,400	4,970.00	116,298,000
三谷産業	15,200	273.00	4,149,600
西本Wismettacホールディングス	2,800	3,415.00	9,562,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,211.00	1,332,100
国際紙パルプ商事	30,300	290.00	8,787,000
ヤマタネ	6,500	1,260.00	8,190,000
丸紅建材リース	1,300	1,603.00	2,083,900
日鉄物産	9,200	3,965.00	36,478,000
泉州電業	4,100	2,503.00	10,262,300
トラスコ中山	27,000	2,322.00	62,694,000
オートバックスセブン	51,500	1,780.00	91,670,000
モリト	9,500	756.00	7,182,000
加藤産業	20,300	3,010.00	61,103,000
北恵	2,500	874.00	2,185,000
イノテック	7,700	817.00	6,290,900
イエローハット	24,500	1,560.00	38,220,000
JKホールディングス	11,800	454.00	5,357,200
日伝	10,800	1,862.00	20,109,600
北沢産業	9,800	245.00	2,401,000
杉本商事	7,000	1,780.00	12,460,000
因幡電機産業	18,400	4,630.00	85,192,000
東テク	4,300	1,941.00	8,346,300
ミスミグループ本社	162,300	2,328.00	377,834,400
アルテック	10,400	197.00	2,048,800
タキヒヨー	3,900	1,767.00	6,891,300
蔵王産業	2,100	1,344.00	2,822,400
スズケン	59,100	5,560.00	328,596,000
ジェコス	9,000	829.00	7,461,000
グローセル	11,900	396.00	4,712,400
ローソン	32,800	5,330.00	174,824,000
サンエー	9,800	4,400.00	43,120,000
カワチ薬品	10,100	1,987.00	20,068,700
エービーシー・マート	20,300	6,880.00	139,664,000
ハードオフコーポレーション	5,300	689.00	3,651,700
アスクル	13,600	2,752.00	37,427,200
ゲオホールディングス	19,900	1,314.00	26,148,600
アダストリア	18,000	2,070.00	37,260,000
ジーフット	8,100	643.00	5,208,300
くら寿司	7,300	4,140.00	30,222,000

キャンドウ	6,300	1,613.00	10,161,900
パルグループホールディングス	6,700	3,205.00	21,473,500
エディオン	55,100	998.00	54,989,800
サーラコーポレーション	26,600	577.00	15,348,200
ワッツ	5,900	670.00	3,953,000
ハローズ	4,900	2,099.00	10,285,100
フジオフードシステム	5,500	2,738.00	15,059,000
あみやき亭	2,800	3,335.00	9,338,000
ひらまつ	26,300	335.00	8,810,500
大黒天物産	3,200	3,140.00	10,048,000
ハニーズホールディングス	11,500	1,389.00	15,973,500
ファーマライズホールディングス	3,300	540.00	1,782,000
アルペン	10,000	1,527.00	15,270,000
ハブ	4,300	1,078.00	4,635,400
クオールホールディングス	19,200	1,374.00	26,380,800
ジーンズホールディングス	6,900	5,880.00	40,572,000
ビックカメラ	77,000	1,057.00	81,389,000
D C Mホールディングス	70,000	1,062.00	74,340,000
ペッパーフードサービス	10,400	1,537.00	15,984,800
Monotaro	92,200	2,510.00	231,422,000
東京一番フーズ	3,500	609.00	2,131,500
D Dホールディングス	2,900	2,979.00	8,639,100
きちりホールディングス	3,700	714.00	2,641,800
アークランドサービスホールディングス	9,500	1,889.00	17,945,500
J . フロント リテイリング	165,900	1,208.00	200,407,200
ドトール・日レスホールディングス	22,800	2,000.00	45,600,000
マツモトキヨシホールディングス	53,600	3,865.00	207,164,000
ブロンコビリー	6,800	2,197.00	14,939,600
Z O Z O	140,100	2,110.00	295,611,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,173.00	4,574,700
物語コーポレーション	3,200	9,680.00	30,976,000
ココカラファイン	14,600	5,720.00	83,512,000
三越伊勢丹ホールディングス	242,800	793.00	192,540,400
H a m e e	4,100	714.00	2,927,400
ウエルシアホールディングス	34,300	5,520.00	189,336,000
クリエイトSDホールディングス	19,200	2,320.00	44,544,000
丸善C H I ホールディングス	15,100	366.00	5,526,600
ティーライフ	1,900	848.00	1,611,200
エー・ピーカンパニー	2,700	502.00	1,355,400
チムニー	4,000	2,437.00	9,748,000
シュッピン	8,900	1,039.00	9,247,100
ネクステージ	20,800	1,142.00	23,753,600

ジョイフル本田	38,100	1,325.00	50,482,500
鳥貴族	4,300	2,112.00	9,081,600
キリン堂ホールディングス	5,200	1,752.00	9,110,400
ホットランド	7,700	1,353.00	10,418,100
すかいらーくホールディングス	145,300	1,806.00	262,411,800
SFPホールディングス	5,600	2,258.00	12,644,800
綿半ホールディングス	4,900	2,244.00	10,995,600
ヨシックス	2,200	3,205.00	7,051,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,800	948.00	35,834,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	642.00	3,980,400
B E E N O S	4,600	1,261.00	5,800,600
あさひ	10,800	1,207.00	13,035,600
日本調剤	4,600	3,615.00	16,629,000
コスモス薬品	5,700	21,410.00	122,037,000
トーエル	6,500	665.00	4,322,500
オンリー	2,400	897.00	2,152,800
セブン&アイ・ホールディングス	543,300	3,751.00	2,037,918,300
薬王堂	5,700	2,425.00	13,822,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	34,900	1,624.00	56,677,600
ツルハホールディングス	28,200	11,420.00	322,044,000
サンマルクホールディングス	10,300	2,455.00	25,286,500
フェリシモ	3,000	1,004.00	3,012,000
トリドールホールディングス	16,100	2,405.00	38,720,500
T O K Y O B A S E	11,800	839.00	9,900,200
ウイルプラスホールディングス	2,200	808.00	1,777,600
ジャパンミート	6,600	1,996.00	13,173,600
サツドラホールディングス	2,000	1,704.00	3,408,000
デファクトスタンダード	1,600	305.00	488,000
アレンザホールディングス	7,200	746.00	5,371,200
串カツ田中ホールディングス	2,000	1,993.00	3,986,000
パロックジャパンリミテッド	10,600	986.00	10,451,600
クスリのアオキホールディングス	12,900	8,040.00	103,716,000
力の源ホールディングス	5,000	810.00	4,050,000
スシローグローバルホールディングス	14,200	6,690.00	94,998,000
L I X I L ビバ	11,100	1,362.00	15,118,200
メディカルシステムネットワーク	14,000	514.00	7,196,000
はるやまホールディングス	6,200	772.00	4,786,400
ノジマ	23,100	1,756.00	40,563,600
カップ・クリエイト	18,200	1,390.00	25,298,000
ライトオン	9,700	719.00	6,974,300
良品計画	18,400	17,970.00	330,648,000

三城ホールディングス	16,600	276.00	4,581,600
アドヴァン	19,900	1,130.00	22,487,000
アルビス	5,000	2,326.00	11,630,000
コナカ	15,600	399.00	6,224,400
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,575.00	2,677,500
G - 7ホールディングス	3,900	2,931.00	11,430,900
イオン北海道	13,200	719.00	9,490,800
コジマ	22,600	459.00	10,373,400
ヒマラヤ	4,700	808.00	3,797,600
コーナン商事	17,100	2,314.00	39,569,400
エコス	4,900	1,494.00	7,320,600
ワタミ	17,100	1,378.00	23,563,800
マルシェ	3,600	779.00	2,804,400
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	77,600	6,560.00	509,056,000
西松屋チェーン	28,600	911.00	26,054,600
ゼンショーホールディングス	63,100	2,386.00	150,556,600
幸楽苑ホールディングス	8,300	2,639.00	21,903,700
ハークスレイ	2,800	1,000.00	2,800,000
サイゼリヤ	21,400	2,532.00	54,184,800
V Tホールディングス	58,900	431.00	25,385,900
魚力	3,700	1,547.00	5,723,900
フジ・コーポレーション	3,500	2,035.00	7,122,500
ユナイテッドアローズ	14,900	3,065.00	45,668,500
ハイデイ日高	18,800	2,136.00	40,156,800
京都きもの友禅	8,700	320.00	2,784,000
コロワイド	43,100	2,028.00	87,406,800
ピーシーデポコーポレーション	17,500	470.00	8,225,000
壱番屋	9,200	5,070.00	46,644,000
P L A N T	3,500	685.00	2,397,500
スギホールディングス	28,500	5,530.00	157,605,000
スクロール	20,400	315.00	6,426,000
ヨンドシーホールディングス	14,400	2,448.00	35,251,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	145,000	2,480.00	359,600,000
木曽路	15,900	2,624.00	41,721,600
S R Sホールディングス	15,400	1,024.00	15,769,600
タカキュー	10,800	173.00	1,868,400
ケーヨー	24,300	475.00	11,542,500
上新電機	15,400	1,927.00	29,675,800
日本瓦斯	20,500	3,065.00	62,832,500
ロイヤルホールディングス	22,700	2,561.00	58,134,700
いなげや	14,600	1,464.00	21,374,400
島忠	27,500	2,460.00	67,650,000

チヨダ	13,700	1,525.00	20,892,500
ライフコーポレーション	9,900	2,082.00	20,611,800
リンガーハット	16,000	2,528.00	40,448,000
MrMaxHD	18,100	425.00	7,692,500
テンアライド	11,900	427.00	5,081,300
AOKIホールディングス	26,100	1,003.00	26,178,300
オークワ	18,600	1,115.00	20,739,000
コメリ	20,100	2,158.00	43,375,800
青山商事	22,700	1,842.00	41,813,400
しまむら	15,100	8,260.00	124,726,000
はせがわ	7,200	397.00	2,858,400
高島屋	101,800	1,215.00	123,687,000
松屋	26,300	751.00	19,751,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,700	1,091.00	72,769,700
近鉄百貨店	5,000	3,075.00	15,375,000
パルコ	12,600	1,213.00	15,283,800
丸井グループ	109,700	2,109.00	231,357,300
アクシアル リテイリング	10,800	3,775.00	40,770,000
イオン	498,800	1,842.00	918,789,600
イズミ	26,400	4,005.00	105,732,000
平和堂	26,400	1,955.00	51,612,000
フジ	15,700	1,809.00	28,401,300
ヤオコー	14,700	4,720.00	69,384,000
ゼビオホールディングス	15,800	1,112.00	17,569,600
ケーズホールディングス	134,800	1,120.00	150,976,000
Olympicグループ	7,900	595.00	4,700,500
日産東京販売ホールディングス	19,600	274.00	5,370,400
Genky DrugStores	6,400	2,058.00	13,171,200
総合メディカルホールディングス	11,400	1,443.00	16,450,200
ブックオフグループホールディングス	6,700	1,156.00	7,745,200
アインホールディングス	17,400	5,540.00	96,396,000
元気寿司	3,700	2,777.00	10,274,900
ヤマダ電機	395,200	488.00	192,857,600
アークランドサカモト	22,100	1,174.00	25,945,400
ニトリホールディングス	56,100	15,675.00	879,367,500
グルメ杵屋	9,400	1,158.00	10,885,200
愛眼	10,300	240.00	2,472,000
ケーユーホールディングス	6,900	775.00	5,347,500
吉野家ホールディングス	45,300	2,250.00	101,925,000
松屋フーズホールディングス	6,300	3,770.00	23,751,000
サガミホールディングス	17,400	1,348.00	23,455,200
関西スーパーマーケット	9,900	1,088.00	10,771,200

王将フードサービス	9,500	7,210.00	68,495,000
プレナス	14,600	1,730.00	25,258,000
ミニストップ	9,700	1,433.00	13,900,100
アークス	24,400	2,190.00	53,436,000
パローホールディングス	28,100	1,760.00	49,456,000
ベルク	6,400	5,040.00	32,256,000
大庄	7,000	1,600.00	11,200,000
ファーストリテイリング	17,300	62,450.00	1,080,385,000
サンドラッグ	48,800	3,280.00	160,064,000
サクスパー ホールディングス	11,100	878.00	9,745,800
ヤマザワ	2,800	1,626.00	4,552,800
やまや	2,300	2,231.00	5,131,300
ペルーナ	32,000	599.00	19,168,000
島根銀行	4,000	614.00	2,456,000
じもとホールディングス	87,700	90.00	7,893,000
めぶきフィナンシャルグループ	677,800	233.00	157,927,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,200	1,223.00	22,258,600
九州フィナンシャルグループ	215,000	402.00	86,430,000
ゆうちょ銀行	368,500	955.00	351,917,500
富山第一銀行	33,900	268.00	9,085,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	816,500	354.00	289,041,000
西日本フィナンシャルホールディングス	82,900	650.00	53,885,000
関西みらいフィナンシャルグループ	62,100	666.00	41,358,600
三十三フィナンシャルグループ	11,800	1,461.00	17,239,800
第四北越フィナンシャルグループ	22,900	2,429.00	55,624,100
新生銀行	95,300	1,434.00	136,660,200
あおぞら銀行	72,500	2,455.00	177,987,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,935,000	498.40	4,453,204,000
りそなホールディングス	1,424,400	403.40	574,602,960
三井住友トラスト・ホールディングス	255,200	3,403.00	868,445,600
三井住友フィナンシャルグループ	914,800	3,427.00	3,135,019,600
千葉銀行	448,000	517.00	231,616,000
群馬銀行	262,000	337.00	88,294,000
武蔵野銀行	19,800	1,715.00	33,957,000
千葉興業銀行	38,500	278.00	10,703,000
筑波銀行	54,000	153.00	8,262,000
七十七銀行	41,300	1,336.00	55,176,800
青森銀行	10,400	2,493.00	25,927,200
秋田銀行	8,700	1,902.00	16,547,400
山形銀行	15,200	1,416.00	21,523,200
岩手銀行	9,400	2,414.00	22,691,600
東邦銀行	116,100	232.00	26,935,200

東北銀行	6,600	934.00	6,164,400
みちのく銀行	8,300	1,538.00	12,765,400
ふくおかフィナンシャルグループ	114,800	1,782.00	204,573,600
静岡銀行	322,500	700.00	225,750,000
十六銀行	17,800	2,096.00	37,308,800
八十二銀行	315,300	375.00	118,237,500
山梨中央銀行	16,500	940.00	15,510,000
大垣共立銀行	27,700	2,152.00	59,610,400
福井銀行	11,700	1,259.00	14,730,300
北國銀行	13,700	2,367.00	32,427,900
清水銀行	5,800	1,740.00	10,092,000
富山銀行	2,800	2,410.00	6,748,000
滋賀銀行	26,400	2,281.00	60,218,400
南都銀行	20,600	2,170.00	44,702,000
百五銀行	119,300	314.00	37,460,200
京都銀行	46,700	3,690.00	172,323,000
紀陽銀行	46,500	1,405.00	65,332,500
ほくほくフィナンシャルグループ	87,200	951.00	82,927,200
広島銀行	193,300	469.00	90,657,700
山陰合同銀行	78,300	593.00	46,431,900
中国銀行	112,600	856.00	96,385,600
鳥取銀行	5,000	1,326.00	6,630,000
伊予銀行	173,600	495.00	85,932,000
百十四銀行	14,200	1,935.00	27,477,000
四国銀行	19,300	884.00	17,061,200
阿波銀行	20,200	2,231.00	45,066,200
大分銀行	8,200	2,995.00	24,559,000
宮崎銀行	9,000	2,227.00	20,043,000
佐賀銀行	8,500	1,349.00	11,466,500
沖縄銀行	12,200	2,999.00	36,587,800
琉球銀行	30,700	1,020.00	31,314,000
セブン銀行	441,400	270.00	119,178,000
みずほフィナンシャルグループ	17,637,400	152.80	2,694,994,720
高知銀行	4,700	722.00	3,393,400
山口フィナンシャルグループ	163,200	657.00	107,222,400
長野銀行	4,800	1,560.00	7,488,000
名古屋銀行	10,800	3,080.00	33,264,000
北洋銀行	199,600	204.00	40,718,400
愛知銀行	4,900	3,335.00	16,341,500
中京銀行	5,700	2,127.00	12,123,900
大光銀行	4,900	1,688.00	8,271,200
愛媛銀行	18,800	1,085.00	20,398,000

トマト銀行	5,800	996.00	5,776,800
京葉銀行	56,700	594.00	33,679,800
栃木銀行	72,100	161.00	11,608,100
北日本銀行	4,500	1,658.00	7,461,000
東和銀行	22,800	687.00	15,663,600
福島銀行	11,300	192.00	2,169,600
大東銀行	6,200	535.00	3,317,000
トモニホールディングス	102,900	314.00	32,310,600
フィデアホールディングス	126,000	110.00	13,860,000
池田泉州ホールディングス	142,400	173.00	24,635,200
F P G	40,900	1,012.00	41,390,800
マーキュリアインベストメント	6,000	693.00	4,158,000
S B Iホールディングス	154,700	2,109.00	326,262,300
ジャフコ	21,300	3,575.00	76,147,500
大和証券グループ本社	1,041,900	445.40	464,062,260
野村ホールディングス	2,284,300	416.10	950,497,230
岡三証券グループ	111,100	348.00	38,662,800
丸三証券	38,900	484.00	18,827,600
東洋証券	47,700	127.00	6,057,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	155,400	274.00	42,579,600
光世証券	3,400	555.00	1,887,000
水戸証券	38,400	188.00	7,219,200
いちよし証券	26,400	615.00	16,236,000
松井証券	63,700	884.00	56,310,800
だいこう証券ビジネス	5,600	524.00	2,934,400
マネックスグループ	120,300	291.00	35,007,300
極東証券	17,600	799.00	14,062,400
岩井コスモホールディングス	13,400	1,055.00	14,137,000
藍澤證券	23,600	648.00	15,292,800
マネーパートナーズグループ	15,800	257.00	4,060,600
スパークス・グループ	52,100	232.00	12,087,200
かんぽ生命保険	46,000	1,491.00	68,586,000
S O M P Oホールディングス	228,800	4,188.00	958,214,400
アニコム ホールディングス	10,700	4,185.00	44,779,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	339,400	3,330.00	1,130,202,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	106,700	2,396.00	255,653,200
第一生命ホールディングス	734,400	1,421.00	1,043,582,400
東京海上ホールディングス	464,100	5,418.00	2,514,493,800
T & Dホールディングス	401,400	1,011.50	406,016,100
アドバンスクリエイト	3,000	1,777.00	5,331,000
全国保証	36,600	3,965.00	145,119,000
ジェイリース	3,600	321.00	1,155,600

イントラスト	3,600	699.00	2,516,400
日本モーゲージサービス	2,300	1,039.00	2,389,700
C a s a	5,800	1,167.00	6,768,600
アルヒ	11,800	2,011.00	23,729,800
プレミアグループ	7,400	1,784.00	13,201,600
クレディセゾン	90,900	1,151.00	104,625,900
芙蓉総合リース	14,900	5,830.00	86,867,000
興銀リース	24,400	2,575.00	62,830,000
東京センチュリー	26,100	4,090.00	106,749,000
日本証券金融	57,200	481.00	27,513,200
アイフル	198,000	212.00	41,976,000
リコーリース	10,200	3,165.00	32,283,000
イオンフィナンシャルサービス	82,900	1,503.00	124,598,700
アコム	260,900	366.00	95,489,400
ジャックス	14,300	2,112.00	30,201,600
オリエントコーポレーション	351,100	126.00	44,238,600
日立キャピタル	30,600	2,051.00	62,760,600
アプラスフィナンシャル	62,300	68.00	4,236,400
オリックス	866,000	1,528.50	1,323,681,000
三菱UFJリース	292,800	565.00	165,432,000
九州リースサービス	6,400	581.00	3,718,400
日本取引所グループ	350,600	1,641.00	575,334,600
イー・ギャランティ	12,200	1,267.00	15,457,400
アサックス	5,400	584.00	3,153,600
NECキャピタルソリューション	5,300	2,033.00	10,774,900
いちご	167,600	414.00	69,386,400
日本駐車場開発	148,500	168.00	24,948,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,781.00	13,001,300
ヒューリック	271,900	1,035.00	281,416,500
三栄建築設計	5,900	1,407.00	8,301,300
野村不動産ホールディングス	86,900	2,236.00	194,308,400
三重交通グループホールディングス	28,200	530.00	14,946,000
サムティ	18,900	1,840.00	34,776,000
ディア・ライフ	18,600	521.00	9,690,600
コーセーアールイー	5,300	654.00	3,466,200
エー・ディー・ワークス	399,800	33.00	13,193,400
日本商業開発	8,800	1,451.00	12,768,800
プレサンスコーポレーション	21,200	1,558.00	33,029,600
ユニゾホールディングス	18,800	4,220.00	79,336,000
日本管理センター	9,300	1,298.00	12,071,400
サンセイランディック	5,100	761.00	3,881,100
エストラスト	1,800	635.00	1,143,000

フージャースホールディングス	28,200	607.00	17,117,400	
オープンハウス	19,000	4,875.00	92,625,000	
東急不動産ホールディングス	350,700	657.00	230,409,900	
飯田グループホールディングス	108,900	1,630.00	177,507,000	
イーランド	3,300	659.00	2,174,700	
ムゲンエステート	10,700	590.00	6,313,000	
ハウストゥ	7,100	1,504.00	10,678,400	
シーアールイー	4,100	1,140.00	4,674,000	
ケイアイスター不動産	4,000	1,778.00	7,112,000	
グッドコムアセット	3,600	1,631.00	5,871,600	
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,360.00	6,976,000	
テンポイノベーション	2,000	1,738.00	3,476,000	
パーク24	70,100	2,391.00	167,609,100	
パラカ	3,800	2,029.00	7,710,200	
三井不動産	689,000	2,528.00	1,741,792,000	
三菱地所	909,800	2,048.00	1,863,270,400	
平和不動産	24,200	2,518.00	60,935,600	
東京建物	142,600	1,380.00	196,788,000	
ダイビル	39,200	1,018.00	39,905,600	
京阪神ビルディング	23,500	1,236.00	29,046,000	
住友不動産	292,000	4,044.00	1,180,848,000	
テーオーシー	31,000	789.00	24,459,000	
東京楽天地	2,000	5,280.00	10,560,000	
スターツコーポレーション	18,100	2,369.00	42,878,900	
フジ住宅	18,100	663.00	12,000,300	
空港施設	17,200	507.00	8,720,400	
明和地所	9,000	522.00	4,698,000	
ゴールドクレスト	10,700	1,991.00	21,303,700	
日本エスリード	5,700	1,567.00	8,931,900	
日神不動産	21,500	436.00	9,374,000	
日本エスコン	24,800	754.00	18,699,200	
タカラレーベン	62,000	385.00	23,870,000	
サンヨーハウジング名古屋	8,400	960.00	8,064,000	
イオンモール	65,700	1,720.00	113,004,000	
毎日コムネット	4,200	718.00	3,015,600	
ファースト住建	6,400	1,187.00	7,596,800	
カチタス	14,700	4,000.00	58,800,000	
トーセイ	18,700	1,210.00	22,627,000	
穴吹興産	1,800	2,724.00	4,903,200	
サンフロンティア不動産	18,700	1,236.00	23,113,200	
エフ・ジェー・ネクスト	12,300	1,011.00	12,435,300	
インテリックス	5,100	718.00	3,661,800	

ランドビジネス	5,500	771.00	4,240,500
日本社宅サービス	4,300	955.00	4,106,500
グランディハウス	13,700	420.00	5,754,000
日本空港ビルデング	41,700	4,095.00	170,761,500
日本工営	8,500	2,550.00	21,675,000
L I F U L L	44,100	641.00	28,268,100
ジェイエイシーリクルートメント	9,800	1,965.00	19,257,000
日本M&Aセンター	93,800	2,975.00	279,055,000
メンバーズ	4,300	1,825.00	7,847,500
中広	1,600	574.00	918,400
アイティメディア	2,700	718.00	1,938,600
タケエイ	13,200	908.00	11,985,600
E・Jホールディングス	1,700	1,170.00	1,989,000
トラスト・テック	14,000	1,216.00	17,024,000
コシダカホールディングス	30,400	1,726.00	52,470,400
アルトナー	3,300	671.00	2,214,300
パソナグループ	15,400	1,402.00	21,590,800
C D S	3,200	1,259.00	4,028,800
リンクアンドモチベーション	28,100	493.00	13,853,300
G C A	15,100	697.00	10,524,700
エス・エム・エス	46,300	2,391.00	110,703,300
サニーサイドアップ	2,900	934.00	2,708,600
パーソルホールディングス	125,800	2,177.00	273,866,600
リニカル	7,200	1,028.00	7,401,600
クックパッド	44,400	285.00	12,654,000
エスクリ	3,600	820.00	2,952,000
アイ・ケイ・ケイ	6,300	702.00	4,422,600
学情	5,000	1,100.00	5,500,000
スタジオアリス	6,400	2,081.00	13,318,400
シミックホールディングス	7,000	1,683.00	11,781,000
N J S	2,900	1,550.00	4,495,000
総合警備保障	50,100	5,350.00	268,035,000
カカクコム	94,200	2,626.00	247,369,200
アイロムグループ	4,800	1,601.00	7,684,800
セントケア・ホールディング	9,500	493.00	4,683,500
サイネックス	2,400	609.00	1,461,600
ルネサンス	7,100	1,548.00	10,990,800
ディップ	20,300	2,436.00	49,450,800
オプトホールディング	7,500	1,506.00	11,295,000
ツクイ	30,000	432.00	12,960,000
キャリアデザインセンター	3,300	1,312.00	4,329,600
ベネフィット・ワン	34,900	1,678.00	58,562,200

エムスリー	264,800	2,306.00	610,628,800
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	573.00	4,755,900
プラス	1,700	586.00	996,200
アウトソーシング	72,000	923.00	66,456,000
ウェルネット	12,100	714.00	8,639,400
ワールドホールディングス	4,300	1,520.00	6,536,000
ディー・エヌ・エー	67,900	2,237.00	151,892,300
博報堂D Yホールディングス	174,900	1,560.00	272,844,000
ぐるなび	18,100	677.00	12,253,700
タカミヤ	13,200	717.00	9,464,400
ジャパンベストレスキューシステム	8,500	1,148.00	9,758,000
ファンコミュニケーションズ	34,900	536.00	18,706,400
ライク	5,000	1,816.00	9,080,000
ビジネス・ブレークスルー	5,700	365.00	2,080,500
WDBホールディングス	5,800	2,306.00	13,374,800
ティア	7,600	622.00	4,727,200
C D G	1,300	1,375.00	1,787,500
バリューコマース	8,200	1,705.00	13,981,000
インフォマート	69,000	1,573.00	108,537,000
J Pホールディングス	36,500	265.00	9,672,500
エコナックホールディングス	24,000	121.00	2,904,000
E P Sホールディングス	19,000	1,271.00	24,149,000
レグス	3,200	1,565.00	5,008,000
プレステージ・インターナショナル	23,600	1,831.00	43,211,600
アミューズ	7,700	2,503.00	19,273,100
ドリームインキュベータ	3,900	1,216.00	4,742,400
クイック	7,900	1,328.00	10,491,200
T A C	7,600	190.00	1,444,000
ケネディクス	120,000	518.00	62,160,000
電通	129,700	3,595.00	466,271,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,158.00	5,674,200
ぴあ	3,600	4,165.00	14,994,000
イオンファンタジー	4,100	2,943.00	12,066,300
シーティーエス	14,400	675.00	9,720,000
ネクシィーズグループ	4,500	1,732.00	7,794,000
みらかホールディングス	35,200	2,316.00	81,523,200
アルプス技研	11,700	1,402.00	16,403,400
ダイオーズ	3,000	1,412.00	4,236,000
日本空調サービス	14,500	693.00	10,048,500
オリエンタルランド	148,600	15,295.00	2,272,837,000
ダスキン	32,400	2,720.00	88,128,000
明光ネットワークジャパン	14,900	916.00	13,648,400

ファルコホールディングス	7,000	1,596.00	11,172,000
ラウンドワン	39,100	1,720.00	67,252,000
リゾートトラスト	53,300	1,658.00	88,371,400
ビー・エム・エル	16,200	2,992.00	48,470,400
ワタベウェディング	2,300	574.00	1,320,200
りらいあコミュニケーションズ	22,800	1,300.00	29,640,000
リソー教育	64,200	453.00	29,082,600
早稲田アカデミー	3,800	795.00	3,021,000
ユー・エス・エス	153,700	2,013.00	309,398,100
東京個別指導学院	4,600	852.00	3,919,200
サイバーエージェント	72,400	4,680.00	338,832,000
楽天	586,300	932.00	546,431,600
クリーク・アンド・リバー社	7,500	1,132.00	8,490,000
テー・オー・ダブリュー	11,200	730.00	8,176,000
山田コンサルティンググループ	6,200	1,596.00	9,895,200
セントラルスポーツ	4,700	2,991.00	14,057,700
フルキャストホールディングス	12,700	1,970.00	25,019,000
エン・ジャパン	18,300	3,855.00	70,546,500
リソルホールディングス	1,400	3,960.00	5,544,000
テクノプロ・ホールディングス	25,200	5,960.00	150,192,000
アトラ	3,600	220.00	792,000
インターワークス	2,700	541.00	1,460,700
アイ・アールジャパンホールディングス	5,100	4,295.00	21,904,500
K e e P e r 技研	4,700	1,353.00	6,359,100
ファーストロジック	3,200	628.00	2,009,600
三機サービス	2,800	847.00	2,371,600
G u n o s y	8,900	1,378.00	12,264,200
デザインワン・ジャパン	3,000	278.00	834,000
イー・ガーディアン	6,500	1,744.00	11,336,000
リブセンス	8,700	251.00	2,183,700
ジャパンマテリアル	34,500	1,096.00	37,812,000
ベクトル	15,900	865.00	13,753,500
ウチヤマホールディングス	6,500	471.00	3,061,500
チャーム・ケア・コーポレーション	4,100	2,296.00	9,413,600
ライクキッズネクスト	3,200	907.00	2,902,400
キャリアリンク	4,900	563.00	2,758,700
I B J	8,600	1,186.00	10,199,600
アサンテ	5,100	1,964.00	10,016,400
N・フィールド	8,900	610.00	5,429,000
バリューHR	2,700	2,952.00	7,970,400
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	6,100.00	27,450,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,534.00	8,130,200

ERIホールディングス	3,700	747.00	2,763,900
アシスト	2,000	2,442.00	4,884,000
シグマクシス	6,100	1,246.00	7,600,600
ウィルグループ	8,400	790.00	6,636,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,000	212.00	3,816,000
日本ビューホテル	4,100	1,647.00	6,752,700
リクルートホールディングス	900,900	3,313.00	2,984,681,700
エラン	8,400	1,693.00	14,221,200
土木管理総合試験所	5,800	417.00	2,418,600
ネットマーケティング	4,700	739.00	3,473,300
日本郵政	1,030,900	958.00	987,602,200
ベルシステム24ホールディングス	21,200	1,564.00	33,156,800
鎌倉新書	9,400	1,666.00	15,660,400
ソネット・メディア・ネットワークス	1,800	606.00	1,090,800
一蔵	1,600	575.00	920,000
LITALICO	3,000	1,789.00	5,367,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	815.00	1,711,500
エボラブルアジア	5,700	1,892.00	10,784,400
アトラエ	3,300	2,403.00	7,929,900
ストライク	4,800	2,559.00	12,283,200
ソラスト	30,900	1,272.00	39,304,800
セラク	4,200	686.00	2,881,200
インソース	4,900	2,876.00	14,092,400
ベिकाレント・コンサルティング	8,900	4,850.00	43,165,000
Orchestra Holdings	2,600	1,022.00	2,657,200
アイモバイル	4,200	724.00	3,040,800
キャリアインデックス	4,600	472.00	2,171,200
MS - Japan	5,200	1,322.00	6,874,400
船場	2,200	893.00	1,964,600
グレイステクノロジー	4,600	2,839.00	13,059,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,000	2,653.00	26,530,000
フルテック	1,900	1,191.00	2,262,900
グリーンズ	4,900	1,308.00	6,409,200
ツナググループ・ホールディングス	1,800	530.00	954,000
ソウルドアウト	2,000	1,461.00	2,922,000
MS&Consulting	2,200	957.00	2,105,400
日総工産	8,500	1,032.00	8,772,000
キュービーネットホールディングス	7,700	2,257.00	17,378,900
RPAホールディングス	5,400	1,568.00	8,467,200
スプリックス	4,300	1,584.00	6,811,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	797.00	4,064,700
リログループ	68,800	2,696.00	185,484,800

東祥	7,900	2,760.00	21,804,000
エイチ・アイ・エス	19,700	2,586.00	50,944,200
ラックランド	2,600	2,207.00	5,738,200
共立メンテナンス	19,300	4,210.00	81,253,000
イチネンホールディングス	13,200	1,004.00	13,252,800
建設技術研究所	8,800	1,582.00	13,921,600
スペース	8,300	1,134.00	9,412,200
長大	4,800	833.00	3,998,400
燦ホールディングス	2,800	2,077.00	5,815,600
スバル興業	900	5,990.00	5,391,000
東京テアトル	5,000	1,328.00	6,640,000
タナベ経営	2,500	1,260.00	3,150,000
ナガワ	3,500	4,980.00	17,430,000
よみうりランド	2,800	4,475.00	12,530,000
東京都競馬	8,300	3,105.00	25,771,500
カナモト	20,600	2,639.00	54,363,400
東京ドーム	47,100	1,057.00	49,784,700
西尾レントオール	12,800	2,748.00	35,174,400
トランス・コスモス	14,000	2,502.00	35,028,000
乃村工藝社	58,900	1,312.00	77,276,800
藤田観光	5,500	2,691.00	14,800,500
KNT - CTホールディングス	6,700	1,496.00	10,023,200
日本管財	13,500	1,862.00	25,137,000
トーカイ	12,200	2,189.00	26,705,800
白洋舎	1,500	2,791.00	4,186,500
セコム	133,500	9,090.00	1,213,515,000
セントラル警備保障	6,100	5,030.00	30,683,000
丹青社	23,900	1,254.00	29,970,600
メイテック	15,600	5,500.00	85,800,000
応用地質	13,700	1,041.00	14,261,700
船井総研ホールディングス	26,100	2,126.00	55,488,600
進学会ホールディングス	6,000	484.00	2,904,000
オオバ	10,100	595.00	6,009,500
いであ	2,500	1,071.00	2,677,500
学究社	4,200	1,206.00	5,065,200
ベネッセホールディングス	46,100	2,679.00	123,501,900
イオンディライト	15,500	3,245.00	50,297,500
ナック	8,100	894.00	7,241,400
ニチイ学館	18,000	1,651.00	29,718,000
ダイセキ	21,100	2,535.00	53,488,500
ステップ	4,700	1,403.00	6,594,100
合計	153,883,000		280,845,503,060

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,199,408,629
コール・ローン	220,501,897
株式	319,523,141,908
投資信託受益証券	271,335,475
投資証券	9,347,435,947
派生商品評価勘定	8,614,821
未収入金	258,738,395
未収配当金	667,040,206
前払金	240,793,310
差入委託証拠金	1,859,385,874
流動資産合計	343,596,396,462
資産合計	343,596,396,462
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	249,744,765
未払金	6,295,394,097
未払解約金	21,956,893
未払利息	346
流動負債合計	6,567,096,101
負債合計	6,567,096,101
純資産の部	
元本等	
元本	137,096,412,688
剰余金	
剰余金又は欠損金()	199,932,887,673
元本等合計	337,029,300,361
純資産合計	337,029,300,361
負債純資産合計	343,596,396,462

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2019年 8月28日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,096,412,688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 2.4583円 (1万口当たり純資産額) (24,583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 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>

	2019年 8月28日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	139,889,843,489円
期中追加設定元本額	5,861,143,293円
期中一部解約元本額	8,654,574,094円
期末元本額	137,096,412,688円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,466,220,276円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,743,667円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,239,640,372円
世界経済インデックスファンド	7,569,485,034円
外国株式インデックス・オープン	900,056,568円
D C マイセレクション 2 5	1,096,492,671円
D C マイセレクション 5 0	4,819,722,695円
D C マイセレクション 7 5	5,043,226,923円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,614,970,127円
D C マイセレクション S 2 5	436,244,542円
D C マイセレクション S 5 0	1,949,370,034円
D C マイセレクション S 7 5	1,438,262,461円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	108,000,999円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	188,765,946円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	123,815,508円
D C 世界経済インデックスファンド	6,556,305,835円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,969,721,903円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	9,491,154円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	40,540,056円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	49,025,636円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	195,398,699円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	34,527,140円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	271,078,469円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	715,505,651円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	367,824,539円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,398,383,445円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,840,154,878円

区分	2019年 8月28日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	77,673,998円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	349,172,169円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,588,264円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	123,544,818円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,845,367,154円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,094,899,634円
外国株式ファンド・シリーズ1	875,518,535円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,485,538,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,428,856,181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	4,952,005,797円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	911,559,773円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,024,664,542円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,150,900,817円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	815,879,667円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,449,930円
S M T インデックスバランス・オープン	273,404,019円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,668,443,645円
外国株式S M T Bセクション（S M A専用）	30,223,198,128円
S M T 世界経済インデックス・オープン	79,500,691円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	325,395,018円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	50,012,229円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,459,532円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	46,789,800円
グローバル経済コア	1,064,322,288円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	6,808,292円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	382,203円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	367,788,121円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,560,043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
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,372,424,434円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,176,993,754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）	360,749,756円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	32,905,022円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2019年 8月28日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,654,249,794
投資信託受益証券	17,470,156
投資証券	452,165,427
合計	4,123,885,377

(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 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,717,967,165	-	8,477,173,855	240,793,310
合計		8,717,967,165	-	8,477,173,855	240,793,310

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	787,623,534	-	787,286,900	336,634
	アメリカドル	279,956,400	-	279,827,210	129,190
	カナダドル	143,605,896	-	143,577,000	28,896
	ユーロ	167,675,320	-	167,596,000	79,320
	イギリスポンド	47,787,008	-	47,788,480	1,472
	スイスフラン	16,546,338	-	16,484,220	62,118
	デンマーククローネ	21,189,212	-	21,190,560	1,348
	オーストラリアドル	58,962,358	-	58,951,620	10,738
	香港ドル	21,868,302	-	21,861,810	6,492
	イスラエルシェケル	30,032,700	-	30,010,000	22,700

合計	787,623,534	-	787,286,900	336,634
----	-------------	---	-------------	---------

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	34,273	20.96	718,362.08	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	21.29	945,276.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	16.60	595,591.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,927	58.23	1,160,349.21	
	CHEVRON CORP	162,402	115.83	18,811,023.66	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	37.63	285,950.37	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	69.02	1,206,538.62	
	CONOCOPHILLIPS	96,515	50.98	4,920,334.70	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	28.55	218,321.85	
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	21.34	807,953.74	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	92.37	1,245,794.19	
	EOG RESOURCES INC	49,600	71.66	3,554,336.00	
	EXXON MOBIL	360,671	67.19	24,233,484.49	
	HALLIBURTON CO	76,620	17.31	1,326,292.20	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	36.65	304,744.75	
	HESS CORP	22,081	59.71	1,318,456.51	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	43.15	608,846.50	
	KINDER MORGAN INC	174,156	20.04	3,490,086.24	
	MARATHON OIL CORP	74,537	11.53	859,411.61	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	45.33	2,616,447.60	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	18.46	559,541.06	
	NOBLE ENERGY INC	38,291	21.51	823,639.41	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	42.35	3,243,671.20	
	ONEOK INC	34,074	68.32	2,327,935.68	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	16.65	340,908.75	
	PHILLIPS 66	38,115	94.52	3,602,629.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	118.02	1,705,979.10		

PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	21.28	210,459.20
SCHLUMBERGER	118,363	31.25	3,698,843.75
TARGA RESOURCES CORP	20,002	32.46	649,264.92
TECHNIPFMC PLC	36,005	24.72	890,043.60
VALERO ENERGY CORP	35,352	71.71	2,535,091.92
WILLIAMS COS	103,730	22.92	2,377,491.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,806	225.54	4,241,505.24
ALBEMARLE CORP	8,647	59.30	512,767.10
AMCOR PLC	138,214	9.78	1,351,732.92
AVERY DENNISON CORP	7,457	112.92	842,044.44
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	26.92	473,953.52
BALL CORP	27,142	79.02	2,144,760.84
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	107.22	1,185,102.66
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	46.69	890,424.99
CORTEVA INC	64,411	28.73	1,850,528.03
CROWN HOLDINGS INC	11,700	64.56	755,352.00
DOW INC	65,790	41.17	2,708,574.30
DUPONT DE NEMOURS INC	64,206	63.96	4,106,615.76
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	61.55	729,859.90
ECOLAB INC	21,748	204.72	4,452,250.56
FMC CORP	12,118	83.24	1,008,702.32
FREEMONT-MCMORAN INC	124,849	8.71	1,087,434.79
INT'L PAPER CO	33,803	36.74	1,241,922.22
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	107.33	930,980.42
LINDE PLC	46,307	184.74	8,554,755.18
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	69.75	1,604,738.25
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	250.21	1,342,877.07
MOSAIC CO/THE	31,911	17.66	563,548.26
NEWMONT GOLDCORP CORP	69,458	40.75	2,830,413.50
NUCOR CORP	26,204	46.61	1,221,368.44
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	97.66	868,197.40
PPG INDUSTRIES INC	19,958	107.41	2,143,688.78
SEALED AIR CORP	14,689	39.91	586,237.99
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,101	515.39	3,659,784.39
STEEL DYNAMICS INC	18,273	25.90	473,270.70
VULCAN MATERIALS CO	10,740	139.82	1,501,666.80
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	56.10	193,825.50
WESTROCK CO	21,244	32.31	686,393.64
3 M COMPANY	49,185	155.75	7,660,563.75
ACUITY BRANDS INC	3,505	120.71	423,088.55
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	50.43	571,371.90
ALLEGION PLC	7,435	93.77	697,179.95

AMETEK INC	19,001	83.73	1,590,953.73
ARCONIC INC	36,550	25.18	920,329.00
BOEING CO	45,573	354.73	16,166,110.29
CATERPILLAR	48,214	113.38	5,466,503.32
CUMMINS INC	12,585	142.80	1,797,138.00
DEERE&CO	25,734	150.10	3,862,673.40
DOVER CORP	12,008	88.93	1,067,871.44
EATON CORP	36,194	76.86	2,781,870.84
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	57.27	3,010,225.74
FASTENAL CO	46,922	29.70	1,393,583.40
FLOWSERVE CORP	10,826	40.22	435,421.72
FLUOR CORP	11,267	16.35	184,215.45
FORTIVE CORP	25,813	69.03	1,781,871.39
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	49.44	633,326.40
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	183.36	3,854,410.56
GENERAL ELECTRIC CO	744,434	7.93	5,903,361.62
GRAINGER (WW) INC	3,976	265.37	1,055,111.12
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	37.70	574,020.20
HEICO CORP	3,640	145.10	528,164.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	109.74	707,713.26
HONEYWELL INTL INC	62,077	157.48	9,775,885.96
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	202.61	713,592.42
IDEX CORP	6,916	162.61	1,124,610.76
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	145.00	4,064,060.00
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	116.51	2,367,716.22
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	85.02	1,022,450.52
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	52.24	1,050,024.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	31.47	645,135.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	41.99	2,858,763.18
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,859	210.48	3,969,442.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	247.40	713,749.00
LOCKHEED MARTIN CORP	21,716	379.99	8,251,862.84
MASCO CORP	24,547	39.34	965,678.98
MIDDLEBY CORP	4,364	108.65	474,148.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,775	364.18	5,016,579.50
OWENS CORNING	7,979	54.89	437,967.31
PACCAR INC	30,075	63.43	1,907,657.25
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	157.83	1,789,792.20
PENTAIR PLC	13,583	34.73	471,737.59
RAYTHEON COMPANY	23,520	178.39	4,195,732.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	146.25	1,537,233.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	353.76	3,084,787.20

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.41	600,273.48
SMITH (A.O.) CORP	12,146	44.48	540,254.08
SNAP-ON INC	4,900	145.10	710,990.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	77.85	660,245.85
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	129.62	1,715,391.08
TEXTRON	18,220	42.77	779,269.40
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	512.51	2,086,940.72
UNITED RENTALS INC	6,446	103.80	669,094.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	69,887	124.57	8,705,823.59
WABCO HOLDINGS INC	3,841	132.66	509,547.06
WABTEC CORP	15,679	65.94	1,033,873.26
XYLEM INC	16,060	74.28	1,192,936.80
CINTAS CORP	7,616	261.15	1,988,918.40
COPART INC	17,540	74.63	1,309,010.20
COSTAR GROUP INC	3,008	612.61	1,842,730.88
EQUIFAX INC	10,799	144.71	1,562,723.29
IHS MARKIT LTD	32,775	64.39	2,110,382.25
MANPOWER GROUP	5,123	78.89	404,153.47
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	20.32	558,881.28
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	88.60	1,635,644.60
ROBERT HALF INTL INC	9,566	52.90	506,041.40
ROLLINS INC	10,546	31.53	332,515.38
TRANSUNION	15,344	83.39	1,279,536.16
VERISK ANALYTICS INC	13,480	158.91	2,142,106.80
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	91.29	2,100,400.32
WASTE MANAGEMENT INC	36,280	117.75	4,271,970.00
AMERCO	602	343.07	206,528.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	24.45	242,544.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	82.33	942,513.84
CSX CORP	64,710	64.41	4,167,971.10
DELTA AIR LINES INC	15,095	56.14	847,433.30
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	69.88	964,553.64
FEDEX CORP	21,165	149.53	3,164,802.45
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	100.66	718,108.44
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	121.21	1,059,739.03
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	31.75	339,725.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	169.95	3,877,239.30
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	159.51	836,629.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	50.49	578,867.85
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	33.11	521,449.39
UNION PACIFIC CORP	60,776	157.47	9,570,396.72
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	81.94	491,885.82

UNITED PARCEL SERVICE B	59,531	114.13	6,794,273.03
XPO LOGISTICS INC	8,001	66.26	530,146.26
APTIV PLC	22,107	81.02	1,791,109.14
AUTOLIV INC	6,639	64.58	428,746.62
BORGWARNER INC	15,953	31.14	496,776.42
FORD MOTOR COMPANY	335,147	8.76	2,935,887.72
GENERAL MOTORS CO	109,074	35.89	3,914,665.86
HARLEY-DAVIDSON	14,677	30.39	446,034.03
LEAR CORP	5,287	106.88	565,074.56
TESLA INC	10,812	214.08	2,314,632.96
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	25.89	298,951.83
DR HORTON INC	28,998	48.93	1,418,872.14
GARMIN LTD	11,464	79.81	914,941.84
HANESBRANDS INC	31,136	13.50	420,336.00
HASBRO INC	10,617	107.26	1,138,779.42
LEGGETT & PLATT INC	10,594	36.33	384,880.02
LENNAR CORP-CL A	23,545	50.50	1,189,022.50
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	180.11	1,710,324.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	112.58	569,879.96
NEWELL BRANDS INC	37,563	15.70	589,739.10
NIKE B	107,215	82.03	8,794,846.45
NVR INC	294	3,591.89	1,056,015.66
POLARIS INC	4,691	77.75	364,725.25
PULTE GROUP INC	21,959	33.39	733,211.01
PVH CORP	7,252	69.81	506,262.12
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	85.42	391,052.76
ROKU INC	7,065	147.02	1,038,696.30
TAPESTRY INC	25,989	20.48	532,254.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	17.82	284,229.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	16.12	262,481.96
VF CORP	28,754	79.56	2,287,668.24
WHIRLPOOL CORP	5,324	134.10	713,948.40
ARAMARK	19,980	40.01	799,399.80
BLOCK H & R INC	16,984	26.90	456,869.60
CARNIVAL CORPORATION	35,126	43.03	1,511,471.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	842.11	1,900,642.27
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	119.52	1,198,905.12
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	222.45	768,119.85
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	91.13	2,143,650.99
LAS VEGAS SANDS CORP	28,379	54.29	1,540,695.91
MARRIOTT INTL A	23,516	125.35	2,947,730.60
MCDONALD'S CORP	65,110	216.05	14,067,015.50

MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	20.31	358,715.22
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.89	1,245,455.84
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	49.09	875,667.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	101.77	1,556,165.07
STARBUCKS CORP	103,316	96.09	9,927,634.44
VAIL RESORTS INC	3,574	236.54	845,393.96
WYNN RESORTS LTD	8,052	104.15	838,615.80
YUM BRANDS INC	26,166	116.97	3,060,637.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,500	51.09	3,346,395.00
ALPHABET INC-CL A	25,523	1,170.82	29,882,838.86
ALPHABET INC-CL C	26,716	1,167.84	31,200,013.44
ALTICE USA INC- A	12,457	28.66	357,017.62
CBS CORP-CL B	28,628	41.04	1,174,893.12
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	398.49	5,432,215.68
COMCAST CORP-CL A	386,179	43.60	16,837,404.40
DISCOVERY INC - A	12,804	26.47	338,921.88
DISCOVERY INC-C	31,156	24.89	775,472.84
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	32.37	589,716.66
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	94.06	2,393,544.82
FACEBOOK INC-A	204,769	181.30	37,124,619.70
FOX CORP - CLASS A	30,270	31.93	966,521.10
FOX CORP- CLASS B	15,092	31.62	477,209.04
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	253.07	1,700,883.47
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	19.90	673,296.60
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	102.15	884,925.45
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	25.81	400,467.96
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,606	25.14	1,071,114.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	39.99	747,533.07
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	39.72	605,054.76
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.44	251,784.96
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	70.31	888,507.47
NETFLIX INC	37,291	291.03	10,852,799.73
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.51	452,301.29
OMNICOM GROUP	19,030	75.40	1,434,862.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.06	784,800.30
SNAP INC - A	57,914	15.51	898,246.14
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	130.84	1,249,783.68
THE WALT DISNEY CO	153,426	134.49	20,634,262.74
TRIPADVISOR INC	10,393	35.81	372,173.33
TWITTER INC	61,378	42.14	2,586,468.92
VIACOM INC-CLASS B	31,895	24.37	777,281.15
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	32.78	326,554.36

ADVANCE AUTO PARTS	6,186	134.89	834,429.54
AMAZON.COM	35,663	1,761.83	62,832,143.29
AUTOZONE INC	2,085	1,064.79	2,220,087.15
BEST BUY COMPANY INC	20,711	67.82	1,404,620.02
BOOKING HOLDINGS INC	3,695	1,919.99	7,094,363.05
BURLINGTON STORES INC	6,004	170.38	1,022,961.52
CARMAX INC	14,253	79.53	1,133,541.09
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	138.75	3,098,287.50
DOLLAR TREE INC	19,630	96.75	1,899,202.50
EBAY	71,876	39.00	2,803,164.00
EXPEDIA GROUP INC	12,028	128.46	1,545,116.88
GAP	21,891	15.58	341,061.78
GENUINE PARTS CO	12,722	87.85	1,117,627.70
GRUBHUB INC	8,261	56.46	466,416.06
HOME DEPOT	94,028	218.21	20,517,849.88
KOHL'S CORP	14,645	44.75	655,363.75
L BRANDS INC	19,499	16.15	314,908.85
LKQ CORP	24,693	25.03	618,065.79
LOWES COMPANIES	67,906	106.04	7,200,752.24
MACY'S INC	25,926	14.30	370,741.80
MERCADOLIBRE INC	3,727	594.13	2,214,322.51
NORDSTROM INC	10,094	27.89	281,521.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	376.92	2,524,987.08
QURATE RETAIL INC	35,071	10.65	373,506.15
ROSS STORES INC	31,827	102.58	3,264,813.66
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,758	104.70	4,581,462.60
TIFFANY & CO	9,326	82.67	770,980.42
TJX COMPANIES INC	103,117	53.41	5,507,478.97
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,497	99.40	944,001.80
ULTA BEAUTY INC	4,911	323.77	1,590,034.47
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	108.23	576,541.21
COSTCO WHOLESALE CORP	37,514	292.38	10,968,343.32
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	7.07	239,673.00
KROGER CO	68,147	23.12	1,575,558.64
SYSCO CORP	41,755	73.87	3,084,441.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	49.45	3,333,276.15
WALMART INC	122,245	112.42	13,742,782.90
ALTRIA GROUP INC	158,456	45.25	7,170,134.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	37.42	1,788,601.16
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	58.99	1,559,636.61
BUNGE LIMITED	11,767	52.58	618,708.86
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	42.05	591,727.60

COCA-COLA CO	345,522	54.72	18,906,963.84
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	55.49	1,124,782.30
CONAGRA BRANDS INC	39,943	27.91	1,114,809.13
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	198.19	2,778,227.42
GENERAL MILLS INC	50,246	51.91	2,608,269.86
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	159.38	1,995,596.98
HORMEL FOODS CORP	23,465	42.41	995,150.65
INGREDION INC	5,835	73.25	427,413.75
JM SMUCKER CO	9,442	103.69	979,040.98
KELLOGG CO	21,051	62.10	1,307,267.10
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	25.00	1,439,525.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	68.45	884,647.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	163.03	1,626,387.28
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	50.17	757,567.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	54.42	6,651,974.28
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	56.57	1,976,103.24
PEPSICO INC	119,526	134.76	16,107,323.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,697	71.70	9,514,374.90
TYSON FOODS INC	24,363	89.97	2,191,939.11
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	79.72	1,695,166.08
CLOROX COMPANY	10,995	158.65	1,744,356.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	69,644	73.44	5,114,655.36
COTY INC-CL A	30,534	8.80	268,699.20
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,739	200.55	3,758,106.45
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	141.14	4,152,762.22
PROCTER & GAMBLE CO	213,814	120.55	25,775,277.70
ABBOTT LABORATORIES	150,743	83.65	12,609,651.95
ABIOMED INC	3,502	190.06	665,590.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	173.80	1,088,683.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	81.28	1,044,204.16
ANTHEM INC	21,803	251.30	5,479,093.90
BAXTER INTERNATIONAL	40,492	86.39	3,498,103.88
BECTON DICKINSON & CO	23,072	250.32	5,775,383.04
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,988	42.22	5,023,673.36
CARDINAL HEALTH	25,252	41.93	1,058,816.36
CENTENE CORP	35,914	45.03	1,617,207.42
CERNER CORP	27,944	68.19	1,905,501.36
CIGNA CORP	32,466	146.27	4,748,801.82
CVS HEALTH CORP	111,087	59.19	6,575,239.53
DANAHER CORP	55,089	138.25	7,616,054.25
DAVITA INC	9,056	53.78	487,031.68
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	51.56	1,040,893.28

DEXCOM INC	7,827	175.00	1,369,725.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	214.89	3,833,422.71
HCA HEALTHCARE INC	22,986	117.40	2,698,556.40
HENRY SCHEIN INC	12,492	60.46	755,266.32
HOLOGIC INC	24,459	48.26	1,180,391.34
HUMANA INC	11,566	272.06	3,146,645.96
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	284.77	2,051,767.85
INTUITIVE SURGICAL INC	9,879	495.02	4,890,302.58
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	163.93	1,447,010.11
MCKESSON CORP	16,655	138.75	2,310,881.25
MEDTRONIC PLC	114,560	107.54	12,319,782.40
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	100.46	1,163,326.80
RESMED INC	12,398	135.98	1,685,880.04
STERIS PLC	7,229	153.02	1,106,181.58
STRYKER CORP	28,773	218.51	6,287,188.23
TELEFLEX INC	3,971	359.99	1,429,520.29
THE COOPER COS INC	4,135	326.39	1,349,622.65
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,179	222.93	18,097,234.47
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	140.68	1,019,648.64
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	105.49	868,921.13
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	163.41	1,794,568.62
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	265.24	1,167,851.72
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	134.50	2,332,499.00
ABBVIE INC	126,373	65.67	8,298,914.91
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	69.48	1,902,848.76
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	110.16	2,098,327.68
ALKERMES PLC	12,547	20.05	251,567.35
ALLERGAN PLC	27,804	160.77	4,470,049.08
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	82.21	787,982.85
AMGEN	52,414	206.49	10,822,966.86
BEIGENE LTD-ADR	3,149	141.61	445,929.89
BIOGEN INC	16,410	220.79	3,623,163.90
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	74.68	1,209,218.56
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	139,879	47.93	6,704,400.47
CELGENE CORP	59,466	96.70	5,750,362.20
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	25.62	785,534.82
EXACT SCIENCES CORP	10,748	119.01	1,279,119.48
GILEAD SCIENCES INC	108,729	63.31	6,883,632.99
ILLUMINA INC	12,589	285.02	3,588,116.78
INCYTE CORP	16,120	80.26	1,293,791.20
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	66.14	743,149.04
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	153.66	2,190,423.30

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	125.18	622,269.78
JOHNSON & JOHNSON	226,749	129.64	29,395,740.36
LILLY (ELI) & CO	74,693	110.73	8,270,755.89
MERCK & CO	219,928	85.52	18,808,242.56
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,025	647.23	1,310,640.75
MYLAN NV	42,644	18.67	796,163.48
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	16.91	228,403.37
PERKINELMER INC	9,475	80.20	759,895.00
PERRIGO CO PLC	11,333	45.43	514,858.19
PFIZER	474,281	34.34	16,286,809.54
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	281.41	1,947,638.61
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	92.15	594,183.20
SEATTLE GENETICS INC	9,601	74.78	717,962.78
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	6.71	636,336.14
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,187	272.93	9,330,657.91
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	178.25	3,856,260.50
WATERS CORP	5,663	204.19	1,156,327.97
ZOETIS INC	40,953	125.24	5,128,953.72
BANK OF AMERICA CORP	770,049	26.47	20,383,197.03
BB&T CORP	64,191	45.67	2,931,602.97
CIT GROUP INC	7,038	41.29	290,599.02
CITIGROUP	197,425	61.66	12,173,225.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	31.89	1,275,918.90
COMERICA INC	14,360	58.80	844,368.00
EAST WEST BANCORP INC	13,827	37.83	523,075.41
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	25.30	1,594,228.90
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	88.55	1,250,857.30
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	12.56	1,075,927.28
JPMORGAN CHASE & CO	276,504	105.74	29,237,532.96
KEY CORP	87,033	15.81	1,375,991.73
M & T BANK CORP	10,559	143.86	1,519,017.74
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	13.94	511,876.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,554	124.13	4,785,708.02
REGIONS FINL CORP	83,851	13.85	1,161,336.35
SIGNATURE BANK	4,354	112.76	490,957.04
SUNTRUST BANKS	38,353	59.61	2,286,222.33
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	184.71	810,876.90
US BANCORP	129,084	51.04	6,588,447.36
WELLS FARGO & CO	364,038	44.75	16,290,700.50
ZIONS BANCORPORATION	15,186	39.49	599,695.14
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	74.84	331,765.72
ALLY FINANCIAL INC	36,028	30.49	1,098,493.72

AMERICAN EXPRESS	60,573	117.75	7,132,470.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	125.24	1,484,094.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	19.85	450,475.90
BANK NEW YORK CO	71,617	40.95	2,932,716.15
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110,807	198.35	21,978,568.45
BLACKROCK INC	9,909	410.51	4,067,743.59
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	83.11	3,284,507.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	120.06	1,136,968.20
CME GROUP INC	30,553	216.22	6,606,169.66
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,947	77.49	2,088,123.03
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	39.64	836,721.12
EATON VANCE CORP	10,061	40.46	407,068.06
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	273.73	892,359.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.95	676,516.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	198.07	5,571,709.10
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,352	93.12	4,409,418.24
INVESCO LTD	30,943	15.31	473,737.33
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	18.04	463,736.24
KKR & CO INC -A	42,145	25.66	1,081,440.70
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	405.68	1,303,044.16
MOODY'S CORP	14,592	213.27	3,112,035.84
MORGAN STANLEY	108,193	39.79	4,304,999.47
MSCI INC	7,262	231.23	1,679,192.26
NASDAQ INC	9,996	98.27	982,306.92
NORTHERN TRUST CORP	17,320	84.49	1,463,366.80
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	107.08	2,148,667.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	75.66	827,871.72
S&P GLOBAL INC	20,750	257.26	5,338,145.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	36.12	3,678,641.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	55.83	603,075.66
STATE STREET CORP	32,349	49.40	1,598,040.60
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	31.39	1,666,652.05
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	42.50	994,670.00
VOYA FINANCIAL INC	12,505	48.86	610,994.30
AFLAC	63,745	48.98	3,122,230.10
ALLEGHANY CORP	1,276	744.90	950,492.40
ALLSTATE CORP	28,490	102.63	2,923,928.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	100.06	701,720.78
AMERICAN INT'L GROUP	74,317	52.74	3,919,478.58
AON PLC	20,104	191.14	3,842,678.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	39.11	1,351,289.61
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	88.04	1,318,134.88

ASSURANT INC	4,769	120.86	576,381.34
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	37.56	501,313.32
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	34.62	360,601.92
CHUBB LTD	38,690	155.53	6,017,455.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	110.39	1,468,849.34
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	212.69	460,686.54
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	245.55	823,329.15
FNF GROUP	24,961	43.72	1,091,294.92
GLOBE LIFE INC	8,473	86.52	733,083.96
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	58.55	1,856,620.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	51.42	914,761.80
LOEWS CORP	22,051	47.45	1,046,319.95
MARKEL CORP	1,132	1,126.34	1,275,016.88
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	97.56	4,261,811.04
METLIFE INC	67,515	43.86	2,961,207.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	52.51	1,215,869.05
PROGRESSIVE CORP	49,905	74.96	3,740,878.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	78.29	2,719,168.28
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	148.84	808,350.04
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	186.44	712,573.68
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	147.10	3,243,702.10
UNUM GROUP	18,574	25.16	467,321.84
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	191.26	2,090,471.80
WR BERKLEY CORP	12,637	71.78	907,083.86
CBRE GROUP INC-A	26,855	49.33	1,324,757.15
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.48	540,876.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	130.05	583,144.20
WEYERHAEUSER CO	62,107	25.05	1,555,780.35
ACCENTURE PLC-CL A	54,403	197.16	10,726,095.48
ADOBE INC	41,615	289.45	12,045,461.75
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	88.21	1,250,641.38
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	122.08	490,273.28
ANSYS INC	6,865	211.04	1,448,789.60
AUTODESK INC	18,836	150.21	2,829,355.56
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	166.85	6,138,912.05
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	129.45	1,249,192.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	67.11	1,618,022.10
CDK GLOBAL INC	10,687	42.31	452,166.97
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	106.72	1,152,682.72
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	92.41	1,049,038.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	59.70	2,887,271.10
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	111.90	346,890.00

DOCUSIGN INC	8,693	44.76	389,098.68
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	17.53	284,809.91
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	31.76	746,296.48
EPAM SYSTEMS INC	4,620	188.90	872,718.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,366	136.73	7,160,003.18
FISERV INC	49,096	106.98	5,252,290.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	292.57	2,133,420.44
FORTINET INC	12,963	80.86	1,048,188.18
GARTNER INC	7,761	130.53	1,013,043.33
GLOBAL PAYMENTS INC	13,420	162.22	2,176,992.40
GODADDY INC - CLASS A	14,919	64.00	954,816.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,631	131.17	9,920,518.27
INTUIT INC	22,128	283.21	6,266,870.88
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	142.60	949,430.80
LEIDOS HOLDINGS	10,999	85.03	935,244.97
MASTERCARD INC-CLASS A	77,481	276.64	21,434,343.84
MICROSOFT CORP	620,342	135.74	84,205,223.08
MONGODB INC	3,652	150.21	548,566.92
OKTA INC	8,635	135.07	1,166,329.45
ORACLE CORP	204,053	52.39	10,690,336.67
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	202.08	1,629,573.12
PAYCHEX INC	27,697	80.66	2,234,040.02
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	255.10	1,081,113.80
PAYPAL HOLDINGS INC	95,208	107.45	10,230,099.60
PTC INC	9,984	64.92	648,161.28
SABRE CORP	24,114	23.00	554,622.00
SALESFORCE.COM INC	70,919	153.57	10,891,030.83
SERVICENOW INC	15,779	266.21	4,200,527.59
SPLUNK INC	12,887	112.97	1,455,844.39
SQUARE INC - A	27,989	61.75	1,728,320.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	45.32	890,311.40
SYMANTEC CORP	53,148	23.07	1,226,124.36
SYNOPSYS INC	12,264	136.69	1,676,366.16
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	131.26	1,866,254.68
TWILIO INC - A	9,579	131.48	1,259,446.92
VERISIGN INC	9,194	203.79	1,873,645.26
VISA INC-CLASS A SHARES	148,232	178.38	26,441,624.16
VMWARE INC-CLASS A	6,787	130.56	886,110.72
WESTERN UNION CO	38,757	21.87	847,615.59
WIX.COM LTD	3,961	145.64	576,880.04
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	188.35	2,610,531.00
AMPHENOL CORPORATION	25,582	85.04	2,175,493.28

APPLE INC	392,086	204.16	80,048,277.76
ARISTA NETWORKS INC	4,324	223.78	967,624.72
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	67.38	449,155.08
CDW CORP/DE	12,482	112.58	1,405,223.56
CISCO SYSTEMS	366,517	46.79	17,149,330.43
COGNEX CORP	16,230	43.04	698,539.20
CORNING	66,228	27.07	1,792,791.96
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	45.60	633,384.00
F5 NETWORKS INC	5,350	122.07	653,074.50
FLEX LTD	40,465	9.11	368,636.15
FLIR SYSTEMS INC	11,686	47.56	555,786.16
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	12.93	1,449,517.65
HP INC	124,838	17.73	2,213,377.74
IPG PHOTONICS CORP	3,207	116.52	373,679.64
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	22.85	715,296.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	94.51	1,498,267.03
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	178.51	2,487,715.36
NETAPP INC	20,586	46.51	957,454.86
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	46.94	1,071,921.84
TE CONNECTIVITY LTD	28,434	89.66	2,549,392.44
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	36.17	745,897.74
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	52.66	1,241,564.82
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	27.49	459,577.82
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	198.59	913,514.00
AT&T INC	622,137	34.72	21,600,596.64
CENTURYLINK INC	83,301	11.36	946,299.36
SPRINT CORP	64,825	6.70	434,327.50
T-MOBILE US INC	28,273	77.12	2,180,413.76
VERIZON COMMUNICATIONS	352,577	57.18	20,160,352.86
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	33.89	691,288.22
AES CORP	52,646	14.61	769,158.06
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	52.34	1,007,859.04
AMEREN CORPORATION	21,002	75.75	1,590,901.50
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	90.67	3,755,732.74
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	125.10	1,935,422.10
ATMOS ENERGY CORP	9,385	108.04	1,013,955.40
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	27.28	1,167,365.76
CMS ENERGY CORP	24,527	62.56	1,534,409.12
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	88.04	2,420,571.76
DOMINION ENERGY INC	68,162	77.15	5,258,698.30
DTE ENERGY COMPANY	15,603	130.40	2,034,631.20
DUKE ENERGY CORP	62,154	92.15	5,727,491.10

EDISON INTL	30,299	73.33	2,221,825.67	
ENERGY CORP	15,636	112.10	1,752,795.60	
EVERGY INC	21,330	65.29	1,392,635.70	
EVERSOURCE ENERGY	27,188	80.56	2,190,265.28	
EXELON CORP	82,975	46.24	3,836,764.00	
FIRSTENERGY CORP	45,526	45.43	2,068,246.18	
NEXTERA ENERGY INC	40,857	224.01	9,152,376.57	
NISOURCE INC	32,308	29.24	944,685.92	
NRG ENERGY INC	23,078	35.37	816,268.86	
OGE ENERGY CORP	15,686	42.70	669,792.20	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	94.50	889,812.00	
PPL CORPORATION	59,613	29.18	1,739,507.34	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	59.46	2,571,882.84	
SEMPRA ENERGY	23,257	141.43	3,289,237.51	
SOUTHERN CO	88,512	57.76	5,112,453.12	
UGI CORP	18,019	47.55	856,803.45	
VISTRA ENERGY CORP	29,561	23.99	709,168.39	
WEC ENERGY GROUP INC	26,996	95.31	2,572,988.76	
XCEL ENERGY INC	44,029	63.99	2,817,415.71	
ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	30.20	2,655,244.40	
ANALOG DEVICES	31,611	107.05	3,383,957.55	
APPLIED MATERIALS	80,718	45.51	3,673,476.18	
BROADCOM INC	33,768	275.57	9,305,447.76	
INTEL CORP	381,705	45.79	17,478,271.95	
KLA CORP	13,856	142.42	1,973,371.52	
LAM RESEARCH CORP	12,864	199.77	2,569,841.28	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	23.51	1,286,866.87	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	52.76	1,235,797.48	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	84.35	1,749,756.40	
MICRON TECHNOLOGY	95,275	42.44	4,043,471.00	
NVIDIA CORP	49,363	161.80	7,986,933.40	
NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	98.72	2,475,700.16	
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	17.23	620,211.08	
QORVO INC	10,609	70.21	744,857.89	
QUALCOMM	103,733	73.97	7,673,130.01	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	72.87	1,057,343.70	
TEXAS INSTRUMENTS	80,031	122.18	9,778,187.58	
XILINX INC	21,744	100.22	2,179,183.68	
アメリカドル 小計	25,759,072		2,077,324,655.11 (219,635,535,784)	
カナダドル				
CAMECO CORP	28,709	11.17	320,679.53	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	30.12	3,112,239.36	

CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.99	1,062,359.34
ENBRIDGE	172,807	43.75	7,560,306.25
ENCANA CORP	138,637	5.74	795,776.38
HUSKY ENERGY INC	31,439	8.86	278,549.54
IMPERIAL OIL	24,763	31.71	785,234.73
INTER PIPELINE LTD	35,455	24.07	853,401.85
KEYERA CORP	18,607	31.90	593,563.30
PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	47.07	1,989,931.32
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	16.25	298,187.50
SUNCOR ENERGY	134,430	37.26	5,008,861.80
TC ENERGY CORP	79,239	65.53	5,192,531.67
TOURMALINE OIL CORP	19,965	12.26	244,770.90
VERMILION ENERGY INC	10,067	18.52	186,440.84
AGNICO EAGLE MINES	21,459	85.17	1,827,663.03
BARRICK GOLD CORP	149,092	26.27	3,916,646.84
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	59.02	775,463.78
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	7.89	448,941.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,758	130.89	2,193,454.62
KINROSS GOLD CORP	107,615	6.86	738,238.90
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	66.50	1,132,694.50
LUNDIN MINING CORP	62,243	5.98	372,213.14
METHANEX CORP	7,099	40.82	289,781.18
NUTRIEN LTD	51,428	64.85	3,335,105.80
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.03	1,006,264.31
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	44.28	191,599.56
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	39.72	1,463,205.36
BOMBARDIER B	151,366	1.70	257,322.20
CAE INC	25,999	33.55	872,266.45
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	16.05	236,143.65
WSP GLOBAL INC	9,471	69.88	661,833.48
THOMSON REUTERS CORP	16,142	89.47	1,444,224.74
AIR CANADA	11,591	42.71	495,051.61
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	120.78	7,388,595.72
CP RAILWAY LIMITED	11,825	314.38	3,717,543.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	64.36	1,800,664.08
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	48.15	850,280.85
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	102.64	2,192,903.60
STARS GROUP INC/THE	20,487	19.28	394,989.36
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.55	449,160.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.01	899,034.47
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	135.15	731,026.35
DOLLARAMA INC	26,700	51.34	1,370,778.00

ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	81.78	2,957,001.24
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	36.79	561,157.87
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	71.61	1,118,404.98
METRO INC	22,050	55.05	1,213,852.50
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	107.29	738,477.07
SAPUTO INC	20,412	39.40	804,232.80
AURORA CANNABIS INC	53,000	7.40	392,200.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	31.18	511,352.00
CRONOS GROUP INC	15,900	14.69	233,571.00
BANK MONTREAL	54,609	89.21	4,871,668.89
BANK NOVA SCOTIA	104,375	68.57	7,156,993.75
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	100.23	3,807,737.70
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	60.45	1,706,382.60
ROYAL BANK OF CANADA	122,426	97.92	11,987,953.92
TORONTO-DOMINION BANK	156,017	71.83	11,206,701.11
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	72,274	67.72	4,894,395.28
CI FINANCIAL CORP	18,671	19.38	361,843.98
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.30	271,280.50
ONEX CORP	6,603	76.79	507,044.37
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	580.67	1,338,444.35
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	28.24	671,773.12
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	54.23	446,312.90
INTACT FINANCIAL CORP	11,102	130.21	1,445,591.42
MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	21.51	3,623,832.72
POWER CORP OF CANADA	29,774	27.14	808,066.36
POWER FINANCIAL CORP	20,740	27.57	571,801.80
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,943	53.00	2,593,979.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.99	274,105.35
BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.96	353,024.00
CGI INC - CL A	21,192	103.97	2,203,332.24
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,282.60	2,181,702.60
OPEN TEXT CORP	24,643	51.42	1,267,143.06
SHOPIFY INC - CLASS A	8,392	541.49	4,544,184.08
BCE INC	12,539	61.54	771,650.06
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	65.16	2,091,310.20
TELUS CORP	16,454	46.88	771,363.52
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	17.82	434,718.90
ATCO LTD -CLASS I	5,241	47.35	248,161.35
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.32	395,615.68
EMERA INC	20,611	56.53	1,165,139.83
FORTIS INC	38,447	54.83	2,108,049.01
HYDRO ONE LTD	32,299	24.41	788,418.59

	カナダドル 小計	3,441,476		156,135,896.09 (12,414,365,098)
ユーロ	ENI	217,599	13.30	2,894,501.89
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	12.53	499,533.51
	NESTE OIL OYJ	36,438	28.91	1,053,422.58
	OMV AG	12,139	45.40	551,110.60
	REPSOL SA	129,100	12.55	1,620,205.00
	TENARIS SA	40,648	9.93	403,715.93
	TOTAL SA	204,013	43.96	8,969,431.54
	VOPAK	6,360	42.87	272,653.20
	AIR LIQUIDE	36,297	123.70	4,489,938.90
	AKZO NOBEL	19,742	81.05	1,600,089.10
	ARCELORMITTAL	53,985	12.41	670,061.82
	ARKEMA	5,335	76.96	410,581.60
	BASF SE	77,211	58.24	4,496,768.64
	COVESTRO AG	15,098	39.39	594,710.22
	CRH PLC	71,124	29.50	2,098,158.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	22.39	301,235.06
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	31.82	183,346.84
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,833	60.80	719,446.40
	IMERYS SA	3,000	36.32	108,960.00
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	110.80	1,687,927.20
	LANXESS	7,293	51.78	377,631.54
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	27.62	540,385.30
	SOLVAY SA	6,906	88.74	612,838.44
	STORA ENSO OYJ R	47,237	9.76	461,033.12
	SYMRISE AG	11,581	81.50	943,851.50
	THYSSEN KRUPP	33,044	10.57	349,275.08
	UMICORE	17,605	26.70	470,053.50
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	23.20	1,020,568.00
	VOESTALPINE AG	8,140	20.26	164,916.40
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	33.70	731,121.50
	AIRBUS SE	49,825	122.56	6,106,552.00
	ALSTOM	13,816	38.54	532,468.64
	ANDRITZ AG	5,242	32.40	169,840.80
	BOUYGUES ORD	19,381	32.72	634,146.32
	BRENTAG AG	11,626	42.04	488,757.04
	CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.37	778,627.62
	DASSAULT AVIATION SA	213	1,262.00	268,806.00
	EIFFAGE	6,079	92.20	560,483.80
	FERROVIAL SA	39,067	25.86	1,010,272.62
	GEA GROUP AG	13,382	23.96	320,632.72

HOCHTIEF AG	2,222	98.65	219,200.30
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	42.22	498,744.86
KION GROUP AG	5,887	42.48	250,079.76
KNORR-BREMSE AG	4,123	84.50	348,393.50
KONE OYJ-B	30,120	51.16	1,540,939.20
LEGRAND SA	21,794	62.60	1,364,304.40
LEONARDO SPA	35,425	10.31	365,408.87
METSO OYJ	9,561	32.35	309,298.35
MTU AERO ENGINES AG	4,753	245.80	1,168,287.40
PRYSMIAN SPA	21,155	19.05	403,108.52
SAFRAN SA	27,984	128.25	3,588,948.00
SAINT-GOBAIN	40,731	31.80	1,295,245.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,063	73.62	3,391,158.06
SIEMENS	65,307	89.00	5,812,323.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.24	214,177.29
THALES SA	9,665	106.10	1,025,456.50
VINCI S.A.	43,091	97.82	4,215,161.62
WARTSILA OYJ	34,386	10.62	365,179.32
BUREAU VERITAS SA	25,073	21.48	538,568.04
EDENRED	18,941	44.78	848,177.98
RANDSTAD NV	9,588	41.80	400,778.40
SOCIETE BIC SA	2,424	58.50	141,804.00
TELEPERFORMANCE	5,057	194.70	984,597.90
WOLTERS KLUWER	22,886	64.80	1,483,012.80
ADP	2,382	154.90	368,971.80
AENA SME SA	5,610	164.25	921,442.50
ATLANTIA SPA	42,039	22.79	958,068.81
BOLLORE	61,805	3.85	237,949.25
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	13.85	322,317.20
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	29.22	2,483,715.85
FRAPORT AG	3,561	74.58	265,579.38
GETLINK	36,478	12.64	461,081.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	59.49	1,721,997.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	47.56	237,371.96
CONTINENTAL AG	9,928	107.88	1,071,032.64
DAIMLER AG	77,754	41.54	3,229,901.16
FAURECIA	5,945	37.05	220,262.25
FERRARI NV	9,947	144.95	1,441,817.65
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	11.60	1,117,996.40
MICHELIN	14,695	92.40	1,357,818.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	25.44	261,828.48
PEUGEOT SA	52,883	19.69	1,041,266.27

PIRELLI & C SPA	39,097	4.84	189,503.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	56.00	785,568.00
RENAULT SA	17,362	51.66	896,920.92
VALEO SA	19,350	24.04	465,174.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	143.50	2,295,856.50
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	146.15	379,113.10
ADIDAS AG	15,411	264.10	4,070,045.10
ESSILORLUXOTTICA	24,247	132.85	3,221,213.95
HERMES INTERNATIONAL	2,600	618.00	1,606,800.00
HUGO BOSS AG	4,852	50.72	246,093.44
KERING	6,332	430.05	2,723,076.60
LVMH	23,706	359.85	8,530,604.10
MONCLER SPA	15,736	34.21	538,328.56
PUMA SE	7,720	67.70	522,644.00
SEB SA	2,075	140.80	292,160.00
ACCOR	17,931	38.51	690,522.81
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	75.02	535,867.86
SODEXO	8,135	101.55	826,109.25
AXEL SPRINGER SE-TEND	3,827	62.50	239,187.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	15.66	187,544.16
JC DECAUX SA	4,674	25.00	116,850.00
PUBLICIS GROUPE	17,601	43.10	758,603.10
RTL GROUP	3,513	42.00	147,546.00
SES	31,369	14.41	452,027.29
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.66	218,212.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	72.54	495,448.20
VIVENDI	77,307	25.31	1,956,640.17
DELIVERY HERO SE	8,671	44.03	381,784.13
INDITEX	93,820	27.16	2,548,151.20
ZALANDO SE	9,155	43.93	402,179.15
CARREFOUR	53,759	15.39	827,619.80
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.43	134,317.41
COLRUYT SA	4,160	46.21	192,233.60
JERONIMO MARTINS	20,234	14.30	289,346.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	20.77	2,040,811.35
METRO AG	13,712	14.16	194,230.48
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,052	85.16	5,539,828.32
DANONE (GROUPE)	52,307	80.60	4,215,944.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.46	359,769.96
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	88.55	947,573.55
HEINEKEN NV	22,649	94.88	2,148,937.12
KERRY GROUP PLC-A	13,146	109.10	1,434,228.60

PERNOD-RICARD	18,169	166.00	3,016,054.00
REMY COINTREAU	1,575	132.20	208,215.00
BEIERSDORF AG	9,190	113.00	1,038,470.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	81.40	701,505.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	88.76	1,396,727.36
LOREAL	21,584	244.10	5,268,654.40
UNILEVER NV	123,171	55.14	6,791,648.94
BIOMERIEUX	3,246	73.80	239,554.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	105.10	360,493.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	60.30	1,085,158.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	43.96	1,615,398.12
KONINKLIJKE PHILIPS	79,182	41.93	3,320,101.26
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	179.00	581,034.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.86	448,312.50
BAYER	79,624	66.98	5,333,215.52
EUROFINS SCIENTIFIC	971	378.40	367,426.40
GRIFOLS SA	27,685	28.84	798,435.40
IPSEN	2,722	92.30	251,240.60
MERCK KGAA	10,480	95.74	1,003,355.20
ORION OYJ-CLASS B	7,975	34.37	274,100.75
QIAGEN N.V.	21,801	31.22	680,627.22
RECORDATI SPA	7,493	40.97	306,988.21
SANOFI	96,027	77.87	7,477,622.49
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	137.90	414,251.60
UCB (GROUPE)	10,465	67.70	708,480.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.01	531,521.83
AIB GROUP PLC	70,200	2.28	160,617.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	4.29	2,386,071.47
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.76	339,396.71
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	3.46	4,735,186.42
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	3.45	289,800.00
BANKIA SA	110,053	1.64	181,257.29
BANKINTER SA	58,881	5.31	313,129.15
BNP PARIBAS	94,302	40.32	3,802,728.15
CAIXABANK	286,347	2.04	586,438.65
COMMERZBANK AG	80,494	4.95	398,847.77
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.08	935,766.72
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	30.03	827,626.80
FINECOBANK SPA	53,120	9.36	497,309.44
ING GROEP NV-CVA	332,029	8.49	2,820,586.35
INTESA SANPAOLO	1,286,795	1.94	2,506,934.01
KBC GROEP NV	21,492	51.72	1,111,566.24

MEDIOBANCA	53,990	8.80	475,543.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.44	255,295.60
SOCIETE GENERALE	63,719	22.42	1,428,898.57
UNICREDIT SPA	172,440	9.71	1,675,944.36
AMUNDI SA	4,764	57.70	274,882.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.42	1,035,427.30
DEUTSCHE BOERSE	15,674	128.95	2,021,162.30
EURAZEO SA	3,357	60.00	201,420.00
EXOR NV	10,345	60.08	621,527.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	82.96	518,251.12
NATIXIS	69,996	3.46	242,536.14
WENDEL	2,023	125.00	252,875.00
AEGON	166,267	3.47	577,777.82
AGEAS	16,065	48.57	780,277.05
ALLIANZ SE-REG	36,222	198.76	7,199,484.72
ASSICURAZIONI GENERALI	89,649	16.43	1,472,933.07
AXA	165,661	21.25	3,521,124.55
CNP ASSURANCES	11,830	16.39	193,893.70
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	146.70	690,370.20
MAPFRE SA	90,939	2.41	219,890.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	217.70	2,757,170.50
NN GROUP NV	27,631	30.37	839,153.47
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.49	437,240.43
SAMPO OYJ-A SHS	38,075	36.68	1,396,591.00
SCOR SE	13,354	36.34	485,284.36
AROUNDTOWN SA	79,006	7.47	590,174.82
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	29.50	855,765.50
VONOVIA SE	43,528	43.86	1,909,138.08
ADYEN NV	884	649.00	573,716.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	67.04	2,447,630.40
ATOS SE	7,634	67.38	514,378.92
CAPGEMINI SA	13,238	107.45	1,422,423.10
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	128.50	1,452,050.00
SAP SE	83,843	108.54	9,100,319.22
WIRECARD AG	9,864	144.75	1,427,814.00
WORLDLINE SA	7,022	61.60	432,555.20
INGENICO GROUP	4,681	89.52	419,043.12
NOKIA OYJ	489,813	4.47	2,193,382.61
1&1 DRILLISCH AG	3,773	24.32	91,759.36
CELLNEX TELECOM SA	16,559	36.92	611,358.28
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	14.90	4,163,551.70
ELISA A	11,722	45.43	532,530.46

	ILIAD SA	2,053	94.74	194,501.22
	KPN (KON.)	308,450	2.79	862,426.20
	ORANGE	170,925	13.52	2,310,906.00
	PROXIMUS	13,141	26.44	347,448.04
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.46	397,630.25
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.44	207,146.76
	TELEFONICA	400,024	6.14	2,457,347.43
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.24	150,608.78
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	28.53	271,405.89
	E.ON SE	183,255	8.34	1,528,896.46
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	10.58	526,206.88
	ENAGAS	18,299	20.13	368,358.87
	ENDESA	24,774	23.44	580,702.56
	ENEL	694,781	6.49	4,515,381.71
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.37	795,026.81
	ENGIE	156,560	13.66	2,138,609.60
	FORTUM OYJ	38,328	19.90	762,918.84
	IBERDROLA SA	512,842	9.30	4,771,481.96
	INNOGY SE	11,000	44.75	492,250.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	23.96	554,194.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.89	709,016.48
	RWE STAMM	47,044	25.90	1,218,439.60
	SNAM SPA	163,694	4.56	746,935.72
	SUEZ	28,043	13.56	380,403.29
	TERNA SPA	130,230	5.73	746,217.90
	UNIPER SE	14,751	27.56	406,537.56
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	21.56	986,197.52
	VERBUND AG	7,463	54.50	406,733.50
	ASML HOLDING NV	36,326	193.46	7,027,627.96
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	15.22	1,632,405.88
	STMICROELECTRONICS	57,598	15.78	908,896.44
	ユーロ 小計	16,451,299		317,532,712.04 (37,214,833,851)
イギリスポンド	BP PLC	1,735,604	4.88	8,470,615.32
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	372,635	22.48	8,376,834.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	319,578	22.43	7,168,134.54
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	3.90	210,654.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	16.90	1,477,730.77
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.10	290,577.02
	BHP GROUP PLC	180,556	16.72	3,019,979.65
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	45.64	456,354.36
	EVRAZ PLC	43,000	4.83	207,733.00

FRESNILLO PLC	17,743	6.97	123,775.16
GLENCORE PLC	941,686	2.23	2,107,493.26
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	28.33	477,303.84
MONDI PLC	42,009	15.96	670,463.64
RIO TINTO PLC REG	96,995	39.34	3,816,268.27
ASHTED GROUP PLC	42,021	21.53	904,712.13
BAE SYSTEMS PLC	274,735	5.41	1,486,316.35
BUNZL PLC	27,712	20.27	561,722.24
DCC PLC	9,127	68.94	629,215.38
FERGUSON PLC	19,208	58.84	1,130,198.72
MEGGITT PLC	66,268	6.14	406,885.52
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.67	685,643.75
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.48	1,115,601.15
SMITHS GROUP PLC	37,146	15.72	584,120.85
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	77.95	489,292.15
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	13.89	258,159.54
EXPERIAN PLC	77,938	25.35	1,975,728.30
G4S PLC	132,555	1.72	228,060.87
INTERTEK GROUP PLC	12,722	53.32	678,337.04
RELX PLC	163,442	19.49	3,185,484.58
RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.47	706,202.99
EASYJET PLC	11,633	9.71	112,956.43
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.47	624,347.36
BURBERRY GROUP PLC	35,328	21.09	745,067.52
PERSIMMON PLC	26,389	19.30	509,307.70
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.48	401,564.46
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	39.67	420,462.33
CARNIVAL PLC	13,721	34.07	467,474.47
COMPASS GROUP PLC	136,301	20.75	2,828,245.75
GVC HOLDINGS PLC	42,500	6.10	259,590.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	50.86	815,845.26
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.52	294,242.96
TUI AG-DI	37,945	8.25	313,273.92
WHITBREAD PLC	11,623	43.06	500,486.38
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.35	428,213.52
INFORMA PLC	100,899	8.64	871,969.15
ITV PLC	295,435	1.14	336,795.90
PEARSON	66,305	8.09	536,407.45
WPP PLC	113,065	9.47	1,070,951.68
KINGFISHER PLC	170,994	1.93	330,018.42
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.89	256,458.64
NEXT PLC	11,202	58.82	658,901.64

OCADO GROUP PLC	38,762	12.36	479,098.32
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.82	381,466.67
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.96	291,107.43
TESCO	856,393	2.13	1,830,111.84
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.67	653,916.15
BRITISH AMERICAN TOBACCO	195,779	28.32	5,544,461.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.89	482,944.40
DIAGEO	204,601	34.44	7,047,481.44
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	20.61	1,716,095.67
RECKITT BENCKISER PLC	60,485	62.54	3,782,731.90
UNILEVER PLC	94,764	50.95	4,828,225.80
NMC HEALTH PLC	9,509	22.98	218,516.82
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	19.37	1,454,113.12
ASTRAZENECA	111,905	72.40	8,101,922.00
GLAXOSMITHKLINE	425,577	16.87	7,180,335.14
BARCLAYS	1,471,691	1.36	2,011,507.25
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,725,998	5.80	10,026,322.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.49	2,970,038.05
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	1.84	728,357.44
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.06	1,416,993.29
3I GROUP PLC	79,251	10.79	855,118.29
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	19.09	515,830.89
INVESTEC PLC	54,280	4.13	224,339.24
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	68.40	1,798,646.40
SCHRODERS PLC	8,614	26.71	230,079.94
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	9.38	419,934.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.50	485,081.93
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.65	351,920.75
AVIVA PIC	348,023	3.58	1,247,662.45
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.89	328,636.35
LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.19	1,076,560.75
PRUDENTIAL	217,306	13.48	2,929,284.88
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.28	457,439.86
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	15.66	455,390.42
SAGE GROUP PLC	89,321	6.93	618,994.53
HALMA PLC	32,374	19.51	631,778.61
BT GROUP PLC	730,298	1.60	1,168,476.80
VODAFONE GROUP PLC	2,283,635	1.51	3,454,683.02
CENTRICA PLC	440,558	0.66	293,675.96
NATIONAL GRID PLC	291,880	8.54	2,492,947.08
SEVERN TRENT PLC	18,112	20.52	371,658.24
SSE PLC	93,277	11.28	1,052,630.94

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.95	468,175.50
	イギリスbond 小計	25,433,297		147,756,873.35 (19,189,185,141)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.76	309,075.47
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	569.00	382,368.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,580.00	2,097,540.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	45.81	1,847,700.54
	SIKA AG-BR	10,500	138.20	1,451,100.00
	ABB LTD	153,407	18.15	2,784,337.05
	GEBERIT AG-REG	3,021	439.90	1,328,937.90
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	217.20	321,238.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	217.90	821,047.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	51.42	679,978.08
	SGS SA	437	2,380.00	1,040,060.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	139.45	706,593.15
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	76.00	3,400,544.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	266.30	661,222.90
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.05	197,096.90
	DUFREY AG-REG	3,825	78.82	301,486.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,972.00	315,520.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,500.00	644,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,260.00	755,040.00
	NESTLE SA - REGISTERED	261,093	109.06	28,474,802.58
	ALCON INC	35,606	58.48	2,082,238.88
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	228.30	1,165,243.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	765.20	684,854.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	351.20	2,285,258.40
	NOVARTIS	183,180	88.21	16,158,307.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,906	271.80	16,282,450.80
	VIFOR PHARMA AG	3,601	155.35	559,415.35
	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	11.19	2,449,065.78
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	37.78	800,067.06
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	69.75	236,940.75
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	793.20	1,275,465.60
	UBS GROUP AG	329,974	10.32	3,405,331.68
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	179.00	693,983.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	464.90	1,370,990.10
	SWISS RE LTD	26,239	98.58	2,586,640.62
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,930	347.20	4,489,296.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	98.75	619,853.75
	TEMENOS AG - REG	5,252	161.40	847,672.80
	SWISSCOM	2,064	484.70	1,000,420.80

	スイスフラン 小計	1,495,880		107,513,185.44 (11,583,470,599)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	279.70	3,969,222.70	
	BOLIDEN AB	23,903	200.70	4,797,332.10	
	ALFA LAVAL AB	25,639	170.95	4,382,987.05	
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	206.10	17,720,478.00	
	ATLAS COPCO A	59,675	274.80	16,398,690.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	247.10	9,028,539.80	
	EPIROC AB-A	53,833	98.70	5,313,317.10	
	EPIROC AB-B	29,972	94.24	2,824,561.28	
	SANDVIK AB	100,730	136.10	13,709,353.00	
	SKANSKA B	28,530	179.65	5,125,414.50	
	SKF AB-B	28,335	149.40	4,233,249.00	
	VOLVO B	125,906	126.70	15,952,290.20	
	SECURITAS B	22,844	144.70	3,305,526.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	218.80	3,975,596.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	74.36	2,878,624.32	
	HENNES & MAURITZ B	69,119	180.30	12,462,155.70	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	484.40	3,855,339.60	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	377.90	5,724,807.10	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	293.60	15,292,156.00	
	NORDEA BANK ABP	254,073	60.80	15,447,638.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	82.50	11,443,575.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	84.02	11,459,151.72	
	SWEDBANK AB-A	80,216	123.85	9,934,751.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	197.00	2,520,024.00	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	443.90	17,950,428.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	260.00	4,707,040.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	361.00	2,628,080.00		
ERICSSON (LM) B	268,755	77.48	20,823,137.40		
HEXAGON AB-B SHS	21,504	438.20	9,423,052.80		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	486.40	3,012,761.60		
TELE2 AB-B SHS	38,012	139.00	5,283,668.00		
TELIA CO AB	235,437	41.70	9,817,722.90		
	スウェーデンクローナ 小計	2,095,171		275,400,671.87 (3,010,129,343)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	226.40	2,334,410.40	
	EQUINOR ASA	80,907	151.00	12,216,957.00	
	NORSK HYDRO	106,150	27.66	2,936,109.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	374.80	5,048,556.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	255.20	1,778,999.20	
	MOWI ASA	40,968	220.80	9,045,734.40	

	ORKLA	69,804	83.00	5,793,732.00	
	DNB ASA	80,217	142.65	11,442,955.05	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	174.85	3,247,663.90	
	TELENOR ASA	60,821	185.65	11,291,418.65	
	ノルウェークローネ 小計	488,193		65,136,535.60 (764,051,562)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	553.00	5,020,687.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	271.50	4,802,020.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	15,201	528.60	8,035,248.60	
	ISS A/S	14,253	167.00	2,380,251.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	6,820.00	2,039,180.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,210.00	3,662,680.00	
	DSV A/S	18,714	666.60	12,474,752.40	
	PANDORA A/S	8,431	317.60	2,677,685.60	
	CARLSBERG AS-B	9,692	985.00	9,546,620.00	
	COLOPLAST-B	10,223	810.40	8,284,719.20	
	DEMANT A/S	7,420	204.40	1,516,648.00	
	GENMAB A/S	5,595	1,372.50	7,679,137.50	
	H LUNDBECK A/S	4,871	245.00	1,193,395.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,997	353.60	53,392,539.20	
	DANSKE BANK A/S	59,378	87.72	5,208,638.16	
TRYG A/S	9,828	199.50	1,960,686.00		
ORSTED A/S	15,908	661.80	10,527,914.40		
	デンマーククローネ 小計	358,084		140,402,802.56 (2,207,132,056)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	24.66	508,711.14	
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.43	763,761.83	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.41	1,227,058.95	
	SANTOS	156,437	7.00	1,095,059.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.15	258,181.95	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	30.96	2,587,946.40	
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	12.25	423,801.00	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.16	368,189.28	
	BHP GROUP LTD	251,513	34.95	8,790,379.35	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.85	633,864.80	
	BORAL LIMITED	81,732	4.07	332,649.24	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	7.55	1,016,803.80	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.14	472,880.86	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.44	838,425.72	
	NEWCREST MINING LIMITED	66,006	35.51	2,343,873.06	
	ORICA LTD	29,211	21.04	614,599.44	
RIO TINTO LTD	32,522	83.76	2,724,042.72		

SOUTH32 LTD	408,172	2.45	1,000,021.40
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	31.21	287,756.20
BRAMBLES LTD	129,297	11.10	1,435,196.70
SEEK LTD	26,358	20.07	529,005.06
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.84	931,404.08
TRANSURBAN GROUP	229,164	14.90	3,414,543.60
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.36	1,548,798.72
CROWN RESORTS LTD	30,328	12.10	366,968.80
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	47.88	156,232.44
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.63	772,496.98
REA GROUP LTD	3,593	104.77	376,438.61
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.76	214,975.88
WESFARMERS LTD	97,071	39.10	3,795,476.10
COLES GROUP LTD	93,277	13.56	1,264,836.12
WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	35.97	3,875,803.47
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.77	496,820.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.89	1,044,328.75
COCHLEAR LIMITED	4,811	211.08	1,015,505.88
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	67.70	829,189.60
SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	28.59	1,114,695.51
CSL LIMITED	38,683	234.05	9,053,756.15
AUST AND NZ BANKING GROUP	242,083	26.38	6,386,149.54
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.05	322,180.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.98	465,925.32
COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,067	77.15	11,654,819.05
NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	27.30	6,490,875.30
WESTPAC BANKING	294,403	27.62	8,131,410.86
AMP LTD	244,230	1.66	405,421.80
ASX LTD	15,814	85.23	1,347,827.22
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	6.60	290,848.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	123.51	3,312,167.67
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	50.91	555,529.92
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.98	1,670,652.90
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.56	763,662.72
QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.28	1,388,782.04
SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.50	1,389,433.50
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	15.23	675,846.48
TELSTRA CORP	342,339	3.74	1,280,347.86
TPG TELECOM LTD	31,475	6.54	205,846.50
AGL ENERGY LTD	51,344	18.69	959,619.36
AUSNET SERVICES	120,230	1.76	212,205.95
	5,931,661		106,434,031.48

オーストラリアドル 小計				(7,597,261,167)
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	4.44	340,299.36
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.20	781,540.00
	A2 MILK CO LTD	66,854	14.42	964,034.68
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.15	689,446.20
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.60	457,594.20
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.39	639,248.35
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.80	530,611.20
ニュージーランドドル 小計		566,266		4,402,773.99 (296,086,550)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	69.30	16,215,922.80
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	13.12	2,138,560.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	54.60	6,497,400.00
	MTR CORP	133,000	46.65	6,204,450.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	20.70	1,417,950.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	48.75	9,116,250.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	11.52	774,144.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	35.50	7,199,400.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.10	793,800.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.50	990,000.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	15.98	2,249,984.00
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	36.85	2,358,400.00
	WH GROUP LTD	829,500	6.42	5,325,390.00
	BANK EAST ASIA	109,160	20.05	2,188,658.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	26.45	8,199,500.00
	HANG SENG BANK	68,000	166.90	11,349,200.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	241.40	24,671,080.00
	AIA GROUP LTD	1,031,200	75.35	77,700,920.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	54.30	11,728,582.80
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.46	3,020,580.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.85	4,614,651.80
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	32.60	1,923,400.00
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	27.10	1,747,950.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	9.86	4,846,190.00
	SINO LAND CO	315,400	11.36	3,582,944.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	112.50	15,356,250.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	78.45	3,177,225.00
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	26.75	2,573,350.00	
WHARF HOLDINGS	91,000	17.20	1,565,200.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	42.90	4,075,500.00	
WHEELLOCK & CO LTD	65,000	46.10	2,996,500.00	
PCCW LTD	357,000	4.27	1,524,390.00	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	54.25	2,712,500.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	79.85	11,258,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.44	13,857,461.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	53.50	5,938,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	89.90	2,130,630.00	
	香港ドル 小計	7,608,384		284,021,664.16 (3,828,612,032)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.79	650,217.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.07	221,490.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.94	429,460.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.90	180,909.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.41	401,265.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	8.82	382,197.06	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.73	242,176.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.88	374,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	1.99	252,929.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.24	299,376.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.26	108,940.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.72	664,392.00	
	DBS GROUP	156,300	24.17	3,777,771.00	
	OCBC BANK	264,200	10.58	2,795,236.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,300	24.46	2,526,718.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.18	509,614.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.38	755,430.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.13	284,856.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.18	341,050.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.55	373,935.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.20	2,135,817.60		
	シンガポールドル 小計	3,530,276		17,707,779.16 (1,347,916,149)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	15.97	1,082,063.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	536.00	1,150,256.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	25.80	2,536,398.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.99	3,514,968.45	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	14.81	1,473,595.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	80.21	1,002,865.63	
	AZRIELI GROUP	4,323	256.10	1,107,120.30	
	NICE LTD	4,894	533.00	2,608,502.00	
	イスラエルシェケル 小計	430,087		14,475,768.70 (434,562,576)	
	合 計	93,589,146		319,523,141,908 (319,523,141,908)	

(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	102,205	1,125,277.05	
		LENDLEASE GROUP	44,009	730,549.40	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	745,838.00	
	オーストラリアドル 小計		236,074	2,601,664.45 (185,706,808)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,664,775.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,687,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,352,275.00 (85,628,667)	
	投資信託受益証券合計			831,574	271,335,475 (271,335,475)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	697,600.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,435,199.36	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,711	8,665,610.69	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,055,253.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,441,402.64	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,715,601.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	943,040.28	
		CROWN CASTLE INTL CORP	35,498	5,185,192.86	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,146,624.92	
		DUKE REALTY CORP	29,929	984,664.10	
		EQUINIX INC	7,183	4,004,666.16	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	982,673.65	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,620,135.72	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,814,518.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,327,589.73	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	765,502.13	
		HCP INC	41,014	1,418,674.26	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,065,739.66	
		INVITATION HOMES INC	38,000	1,104,280.00	
		IRON MOUNTAIN INC	24,669	769,919.49	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	644,761.47	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	606,113.94	
		MACERICH CO/THE	10,128	281,153.28	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,281,160.55	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	787,101.00			
PROLOGIS INC	53,238	4,366,048.38			
PUBLIC STORAGE	13,426	3,520,699.98			

	REALTY INCOME CORP	27,116	1,982,993.08	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	896,646.93	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	2,480,491.44	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,938	3,773,200.86	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	625,353.84	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,094,880.90	
	UDR INC	24,799	1,180,680.39	
	VENTAS INC	30,413	2,214,066.40	
	VEREIT INC	77,798	739,081.00	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	911,703.60	
	WELLTOWER INC	34,628	3,080,506.88	
	WP CAREY INC	14,644	1,294,090.28	
アメリカドル 小計		1,014,528	72,904,624.03 (7,708,205,898)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	211,792.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	409,865.40	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	178,164.84	
カナダドル 小計		30,576	799,822.24 (63,593,866)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	337,584.30	
	GECINA SA	4,459	633,178.00	
	ICADE	2,845	226,462.00	
	KLEPIERRE	17,225	477,821.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,468,762.40	
ユーロ 小計		39,995	3,143,808.20 (368,454,321)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	410,729.20	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	459,383.30	
	SEGRO PLC	94,451	733,506.46	
イギリスポンド 小計		232,415	1,603,618.96 (208,261,994)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,210,938.30	
	GOODMAN GROUP	140,271	2,074,608.09	
	GPT GROUP	167,884	1,050,953.84	
	MIRVAC GROUP	306,089	970,302.13	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,917,452.22	
	STOCKLAND	207,412	927,131.64	
	VICINITY CENTERS	291,115	727,787.50	
オーストラリアドル 小計		1,693,524	8,879,173.72 (633,795,420)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	16,074,225.00	
香港ドル 小計		179,500	16,074,225.00	

			(216,680,553)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	600,400.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	505,440.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	520,780.00	
	SUNTEC REIT	173,000	323,510.00	
シンガポールドル 小計		813,800	1,950,130.00	(148,443,895)
投資証券合計		4,004,338	9,347,435,947	(9,347,435,947)
合計			9,618,771,422	(9,618,771,422)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 611銘柄	96.6%			66.7%
	投資証券 39銘柄			3.4%	2.3%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			11.3%
	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%			5.8%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			0.9%
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%			0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	90.3%			2.3%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			7.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 37銘柄	92.7%			1.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.2%	0.1%

シンガポールドル	株式	21銘柄	90.1%			0.4%
	投資証券	4銘柄			9.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,632,436,475
コール・ローン	17,649,362
株式	49,165,947,914
投資信託受益証券	164,242,848
投資証券	146,331,593
派生商品評価勘定	1,189,991
未収入金	93,459,113
未収配当金	87,902,367
前払金	118,149,575
差入委託証拠金	543,053,009
流動資産合計	52,970,362,247
資産合計	52,970,362,247
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,367,530
未払金	819,437,887
未払解約金	3,795,702
未払利息	27
流動負債合計	942,601,146
負債合計	942,601,146
純資産の部	
元本等	
元本	20,683,262,362
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,344,498,739
元本等合計	52,027,761,101
純資産合計	52,027,761,101
負債純資産合計	52,970,362,247

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

	2019年 8月28日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,683,262,362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 2.5155円 (1万口当たり純資産額) (25,155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 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>

	2019年 8月28日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月28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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	19,306,518,934円
期中追加設定元本額	1,912,238,648円
期中一部解約元本額	535,495,220円
期末元本額	20,683,262,362円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,219,760,799円
世界経済インデックスファンド	3,325,406,534円
D C 新興国株式インデックス・オープン	4,137,193,330円
D C 世界経済インデックスファンド	2,889,348,682円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	219,979,030円
分散投資コア戦略ファンドA	227,660,349円
分散投資コア戦略ファンドS	487,566,863円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	407,550,956円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	447,270,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	363,020,666円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,066,355円
S M T インデックスバランス・オープン	119,118,139円
S M T 世界経済インデックス・オープン	49,524,669円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	206,645,909円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	30,358,839円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,307,507円
グローバル経済コア	494,267,258円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	15,782,333円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	26,252円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	29,706円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	33,160円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	36,269円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	22,308,468円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	396,676,346	
投資信託受益証券	252,189	
投資証券	4,481,310	
合計	392,447,225	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,907,093,400	-	2,788,943,825	118,149,575
	合計	2,907,093,400	-	2,788,943,825	118,149,575

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	295,418,464	-	295,390,500	27,964
	アメリカドル	290,730,000	-	290,702,500	27,500
	ユーロ	4,688,464	-	4,688,000	464
	合計	295,418,464	-	295,390,500	27,964

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	493,504	6.67	3,294,632.70	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.88	92,040.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	36,794	76.00	2,796,344.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	188.50	1,624,304.50	
	ROSNEFT OJSC-GDR	103,060	6.05	623,513.00	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	3.82	613,698.05	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	24,530	63.58	1,559,617.40	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	7,076	7.96	56,324.96	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	8.92	138,358.12	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	14.96	253,272.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	23.23	1,544,725.31	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	21.38	331,582.42	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	12.30	229,026.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	56.65	403,574.60	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	14.17	359,209.50	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	29.82	161,087.64	
	51JOB INC-ADR	1,655	65.68	108,700.40	
	DP WORLD PLC	21,152	13.62	288,090.24	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	20.38	610,421.76	
	NIO INC - ADR	53,878	2.91	156,784.98	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	32.51	355,464.34	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,433	108.42	1,456,405.86	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	33,143	35.09	1,162,987.87	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	43.18	1,438,153.08	
	58.COM INC-ADR	9,450	51.55	487,147.50	
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	83.77	443,813.46	
	BAIDU INC - SPON ADR	24,875	103.84	2,583,020.00	
	IQIYI INC-ADR	11,977	17.26	206,723.02	
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	33.19	431,370.43	
	NETEASE INC-ADR	6,498	256.54	1,666,996.92	
	SINA CORP	5,725	40.50	231,862.50	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	12.57	114,047.61		
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	40.35	211,797.15		
YY INC-ADR	4,344	54.62	237,269.28		

	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	129,785	166.20	21,570,267.00
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	42.16	147,897.28
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	31.39	1,195,048.69
	JD.COM INC-ADR	68,369	29.92	2,045,600.48
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	30.87	547,201.62
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	7.90	286,288.10
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,845	12.57	500,851.65
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	21.31	77,632.33
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	27.05	109,146.75
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	4,996	4.44	22,182.24
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	147,287	4.50	662,791.50
	CREDICORP LTD	6,431	201.20	1,293,917.20
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	8,771	12.87	112,882.77
	SBERBANK-SPONSORED ADR	233,869	13.18	3,082,393.42
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.13	233,302.82
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	29.66	59,942.86
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	1.13	61,617.02
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	40.51	178,446.55
	GLOBANT SA	3,122	93.70	292,531.40
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	7.84	312,455.36
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	6,359	9.48	60,283.32
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	5,650	14.45	81,642.50
	アメリカドル 小計	2,466,199		59,206,690.26 (6,259,923,361)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,455,661	6.41	9,330,787.01
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	295,492	44.07	13,022,332.44
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	217.63	3,155,635.00
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	33.81	3,274,566.12
	ALFA S.A.B. -A	242,900	16.03	3,893,687.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	53.80	2,017,500.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	280.39	6,534,488.95
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	178.63	5,551,820.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	161.91	2,749,231.80
	ALSEA SAB DE CV	34,300	39.99	1,371,657.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	209,790	31.67	6,644,049.30
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	76.94	2,415,916.00
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	96.95	1,056,755.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	55.47	25,992,132.60
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	102.46	3,450,340.50
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	177.68	31,829,595.20
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	180.01	4,673,059.60
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	33.27	4,404,948.00

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	40.01	7,273,818.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	25.64	4,351,108.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	247,600	103.94	25,735,544.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	23.50	5,933,750.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	13.75	41,770,300.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	76.75	2,893,475.00	
	メキシコペソ 小計	7,267,555		219,326,496.92 (1,160,237,168)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	47.19	868,296.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,100	26.91	7,483,671.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	371,740	24.34	9,048,151.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	15.58	1,177,848.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	26.12	386,576.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	13.36	841,680.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	11.77	1,023,990.00	
	SUZANO SA	50,679	28.52	1,445,365.08	
	VALE SA	285,178	43.32	12,353,910.96	
	EMBRAER SA	69,700	17.55	1,223,235.00	
	WEG SA	66,872	21.68	1,449,784.96	
	CCR SA	101,100	15.86	1,603,446.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	44.70	2,637,389.40	
	RUMO SA	97,700	21.72	2,122,044.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	9.76	1,348,675.84	
	B2W CIA DIGITAL	23,600	41.33	975,388.00	
	B2W CIA DIGITAL-RIGHTS	3,306	2.50	8,265.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	16.95	1,079,986.20	
	LOJAS RENNER S.A.	66,407	47.44	3,150,348.08	
	MAGAZINE LUIZA SA	56,800	34.21	1,943,128.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	59,600	27.99	1,668,204.00	
	ATACADA0 DISTRIBUICAO COMERC	41,500	21.69	900,135.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	85.89	1,271,172.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	89.30	1,884,230.00	
	AMBEV SA	438,500	18.17	7,967,545.00	
	BRF SA	52,500	38.01	1,995,525.00	
	JBS SA	90,300	27.85	2,514,855.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	33.31	209,853.00	
	NATURA COSMETICOS SA	20,700	63.04	1,304,928.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	33,600	50.28	1,689,408.00	
	HYPERA SA	35,300	30.77	1,086,181.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	28.38	3,302,353.56	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	365,953	32.04	11,725,134.12	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	44.38	3,599,218.00	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	442,781	33.53	14,846,446.93	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	410,067	12.02	4,929,005.34	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	43.00	8,191,629.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	32.10	1,807,230.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	19,100	100.20	1,913,820.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	54.27	396,171.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	13.65	778,909.95	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	25.83	1,172,682.00	
	CIELO SA	99,269	7.22	716,722.18	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	51.65	2,499,860.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	11.89	866,781.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	44.05	779,685.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	42.69	1,028,829.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	14.46	954,244.32	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	50.80	1,325,880.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	42.97	719,747.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13,000	92.39	1,201,070.00	
	ブラジルリアル 小計	4,981,224		137,418,634.02 (3,516,542,844)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,000.00	268,380,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,507.00	204,899,255.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	16,640.00	164,020,480.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,754	5,580.00	132,547,320.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	3,978.00	281,789,586.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,055.10	145,591,138.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	7,950.00	74,117,850.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,145.00	32,629,740.00	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	101.86	237,871,620.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	43,045.00	223,575,730.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	50.00	313,991,050.00	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.33	89,423,743.88	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,690.00	105,560,880.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	376.32	107,715,202.56	
	COLBUN SA	475,888	122.37	58,234,414.56	
	ENEL AMERICAS SA	2,867,591	115.50	331,206,760.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	58.73	150,423,856.94	
	チリペソ 小計	32,026,659		2,921,978,629.04 (427,777,671)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,655.00	1,298,239,245.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	7,700.00	246,484,700.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	17,380.00	308,025,740.00	
	BANCOLOMBIA SA	20,302	38,800.00	787,717,600.00	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	42,340.00	1,620,690,520.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,230.00	373,560,840.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	32,600.00	678,732,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	30,400.00	381,854,400.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,500.00	883,942,500.00
	コロンビアペソ 小計	984,893		6,579,247,545.00 (200,667,050)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	21.74	195,660.00
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	18.20	79,315.60
	OPAP SA	17,668	9.20	162,545.60
	JUMBO SA	8,599	15.77	135,606.23
	ALPHA BANK AE	129,138	1.48	191,640.79
	EUROBANK ERGASIAS SA	182,882	0.71	130,211.98
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,130	2.31	123,155.34
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	11.95	242,501.35
	ユーロ 小計	425,068		1,260,636.89 (147,746,643)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	11.51	307,317.00
	イギリスポンド 小計	26,700		307,317.00 (39,911,258)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	130.40	1,513,031.20
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	6.43	750,734.65
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	18.10	430,979.10
	KOC HOLDING AS	62,460	17.42	1,088,053.20
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.26	183,895.68
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	23.06	226,818.16
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	11.54	717,684.14
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	59.15	192,710.70
	ARCELIK AS	15,358	16.43	252,331.94
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	46.74	2,001,593.76
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	23.58	264,803.40
	AKBANK T.A.S.	276,321	6.84	1,890,035.64
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.88	2,131,128.96
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.46	944,645.52
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.64	988,225.92
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	12.10	1,150,661.60
	トルコリラ 小計	1,301,293		14,727,333.57 (267,153,830)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	817.00	6,097,271.00
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	75.95	5,221,410.60
	CEZ AS	13,737	509.00	6,992,133.00
		89,948		18,310,814.60

	チェココルナ 小計			(83,131,098)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	2,876.00	94,539,872.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	4,790.00	72,702,620.00
	OTP BANK NYRT	19,549	12,000.00	234,588,000.00
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		401,830,492.00 (142,931,106)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	83.80	926,576.60
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	88.62	2,340,808.68
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	4.54	665,389.37
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	28.52	118,956.92
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	75.08	985,950.56
	CCC SA	3,138	126.70	397,584.60
	LPP SA	124	7,220.00	895,280.00
	CD PROJEKT SA	6,704	245.20	1,643,820.80
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.20	662,756.40
	DINO POLSKA SA	4,430	145.00	642,350.00
	ALIOR BANK SA	8,830	39.98	353,023.40
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	7.36	243,005.12
	BANK PEKAO SA	15,510	96.10	1,490,511.00
	M BANK SA	1,663	329.40	547,792.20
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	39.17	2,996,700.85
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	303.00	1,095,345.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	37.38	1,904,548.38
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.93	330,330.23
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.60	482,569.60
	ポーランドズロチ 小計	548,414		18,723,299.71 (501,222,733)
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.07	300,860.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	9.09	1,745,280.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,377,400	4.51	10,722,074.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	15.14	5,208,160.00
	CNOOC LTD-R	1,626,000	10.94	17,788,440.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	3.73	7,370,480.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.43	913,060.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.26	768,400.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	75,400	2.70	203,580.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	44.15	4,856,500.00
	BBMG CORPORATION - H	131,000	2.18	285,580.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.22	529,830.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	2.09	702,240.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.75	2,227,500.00

CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	144,000	2.90	417,600.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	7.20	1,512,000.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.18	253,128.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	8.69	721,270.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.09	678,940.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	2.93	855,560.00
MMG LIMITED	168,000	1.57	263,760.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	5.76	743,040.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	2.26	449,740.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	10.18	921,290.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.88	2,099,520.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.09	507,160.00
BOC AVIATION LTD	32,500	66.10	2,148,250.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	395,000	6.00	2,370,000.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	136,000	4.80	652,800.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	26.00	4,147,000.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	8.41	1,610,515.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	5.05	1,515,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.84	1,162,800.00
CITIC LTD	502,000	8.99	4,512,980.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	5.28	2,698,344.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.57	2,756,160.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	14.76	516,600.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.73	247,390.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.44	409,920.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	14.90	566,200.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	4.94	353,210.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	11.96	508,300.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	143,800	11.32	1,627,816.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	9.29	291,854.64
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	29.85	1,859,655.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	6.20	2,387,458.80
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	22.50	3,060,000.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	7.17	1,290,600.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	6.88	811,840.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.76	730,080.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	3.72	245,520.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	11.94	1,164,711.18
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.57	804,320.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.55	391,300.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	2.77	405,805.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	6.57	685,540.08

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.40	707,200.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	15.16	1,939,297.52
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.52	277,200.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.72	591,360.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.22	493,740.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	7.73	1,932,500.00
BYD CO LTD-H	68,500	37.85	2,592,725.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	2.38	595,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.23	1,923,180.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	22.40	609,280.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	471,000	12.10	5,699,100.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	4.94	1,742,585.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.73	1,950,619.12
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	6.26	575,920.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	64.55	7,165,050.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	2.67	517,980.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	18.60	2,157,600.00
LI NING CO LTD	194,000	22.80	4,423,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	105.00	7,350,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	11.08	299,160.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	15,000	34.55	518,250.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.29	1,870,500.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	24.05	774,410.00
TENCENT HOLDINGS LTD	520,700	326.20	169,852,340.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.71	421,710.18
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.13	216,936.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	81,600	75.00	6,120,000.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	24.05	1,010,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	7.95	1,550,250.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.08	214,240.00
CHINA HUI SHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	33.10	8,506,700.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	43.70	6,205,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.26	633,830.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	11.28	1,669,440.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	51.75	1,449,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.89	711,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.96	3,337,600.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	46.50	1,581,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	49.35	3,281,775.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	7.43	2,124,980.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	7.54	1,839,760.00

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.76	1,895,184.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	28.25	2,813,700.00
3SBIO INC	119,000	12.80	1,523,200.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	10.02	1,002,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	16.30	7,367,600.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	8.50	1,338,750.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.80	630,800.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	17.00	1,394,000.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.20	505,300.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	24.20	1,343,100.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.36	436,560.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	11.00	6,369,000.00
SSY GROUP LTD	114,000	7.43	847,020.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	8.90	329,300.00
WUXI APPTec CO LTD-H	27,600	88.75	2,449,500.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	80.40	3,577,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	2.97	7,181,460.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	2.95	21,854,190.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.18	4,907,920.50
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.99	3,795,288.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,580,620	5.78	49,595,983.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.19	711,370.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	354,423	35.65	12,635,179.95
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.07	2,795,598.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.76	567,760.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,109,515	4.87	29,753,338.05
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	4.56	3,328,800.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.52	1,264,640.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.08	1,846,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	9.11	564,820.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.73	1,225,305.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.12	1,038,240.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	14.06	1,855,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	14.14	2,813,860.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	6.72	947,520.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	7.92	701,712.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	11.08	655,936.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	7.48	2,070,464.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	11.58	1,838,904.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	710,000	18.28	12,978,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	31.65	8,570,820.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.31	313,090.00

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	18.40	2,609,561.60
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	34.10	2,284,700.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.03	2,096,760.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.64	5,298,808.32
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	495,000	90.20	44,649,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	18.70	200,090.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.08	1,431,360.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	69,000	10.38	716,220.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	17.38	3,232,680.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.79	2,768,620.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	24.60	9,373,584.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	31.75	7,718,774.25
CHINA VANKE CO LTD-H	174,000	27.60	4,802,400.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.41	1,217,160.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	770,285	10.10	7,779,878.50
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	6.39	817,920.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	12.76	877,888.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.75	429,000.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	6.30	560,700.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	11.48	1,079,120.00
LONGFOR PROPERTIES	178,500	28.10	5,015,850.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.93	984,480.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	21.00	2,782,500.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.66	347,770.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	225,091	2.82	634,756.62
SOHO CHINA LTD	113,000	2.39	270,070.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	33.20	7,005,200.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.75	1,011,500.00
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.49	363,260.14
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	7.00	1,694,000.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	13.96	921,360.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.38	1,215,020.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	34.10	2,438,150.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	10.00	850,000.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	4.91	1,158,760.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	18.00	1,206,000.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	5.92	408,480.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	17.18	362,498.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	5.24	3,028,720.00
MEITU INC	143,000	1.98	283,140.00
SUNNY OPTICAL TECH	61,100	102.80	6,281,080.00
XIAOMI CORP-CLASS B	650,400	8.79	5,717,016.00

ZTE CORP-H	82,908	19.70	1,633,287.60		
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	557,500	65.40	36,460,500.00		
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	3.52	4,773,120.00		
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,672,000	1.79	6,572,880.00		
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	7.79	3,957,320.00		
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	36.45	1,421,550.00		
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	3.96	1,615,680.00		
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.08	2,791,360.00		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	30.75	5,295,150.00		
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	4.14	1,047,420.00		
CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.69	278,850.00		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	36.20	3,113,200.00		
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.18	1,785,572.00		
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.66	229,080.00		
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	85.20	6,398,520.00		
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	16.12	3,578,640.00		
HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.14	577,760.00		
HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.29	1,587,300.00		
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.08	636,480.00		
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	6.60	1,702,800.00		
TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.23	240,580.00		
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	13.24	595,800.00		
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	8.77	2,324,050.00		
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	221,725	4.69	1,039,890.25		
香港ドル 小計	82,884,896		805,625,837.94 (10,859,836,295)		
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.47	1,435,427.96	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.62	542,662.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	6.88	1,445,488.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.78	689,754.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.63	505,296.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.50	362,900.00	
	IJM CORP BHD	198,100	2.30	455,630.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.11	352,889.06	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	1.78	115,344.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.50	455,549.00	
	MISC BHD	125,040	6.96	870,278.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.02	281,400.00	
	GENTING BHD	205,300	5.92	1,215,376.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.07	687,987.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	20.06	218,654.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	35.78	304,130.00	

	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.20	142,800.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.25	763,470.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	23.52	1,288,896.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	148.60	1,025,340.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.74	987,223.20	
	QL RESOURCES BHD	83,200	6.92	575,744.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.81	1,188,291.26	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	158,600	5.04	799,344.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.73	1,313,889.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.68	460,512.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	2.92	206,152.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.98	518,196.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.05	2,179,428.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	16.48	1,010,092.16	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	16.24	242,511.92	
	MALAYAN BANKING BHD	359,804	8.55	3,076,324.20	
	PUBLIC BANK BERHAD	256,420	20.70	5,307,894.00	
	RHB BANK BHD	206,419	5.72	1,180,716.68	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	0.79	132,124.34	
	SP SETIA BHD	185,105	1.62	299,870.10	
	AXIATA GROUP BERHAD	281,687	5.02	1,414,068.74	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	5.00	1,558,500.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.47	1,465,413.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.95	278,680.40	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.36	1,159,680.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	13.60	4,004,860.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.98	247,317.70	
	マレーシアリングット 小計	6,660,482		42,766,104.62 (1,075,567,531)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	11.20	4,085,760.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	3.58	2,969,610.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	114.50	14,278,150.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	40.75	39,168,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	61.00	7,326,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	30.50	6,295,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	51.25	11,527,867.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	73,400	402.00	29,506,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	71.00	30,395,100.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	11.10	9,068,700.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	471,100	13.40	6,312,740.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	37.75	12,204,952.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,235	17.30	8,152,365.50	

	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	63.50	2,209,800.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102,700	55.25	5,674,175.00	
	CP ALL PCL-NVDR	566,800	84.75	48,036,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	29.75	10,135,825.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	16.70	4,008,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	819,600	23.50	19,260,600.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	135.50	4,444,400.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	32,700	169.00	5,526,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	154.00	19,465,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	40,800	154.00	6,283,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	16.60	4,104,350.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	147,500	122.00	17,995,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	1.48	1,978,020.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	52.25	4,692,050.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	172,500	64.00	11,040,000.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	537,100	11.10	5,961,810.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	229.00	24,251,100.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	150,800	63.50	9,575,800.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	62.00	4,092,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	6.15	5,912,665.35	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	331.00	7,679,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	47.25	8,764,875.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	142.00	7,440,800.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	72.75	3,950,325.00	
	タイパーツ 小計	11,883,238		423,774,440.85 (1,462,021,820)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	50.00	11,897,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	12.26	7,240,756.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	937.50	20,971,875.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	8.88	3,067,596.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	853.50	5,853,303.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	66.45	15,307,422.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	988.00	22,531,340.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	131.10	8,290,764.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	230.00	14,032,300.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	168.50	10,679,530.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	87.10	5,212,499.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	145.50	25,276,405.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	142,732	70.65	10,084,015.80	
	SECURITY BANK CORP	30,810	186.20	5,736,822.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.87	11,472,259.00	
	AYALA LAND INC	637,000	47.25	30,098,250.00	

	MEGAWORLD CORP	638,000	4.81	3,068,780.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	24.45	2,273,850.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	34.65	30,753,607.50	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,880.00	3,365,200.00	
	PLDT INC	6,225	1,117.00	6,953,325.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	35.20	3,150,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	367.40	10,695,014.00	
	フィリピンベソ 小計	6,788,996		268,012,314.30 (541,384,874)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,130.00	1,626,409,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	2,420.00	1,082,466,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	20,700.00	2,668,230,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,370,000	875.00	1,198,750,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	6,750.00	1,648,350,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	21,150.00	4,018,500,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	9,475.00	821,482,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	12,900.00	3,026,340,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,525.00	682,337,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	6,525.00	11,230,830,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,210.00	644,930,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	550,200	4,780.00	2,629,956,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	74,525.00	2,295,370,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	2,850.00	2,616,015,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	11,750.00	1,891,750,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,750.00	3,325,525,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	47,275.00	5,606,815,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,625.00	4,478,337,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	915,000	30,025.00	27,472,875,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,025.00	12,772,124,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,575.00	6,137,265,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	2,100.00	1,405,110,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	4,200.00	20,521,620,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,425.00	973,845,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	640.00	1,030,656,000.00		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	4,380.00	19,898,778,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	2,000.00	1,583,000,000.00		
	インドネシアルピア 小計	28,209,096		143,287,666,900.00 (1,060,328,735)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	45,250.00	191,271,750.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	89,900.00	305,749,900.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	156,000.00	871,416,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	16,950.00	181,466,700.00	

HYUNDAI STEEL CO	7,242	35,850.00	259,625,700.00
KOREA ZINC CO LTD	783	428,000.00	335,124,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	69,500.00	73,044,500.00
LG CHEM LTD	4,436	323,000.00	1,432,828,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	166,500.00	79,753,500.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	219,500.00	307,300,000.00
OCI COMPANY LTD	1,127	66,200.00	74,607,400.00
POSCO	7,270	204,500.00	1,486,715,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,159	50,500.00	58,529,500.00
CJ CORP	1,230	78,300.00	96,309,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,753	94,300.00	165,307,900.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,015.00	33,204,050.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,300.00	152,072,400.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	31,200.00	210,912,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	23,100.00	65,257,500.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	34,950.00	76,924,950.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	40,200.00	256,476,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	327,000.00	264,870,000.00
KCC CORP	870	213,000.00	185,310,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	38,900.00	201,346,400.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3,318	105,500.00	350,049,000.00
LG CORP	8,323	69,700.00	580,113,100.00
LOTTE CORP	2,370	32,800.00	77,736,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	17,750.00	106,287,000.00
SAMSUNG C&T CORP	7,702	90,500.00	697,031,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	15,150.00	280,517,400.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,210.00	267,858,710.00
SK HOLDINGS CO LTD	3,879	192,500.00	746,707,500.00
S-1 CORPORATION	960	98,500.00	94,560,000.00
CJ LOGISTICS	862	139,500.00	120,249,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	158,000.00	229,890,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	21,900.00	120,537,600.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,460.00	132,622,560.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	27,900.00	197,141,400.00
HANON SYSTEMS	19,000	11,150.00	211,850,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,414	240,500.00	1,542,567,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	125,000.00	1,647,000,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	81,200.00	234,830,400.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	72,400.00	217,417,200.00
KIA MOTORS CORPORATION	25,363	41,800.00	1,060,173,400.00
FILA KOREA LTD	4,080	57,500.00	234,600,000.00
HLB INC	2,398	40,800.00	97,838,400.00

LG ELECTRONICS INC	9,197	59,200.00	544,462,400.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,607	79,600.00	287,117,200.00
KANGWON LAND INC	13,208	27,850.00	367,842,800.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	25,700.00	130,299,000.00
KAKAO CORP	4,122	134,000.00	552,348,000.00
NAVER CORP	13,191	146,500.00	1,932,481,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	531,000.00	876,150,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	92,900.00	228,998,500.00
PEARL ABYSS CORP	338	179,900.00	60,806,200.00
CJ ENM CO LTD	830	151,400.00	125,662,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	75,500.00	230,350,500.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	68,700.00	83,951,400.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	132,000.00	136,488,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	224,500.00	118,985,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	200,000.00	109,800,000.00
EMART	1,661	115,000.00	191,015,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	37,200.00	48,769,200.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	223,000.00	172,825,000.00
KT&G CORP	10,696	101,000.00	1,080,296,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	87,000.00	173,391,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	551,000.00	37,468,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	122,000.00	350,506,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	67,500.00	47,925,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,151,000.00	1,065,826,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	701,000.00	94,635,000.00
PACIFIC CORP	2,115	52,400.00	110,826,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,731	38,600.00	144,016,600.00
CELLTRION INC	7,739	145,000.00	1,122,155,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	30,150.00	33,526,800.00
HANMI PHARM CO LTD	481	271,500.00	130,591,500.00
HANMI SCIENCE CO LTD	628	40,100.00	25,182,800.00
HELIXMITH CO LTD	1,641	169,300.00	277,821,300.00
MEDY-TOX INC	326	355,900.00	116,023,400.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	276,000.00	431,388,000.00
SILLAJEN INC	5,667	12,850.00	72,820,950.00
YUHAN CORPORATION	630	213,500.00	134,505,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	6,370.00	147,885,920.00
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	31,550.00	834,213,550.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,800.00	334,294,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	38,650.00	1,474,845,350.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	42,483	39,650.00	1,684,450,950.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	45,214	11,250.00	508,657,500.00

	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	69,800.00	321,219,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,855.00	232,573,920.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,060.00	219,509,520.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	11,850.00	133,881,300.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	31,500.00	59,818,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	34,000.00	196,384,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	47,250.00	198,875,250.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	2,345.00	70,108,465.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	23,050.00	99,529,900.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	25,050.00	99,573,750.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	225,500.00	700,854,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	66,400.00	492,488,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	193,000.00	602,353,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	12,600.00	303,294,600.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	97,800.00	138,387,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	87,200.00	488,581,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	436,138	44,050.00	19,211,878,900.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	73,732	36,400.00	2,683,844,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,221	244,500.00	1,276,534,500.00	
	LG UPLUS CORP	14,194	12,500.00	177,425,000.00	
	SK TELECOM	1,647	237,000.00	390,339,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	25,150.00	615,345,050.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	38,550.00	55,203,600.00	
	SK HYNIX INC	50,048	73,000.00	3,653,504,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,405,878		65,666,110,195.00 (5,726,084,809)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	95.50	10,432,420.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	41.75	9,776,848.00	
	CHINA STEEL	1,120,261	22.85	25,597,963.85	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	85.50	26,852,215.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	90.60	35,227,454.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	67.00	31,339,384.00	
	TAIWAN CEMENT	469,479	37.65	17,675,884.35	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	317.00	3,804,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	27.75	9,657,777.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	248.50	5,277,394.50	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.18	1,195,263.54	
	EVA AIRWAYS CORP	159,403	13.80	2,199,761.40	
	EVERGREEN MARINE	132,968	12.65	1,682,045.20	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	36.95	6,540,150.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	43.00	7,613,623.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	382.00	4,559,934.00	

FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	199.00	7,205,193.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.20	1,368,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	223.00	5,678,472.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	267.00	4,272,000.00
POU CHEN	273,780	37.90	10,376,262.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	70.80	1,565,246.40
TATUNG CO LTD	210,000	17.20	3,612,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	420.50	10,933,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	283.50	12,911,724.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	60.70	2,170,389.20
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	75.00	33,479,625.00
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	144.00	1,872,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	420,468	20.15	8,472,430.20
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	8.96	11,260,748.80
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,628,237	20.05	32,646,151.85
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	978,573	24.90	24,366,467.70
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	21.25	21,336,997.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	579,945	19.75	11,453,913.75
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	28.00	25,265,492.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	11.95	13,824,823.55
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	964,768	13.45	12,976,129.60
TAIWAN BUSINESS BANK	209,620	12.05	2,525,921.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	769,621	19.65	15,123,052.65
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	306,000	49.65	15,192,900.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	121.00	15,974,662.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	18.00	13,898,754.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	39.75	29,095,052.25
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	177,791	24.05	4,275,873.55
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	43.50	28,235,067.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,142,638	8.87	10,135,199.06
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	48.40	2,038,608.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	41.80	1,397,792.00
ACER INC	255,803	16.90	4,323,070.70
ADVANTECH CO LTD	28,402	263.00	7,469,726.00
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	201.00	12,681,492.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	7.45	7,040,920.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	213.50	12,318,950.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	88.20	2,539,454.40
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	6.64	5,146,000.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	17.60	7,598,976.00
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	145.50	27,194,386.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	63.20	5,868,120.00

	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,196,248	72.20	86,369,105.60	
	INVENTEC CO LTD	280,511	21.30	5,974,884.30	
	LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	3,770.00	34,080,800.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	48.40	10,911,876.80	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	83.60	5,016,000.00	
	PEGATRON CORP	159,474	50.40	8,037,489.60	
	QUANTA COMPUTER INC	242,270	54.90	13,300,623.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	36.50	4,675,650.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	144.00	3,888,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	24.40	5,921,758.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	38.55	5,539,326.60	
	YAGEO CORPORATION	22,764	203.00	4,621,092.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	118.00	2,586,796.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	347,315	107.50	37,336,362.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	71.50	11,225,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	110.00	16,742,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	69.00	20,238,735.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	278.00	5,004,000.00	
	MEDIATEK INC	138,804	345.50	47,956,782.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	72.40	7,457,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	170.50	9,044,172.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	283.50	3,288,316.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	123,770	73.60	9,109,472.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,944	205.50	6,769,992.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,249,389	250.00	562,347,250.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	13.05	12,749,850.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	63.30	5,633,700.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	259.00	8,288,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	16.90	3,447,600.00	
	新台湾ドル 小計	29,929,356		1,644,115,497.30 (5,540,669,225)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	342.30	22,632,876.00	
	COAL INDIA LTD	110,683	191.85	21,234,533.55	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	259.75	15,435,643.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	125.75	24,365,948.75	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	125.60	31,740,250.40	
	PETRONET LNG LTD	49,423	258.50	12,775,845.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,198	1,274.85	324,064,320.30	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	205.10	7,626,643.50	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,599.45	39,922,272.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	723.95	19,794,240.90	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	181.20	21,989,888.40	

JSW STEEL LTD	80,284	213.40	17,132,605.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,371.85	11,122,959.80
SHREE CEMENT LTD	901	19,066.80	17,179,186.80
TATA STEEL LTD	25,839	350.90	9,066,905.10
ULTRATECH CEMENT LTD	9,271	4,135.70	38,342,074.70
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	556.00	30,137,424.00
VEDANTA LTD	198,772	138.10	27,450,413.20
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	66.65	9,571,139.95
HAVELLS INDIA LTD	23,476	660.45	15,504,724.20
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,356.95	60,500,972.70
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	372.05	23,262,798.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	495.80	13,116,389.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,648.60	13,782,296.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,766.50	23,133,473.00
BHARAT FORGE LTD	13,392	395.30	5,293,857.60
BOSCH LTD	431	14,494.20	6,247,000.20
EICHER MOTORS LTD	1,254	15,995.40	20,058,231.60
HERO MOTOCORP LTD	7,507	2,614.45	19,626,676.15
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	554.05	34,876,339.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	6,277.75	59,632,347.25
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	101.75	7,818,164.75
TATA MOTORS LTD	147,050	120.35	17,697,467.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	18,231.35	10,957,041.35
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,123.70	31,260,210.30
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	363.75	17,935,421.25
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,534.10	16,914,986.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	2,685.90	13,719,577.20
ITC LTD	316,525	245.50	77,706,887.50
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	12,472.35	29,871,278.25
UNITED SPIRITS LTD	32,483	599.55	19,475,182.65
DABUR INDIA LTD	58,111	440.15	25,577,556.65
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	603.60	16,862,169.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,861.40	111,106,966.00
MARICO LTD	42,465	385.90	16,387,243.50
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	588.35	11,964,685.60
CIPLA LTD	31,308	465.35	14,569,177.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,593.55	14,434,375.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,540.70	26,484,256.80
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	374.85	6,011,094.60
LUPIN LTD	16,340	738.85	12,072,809.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	1,950.00	13,066,950.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	416.75	34,569,412.50

	AXIS BANK LTD	162,301	682.95	110,843,467.95	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	147,455	2,174.30	320,611,406.50	
	ICICI BANK LTD	222,300	418.60	93,054,780.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	471.50	12,691,837.00	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	427.60	11,960,399.60	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	285.70	47,834,179.60	
	YES BANK LTD	152,956	64.50	9,865,662.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	16,731	3,357.75	56,178,515.25	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	337.10	9,414,865.90	
	REC LTD	48,168	145.10	6,989,176.80	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,019.60	12,374,885.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	7,126.50	22,569,625.50	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	38,897	555.20	21,595,614.40	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,128	1,214.70	11,087,781.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,093.10	50,106,610.90	
	INFOSYS LTD	308,929	784.65	242,401,139.85	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	80,692	2,236.50	180,467,658.00	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	676.35	32,501,999.25	
	WIPRO LTD	118,712	250.10	29,689,871.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	175,272	348.30	61,047,237.60	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	245.05	8,773,770.20	
	IDEA CELLULAR LTD	467,944	5.30	2,480,103.20	
	GAIL INDIA LTD	174,768	130.20	22,754,793.60	
	NTPC LTD	260,019	123.20	32,034,340.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,781	206.55	34,448,615.55	
	TATA POWER CO LTD	93,250	55.35	5,161,387.50	
	インドルピー 小計	6,077,002		2,992,022,917.85 (4,458,114,147)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	113.97	8,319,810.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	113.53	7,549,745.00	
	MCB BANK LTD	53,300	166.62	8,880,846.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		24,750,401.00 (16,830,272)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	25,990	21.60	561,384.00	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDI	302,960	2.71	821,021.60	
	INDUSTRIES QATAR	159,480	10.61	1,692,082.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.56	930,194.40	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.56	1,447,282.40	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	15.50	1,770,565.00	
	QATAR NATIONAL BANK	412,820	18.56	7,661,939.20	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	3.06	580,298.40	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.40	705,466.00	

	OOREDOO QSC	72,800	6.80	495,040.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,820	15.28	577,889.60
	カタールリアル 小計	2,133,760		17,243,163.40 (499,017,148)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	128.80	2,529,374.40
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,219	845.60	4,413,186.40
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,437	348.08	13,379,150.96
	GOLD FIELDS LTD	64,581	92.14	5,950,493.34
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	374.00	2,009,128.00
	SAPPI LIMITED	49,985	42.70	2,134,359.50
	SASOL LTD	51,446	268.37	13,806,563.02
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	173.05	4,793,831.10
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	128.75	5,218,108.75
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	159.53	3,397,829.47
	NASPERS LTD-N SHS	40,026	3,411.40	136,544,696.40
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	146.10	3,511,075.20
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	51.60	2,444,137.20
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	51.19	4,283,783.96
	BID CORP LTD	33,071	302.25	9,995,709.75
	CLICKS GROUP LTD	20,499	190.30	3,900,959.70
	PICK N PAY STORES LTD	62,266	55.62	3,463,234.92
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	110.43	4,946,380.56
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	167.24	2,443,878.12
	TIGER BRANDS LTD	13,023	205.05	2,670,366.15
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	21.48	3,362,543.64
	NETCARE LTD	99,170	15.34	1,521,267.80
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	72.52	2,700,934.88
	ABSA GROUP LTD	61,049	147.77	9,021,210.73
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,080.00	3,479,760.00
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	216.75	8,244,519.75
	STANDARD BANK GROUP LTD	109,999	168.68	18,554,631.32
	FIRSTRAND LTD	312,664	57.90	18,103,245.60
	INVESTEC LTD	28,883	77.75	2,245,653.25
	PSG GROUP LTD	18,494	196.84	3,640,358.96
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	250.00	2,911,750.00
	REMGRO LTD	46,153	167.60	7,735,242.80
RMB HOLDINGS LTD	74,398	69.02	5,134,949.96	
DISCOVERY LIMITED	34,996	105.74	3,700,477.04	
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	105.50	656,843.00	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	15.71	1,069,505.38	
OLD MUTUAL LTD	407,000	17.60	7,163,200.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	27.83	1,124,554.64	

	SANLAM LTD	172,493	71.20	12,281,501.60	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	132.00	4,080,648.00	
	MTN GROUP LTD	156,559	100.49	15,732,613.91	
	TELKOM SA LTD	11,353	77.82	883,490.46	
	VODACOM GROUP	58,903	110.24	6,493,466.72	
	南アフリカランド 小計	2,692,014		371,678,616.34 (2,560,865,666)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	8.35	2,250,241.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.10	655,798.80	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	223,903	15.38	3,443,628.14	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	2.22	1,414,721.64	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	4.17	127,372.65	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.94	348,507.42	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	4.95	1,488,078.90	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	16.52	2,779,836.92	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,938,324		12,508,185.97 (360,611,001)	
香港・オフショア 人民元	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	8.91	341,253.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	39.80	1,171,712.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.95	230,265.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.51	220,158.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.63	271,167.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	14,980	39.20	587,216.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.05	331,580.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	9.87	335,580.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	23.10	263,340.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	15.60	265,200.00	
	CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	28,920	10.08	291,513.60	
	CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	101,300	5.92	599,696.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	126,000	5.48	690,480.00	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	21,900	17.40	381,060.00	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	62,300	4.80	299,040.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	13.83	579,477.00	
	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.62	217,412.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	13.08	263,051.88	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	20.90	217,360.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	8.06	208,754.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.15	206,000.00	
	COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	193,400	2.60	502,840.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	7.65	468,945.00	
	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.11	196,863.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	87.50	465,412.50		

SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.87	260,628.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	42.27	350,841.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.90	854,170.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	13,300	24.84	330,372.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	24.96	1,063,296.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	9,900	55.35	547,965.00
HLA CORP LTD-A	21,400	8.46	181,044.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	52.05	1,072,230.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	15.67	407,420.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	95.57	1,414,436.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	14.58	247,860.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	48,100	5.18	249,158.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	21,060	9.58	201,754.80
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	14.33	243,610.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.80	494,640.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.81	397,305.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	7,300	107.79	786,867.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	10,800	22.55	243,540.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	17,602	28.65	504,297.30
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4,700	106.55	500,785.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	3,400	1,109.00	3,770,600.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	89.25	392,700.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	8,200	78.32	642,224.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	18.01	482,668.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	11,700	132.38	1,548,846.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	34.01	468,657.80
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	32.05	311,526.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,800	13.86	302,148.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	12.48	310,003.20
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	30.39	309,978.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	7,493	32.31	242,098.83
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	14,160	75.80	1,073,328.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	22.86	160,020.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	28.48	319,887.36
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	17.59	343,005.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	102.82	400,998.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.41	1,205,776.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.22	302,760.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.67	385,526.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	7.77	392,385.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	23.11	554,640.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.95	407,225.00

	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.95	868,055.00	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	38,900	34.75	1,351,775.00	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	5.82	1,118,604.00	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	34,200	7.25	247,950.00	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	54,100	18.27	988,407.00	
	PING AN BANK CO LTD-A	52,000	14.31	744,120.00	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67,700	11.30	765,010.00	
	ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.68	149,292.00	
	CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	7.03	1,297,035.00	
	CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,200	16.37	461,634.00	
	EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.07	1,126,926.00	
	HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.66	289,044.00	
	ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	10.29	326,193.00	
	SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110,500	4.97	549,185.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	39,900	87.68	3,498,432.00	
	CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	27.38	383,320.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	25,000	20.42	510,500.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	43,900	14.37	630,843.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	25.79	330,112.00	
	IFLYTEK CO LTD - A	10,800	33.90	366,120.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.85	441,210.00	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	24,800	31.33	776,984.00	
	LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	87,632	25.23	2,210,955.36	
	CHINA UNITED NETWORK-A	349,700	6.04	2,112,188.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	87,800	5.56	488,168.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	19.18	1,319,584.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	4.07	1,214,081.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.66	849,000.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	26.72	435,536.00	
	香港・オフショア人民元 小計	4,915,089		60,134,858.63 (886,989,164)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	19.96	470,237.64	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	8,913	57.40	511,606.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	14.24	454,654.72	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	18.84	608,211.72	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	14,573	81.20	1,183,327.60	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	36,841	47.15	1,737,053.15	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	64,930	101.20	6,570,916.00	
	SAUDI CEMENT	7,489	65.30	489,031.70	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	22.80	480,145.20	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	10.96	724,609.44	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,804	56.00	1,109,024.00	

SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	89.60	397,107.20	
JARIR MARKETING CO	5,046	163.40	824,516.40	
ALMARAI CO	22,935	51.70	1,185,739.50	
SAVOLA	25,336	31.40	795,550.40	
AL RAJHI BANK	106,695	63.90	6,817,810.50	
ALINMA BANK	62,612	22.68	1,420,040.16	
BANK AL-JAZIRA	35,813	14.20	508,544.60	
BANK ALBILAD	32,374	26.90	870,860.60	
BANQUE SAUDI FRANSI	48,323	37.70	1,821,777.10	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	106,300	49.60	5,272,480.00	
RIYAD BANK	106,583	26.00	2,771,158.00	
SAMBA FINANCIAL GROUP	86,380	30.35	2,621,633.00	
SAUDI BRITISH BANK	32,217	33.00	1,063,161.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	104.00	167,336.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	65.40	432,490.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	11.90	560,394.80	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	10.32	476,649.84	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	26.00	894,764.00	
SAUDI TELECOM CO	35,361	103.80	3,670,471.80	
SAUDI ELECTRICITY CO	74,768	21.60	1,614,988.80	
サウジアラビアリアル 小計	1,248,583		48,526,291.27 (1,370,382,465)	
合 計	237,145,066		49,165,947,914 (49,165,947,914)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	5,092,946.00	
		メキシコペソ 小計	43,300	5,092,946.00 (26,941,684)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,385,062.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,620,339.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	771,045.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	789,032.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	799,944.60	
	ブラジルリアル 小計	153,462	5,365,422.60 (137,301,164)		
投資信託受益証券合計			196,762	164,242,848 (164,242,848)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,095,500.00	

	メキシコペソ 小計	308,400	8,095,500.00 (42,825,195)	
南アフリカ ランド	FORTRESS REIT LTD-A	189,245	3,977,929.90	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	6,759,526.77	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	4,285,242.70	
	南アフリカランド 小計	1,032,277	15,022,699.37 (103,506,398)	
	投資証券合計	1,340,677	146,331,593 (146,331,593)	
	合計		310,574,441 (310,574,441)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 56銘柄	100.0%			12.7%
メキシコペソ	株式 24銘柄	94.3%			2.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.1%
ブラジルレアル	株式 51銘柄	96.2%			7.1%
	投資信託受 益証券 5銘柄		3.8%		0.3%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.9%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 19銘柄	100.0%			1.0%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%			21.9%
マレーシアリングギット	株式 43銘柄	100.0%			2.2%
タイバーツ	株式 37銘柄	100.0%			3.0%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%			1.1%

インドネシアルピア	株式	27銘柄	100.0%			2.1%
韓国ウォン	株式	112銘柄	100.0%			11.6%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			11.2%
インドルピー	株式	79銘柄	100.0%			9.0%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式	43銘柄	96.1%			5.2%
	投資証券	3銘柄			3.9%	0.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	8銘柄	100.0%			0.7%
香港・オフショア人 民元	株式	96銘柄	100.0%			1.8%
サウジアラビアリアル	株式	31銘柄	100.0%			2.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,446,171,103
国債証券	416,522,674,550
地方債証券	26,543,703,337
特殊債券	33,843,614,219
社債券	19,597,844,320
未収入金	559,044,000
未収利息	1,134,845,283
前払費用	54,224,929
流動資産合計	499,702,121,741
資産合計	499,702,121,741
負債の部	
流動負債	
未払金	1,761,860,588
未払解約金	131,896,078
未払利息	2,269
その他未払費用	12
流動負債合計	1,893,758,947

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
負債合計	1,893,758,947
純資産の部	
元本等	
元本	343,350,525,726
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,457,837,068
元本等合計	497,808,362,794
純資産合計	497,808,362,794
負債純資産合計	499,702,121,741

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	343,350,525,726口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 103,923,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4499円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,499円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年 8月28日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	318,117,667,141円
期中追加設定元本額	30,912,530,851円
期中一部解約元本額	5,679,672,266円
期末元本額	343,350,525,726円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,898,071,972円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,076,485円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,350,877,613円
世界経済インデックスファンド	1,863,590,339円
D C マイセレクション 2 5	20,245,722,581円
D C マイセレクション 5 0	22,072,478,038円
D C マイセレクション 7 5	5,957,510,299円
D C 日本債券インデックス・オープン	459,709,461円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,130,280,795円
D C 日本債券インデックス・オープン P	39,841,989,928円
D C マイセレクション S 2 5	8,206,681,602円
D C マイセレクション S 5 0	8,964,737,889円
D C マイセレクション S 7 5	1,705,019,336円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,085,660,144円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,288,187,122円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	430,761,644円
D C 世界経済インデックスファンド	1,636,345,323円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	87,990,968円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,809,222円

区分	2019年 8月28日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	42,594,728円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,389,556円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	866,233円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	172,365,570円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	290,722,702円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	61,675,646円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	141,257,916円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,281,283,443円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	944,447,497円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,562,731,506円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	820,473,761円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	105,827,157円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,237,395,246円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	27,145,332円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,440,286,214円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,792,934,308円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	165,211,899円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,234,605,870円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,080,499,241円
分散投資コア戦略ファンドA	7,646,731,677円
分散投資コア戦略ファンドS	4,622,958,558円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	65,184,338円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	797,354,587円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	51,300,493円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,195,959円
SMT インデックスバランス・オープン	64,842,771円
SMT 世界経済インデックス・オープン	10,755,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	11,167,961円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	23,291,558円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,440,161円
グローバル経済コア	227,066,829円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,947,652円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	606,918円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	79,119,187,491円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	8,319,659,750	
地方債証券	61,638,838	
特殊債券	125,679,580	
社債券	148,127,110	
合計	8,655,105,278	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第392回利付国債(2年)	530,000,000	532,008,700	
	第393回利付国債(2年)	840,000,000	843,486,000	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,044,659,200	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,682,400	
	第396回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,020,291,200	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,367,398,400	
	第398回利付国債(2年)	5,040,000,000	5,069,282,400	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,119,282,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	634,176,900	
	第401回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,718,819,000	
	第402回利付国債(2年)	1,870,000,000	1,883,819,300	
	第403回利付国債(2年)	50,000,000	50,391,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,624,367,800	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,974,770,400	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,809,110,200	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,621,559,800	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,368,022,600	

第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,372,960,800	
第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,599,222,600	
第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,857,120,000	
第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,802,236,200	
第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,215,584,600	
第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,769,914,400	
第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	6,002,424,000	
第137回利付国債(5年)	3,430,000,000	3,492,837,600	
第138回利付国債(5年)	9,070,000,000	9,246,502,200	
第139回利付国債(5年)	5,970,000,000	6,092,922,300	
第140回利付国債(5年)	3,960,000,000	4,046,130,000	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	650,904,000	
第2回利付国債(40年)	470,000,000	745,847,700	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	883,289,000	
第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,625,000,000	
第5回利付国債(40年)	890,000,000	1,405,434,600	
第6回利付国債(40年)	720,000,000	1,126,137,600	
第7回利付国債(40年)	720,000,000	1,088,424,000	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	1,137,552,000	
第9回利付国債(40年)	1,090,000,000	1,174,257,000	
第10回利付国債(40年)	1,920,000,000	2,419,065,600	
第11回利付国債(40年)	1,730,000,000	2,124,370,800	
第12回利付国債(40年)	520,000,000	581,443,200	
第310回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,429,105,500	
第311回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,092,344,400	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,884,104,500	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,383,547,500	
第314回利付国債(10年)	470,000,000	480,208,400	
第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,225,031,200	
第316回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,199,554,200	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	915,827,800	
第318回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,012,822,000	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,765,865,700	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,708,699,500	
第321回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,553,362,500	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	773,377,500	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,003,241,900	
第324回利付国債(10年)	2,630,000,000	2,712,687,200	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,021,061,200	
第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,716,921,400	
第327回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,328,166,400	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,863,210,500	

第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,348,955,000	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,507,579,200	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,433,406,000	
第332回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,383,607,500	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,431,355,000	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,918,898,000	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,779,461,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	533,740,500	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,500,733,600	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,556,281,000	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,066,567,100	
第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	4,524,768,000	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,577,284,200	
第342回利付国債(10年)	4,060,000,000	4,186,793,800	
第343回利付国債(10年)	2,830,000,000	2,922,880,600	
第344回利付国債(10年)	2,420,000,000	2,503,344,800	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,052,210,600	
第346回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,966,792,400	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,356,714,000	
第348回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,140,422,400	
第349回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,523,566,000	
第350回利付国債(10年)	5,350,000,000	5,559,880,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,979,370,000	
第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,042,410,200	
第353回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,570,720,000	
第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,091,020,200	
第355回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,961,442,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	144,250,700	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	205,075,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	153,210,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	149,078,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	64,251,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	250,659,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	237,047,400	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	62,993,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	289,536,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	186,899,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	112,840,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	249,608,700	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	378,133,900	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	409,572,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	471,100,600	

第16回利付国債(30年)	370,000,000	514,340,700
第17回利付国債(30年)	570,000,000	786,657,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	472,108,350
第19回利付国債(30年)	380,000,000	521,873,000
第20回利付国債(30年)	480,000,000	677,068,800
第21回利付国債(30年)	500,000,000	690,940,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	567,912,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	612,745,700
第24回利付国債(30年)	380,000,000	543,460,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	489,765,500
第26回利付国債(30年)	430,000,000	611,176,200
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,462,055,800
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,389,709,600
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	2,024,974,000
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,564,967,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,566,598,000
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,947,515,800
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,338,918,500
第34回利付国債(30年)	1,545,000,000	2,241,455,100
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,393,394,900
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,392,017,600
第37回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,507,842,000
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,713,193,200
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,335,016,200
第40回利付国債(30年)	810,000,000	1,133,522,100
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,283,139,600
第42回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,577,167,200
第43回利付国債(30年)	960,000,000	1,330,214,400
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,500,616,800
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,476,497,000
第46回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,749,163,000
第47回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,074,619,200
第48回利付国債(30年)	1,590,000,000	2,106,956,700
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,936,617,000
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,254,018,600
第51回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,291,261,600
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,684,544,400
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,255,508,800
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,562,896,300
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,223,716,000
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,484,519,400
第57回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,602,229,600
第58回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,710,420,000

第59回利付国債(30年)	170,000,000	196,089,900	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,973,163,900	
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,500,733,000	
第62回利付国債(30年)	670,000,000	735,325,000	
第63回利付国債(30年)	470,000,000	502,091,600	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	92,374,200	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	134,759,300	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	145,248,600	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	227,557,000	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	104,168,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,480,200	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,474,400	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	211,652,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,341,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	159,814,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	255,024,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	320,580,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,548,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	370,198,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,529,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	334,073,600	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	216,470,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	349,436,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	241,500,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	360,805,500	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,442,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	212,283,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	433,937,400	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	453,572,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	224,830,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	709,329,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,766,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,508,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	148,046,600	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	304,422,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,613,500	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,676,300	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	307,616,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,955,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	446,745,000	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	691,014,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	335,947,600	

第84回利付国債(20年)	470,000,000	541,435,300
第85回利付国債(20年)	290,000,000	337,673,100
第86回利付国債(20年)	210,000,000	247,340,100
第87回利付国債(20年)	550,000,000	644,105,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	497,796,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	412,387,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	746,562,600
第91回利付国債(20年)	450,000,000	536,517,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,042,509,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	484,968,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	726,272,100
第95回利付国債(20年)	610,000,000	739,765,300
第96回利付国債(20年)	320,000,000	382,934,400
第97回利付国債(20年)	400,000,000	484,400,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	529,192,400
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,389,349,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	586,406,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	886,078,050
第102回利付国債(20年)	410,000,000	510,380,300
第103回利付国債(20年)	400,000,000	494,312,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	438,364,800
第105回利付国債(20年)	680,000,000	831,606,000
第106回利付国債(20年)	380,000,000	468,258,800
第107回利付国債(20年)	260,000,000	319,300,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	797,907,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	630,687,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,170,846,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,209,551,200
第112回利付国債(20年)	790,000,000	977,151,000
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,800,711,500
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,171,898,000
第115回利付国債(20年)	700,000,000	880,089,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,337,942,600
第117回利付国債(20年)	780,000,000	976,092,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	822,214,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	648,529,200
第120回利付国債(20年)	790,000,000	949,185,000
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,858,380,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	540,139,600
第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,620,659,200
第124回利付国債(20年)	610,000,000	765,281,600
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,051,559,800
第126回利付国債(20年)	730,000,000	918,894,800

第127回利付国債(20年)	990,000,000	1,234,470,600	
第128回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,576,184,400	
第129回利付国債(20年)	550,000,000	681,384,000	
第130回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,385,454,400	
第131回利付国債(20年)	870,000,000	1,070,308,800	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,036,182,000	
第133回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,482,870,900	
第134回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,312,857,000	
第135回利付国債(20年)	590,000,000	730,142,700	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	698,096,100	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,389,673,600	
第138回利付国債(20年)	420,000,000	510,165,600	
第139回利付国債(20年)	550,000,000	675,251,500	
第140回利付国債(20年)	1,670,000,000	2,077,396,500	
第141回利付国債(20年)	1,610,000,000	2,007,670,000	
第142回利付国債(20年)	520,000,000	655,480,800	
第143回利付国債(20年)	720,000,000	890,654,400	
第144回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,798,162,800	
第145回利付国債(20年)	2,455,000,000	3,078,029,900	
第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,639,049,000	
第147回利付国債(20年)	1,690,000,000	2,105,554,100	
第148回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,442,528,000	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,141,395,800	
第150回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,777,889,800	
第151回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,715,700,350	
第152回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,405,789,100	
第153回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,904,112,900	
第154回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,376,851,400	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,526,703,200	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,100,218,400	
第157回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,188,281,000	
第158回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,404,656,800	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,286,956,700	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	2,189,635,500	
第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,933,540,000	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,265,988,000	
第163回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,933,400,000	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,934,379,400	
第165回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,129,304,800	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	1,011,402,000	
第167回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,289,392,200	
第168回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,609,222,100	

	第169回利付国債(20年)	280,000,000	292,866,000
	国債証券合計	371,390,000,000	416,522,674,550
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,272,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,191,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	141,099,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	139,938,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	136,454,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	137,001,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,070,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,479,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	241,928,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	240,722,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	101,861,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	102,140,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,088,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	204,788,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	102,534,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,224,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,297,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,781,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,334,000
	第764回東京都公募公債	150,000,000	152,131,500
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,433,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,246,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,336,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,695,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,265,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,265,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	304,368,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	144,332,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,534,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,820,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,790,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,230,000
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,640,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,246,000
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	241,388,000
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,657,000
	第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,279,000
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,577,000
	第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,086,000
	第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,301,000

第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,715,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,676,850	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,143,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,048,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,620,880	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,570,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,003,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,242,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,480,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,227,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,211,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,261,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,799,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,125,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,656,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,828,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,216,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,501,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	130,620,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	114,331,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,426,037	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,203,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,398,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,324,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,480,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,567,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,885,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,293,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,106,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,259,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,270,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,082,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,438,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,674,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,576,000	
	200,000,000	203,160,000	

平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）			
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	113,551,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	120,771,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,618,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,951,835	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,394,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	118,701,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	116,880,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	241,338,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	205,476,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,782,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,686,300	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,781,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,875,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,974,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,966,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,427,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,713,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,326,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,794,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,644,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,409,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	122,363,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,306,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,636,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	141,079,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,080,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,935,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	112,947,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	121,322,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	120,361,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,484,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,332,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,357,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,148,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,425,000	

平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,785,600	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,508,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,743,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,910,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	364,088,320	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,044,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,190,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,587,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,778,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,424,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,427,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,372,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,554,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,253,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,807,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,777,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,660,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,985,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,983,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,817,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,648,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,592,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,342,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,495,564	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,096,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,525,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,398,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,014,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,388,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,270,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,207,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,183,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,683,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,576,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,256,601	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,588,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,146,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	205,026,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,248,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,645,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	242,804,000	

平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,260,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	136,705,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	143,362,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,830,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,831,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,447,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,550,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,463,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,506,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,910,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,552,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	140,557,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	241,184,000	
平成21年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	122,189,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,645,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,262,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,435,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,145,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,462,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,508,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,532,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,971,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,634,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,284,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	119,440,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	101,020,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,400,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,052,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,794,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,529,750	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,494,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,570,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,275,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,117,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,479,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,428,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,113,000	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	173,026,000	

	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,736,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	203,580,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,532,000	
	地方債証券合計	24,934,220,000	26,543,703,337	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,399,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,549,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,584,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,948,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,030,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,619,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,925,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,148,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,756,000	
	第14回道路債券	100,000,000	106,292,000	
	第17回道路債券	100,000,000	105,067,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	464,376,000	
	第21回道路債券	100,000,000	136,752,000	
	第28回道路債券	200,000,000	278,058,000	
	第33回道路債券	200,000,000	281,610,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,817,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	166,596,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,627,000	
	第42回道路債券	100,000,000	112,002,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,469,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,371,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,166,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	161,493,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,356,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,794,000		
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,508,000		
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,658,000		

第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	140,417,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,957,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,336,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,592,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,778,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,281,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,258,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,210,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,392,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,843,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,638,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	307,950,090	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,850,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,248,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,685,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,563,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,854,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,648,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,034,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,108,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,106,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,340,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,392,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,168,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	153,157,800	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,578,000	
	100,000,000	103,192,000	

第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,452,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,433,320	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,364,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,224,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,028,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,730,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,955,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,987,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,700,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,702,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,238,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,611,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	107,379,850	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	319,020,960	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	207,441,550	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,446,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,269,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,606,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	530,649,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,338,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,397,700	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,768,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	311,679,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,997,400	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,496,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	415,755,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,966,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	139,784,000	

第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,077,600	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,082,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,692,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,620,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,929,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,960,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,096,760	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,228,060	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,348,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,003,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,293,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,100,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,571,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,010,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,158,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,437,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,512,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,362,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,338,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,893,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,317,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,942,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,674,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,426,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,531,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,179,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,948,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,186,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,554,160	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,621,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,597,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,242,900	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,564,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,046,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,906,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,263,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,588,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,246,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,795,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	111,750,000	

第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,034,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	124,027,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,536,760	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,623,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,295,300	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,620,320	
第43回都市再生債券	100,000,000	101,353,000	
第127回都市再生債券	400,000,000	400,424,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,519,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	105,673,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,825,400	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,354,000	14,973,088	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,680,000	15,397,118	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,042,000	15,921,957	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	253,734,000	255,517,750	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	177,722,000	178,843,425	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,936,000	15,724,322	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,011,000	16,907,936	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,993,000	13,368,107	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,838,000	28,010,283	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,602,000	16,408,467	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,827,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,161,000	14,829,965	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,475,000	17,492,166	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,084,000	14,773,411	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,287,000	17,246,141	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,490,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,087,000	15,397,339	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,387,000	15,701,048	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,644,000	23,415,344	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,113,000	23,988,403	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,519,000	26,808,584	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,513,000	29,774,293	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,509,000	32,063,003	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,626,000	33,201,340	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,750,000	70,157,920	

第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,519,000	15,112,101
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,385,000	34,612,764
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,487,000	15,087,196
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,368,000	15,117,291
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,391,000	37,985,514
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,336,000	13,951,989
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,948,000	37,533,802
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,810,000	35,192,990
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,265,000	16,225,473
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,764,000	70,157,692
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,747,000	38,169,574
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,948,000	15,707,806
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,878,000	50,042,733
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,726,000	47,714,591
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,624,000	47,651,738
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,096,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,432,000	101,749,598
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,733,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,762,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,279,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,238,000	108,101,349
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,863,000	54,709,760
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,798,000	55,116,179
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,802,000	56,266,867
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,329,000	49,139,317
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,404,000	48,809,119
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,253,000	55,661,985
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	184,591,500
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,956,000	50,484,240
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,912,000	56,630,782
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,206,000	58,046,900
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,247,000	58,999,165
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,331,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,950,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,612,000	124,530,738
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,531,000	63,325,110
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,044,000	130,992,487
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,928,000
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,117,000	74,263,927
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,710,000	77,845,578
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,965,000	77,432,479
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,860,000	159,647,380
	74,670,000	78,281,787

第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,279,000	83,273,868	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,311,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,179,000	90,218,580	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,405,000	90,263,273	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,191,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,498,000	90,757,353	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,994,000	91,492,061	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,529,000	92,112,806	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,910,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,506,000	93,830,252	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,029,000	94,491,696	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	94,350,313	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	94,687,521	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,945,000	95,592,073	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,982,000	191,916,454	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,201,000	95,558,053	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,900,000	193,856,430	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,977,000	96,690,115	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,178,000	193,710,704	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,858,298	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,306,000	196,838,652	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,530,000	197,187,300	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	139,410,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,836,000	99,701,377	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,387,000	100,511,174	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,771,000	99,923,917	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,762,000	200,199,432	

第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,733,000	100,425,283	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,098,000	100,992,753	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,004,000	202,410,948	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,842,000	100,794,492	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,444,000	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,194,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,812,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,676,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,118,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,439,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,658,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,747,000	
い第795号商工債	200,000,000	200,040,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,078,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,970,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,938,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,142,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,302,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,310,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,636,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,340,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,264,000	
第218号商工債（3年）	300,000,000	300,474,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	200,328,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,754,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	123,087,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,052,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,436,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,703,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,146,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,899,000	
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,232,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,741,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,012,000	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,986,000	
特殊債券合計	31,673,915,000	33,843,614,219	

社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,123,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	101,094,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,560,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,906,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,969,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,707,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,035,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,260,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,202,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,585,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,243,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,677,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	105,359,000	
	第11回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	300,885,000	
	第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	201,460,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,291,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,749,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,550,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,572,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,616,000	
	第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,496,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,741,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,914,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,594,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,643,000	
	第7回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,325,000	
	第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,315,000	
	第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,262,000	
		100,000,000	100,159,000	

第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債			
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,862,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,687,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,142,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,820,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,594,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,569,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,806,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,199,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,295,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,065,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,363,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,404,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,822,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,798,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,383,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,826,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,490,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,582,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,809,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,184,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,478,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,697,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,382,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,328,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,360,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,145,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,203,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	200,984,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,452,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,334,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,752,000	

第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第2回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,758,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	122,353,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,449,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,049,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,195,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,386,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	125,793,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,460,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,665,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	115,978,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,513,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	102,517,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,949,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	308,478,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,431,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,269,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,376,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,671,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	201,172,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,383,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,427,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,716,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,185,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,207,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	203,428,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	102,320,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,416,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,556,000	

第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,876,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,938,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,372,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,534,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,261,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,052,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,412,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	108,705,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,194,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,519,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,961,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,402,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,825,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,621,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,780,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,813,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,604,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,621,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,101,810	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,725,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,207,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,500,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,173,200	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	140,243,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	137,516,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	124,782,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,034,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,804,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,678,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,728,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,194,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,192,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,798,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,341,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,738,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,213,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,810,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,961,000	

第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,676,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,730,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	204,034,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,383,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,383,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,227,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,556,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,614,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,182,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,857,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,048,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,682,600	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,731,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,243,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,352,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,562,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,216,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,236,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,957,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,404,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,182,710	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,582,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,765,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,077,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,820,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,902,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,950,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,227,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,252,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,436,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	203,720,000	
社債券合計	18,966,000,000	19,597,844,320	
合計		496,507,836,426	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年 8月28日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	671,243,361
コール・ローン	3,829,534,274
国債証券	378,086,762,179
派生商品評価勘定	29,047,451
未収入金	537,873
未収利息	2,208,940,431
前払費用	270,066,627
差入委託証拠金	297,924,343
流動資産合計	385,394,056,539
資産合計	385,394,056,539
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,638,549
前受金	19,083,136
未払解約金	51,076,870
未払利息	6,009
その他未払費用	9
流動負債合計	84,804,573
負債合計	84,804,573
純資産の部	
元本等	
元本	138,356,719,879
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	246,952,532,087
元本等合計	385,309,251,966
純資産合計	385,309,251,966
負債純資産合計	385,394,056,539

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

2019年 8月28日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,356,719,879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 2.7849円 (1万口当たり純資産額) (27,849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 8月28日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	103,384,444,638円
期中追加設定元本額	38,696,612,513円
期中一部解約元本額	3,724,337,272円
期末元本額	138,356,719,879円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,766,941,433円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	715,909,037円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,019,973,396円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,866,810円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,157,863,753円
世界経済インデックスファンド	6,665,674,005円
D C マイセレクション 2 5	1,691,216,486円
D C マイセレクション 5 0	1,281,799,537円
D C マイセレクション 7 5	817,096,699円

区分	2019年 8月28日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	1,886,282,574円
D C マイセレクション S 2 5	676,142,399円
D C マイセレクション S 5 0	519,942,498円
D C マイセレクション S 7 5	233,324,309円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	47,554,178円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	65,461,662円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	31,009,382円
D C 世界経済インデックスファンド	5,780,880,309円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	621,793,619円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	41,988,424円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,776,276円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	49,501,498円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	99,170,676円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	174,527,660円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	158,276,498円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	414,340,126円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,137,079,885円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	607,027,029円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,157,939,969円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	877,265,148円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	86,401,545円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	614,248,246円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	35,527,524円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	236,200,270円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	295,637,098円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	971,537,122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）	2,059,292,629円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	838,905,195円
外国債券ファンド・シリーズ 1	471,091,136円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,378,191,685円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,652,743,627円
分散投資コア戦略ファンド A	1,516,843,116円
分散投資コア戦略ファンド S	3,655,248,169円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,469,099円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,664,212,467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）	234,323,157円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,633,350円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,073,467,374円
S M T インデックスバランス・オープン	233,973,477円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	24,450,532,929円
S M T 世界経済インデックス・オープン	69,058,663円

区分	2019年 8月28日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	93,691,353円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	128,777,190円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,322,949円
グローバル経済コア	983,679,741円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,870,524円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	74,904円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	205,163,075円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	20,311,164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)	840,387,805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)	11,569,638,857円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,157,322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)	40,425,016,818円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		18,162,045,599
合計		18,162,045,599

(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 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,344,992,114	-	3,364,075,250	19,083,136
	合計	3,344,992,114	-	3,364,075,250	19,083,136

(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 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,219,098,634	-	4,214,424,400	4,674,234
	アメリカドル	2,133,770,750	-	2,136,490,300	2,719,550
	カナダドル	170,288,780	-	170,001,600	287,180
	ユーロ	1,643,827,441	-	1,632,735,300	11,092,141
	イギリスポンド	271,211,663	-	275,197,200	3,985,537
合計		4,219,098,634	-	4,214,424,400	4,674,234

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	6,453,027.36	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,722,671.92	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,960,156.25	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,777,468.76	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,480,449.21	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,521,384.77	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,944,921.90	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,959,394.49	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,466,601.61	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,674,132.85	

T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,993,359.40	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,497,070.32	
T 1.375% 09/30/20	15,970,000.00	15,909,800.60	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,990,000.00	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,977,031.28	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,504,394.52	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,822,851.58	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,012,343.76	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,976,367.20	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,258,781.31	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,196,503.88	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,526,386.71	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,371,436.76	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,038,867.20	
T 1.625% 07/31/20	24,000,000.00	23,966,718.72	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,514,160.15	
T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,083,203.20	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,493,261.70	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,078,398.46	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,226,886.77	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,047,736.32	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,633,462.90	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,517,871.10	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,623,863.32	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,289,687.47	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,830,578.14	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,713,964.80	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,627,966.77	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,062,617.17	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,434,989.02	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,247,535.20	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,204,492.17	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,136,419.95	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,208,808.60	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,113,906.28	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,525,000.00	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,558,437.50	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,565,113.33	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,111,445.29	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,051,718.76	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,853,154.33	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,446,195.32	

T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,026,953.10	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,020,625.00	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,385,441.42	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,636,164.04	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,467,343.72	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,579,541.02	
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,140,851.57	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,964,812.51	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,169,458.99	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,524,628.89	
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,428,347.68	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,283,125.04	
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	13,054,456.25	
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,775,331.98	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,441,985.95	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,144,218.76	
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,398,793.71	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,465,324.26	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,080,440.43	
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,204,687.50	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,537,802.73	
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,575,976.60	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,040,546.89	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,065,003.94	
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	20,403,000.00	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,566,027.32	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,580,582.08	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,615,531.27	
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,553,035.22	
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,905,644.56	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,765,859.39	
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,475,195.35	
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,642,402.31	
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,472,578.19	
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	20,028,808.68	
T 2.375% 05/15/29	13,040,000.00	14,092,368.80	
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,082,519.50	
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,103,339.83	
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,356,250.00	
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,593,343.75	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,285,742.20	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,993,781.25	
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	8,126,382.84	

T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	18,394,921.87	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,203,615.24	
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	3,045,566.39	
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	17,846,250.08	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,741,775.40	
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,110,351.60	
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	19,316,250.00	
T 2.625% 02/15/29	15,000,000.00	16,517,578.20	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,457,367.18	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,721,816.44	
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,765,356.62	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,480,453.15	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,416,345.71	
T 2.625% 07/31/20	12,700,000.00	12,797,978.46	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,545,869.12	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,123,320.34	
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	12,086,679.74	
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,908,140.62	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,174,609.39	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,467,625.00	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,960,109.35	
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,970,312.60	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,282,167.99	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,303,750.00	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,256,308.58	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,478,359.39	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	11,661,710.93	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,426,933.61	
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,222,056.59	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,277,613.26	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,869,046.89	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	10,617,488.32	
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,794,921.90	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,902,128.12	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	13,622,109.37	
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,588,210.96	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,240,080.49	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,794,331.32	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,988,882.86	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,025,351.56	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,598,837.86	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,174,687.50	

T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,648,828.18
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,598,869.16
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,533,496.10
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,236,718.72
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,662,500.00
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,023,593.76
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,270,312.50
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,828,722.64
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,224,375.04
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,794,902.37
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,210,460.94
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,049,218.75
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,707,437.50
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,864,015.60
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,014,453.15
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,708,927.74
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,427,187.51
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,616,823.48
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,521,806.62
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,036,250.00
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,225,867.18
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,889,765.62
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	6,158,203.15
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,438,193.36
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,915,023.46
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	14,858,437.56
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	16,441,875.07
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,992,167.98
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	8,506,243.75
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,949,515.62
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	5,061,103.12
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,420,425.80
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	10,013,671.87
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,663,281.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,684,218.76
T 3.75% 11/15/43	12,500,000.00	16,979,492.25
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,286,214.85
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,471,066.42
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	18,494,967.18
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,558,207.04
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,259,335.95
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	9,504,648.43
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	14,721,839.90

T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,376,367.15	
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,928,515.60	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	7,344,605.49	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,273,851.56	
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	6,211,664.06	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,423,750.00	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,749,359.37	
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,855,750.00	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,892,218.75	
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,421,600.00	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,315,875.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,484,921.87	
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,952,125.00	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,487,226.56	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,662,976.56	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,667,773.43	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,724,125.00	
T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,643,718.75	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,606,968.75	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,179,851.57	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,975,511.72	
T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,795,671.87	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,957,957.03	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,938,597.65	
アメリカドル 小計	1,611,470,000.00	1,720,778,168.98 (181,937,875,806)	
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,038,914.50	
CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,632,701.70	
CAN 0.75% 09/01/20	5,320,000.00	5,278,663.60	
CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,669,112.00	
CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	465,046.20	
CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,232,096.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,352,152.50	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	609,675.00	
CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,069,720.00	
CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,716,740.00	
CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,951,472.15	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,487,887.50	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,405,685.00	
CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	4,029,653.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,157,096.80	
CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,245,986.80	

	CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,105,835.35	
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,811,087.35	
	CAN 2.75% 12/01/64	790,000.00	1,158,874.70	
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,296,669.40	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,173,753.65	
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,122,512.30	
	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,103,244.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,812,637.20	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,866,711.75	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	4,060,615.65	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,087,237.30	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,880,000.00	2,950,603.60	
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,653,582.40	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,789,818.50	
	カナダドル 小計	81,350,000.00	91,335,786.40 (7,262,108,376)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,209,450.25	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,187,297.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	35,712,134.55	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,208,015.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	63,590,000.00	63,040,582.40	
	MBONO 7.25% 12/09/21	25,330,000.00	25,424,227.60	
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	55,745,088.60	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,171,304.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,006,537.55	
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,447,785.80	
	MBONO 8.5% 05/31/29	29,250,000.00	32,294,925.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	26,700,860.60	
	MBONO 8% 09/05/24	18,970,000.00	19,811,414.35	
	MBONO 8% 11/07/47	18,970,000.00	20,009,556.00	
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,490,297.50	
	メキシコペソ 小計	509,770,000.00	530,459,476.70 (2,806,130,631)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,288,264.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,408,072.75	
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,361,950.00	
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,432,818.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	3,160,000.00	3,509,827.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,296,948.20	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,010,259.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	987,588.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,953,853.90	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,668,300.00	

BGB 1.9% 06/22/38	1,330,000.00	1,761,006.45
BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,248,578.90
BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,707,428.25
BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,537,405.00
BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,974,119.40
BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,214,616.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,834,999.40
BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,949,272.00
BGB 3.75% 09/28/20	3,270,000.00	3,430,295.40
BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,235,050.60
BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	6,214,583.30
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,600,733.25
BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,812,090.10
BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,250,156.80
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,491,809.00
BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,428,436.30
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,237,818.10
BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,388,044.60
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	3,000,285.60
BTPS 0.05% 04/15/21	7,190,000.00	7,209,952.25
BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,396,783.20
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,600,136.90
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,413,237.00
BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,257,352.00
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,566,158.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,243,154.80
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,572,765.00
BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,637,377.50
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,489,331.25
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,012,214.75
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,989,334.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,402,338.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,088,981.25
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,357,512.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	3,047,657.55
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,803,670.00
BTPS 1.65% 03/01/32	5,250,000.00	5,426,820.00
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,230,680.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,124,660.00
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,680,676.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,194,016.75
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,620,937.50
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,929,181.00

BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,885,823.50	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,832,111.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,799,900.00	
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,280,007.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,267,582.25	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	7,026,560.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,418,005.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,064,395.85	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,588,630.00	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,375,286.20	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,796,949.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,395,967.75	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,280,126.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,364,307.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	3,390,000.00	4,174,954.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	3,257,792.45	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,860,096.30	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,025,986.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,799,104.75	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,568,116.45	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,485,045.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,098,493.25	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,466,996.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,474,096.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,621,090.40	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,486,326.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,909,107.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,328,311.25	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,642,031.55	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	4,447,602.60	
BTPS 4% 02/01/37	5,470,000.00	7,299,961.15	
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,586,230.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,506,652.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,612,711.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,934,089.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	4,013,574.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,944,478.70	
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,404,441.00	
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,984,388.75	
BTPS 5% 08/01/34	3,690,000.00	5,347,603.35	
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,097,757.10	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,620,000.00	8,093,249.60	

BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,195,344.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,021,775.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,082,436.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,690,000.00	5,085,812.55
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,847,433.85
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,550,603.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,089,523.70
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,462,475.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,478,562.10
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,156,175.75
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,269,206.40
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,467,472.00
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,725,723.25
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,223,538.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,558,662.80
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,009,678.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,852,050.75
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,627,547.50
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,512,912.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,492,614.20
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,796,986.50
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,075,131.50
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,037,880.50
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,811,443.20
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	9,208,706.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,530,686.50
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,309,285.75
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,978,655.05
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,829,617.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,060,000.00	7,355,603.50
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	5,311,413.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,848,179.50
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,524,653.50
DBR 4.75% 07/04/40	3,210,000.00	6,820,961.10
DBR 5.5% 01/04/31	3,900,000.00	6,760,162.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,830,539.80
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,640,510.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,191,112.50
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,036,951.50
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,063,900.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,216,502.50
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,373,884.70
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	11,212,604.00

FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,639,170.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	8,430,000.00	9,369,987.15	
FRTR 0.75% 11/25/28	8,510,000.00	9,481,459.05	
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,073,290.00	
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,331,045.00	
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,638,514.20	
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,627,721.25	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,159,675.50	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,681,535.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,746,754.50	
FRTR 1.25% 05/25/36	6,420,000.00	7,767,108.60	
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,701,438.30	
FRTR 1.5% 05/25/50	2,760,000.00	3,611,639.40	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,039,383.95	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,703,277.50	
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,348,354.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,865,599.25	
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,474,134.50	
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,965,216.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,698,374.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,309,895.90	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,455,619.20	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,657,427.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,391,550.00	
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,992,348.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,835,286.20	
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,819,773.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,284,163.95	
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,241,226.25	
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,405,781.80	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,594,468.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	6,640,000.00	12,864,302.80	
FRTR 4.75% 04/25/35	4,200,000.00	7,417,431.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	6,219,717.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,519,115.00	
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,575,990.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,439,095.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	5,410,000.00	9,758,287.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,699,064.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,348,185.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	2,040,000.00	2,116,132.80	
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,873,134.00	

IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,368,307.50
IRISH 1.1% 05/15/29	910,000.00	1,015,892.15
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	894,831.60
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,021,795.65
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,050,259.65
IRISH 1.7% 05/15/37	940,000.00	1,146,621.40
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,227,516.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,630,000.00	2,053,148.00
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,979,329.80
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,738,194.15
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,500,798.90
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,145,938.00
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	245,073.05
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	3,055,392.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,732,184.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,474,566.40
NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,846,643.10
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	5,045,763.15
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,860,243.20
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,573,255.00
NETHER 0% 01/15/24	3,410,000.00	3,536,204.10
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,257,065.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,813,168.20
NETHER 2.5% 01/15/33	2,430,000.00	3,413,943.45
NETHER 2.75% 01/15/47	2,680,000.00	4,909,049.80
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,433,823.05
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,159,169.95
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,679,197.10
NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,595,245.50
NETHER 4% 01/15/37	2,860,000.00	5,085,022.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,744,815.60
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	257,975.00
OBL 0.25% 10/16/20	5,010,000.00	5,073,501.75
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,154,496.50
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,513,256.75
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,297,633.40
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,592,431.50
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,650,414.00
OBL 0% 10/13/23	2,930,000.00	3,045,881.50
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	1,005,264.00
RAGB 0.5% 02/20/29	780,000.00	851,791.20
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,278,930.50
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,189,789.75

RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,639,841.50	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,546,545.00	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,127,357.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,912,917.15	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,130,000.00	1,541,800.25	
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	998,675.20	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,103,824.80	
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,580,509.95	
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	2,034,260.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,154,368.25	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,330,000.00	2,345,282.10	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,902,435.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,363,249.35	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,585,663.85	
RAGB 3.8% 01/26/62	640,000.00	1,529,750.40	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,625,161.20	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,906,520.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	202,141.55	
RFGB 0.375% 09/15/20	1,330,000.00	1,345,960.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,260,926.55	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,141,108.50	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	732,645.00	
RFGB 0.5% 09/15/29	430,000.00	471,290.75	
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	984,739.95	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	756,419.40	
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	868,258.00	
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,507,844.20	
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	928,161.85	
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	754,561.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	705,194.75	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,430,000.00	1,537,671.85	
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,496,504.20	
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,193,727.60	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	678,735.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	856,796.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,450,710.95	
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,631,590.00	
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,760,700.50	
SPGB 0.25% 07/30/24	450,000.00	463,875.75	
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,926,865.50	
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,363,869.60	
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,937,224.25	

	SPGB 0.6% 10/31/29	1,160,000.00	1,221,265.40	
	SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,255,759.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,624,602.70	
	SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	7,018,686.85	
	SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,650,332.50	
	SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,425,385.20	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,927,964.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,431,021.25	
	SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,444,085.25	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,911,677.65	
	SPGB 1.95% 04/30/26	4,820,000.00	5,520,201.40	
	SPGB 1.95% 07/30/30	3,650,000.00	4,371,805.75	
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,871,961.50	
	SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,506,774.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,339,152.80	
	SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,109,764.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	5,064,223.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,850,000.00	3,259,219.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,963,261.60	
	SPGB 4.2% 01/31/37	3,350,000.00	5,418,641.75	
	SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,112,516.25	
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,136,544.80	
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	7,191,302.80	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,758,820.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,201,378.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	6,023,919.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,778,497.80	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,400,000.00	4,753,656.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,847,381.90	
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,589,481.60	
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,338,509.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,948,578.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,958,321.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,645,287.00	
	ユーロ 小計	1,002,570,000.00	1,225,581,554.95 (143,638,158,240)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,760,225.75	
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,027,014.80	
	UKT 0.875% 10/22/29	510,000.00	528,864.90	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,243,000.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,166,878.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,433,063.50	
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,603,371.20	

UKT 1.625% 10/22/28	5,750,000.00	6,369,562.50	
UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,571,827.25	
UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,540,764.00	
UKT 1.75% 01/22/49	1,480,000.00	1,746,570.20	
UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,428,287.50	
UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,544,347.00	
UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,612,317.80	
UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,187,413.85	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,692,787.50	
UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,565,602.45	
UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,747,270.75	
UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,394,595.00	
UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,895,838.75	
UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,208,403.20	
UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,304,180.80	
UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,795,924.00	
UKT 3.75% 09/07/20	8,060,000.00	8,331,662.30	
UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,028,188.45	
UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,568,140.15	
UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,328,535.00	
UKT 4.25% 09/07/39	2,450,000.00	3,928,072.75	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	884,182.25	
UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,967,596.00	
UKT 4.25% 12/07/46	3,950,000.00	6,963,810.50	
UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,988,492.55	
UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,466,176.70	
UKT 4.5% 09/07/34	3,170,000.00	4,862,890.95	
UKT 4.5% 12/07/42	3,910,000.00	6,747,232.85	
UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,966,247.60	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,196,655.00	
UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,945,975.75	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,129,829.00	
UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,142,375.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,889,487.50	
UKT 8% 06/07/21	740,000.00	840,036.90	
イギリスポンド 小計	136,690,000.00	181,543,697.90 (23,577,080,046)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,304,612.40
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,455,411.80
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	18,232,332.75
	SGB 1% 11/12/26	11,970,000.00	13,345,113.60
	SGB 2.5% 05/12/25	11,460,000.00	13,550,877.00

	SGB 3.5% 03/30/39	8,460,000.00	14,049,395.10
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,668,434.40
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	20,264,334.20
スウェーデンクローナ 小計		100,120,000.00	115,870,511.25 (1,266,464,687)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,642,024.00
	NGB 1.75% 02/17/27	7,460,000.00	7,793,163.60
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	6,002,855.00
	NGB 1.75% 09/06/29	5,140,000.00	5,415,632.50
	NGB 2% 04/26/28	5,730,000.00	6,135,311.55
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,874,716.80
	NGB 3.75% 05/25/21	16,040,000.00	16,764,526.80
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,781,670.75
ノルウェークローネ 小計		71,020,000.00	74,409,901.00 (872,828,138)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,530,895.00
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	19,342,275.30
	DGB 0.5% 11/15/29	4,930,000.00	5,537,942.95
	DGB 1.5% 11/15/23	13,990,000.00	15,435,586.70
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	13,101,591.80
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	14,096,786.40
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	50,313,235.60
デンマーククローネ 小計		94,460,000.00	127,358,313.75 (2,002,072,692)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,810,000.00	7,844,559.25
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,798,854.15
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,048,897.10
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,095,985.95
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,781,611.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	7,136,392.40
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,000,000.00	6,462,300.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,460,000.00	2,672,347.20
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,613,759.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,782,133.75
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,822,327.20
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,110,000.00	3,249,763.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	813,783.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,051,692.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,704,096.00
ポーランドズロチ 小計		75,720,000.00	79,878,502.10 (2,138,347,501)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	1,450,000.00	1,540,683.00
	ACGB 1.75% 11/21/20	6,310,000.00	6,383,259.10

	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,462,855.90
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,068,273.45
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,540,000.00	4,117,055.40
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,631,185.30
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	1,001,688.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,763,726.25
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,616,697.50
	ACGB 2.75% 11/21/28	4,700,000.00	5,478,132.00
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,267,728.30
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,800,076.80
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,670,551.70
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,983,992.20
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,570,000.00	2,099,129.25
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,249,890.80
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,309,126.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,804,301.05
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,827,024.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,306,012.90
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,692,040.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,264,698.45
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,097,733.20
	オーストラリアドル 小計	88,360,000.00	103,435,860.55 (7,383,251,726)
シンガポ ールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	982,763.10
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	803,452.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	782,987.40
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	875,657.25
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,808.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	744,079.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	656,151.30
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	282,530.30
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,128,975.75
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,541,647.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	830,000.00	961,849.65
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,667,208.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	619,234.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	747,150.50
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	416,808.05
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,779.50
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,087,259.10
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,060,000.00	1,267,516.20
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,344,039.55
	SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,119,352.50

シンガポールドル 小計		18,510,000.00	19,785,248.95 (1,506,053,150)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,517,712.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,725,987.50
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,734,904.90
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,720,437.35
	MGS 3.659% 10/15/20	2,360,000.00	2,374,761.80
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,339,689.00
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	356,865.25
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,930.00
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,228,429.80
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	3,098,955.60
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,803.75
	MGS 3.882% 03/14/25	500,000.00	515,837.50
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,055.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,169,713.85
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,049,262.95
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,699,053.60
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,803,248.00
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,089,606.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,973,539.50
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,182,481.25
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,771,798.50
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,615,549.50
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,149,170.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,512,945.00
	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,363,551.40
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,328,389.60
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,688,250.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,490,000.00	1,736,654.60
MGS 4.762% 04/07/37	2,480,000.00	2,843,382.00	
MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	944,000.00	
MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,858,225.25	
MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,712,505.60	
MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	686,247.00	
マレーシアリンギット 小計		65,080,000.00	68,593,943.55 (1,725,137,680)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	43,600,000.00	48,966,942.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,987,847.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,417,392.75
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,730,281.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,866,112.00

	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,864,904.85	
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	23,871,413.15	
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	24,337,426.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,302,920.10	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	40,107,598.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	20,016,968.75	
	SAGB 8% 01/31/30	29,930,000.00	28,068,802.95	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,564,947.75	
	南アフリカランド 小計	307,740,000.00	286,103,556.80	(1,971,253,506)
	合計		378,086,762,179	(378,086,762,179)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	48.1%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 299銘柄	100.0%	38.0%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.2%
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%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	731,030,268
コール・ローン	860,271,473
国債証券	46,592,420,718
未収利息	633,509,052
前払費用	55,927,149
流動資産合計	48,873,158,660
資産合計	48,873,158,660
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,973,336
未払利息	1,350
流動負債合計	3,974,686
負債合計	3,974,686
純資産の部	
元本等	
元本	29,737,144,056
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,132,039,918
元本等合計	48,869,183,974
純資産合計	48,869,183,974
負債純資産合計	48,873,158,660

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

2019年 8月28日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,737,144,056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 1.6434円 (1万口当たり純資産額) (16,434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 8月28日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

	2019年 8月28日現在

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月28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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月20日
期首元本額	28,825,242,652円

区分	2019年 8月28日現在
期中追加設定元本額	1,706,824,550円
期中一部解約元本額	794,923,146円
期末元本額	29,737,144,056円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,143,251,873円
世界経済インデックスファンド	5,545,445,069円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,221,721,330円
DC世界経済インデックスファンド	4,817,381,011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）	1,873,358,430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）	98,209,126円
分散投資コア戦略ファンドA	172,801,832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）	220,233,791円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,232,746,725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）	199,986,787円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,587,794円
SMT インデックスバランス・オープン	202,048,943円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,454,767,674円
SMT 世界経済インデックス・オープン	82,809,529円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	112,180,332円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	152,268,558円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,176,506円
グローバル経済コア	802,778,546円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	21,634,647円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	3,268,814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）	117,260,583円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,602,943,108
合計	2,602,943,108

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,200,000.00	39,040,404.00		
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	93,573,768.75		
		MBONO 5.75% 03/05/26	48,500,000.00	45,496,152.50		
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	80,344,558.00		
		MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	90,907,712.00		
		MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000.00	64,539,196.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000.00	87,942,594.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	52,128,897.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	63,237,067.50		
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	24,999,840.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	63,700,000.00	70,331,170.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	53,545,691.00		
		MBONO 8% 09/05/24	25,000,000.00	26,108,875.00		
		MBONO 8% 11/07/47	34,750,000.00	36,654,300.00		
		MBONO 8% 12/07/23	77,600,000.00	80,639,980.00		
			メキシコペソ 小計		869,150,000.00	909,490,205.75 (4,811,203,188)
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	35,400,000.00	30,793,674.12	
			BLTN 0% 07/01/21	14,600,000.00	13,163,847.64	
			BLTN 0% 07/01/22	13,250,000.00	11,124,058.70	
			BLTN 0% 07/01/23	17,500,000.00	13,564,768.00	
	BNTNF 10% 01/01/21		21,200,000.00	22,338,429.14		
	BNTNF 10% 01/01/23		28,650,000.00	31,452,399.40		
	BNTNF 10% 01/01/25		21,100,000.00	23,781,683.14		

	BNTNF 10% 01/01/27	15,900,000.00	18,279,752.80
	BNTNF 10% 01/01/29	7,000,000.00	8,210,681.41
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,743,875.00
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	523,125.00
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,123,250.00
ブラジルリアル 小計		178,350,000.00	177,099,544.35 (4,531,977,339)
チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/21	1,590,000,000.00	1,650,194,568.21
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,825,000,000.00	2,043,923,749.67
	BTPCL 4.7% 09/01/30	955,000,000.00	1,139,307,281.69
	BTPCL 4% 03/01/23	1,260,000,000.00	1,336,512,205.98
	BTPCL 5% 03/01/35	2,060,000,000.00	2,634,394,879.96
	BTPCL 6% 01/01/43	1,620,000,000.00	2,470,590,319.86
チリペソ 小計		9,310,000,000.00	11,274,923,005.37 (1,650,648,727)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	23,187,760,750.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	9,600,000,000.00	10,031,568,000.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	55,400,000,000.00	70,667,132,000.00
コロンビアペソ 小計		88,650,000,000.00	103,886,460,750.00 (3,168,537,052)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.4% 08/12/34	2,750,000.00	2,924,088.75
	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,700,000.00	6,339,511.50
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,400,000.00	7,263,264.00
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,044,190.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,350,000.00	8,573,407.50
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	8,582,138.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,350,000.00	8,998,641.75
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	8,223,312.50
ペルーヌエボソル 小計		50,000,000.00	58,948,554.00 (1,835,068,486)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	13,444,860.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	16,902,890.50
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	30,347,750.50 (87,704,998)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,669,586.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	25,989,125.00
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	46,658,711.00 (96,116,944)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,811,301.50
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,050,000.00	6,069,740.25
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	7,665,693.75
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,700,000.00	6,244,266.00
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	9,387,975.00

	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	7,207,500.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	4,996,824.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	8,891,536.50	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,315,584.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	4,727,748.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	5,337,085.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,305,929.00	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	9,587,385.50	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,617,320.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	5,571,443.75	
	トルコリラ 小計	108,600,000.00	89,737,332.25 (1,627,835,207)	
チェココ ルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	32,200,000.00	30,522,702.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	22,400,000.00	21,932,848.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,400,000.00	45,934,608.00	
	CZGB 1% 06/26/26	42,800,000.00	42,918,556.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	55,837,072.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	48,800,000.00	54,942,700.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	44,500,000.00	51,908,582.50	
	CZGB 3.75% 09/12/20	36,500,000.00	37,539,885.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	40,113,549.50	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,300,000.00	39,207,357.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	38,800,000.00	47,810,912.00	
	チェココルナ 小計	437,100,000.00	468,668,772.50 (2,127,756,227)	
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	370,000,000.00	372,787,950.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	535,000,000.00	557,175,750.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	430,000,000.00	464,890,200.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	359,263,960.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	373,000,000.00	412,082,940.00	
	HGB 3% 06/26/24	466,000,000.00	515,023,200.00	
	HGB 3% 10/27/27	626,000,000.00	704,347,030.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	597,000,000.00	748,927,545.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	496,000,000.00	607,104,000.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	480,349,220.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	258,364,365.00	
HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	565,103,220.00		
	ハンガリーフォリント 小計	5,278,500,000.00	6,045,419,380.00 (2,150,355,673)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,701,551.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,800,000.00	11,003,742.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,831,770.25	

	POLGB 2.5% 04/25/24	10,500,000.00	10,940,947.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	13,950,000.00	14,649,592.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000.00	14,757,680.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	10,950,000.00	11,793,697.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	5,730,000.00	6,224,613.60	
	POLGB 2% 04/25/21	8,500,000.00	8,569,657.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,825,537.50	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,874,952.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,523,568.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,497,298.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,789,496.00	
	ポーランドズロチ 小計	151,730,000.00	159,984,104.10 (4,282,774,466)	
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	135,100,000.00	133,368,693.50	
	RFLB 6.9% 05/23/29	89,000,000.00	87,856,350.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	177,399,135.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	165,719,667.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	89,000,000.00	89,039,160.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	100,000,000.00	102,280,500.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	176,060,612.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	124,737,990.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	44,400,000.00	45,007,614.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	95,000,000.00	97,031,575.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	181,030,382.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	169,363,187.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	154,857,885.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	97,892,064.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	108,016,864.00	
	RFLB 7% 12/15/21	151,000,000.00	151,760,285.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	187,661,760.00	
RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	136,482,219.00		
	ロシアルーブル 小計	2,327,750,000.00	2,385,565,943.00 (3,793,049,849)	
マレーシアリンギット	MGS 3.62% 11/30/21	8,750,000.00	8,849,006.25	
	MGS 3.659% 10/15/20	10,800,000.00	10,867,554.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,562,932.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,945,132.75	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,837,315.75	
	MGS 3.885% 08/15/29	7,350,000.00	7,714,302.75	
	MGS 3.899% 11/16/27	11,550,000.00	12,014,714.25	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,364,433.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	4,500,000.00	4,681,980.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,628,288.00	

	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,842,222.75
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,167,400.25
	MGS 4.181% 07/15/24	6,000,000.00	6,253,740.00
	MGS 4.762% 04/07/37	6,900,000.00	7,911,022.50
マレーシアリングット 小計		112,450,000.00	116,640,044.75 (2,933,497,125)
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	101,016,040.00
	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000.00	102,676,070.00
	THAIGB 2.4% 12/17/23	70,000,000.00	72,952,250.00
	THAIGB 2.875% 12/17/28	59,000,000.00	66,324,555.00
	THAIGB 2% 12/17/22	77,900,000.00	79,431,124.50
	THAIGB 3.3% 06/17/38	54,000,000.00	69,321,690.00
	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	225,142,969.50
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,910,680.00
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	169,298,069.50
	THAIGB 3.65% 12/17/21	64,100,000.00	67,366,215.50
	THAIGB 3.775% 06/25/32	59,000,000.00	74,848,285.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	76,000,000.00	87,009,740.00
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	124,681,800.00
タイバーツ 小計		1,149,700,000.00	1,330,979,489.00 (4,591,879,237)
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	24,984,875.00
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	20,269,100.00
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	24,100,700.00
フィリピンペソ 小計		65,000,000.00	69,354,675.00 (140,096,443)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,931,404,000.00
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,749,050,000.00
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,541,920,000.00
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,532,734,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	40,800,000,000.00	39,458,904,000.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	33,210,180,000.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	26,337,800,000.00
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	22,776,858,000.00
	INDOGB 7.5% 08/15/32	30,500,000,000.00	30,040,670,000.00
	INDOGB 7% 05/15/22	33,700,000,000.00	34,151,917,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	44,300,000,000.00	43,812,257,000.00
	INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	31,282,760,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/29	23,600,000,000.00	25,227,810,000.00
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	34,624,778,000.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	19,792,458,000.00
	INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	32,852,739,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000.00	51,275,401,000.00

	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	34,358,837,500.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	12,500,000,000.00	13,184,375,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	47,880,450,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	35,559,124,500.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,108,233,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	35,846,037,500.00	
	インドネシアルピア 小計	632,900,000,000.00	653,536,697,500.00 (4,836,171,561)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000.00	97,653,110.25	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	25,152,295.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	37,076,294.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	18,350,000.00	18,401,930.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	42,500,000.00	43,142,600.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,490,081.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	47,650,000.00	43,968,799.25	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	42,029,208.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000.00	47,907,377.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000.00	66,458,916.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	35,250,000.00	33,204,618.75	
	SAGB 8% 01/31/30	50,300,000.00	47,172,094.50	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	32,407,725.00	
	南アフリカランド 小計	619,900,000.00	570,065,050.25 (3,927,748,196)	
	合計		46,592,420,718 (46,592,420,718)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	9.7%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	3.5%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	6.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 8銘柄	100.0%	3.9%
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 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	3.5%

チェココルナ	国債証券	11銘柄	100.0%	4.6%
ハンガリーフォリント	国債証券	12銘柄	100.0%	4.6%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	9.2%
ロシアルーブル	国債証券	18銘柄	100.0%	8.1%
マレーシアリングgit	国債証券	14銘柄	100.0%	6.3%
タイバーツ	国債証券	13銘柄	100.0%	9.9%
フィリピンペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券	23銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	8.4%

(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。

2【ファンドの現況】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

【純資産額計算書】

（2019年 9月30日現在）

資産総額	502,574円
負債総額	177円
純資産総額（ - ）	502,397円
発行済口数	500,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0048円
（1万口当たり純資産額）	（10,048円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

【純資産額計算書】

（2019年 9月30日現在）

資産総額	499,485円
負債総額	177円
純資産総額（ - ）	499,308円
発行済口数	500,000口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9986円
（1万口当たり純資産額）	（9,986円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

【純資産額計算書】

（2019年 9月30日現在）

資産総額	496,393円
負債総額	177円
純資産総額（ - ）	496,216円
発行済口数	500,000口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9924円
（1万口当たり純資産額）	（9,924円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

【純資産額計算書】

(2019年 9月30日現在)

資産総額	493,619円
負債総額	176円
純資産総額（ - ）	493,443円
発行済口数	500,000口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9869円
（1万口当たり純資産額）	（9,869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 9月30日現在)

資産総額	308,428,354,184円
負債総額	1,173,830,842円
純資産総額（ - ）	307,254,523,342円
発行済口数	207,951,200,444口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4775円
（1万口当たり純資産額）	（14,775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 9月30日現在)

資産総額	372,973,975,330円
負債総額	10,378,935,571円
純資産総額（ - ）	362,595,039,759円
発行済口数	139,822,058,208口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5933円
（1万口当たり純資産額）	（25,933円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 9月30日現在）

資産総額	56,968,854,771円
負債総額	254,667,713円
純資産総額（ - ）	56,714,187,058円
発行済口数	21,247,417,875口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6692円
（1万口当たり純資産額）	（26,692円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 9月30日現在）

資産総額	590,997,401,276円
負債総額	46,028,847,305円
純資産総額（ - ）	544,968,553,971円
発行済口数	379,521,438,312口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4359円
（1万口当たり純資産額）	（14,359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 9月30日現在）

資産総額	393,681,071,819円
負債総額	290,903,667円
純資産総額（ - ）	393,390,168,152円
発行済口数	139,801,569,209口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8139円
（1万口当たり純資産額）	（28,139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 9月30日現在）

資産総額	51,287,199,973円
負債総額	36,411,774円
純資産総額（ - ）	51,250,788,199円

発行済口数	30,209,357,900口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6965円
（1万口当たり純資産額）	（16,965円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年 9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2019年11月28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9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	523	12,410,879
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	339,434
単位型公社債投資信託	9	79,382
合計	619	12,829,695

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

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

(単位:千円)

前事業年度

当事業年度

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本	
	利益剰余金	

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

ております。

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

6．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

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

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

表示方法の変更

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

(貸借対照表関係)

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

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

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

(5) 未払金、及び(6) 未払法人税等

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:千円)

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

（1）取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

その他取引の概要に関する事項

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

（2）実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	-	-

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、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11月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第3【参考情報】

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

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月28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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2019年3月20日から2019年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2019年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月28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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2019年3月20日から2019年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2019年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月28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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2019年3月20日から2019年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2019年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月28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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2019年3月20日から2019年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2019年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。