

**【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9月10日提出
【計算期間】	第2期(自 2018年6月12日至 2019年6月10日)
【ファンド名】	SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）並びに債券に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。



## DR(預託証券)とは

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## <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 ]

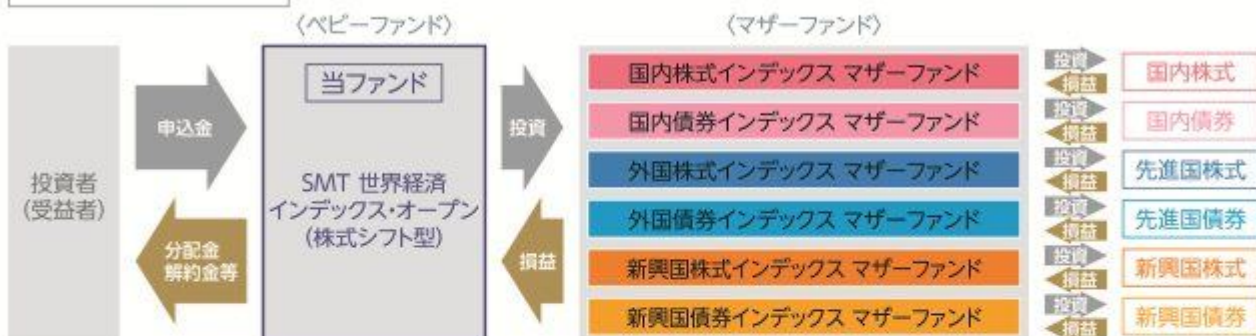
- (1) プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

## &lt; ファンドの特色 &gt;

**特色1** 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

## ファンドのしくみ



## ? ファミリーファンド方式とは

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

**特色2** 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率に基づき決定します。  
※年1回地域別構成比の見直しを行います。

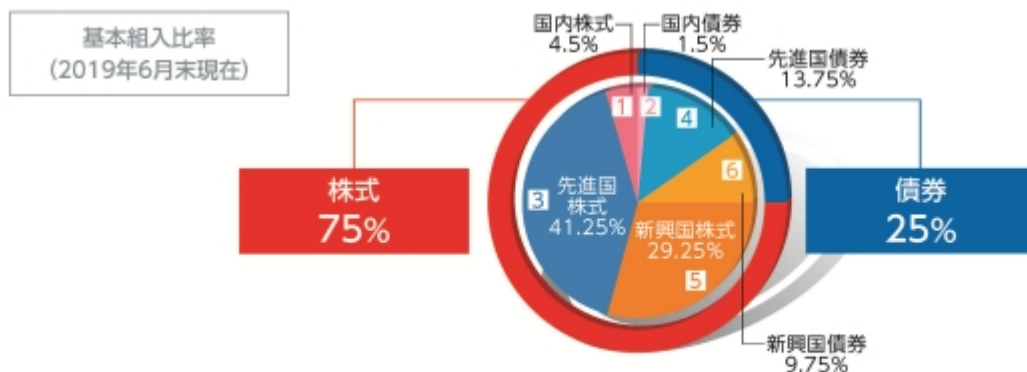


(出所) IMF「世界経済見通し2018年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※上記のファンドの地域別構成比は、2019年6月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- 基本組入比率は年1回見直しを行います。

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

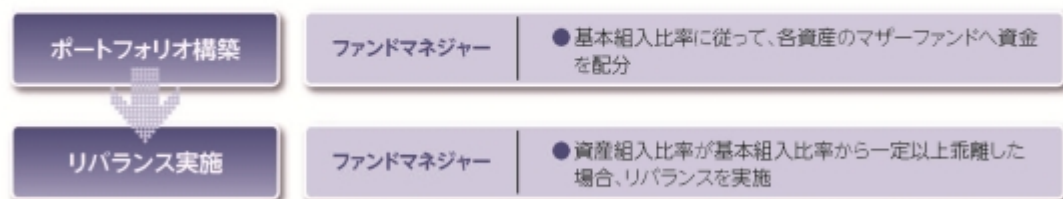
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※3 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※5 「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。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。



## ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

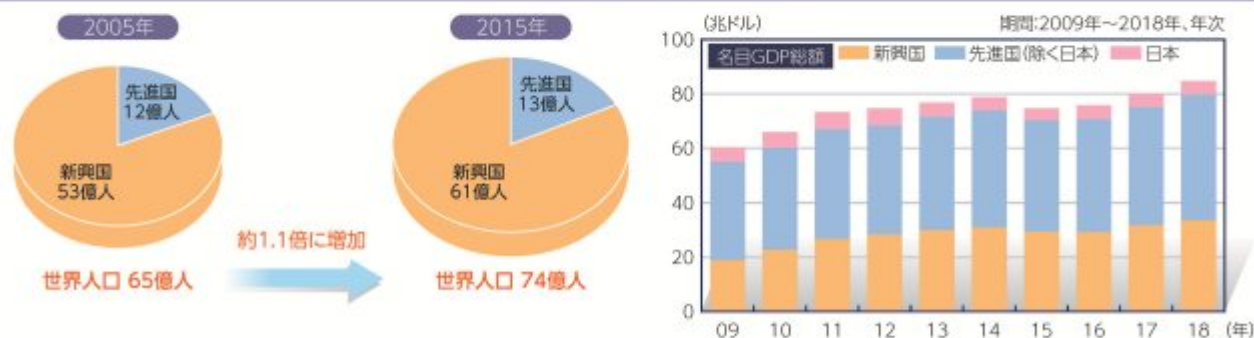
### 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### 〈ご参考情報〉

#### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects(The 2019 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2019年4月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

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

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

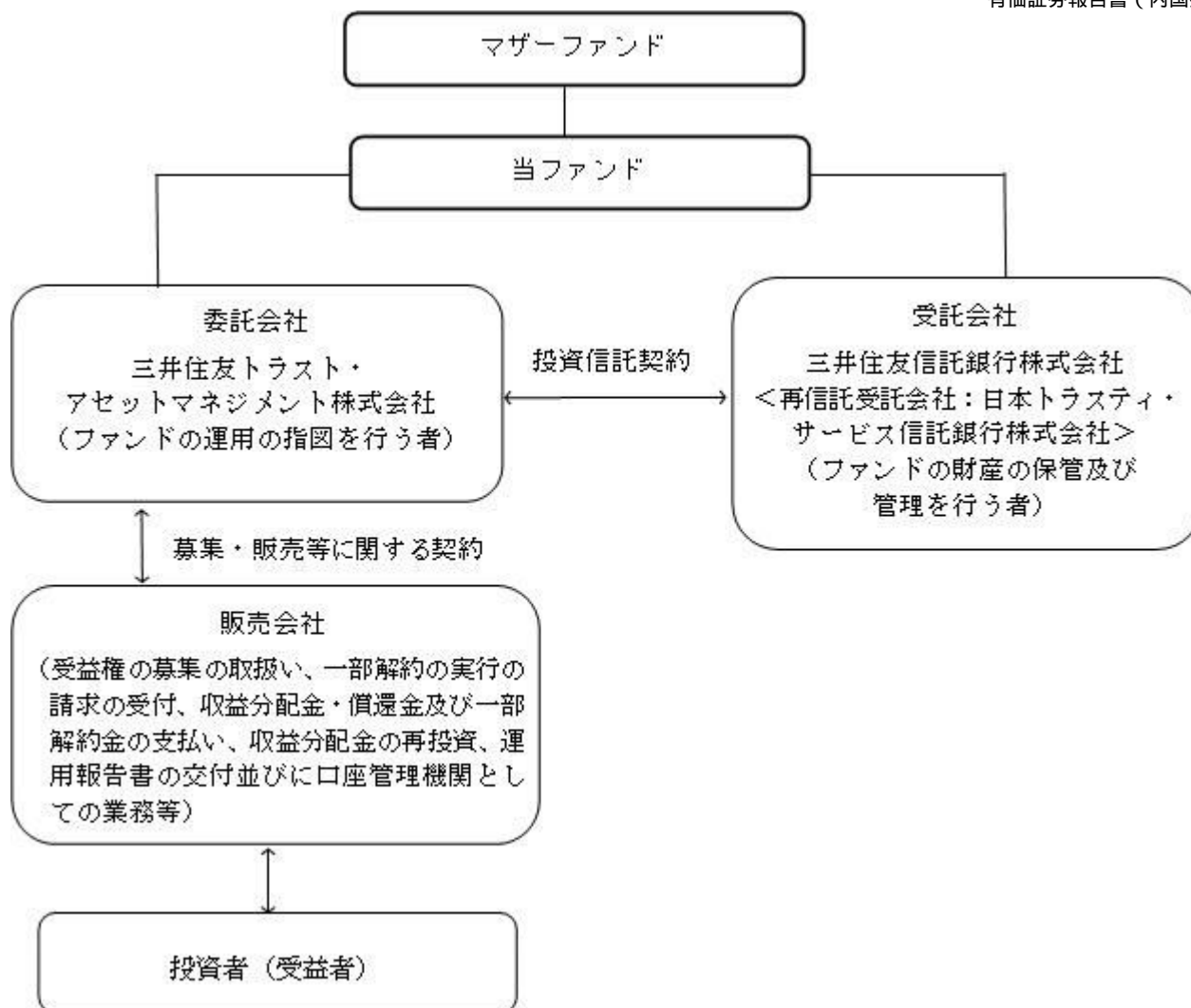
### (2)【ファンドの沿革】

2017年 8月25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 6月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、主として、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．株式と債券の基本資産配分比率は、株式75%、債券25%とします。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。
- ホ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	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）

- ヘ．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。
- 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の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

は、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債並びに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。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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



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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

券を活用することがあります。

## (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

## 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデッ

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

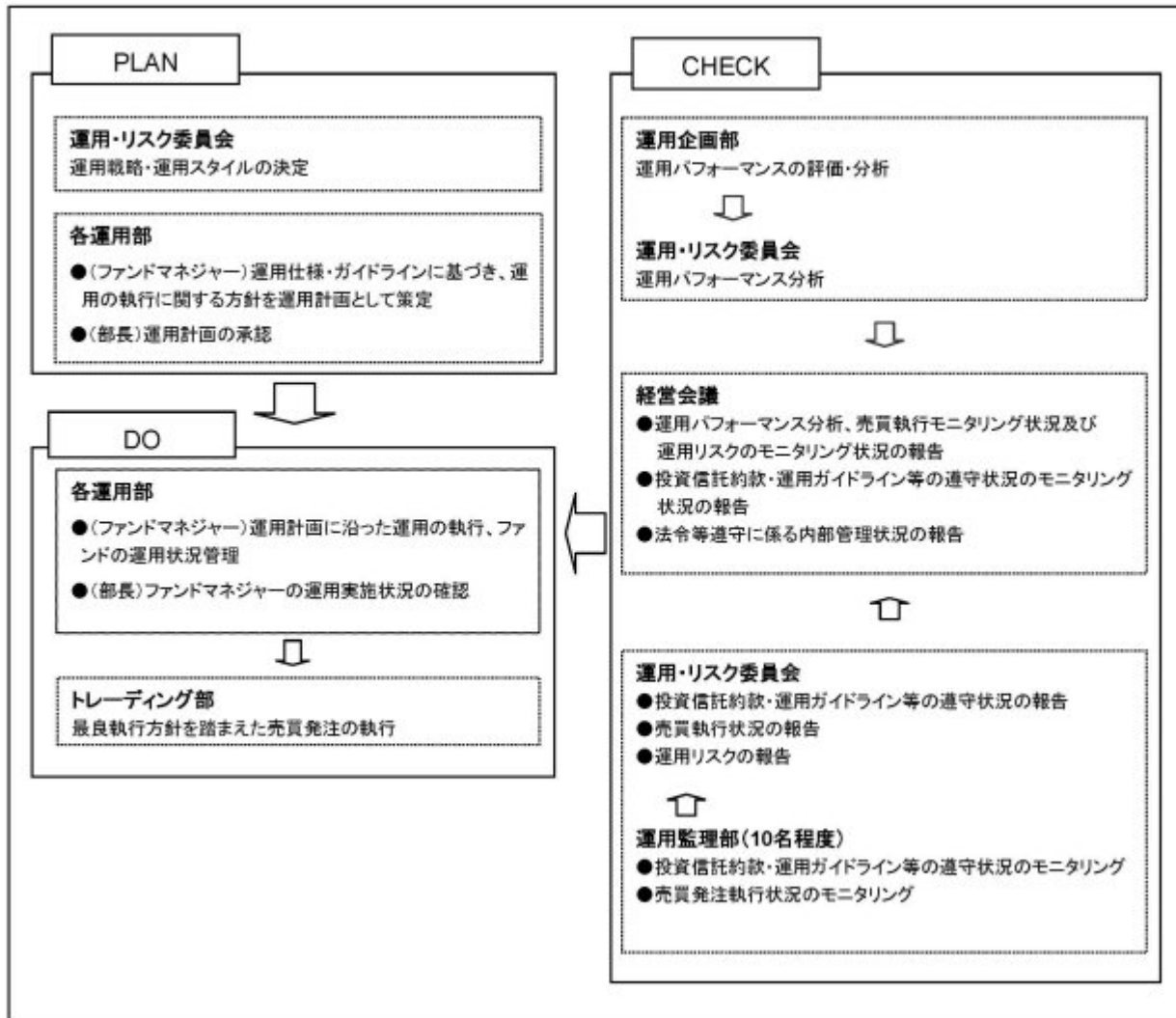
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価

証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとしします。（以下同じ。）

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

（ハ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

（ニ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

#### チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

（ニ）委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する

株式の時価合計額を超えないものとします。

b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

(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。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

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

#### カ．資金の借入れ

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

借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク



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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

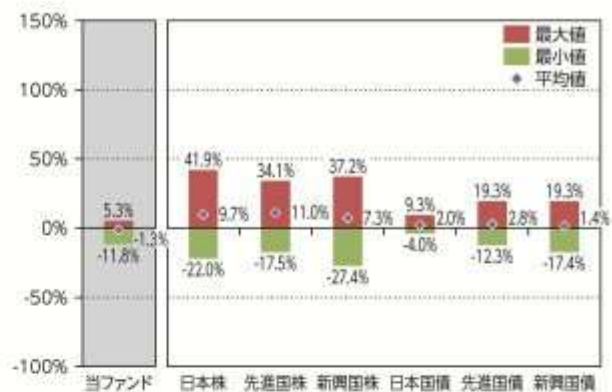
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*当ファンドについては2018年8月～2019年6月の11ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年7月～2019年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

\*各資産クラスの指数  
 日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>\*1</sup>  
 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>\*2</sup>  
 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>\*3</sup>  
 日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>\*4</sup>  
 先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>\*5</sup>  
 新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)<sup>\*6</sup>

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

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

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

\*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.594%（\*）（税抜0.55%）を乗じて得た額とします（信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2376% (税抜 0.22%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.3024% (税抜 0.28%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

\*消費税率が10%になった場合は、0.605%となります。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.242% (税抜 0.22%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.308% (税抜 0.28%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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。

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

徴収が行われます。

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得  
及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件  
に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできませ  
ん。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳し  
くは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

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

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異な

場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、2019年6月28日現在のもので、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6月28日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,862,200,519	99.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,182,112	0.86
合計(純資産総額)		1,878,382,631	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	309,179,811	2.5402	785,389,076	2.5739	795,797,915	42.37

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	195,694,198	2.6684	522,208,311	2.7867	545,341,021	29.03
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	88,897,361	2.7706	246,304,609	2.7746	246,654,617	13.13
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	106,625,132	1.6570	176,686,620	1.7029	181,571,937	9.67
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	54,791,712	1.4284	78,266,474	1.4292	78,308,314	4.17
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	10,154,282	1.4283	14,503,499	1.4306	14,526,715	0.77

(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。

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.14
合計	99.14

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2018年 6月11日)	1,504,217,648	1,504,217,648	10,637	10,637
第2期計算期間末	(2019年 6月10日)	1,826,908,363	1,826,908,363	10,374	10,374
	2018年 6月末日	1,489,426,324		10,336	
	7月末日	1,605,652,271		10,695	
	8月末日	1,580,841,892		10,638	
	9月末日	1,665,460,178		10,898	
	10月末日	1,598,286,028		10,055	
	11月末日	1,700,893,092		10,385	
	12月末日	1,624,150,770		9,662	
	2019年 1月末日	1,780,970,704		10,149	
	2月末日	1,867,616,342		10,571	

3月末日	1,878,612,516		10,561
4月末日	1,840,069,879		10,882
5月末日	1,786,663,539		10,214
6月末日	1,878,382,631		10,591

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	6.4
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	2.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	1,988,223,866	574,034,195	1,414,189,671
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	972,552,858	625,653,753	1,761,088,776

(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	274,247,048,580	98.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,623,877,438	1.30
合計(純資産総額)		277,870,926,018	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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



## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,063,620,000	1.46

(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	1,374,300	6,580.50	9,043,593,900	6,688.00	9,191,318,400	3.31
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,011,400	5,245.04	5,304,842,300	5,165.00	5,223,881,000	1.88
日本	株式	ソニー	電気機器	827,600	5,316.26	4,399,741,600	5,648.00	4,674,284,800	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,372,900	505.51	4,232,601,750	512.00	4,286,924,800	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	827,700	4,920.62	4,072,802,600	5,017.00	4,152,570,900	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,076,600	3,847.51	4,142,239,800	3,823.00	4,115,841,800	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	60,500	62,679.09	3,792,085,000	66,130.00	4,000,865,000	1.44
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	857,300	3,818.27	3,273,406,800	3,806.00	3,262,883,800	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	844,200	3,610.78	3,048,227,100	3,594.00	3,034,054,800	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,040,300	2,758.63	2,869,804,900	2,785.00	2,897,235,500	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	70,600	38,957.67	2,750,412,000	39,490.00	2,787,994,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	992,100	2,790.50	2,768,457,792	2,743.50	2,721,826,350	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	16,527,800	155.27	2,566,375,090	156.10	2,579,989,580	0.93
日本	株式	花王	化学	299,400	8,683.88	2,599,956,500	8,210.00	2,458,074,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	852,300	2,843.25	2,423,307,600	2,840.00	2,420,532,000	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	110,400	22,778.15	2,514,708,500	21,580.00	2,382,432,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	168,300	13,795.76	2,321,827,000	14,065.00	2,367,139,500	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	434,900	5,549.93	2,413,665,300	5,399.00	2,348,025,100	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	117,200	18,351.97	2,150,852,000	19,930.00	2,335,796,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	219,300	10,450.16	2,291,721,500	10,080.00	2,210,544,000	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	555,200	3,769.42	2,092,786,400	3,949.00	2,192,484,800	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	148,400	13,697.59	2,032,723,000	14,725.00	2,185,190,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	212,800	9,229.51	1,964,040,100	10,035.00	2,135,448,000	0.77

日本	株式	キヤノン	電気機器	663,900	3,076.71	2,042,634,400	3,146.00	2,088,629,400	0.75
日本	株式	H O Y A	精密機器	248,300	7,870.11	1,954,148,900	8,254.00	2,049,468,200	0.74
日本	株式	資生堂	化学	245,000	8,049.80	1,972,201,800	8,121.00	1,989,645,000	0.72
日本	株式	第一三共	医薬品	352,900	5,387.46	1,901,234,900	5,635.00	1,988,591,500	0.72
日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	766,300	2,509.84	1,923,292,150	2,512.50	1,925,328,750	0.69
日本	株式	村田製作所	電気機器	388,200	4,671.34	1,813,416,700	4,840.00	1,878,888,000	0.68
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	139,300	13,427.19	1,870,408,500	13,340.00	1,858,262,000	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.77
		食料品	4.06
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.30
		医薬品	5.42
		石油・石炭製品	0.62
		ゴム製品	0.77
		ガラス・土石製品	0.85
		鉄鋼	0.90
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.55
		機械	5.11
		電気機器	13.42
		輸送用機器	7.73
		精密機器	2.10
		その他製品	2.14
		電気・ガス業	1.64
		陸運業	4.66
		海運業	0.16
		空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.20		
情報・通信業	8.79		
卸売業	4.89		
小売業	4.49		
銀行業	5.78		

	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	2.26
	その他金融業	1.11
	不動産業	2.40
	サービス業	5.21
	小計	98.70
合計		98.70

(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	262	円	4,012,745,490	4,063,620,000	1.46

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	392,034,000,150	83.48
地方債証券	日本	25,803,419,504	5.49
特殊債券	日本	31,937,201,478	6.80
社債券	日本	16,607,336,310	3.54
	フランス	1,403,521,000	0.30
	オーストラリア	502,004,000	0.11
	アメリカ	105,530,000	0.02
	イギリス	100,662,000	0.02
	スウェーデン	100,268,000	0.02
	小計		18,819,321,310
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,025,460,884	0.22
合計(純資産総額)		469,619,403,326	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	8,960,000,000	101.35	9,081,497,600	101.62	9,105,868,800	0.100	2023/12/20	1.94
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	101.42	5,983,957,000	0.100	2023/6/20	1.27
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,860,000,000	101.50	5,948,475,200	101.71	5,960,733,400	0.100	2024/3/20	1.27
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	101.29	5,753,499,200	0.100	2023/3/20	1.23
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	100.90	5,589,970,800	0.100	2022/3/20	1.19
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	100.98	4,847,328,000	0.100	2022/6/20	1.03
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	102.02	4,805,518,800	102.64	4,834,720,800	0.100	2028/12/20	1.03
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	100.54	4,805,955,400	0.100	2021/3/20	1.02
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	101.08	4,791,523,800	0.100	2022/9/20	1.02
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	103.03	4,708,516,700	1.000	2021/12/20	1.00
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	103.80	4,484,407,500	104.17	4,500,273,600	0.400	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	102.13	4,024,276,600	102.79	4,050,241,200	0.100	2028/3/20	0.86
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	103.64	4,031,868,300	104.00	4,045,677,800	0.400	2025/6/20	0.86
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	102.61	4,043,109,800	0.100	2029/3/20	0.86
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	102.07	3,970,561,900	102.67	3,993,979,700	0.100	2028/9/20	0.85
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	102.08	3,889,552,800	1.200	2020/12/20	0.83
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	104.02	3,765,632,600	0.500	2024/9/20	0.80
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	100.35	3,622,779,400	100.36	3,623,248,700	0.100	2020/9/20	0.77
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	103.65	3,555,400,800	103.89	3,563,427,000	0.600	2023/12/20	0.76
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	103.68	3,556,395,500	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,460,000,000	102.04	3,530,662,400	102.46	3,545,150,600	0.100	2026/3/20	0.75
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	103.10	3,485,050,400	0.300	2024/12/20	0.74
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	3,430,000,000	101.28	3,473,972,600	101.53	3,482,684,800	0.100	2023/9/20	0.74
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	100.66	3,362,077,400	100.72	3,364,215,000	0.100	2021/9/20	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	102.16	3,279,560,700	102.85	3,301,517,100	0.100	2027/12/20	0.70
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	102.84	3,229,458,600	102.80	3,228,202,600	1.200	2021/6/20	0.69

日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	101.05	3,203,506,900	101.19	3,207,723,000	0.100	2022/12/20	0.68
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,060,000,000	102.16	3,126,347,800	102.74	3,143,844,000	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	120.58	3,062,935,200	121.45	3,084,931,600	1.500	2034/6/20	0.66
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	2,455,000,000	122.69	3,012,039,500	123.48	3,031,654,950	1.700	2033/6/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.48
地方債証券	5.49
特殊債券	6.80
社債券	4.01
合計	99.78

(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。

#### 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	218,672,366,181	62.07
	イギリス	21,173,808,834	6.01
	カナダ	13,151,137,866	3.73
	フランス	12,998,885,256	3.69
	スイス	12,879,402,841	3.66
	ドイツ	11,003,490,147	3.12
	オーストラリア	8,233,002,622	2.34
	アイルランド	6,285,208,631	1.78
	オランダ	6,193,904,339	1.76
	スペイン	3,806,553,349	1.08
	香港	3,542,853,819	1.01

	スウェーデン	3,189,614,467	0.91
	イタリア	2,438,980,303	0.69
	デンマーク	2,173,401,130	0.62
	シンガポール	1,581,955,786	0.45
	フィンランド	1,472,660,692	0.42
	バミューダ	1,467,763,279	0.42
	ベルギー	1,240,176,190	0.35
	ジャージー	1,011,831,183	0.29
	ノルウェー	847,827,811	0.24
	ケイマン	839,014,196	0.24
	イスラエル	720,399,553	0.20
	キュラソー	502,077,496	0.14
	ルクセンブルク	367,021,864	0.10
	ニュージーランド	318,186,015	0.09
	オーストリア	293,200,582	0.08
	ポルトガル	197,267,097	0.06
	リベリア	178,402,367	0.05
	パナマ	173,863,752	0.05
	パプアニューギニア	64,560,799	0.02
	英ヴァージン諸島	42,318,138	0.01
	マン島	37,112,215	0.01
	モーリシャス	10,349,635	0.00
	小計	337,108,598,435	95.69
投資信託受益証券	オーストラリア	173,080,450	0.05
	香港	89,069,610	0.03
	小計	262,150,060	0.07
投資証券	アメリカ	7,262,046,415	2.06
	オーストラリア	655,861,701	0.19
	フランス	386,609,607	0.11
	香港	241,589,768	0.07
	イギリス	222,756,624	0.06
	シンガポール	159,008,531	0.05
	カナダ	66,509,637	0.02
	小計	8,994,382,283	2.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,939,865,838	1.69
合計(純資産総額)		352,304,996,616	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	3,775,264,446	1.07
	買建	カナダ	208,021,564	0.06
	買建	ドイツ	917,612,138	0.26
	買建	イギリス	390,918,650	0.11
	買建	オーストラリア	224,307,211	0.06

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		706,150,280	0.20

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	618,610	13,598.78	8,412,345,255	14,460.02	8,945,118,230	2.54
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	402,575	19,211.41	7,734,034,066	21,529.97	8,667,429,525	2.46
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,539	197,948.78	7,034,902,037	205,262.34	7,294,818,344	2.07
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	203,629	19,866.77	4,045,451,506	20,426.20	4,159,367,698	1.18
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	227,778	14,774.77	3,365,368,768	15,164.97	3,454,247,698	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,755	11,697.37	3,237,305,856	11,731.86	3,246,851,911	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,644	122,250.02	3,257,229,759	115,983.11	3,090,254,193	0.88
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,292	122,833.17	3,106,696,596	116,049.94	2,935,135,277	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	358,711	7,826.63	2,807,498,956	8,172.63	2,931,615,078	0.83
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	261,828	10,903.62	2,854,874,064	11,106.85	2,908,084,845	0.83

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,028	17,646.30	2,629,792,931	18,456.88	2,750,592,166	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	109,623	21,525.66	2,359,707,755	22,853.63	2,505,284,117	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	210,947	11,259.74	2,375,209,091	11,833.18	2,496,175,129	0.71
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	789,496	3,007.34	2,374,283,690	3,040.75	2,400,664,620	0.68
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	152,138	14,295.10	2,174,829,414	15,015.14	2,284,374,434	0.65
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	374,632	5,813.11	2,177,778,786	6,007.13	2,250,465,636	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	616,020	3,441.73	2,120,177,409	3,554.91	2,189,898,245	0.62
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	467,485	4,516.40	2,111,349,722	4,681.31	2,188,446,740	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	77,757	27,317.21	2,124,105,053	28,143.96	2,188,390,598	0.62
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,621	26,091.64	2,129,626,353	26,552.98	2,167,281,483	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	349,784	6,330.50	2,214,309,956	6,170.97	2,158,509,194	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	161,747	12,752.63	2,062,700,437	13,270.02	2,146,387,041	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,597	20,647.17	1,973,807,940	22,314.68	2,133,217,018	0.61
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	220,538	8,651.22	1,907,923,947	9,036.03	1,992,789,241	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	386,406	4,696.41	1,814,721,118	5,115.71	1,976,742,352	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	342,026	5,292.48	1,810,168,843	5,505.91	1,883,165,468	0.53
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	184,125	9,770.40	1,798,976,189	9,853.24	1,814,228,644	0.51
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	363,409	4,914.14	1,785,844,920	4,989.59	1,813,265,219	0.51
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	59,430	29,694.48	1,764,743,095	30,213.59	1,795,594,099	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,639	38,252.51	1,745,806,541	39,237.71	1,790,770,111	0.51

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.95
		素材	4.45



資本財	7.00
商業・専門サービス	1.23
運輸	1.91
自動車・自動車部品	1.11
耐久消費財・アパレル	1.84
消費者サービス	1.88
メディア・娯楽	5.75
小売	4.81
食品・生活必需品小売り	1.46
食品・飲料・タバコ	4.84
家庭用品・パーソナル用品	2.09
ヘルスケア機器・サービス	4.72
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.99
銀行	7.68
各種金融	4.20
保険	3.94
不動産	0.58
ソフトウェア・サービス	9.47
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.24
電気通信サービス	2.31
公益事業	3.39
半導体・半導体製造装置	2.84
小計	95.69
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.55
合計	98.31

(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	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	239	アメリカドル	34,624,328	3,732,156,315	35,024,255	3,775,264,446	1.07
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	13	カナダドル	2,537,086.5	208,878,331	2,526,680	208,021,564	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	21	スイスフラン	2,094,687	231,358,179	2,064,090	227,978,740	0.06

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	164	ユーロ	5,654,208	692,583,937	5,630,120	689,633,398	0.20
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	18	オーストラリアドル	2,923,776	220,715,850	2,971,350	224,307,211	0.06
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	39	イギリスポンド	2,879,756.25	393,288,310	2,862,405	390,918,650	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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	5,666,000.00	610,112,520	610,493,400	0.17
	ユーロ	売建	781,000.00	95,620,268	95,656,880	0.03

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

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

## 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	174,263,094,956	46.17
	フランス	37,175,267,630	9.85
	イタリア	32,660,799,860	8.65
	ドイツ	24,704,313,950	6.55
	イギリス	23,712,494,420	6.28
	スペイン	21,686,533,893	5.75
	ベルギー	9,391,227,006	2.49
	オランダ	7,490,018,685	1.98
	オーストラリア	7,484,104,130	1.98
	カナダ	7,348,069,556	1.95
	オーストリア	5,517,982,741	1.46
	メキシコ	3,110,341,797	0.82
	アイルランド	2,750,344,128	0.73
	ポーランド	2,268,681,492	0.60
	フィンランド	2,202,598,025	0.58
	南アフリカ	2,135,503,600	0.57
	デンマーク	1,915,697,527	0.51

	マレーシア	1,722,341,469	0.46
	シンガポール	1,527,928,987	0.40
	スウェーデン	1,323,369,072	0.35
	ノルウェー	926,790,229	0.25
	小計	371,317,503,153	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,082,675,082	1.61
合計(純資産総額)		377,400,178,235	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,103,277,808	0.29
	買建	ドイツ	1,303,000,236	0.35

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		3,109,491,270	0.82

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.625% 07/31/20	24,000,000	10,724.01	2,573,762,414	10,743.21	2,578,370,491	1.625	2020/7/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,140.74	2,228,148,648	11,188.26	2,237,653,031	2.750	2023/5/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,016.08	2,065,516,599	11,131.84	2,087,220,728	2.375	2027/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,203.69	2,016,664,668	11,281.73	2,030,713,083	2.625	2026/1/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,849.16	2,007,095,947	10,880.89	2,012,965,627	2.125	2021/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	19,200,000	9,936.79	1,907,864,473	10,176.04	1,953,801,540	2.250	2046/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,651.42	1,863,998,571	10,781.52	1,886,767,117	1.750	2023/5/15	0.50

アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,093.10	1,852,548,844	11,278.37	1,883,487,942	2.625	2025/12/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,333.95	1,804,364,861	11,569.74	1,841,902,728	2.875	2028/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,602.05	1,736,828,040	11,829.95	1,770,943,889	3.000	2049/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,366.36	1,710,450,456	10,714.99	1,767,974,948	2.500	2046/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,325.95	1,698,892,509	11,507.42	1,726,113,699	3.000	2025/9/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,359.62	1,657,540,725	10,709.94	1,713,591,525	2.500	2046/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/20	15,970,000	10,691.14	1,707,375,084	10,711.42	1,710,613,890	1.375	2020/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	15,000,000	11,243.35	1,686,503,898	11,354.16	1,703,124,114	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,569.74	1,666,042,669	11,810.58	1,700,724,101	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/43	12,500,000	12,966.05	1,620,757,118	13,260.69	1,657,587,048	3.750	2043/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	10,963.32	1,644,498,135	11,018.58	1,652,787,014	2.250	2024/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	10,992.53	1,648,879,799	11,016.47	1,652,471,227	2.375	2023/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,330.58	1,615,740,949	11,563.00	1,648,884,353	2.875	2028/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	10,895.21	1,634,281,665	10,981.10	1,647,165,938	2.500	2022/1/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,750.43	1,617,940,565	10,780.26	1,622,429,609	1.750	2021/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,798.36	1,581,960,995	11,022.36	1,614,777,155	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,721.54	1,608,232,190	10,741.10	1,611,165,770	1.625	2022/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,716.26	1,569,932,511	10,829.10	1,586,463,960	1.875	2022/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/20	13,950,000	10,798.36	1,506,372,415	10,827.84	1,510,484,006	2.500	2020/5/31	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000	13,259.66	1,507,623,828	13,243.19	1,505,750,713	3.750	2021/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000	13,389.68	1,452,781,162	13,380.01	1,451,731,239	3.250	2021/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,762.77	1,411,532,687	12,017.74	1,442,129,154	3.125	2044/8/15	0.38
ドイツ	国債証券	DBR 3% 07/04/20	11,340,000	12,729.41	1,443,515,928	12,707.05	1,440,979,623	3.000	2020/7/4	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.39
合計	98.39

(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	38	アメリカ ドル	4,466,006.83	481,390,876	4,489,937.5	483,970,363	0.13
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	23	アメリカ ドル	2,922,306.77	314,995,447	2,942,562.5	317,178,812	0.08
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	18	アメリカ ドル	2,770,572	298,639,956	2,802,937.5	302,128,633	0.08

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	17	ユーロ	1,906,483	233,525,102	1,908,505	233,772,777	0.06
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	20	ユーロ	2,681,710	328,482,658	2,687,400	329,179,626	0.09
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	35	ユーロ	6,003,390	735,355,241	6,041,700	740,047,833	0.20

(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	14,303,000.00	1,545,763,741	1,538,859,770	0.41
	カナダドル	買建	1,070,000.00	87,478,804	87,964,700	0.02
	ユーロ	買建	10,280,000.00	1,262,336,896	1,258,888,800	0.33
	イギリスポンド	買建	1,640,000.00	225,678,630	223,778,000	0.06

(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	8,670,948,857	15.82
	韓国	6,579,641,830	12.00
	中国	5,923,789,640	10.81
	台湾	5,746,118,713	10.48
	インド	4,832,799,842	8.82
	ブラジル	3,954,014,345	7.21
	南アフリカ	2,993,548,432	5.46
	ロシア	2,131,494,707	3.89
	香港	1,775,940,359	3.24
	タイ	1,573,028,356	2.87
	メキシコ	1,295,100,022	2.36
	マレーシア	1,154,257,539	2.11
	インドネシア	1,143,240,675	2.09
	サウジアラビア	725,953,114	1.32
	ポーランド	603,007,883	1.10

	フィリピン	592,709,035	1.08
	バミューダ	539,714,275	0.98
	カタール	526,850,181	0.96
	チリ	495,772,084	0.90
	アラブ首長国連邦	368,792,075	0.67
	トルコ	272,552,573	0.50
	コロンビア	226,403,200	0.41
	アメリカ	188,127,012	0.34
	ギリシャ	157,897,973	0.29
	ハンガリー	153,689,295	0.28
	アルゼンチン	143,280,809	0.26
	チェコ	93,281,687	0.17
	エジプト	67,790,801	0.12
	ルクセンブルク	53,336,209	0.10
	マン島	30,543,032	0.06
	ペルー	30,183,593	0.06
	シンガポール	29,198,601	0.05
	パキスタン	17,783,934	0.03
	ジャージー	13,240,019	0.02
	小計	53,104,030,702	96.88
投資信託受益証券	ブラジル	109,322,664	0.20
	メキシコ	29,113,915	0.05
	小計	138,436,579	0.25
投資証券	南アフリカ	100,386,266	0.18
	メキシコ	44,006,151	0.08
	小計	144,392,417	0.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,427,874,462	2.60
合計(純資産総額)		54,814,734,160	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,354,660,526	2.47

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		280,150,000	0.51
	売建		46,200,000	0.08

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	513,900	3,874.02	1,990,861,294	4,865.11	2,500,181,057	4.56
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	125,894	15,860.22	1,996,707,785	18,421.31	2,319,132,527	4.23
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	429,313	4,126.64	1,771,620,745	4,338.45	1,862,552,985	3.40
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,207,389	801.01	1,768,151,258	834.53	1,842,143,379	3.36
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	39,483	20,184.15	796,931,031	25,609.33	1,011,133,571	1.84
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,580,620	88.66	760,841,002	92.11	790,422,689	1.44
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	474,000	1,064.89	504,762,113	1,296.94	614,754,063	1.12
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	557,500	1,009.15	562,602,352	984.60	548,917,845	1.00
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	254,198	1,725.17	438,537,000	2,000.41	508,501,619	0.93
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	147,455	2,865.14	422,479,233	3,446.85	508,256,225	0.93
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,109,515	73.91	451,581,135	78.32	478,541,203	0.87
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	442,781	958.79	424,536,106	1,021.88	452,472,369	0.83
ブラジル	株式	VALE SA	素材	285,178	1,537.76	438,536,604	1,457.42	415,624,976	0.76
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	507,578	487.21	247,297,483	790.10	401,037,733	0.73
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	365,953	845.97	309,587,781	1,068.40	390,984,551	0.71
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	233,869	1,288.09	301,244,437	1,668.58	390,231,288	0.71
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	38,742	8,142.45	315,455,053	9,211.73	356,880,975	0.65
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	308,929	1,040.53	321,450,881	1,146.96	354,330,287	0.65
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	46.19	342,232,912	45.36	336,103,367	0.61
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	50,048	6,754.98	338,073,458	6,549.66	327,797,384	0.60
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	24,875	19,757.90	491,477,937	12,507.95	311,135,296	0.57
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,626,000	185.71	301,979,400	185.61	301,807,388	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	1,113,248	262.60	292,349,612	268.57	298,993,921	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	80,692	2,997.44	241,869,751	3,536.50	285,367,540	0.52
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	341,340	719.40	245,562,999	767.61	262,017,260	0.48
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	73,732	3,466.29	255,576,838	3,545.40	261,409,433	0.48
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SERL	電気通信サービス	3,037,840	81.88	248,748,667	79.07	240,212,337	0.44
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	278,100	789.88	219,668,340	842.59	234,326,810	0.43
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	412,820	564.99	233,242,119	560.05	231,201,038	0.42
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	68,369	2,339.04	159,918,031	3,264.95	223,221,989	0.41

(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	7.81
		素材	7.29
		資本財	3.11
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	2.31
		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	7.02
		小売	8.18
		食品・生活必需品小売り	1.61
		食品・飲料・タバコ	3.58
		家庭用品・パーソナル用品	1.11
		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	1.86
		銀行	18.18
		各種金融	2.58
		保険	3.76
		不動産	2.59
ソフトウェア・サービス	1.86		
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.76		
電気通信サービス	4.51		
公益事業	2.56		



		半導体・半導体製造装置	4.87
		小計	96.88
投資信託受益証券			0.25
投資証券			0.26
合計			97.40

(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	238	アメリカドル	12,152,051	1,309,869,577	12,567,590	1,354,660,526	2.47

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,600,000.00	279,942,000	280,150,000	0.51
	メキシコペソ	売建	3,500,000.00	19,642,000	19,635,000	0.04
	南アフリカランド	売建	3,500,000.00	26,568,500	26,565,000	0.05

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

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

#### 新興国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	4,931,830,570	9.84
	インドネシア	4,925,828,265	9.83
	ブラジル	4,888,060,175	9.75
	ポーランド	4,384,024,383	8.75
	タイ	4,245,237,650	8.47
	南アフリカ	4,116,129,898	8.21

	ロシア	3,930,251,531	7.84
	コロンビア	3,408,498,138	6.80
	マレーシア	2,983,429,957	5.95
	チェコ	2,161,839,807	4.31
	ハンガリー	2,021,216,376	4.03
	トルコ	1,853,067,936	3.70
	ペルー	1,729,790,759	3.45
	チリ	1,553,080,041	3.10
	フィリピン	141,607,672	0.28
	ウルグアイ	101,081,250	0.20
	ドミニカ共和国	43,077,574	0.09
	小計	47,418,051,982	94.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,691,480,525	5.37
合計(純資産総額)		50,109,532,507	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		5,288,634	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。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	54,050,000,000	4.15	2,247,552,496	4.24	2,293,094,788	9.850	2027/6/28	4.58
チリ	国債証券	CHILE 5.5% 08/05/20	9,530,000,000	16.30	1,553,784,983	16.29	1,553,080,041	5.500	2020/8/5	3.10
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000	2,888.85	827,656,041	3,099.62	888,042,369	10.000	2023/1/1	1.77
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/20	32,750,000	2,501.82	819,348,735	2,662.31	871,909,793	0.000	2020/7/1	1.74
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.18	752,926,639	3.28	776,860,699	4.375	2023/3/21	1.55
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000	819.04	712,160,780	860.32	748,051,544	10.500	2026/12/21	1.49
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	23,800,000	2,931.04	697,588,435	2,976.12	708,317,831	10.000	2021/1/1	1.41

タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	357.90	630,263,648	397.82	700,561,900	3.400	2036/6/17	1.40
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,915.59	616,648,562	2,948.89	623,690,396	2.500	2023/1/25	1.24
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	18,600,000	2,888.65	537,289,771	3,174.70	590,495,759	10.000	2025/1/1	1.18
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	368.28	504,180,796	400.98	548,947,780	3.650	2031/6/20	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	597.02	491,050,785	625.79	514,716,741	10.000	2024/12/5	1.03
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000	672.34	500,221,020	683.55	508,565,217	8.750	2048/2/28	1.01
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	534.77	490,387,676	551.60	505,822,528	6.500	2021/6/10	1.01
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	15,000,000	2,812.23	421,835,160	3,223.17	483,476,107	10.000	2027/1/1	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000	518.11	441,952,674	560.25	477,895,110	7.500	2027/6/3	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	77,600,000	549.15	426,143,061	573.52	445,058,838	8.000	2023/12/7	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	525.84	426,982,894	547.60	444,657,030	6.500	2022/6/9	0.89
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	14,950,000	2,781.10	415,774,663	2,934.01	438,634,555	2.500	2026/7/25	0.88
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000	2,179.87	389,107,560	2,414.11	430,920,118	0.000	2022/1/1	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	410.99	390,448,100	434.91	413,167,825	4.875	2029/6/22	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000	2,748.59	384,803,235	2,923.94	409,351,782	2.500	2027/7/25	0.82
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000	0.77	375,574,553	0.81	393,040,971	8.375	2024/3/15	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,954.76	375,255,580	3,067.40	389,559,889	3.250	2025/7/25	0.78
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.77	350,999,303	0.81	368,161,448	8.375	2026/9/15	0.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000	670.01	358,458,560	684.29	366,096,541	8.750	2044/1/31	0.73
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	14,600,000	2,292.44	334,696,695	2,502.46	365,359,302	0.000	2021/7/1	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000	545.94	351,045,345	558.92	359,391,135	7.250	2021/12/9	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000	345.65	344,614,296	350.93	349,879,952	1.875	2022/6/17	0.70
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	58,000,000	564.50	327,413,414	596.99	346,255,899	8.500	2029/5/31	0.69

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	94.63
合計	94.63

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	ハンガリーフォリント	売建	13,980,000.00	5,284,440	5,288,634	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。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2017年8月25日

作成基準日：2019年6月28日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,591円
純資産総額	18.78億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2018年6月	2019年6月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

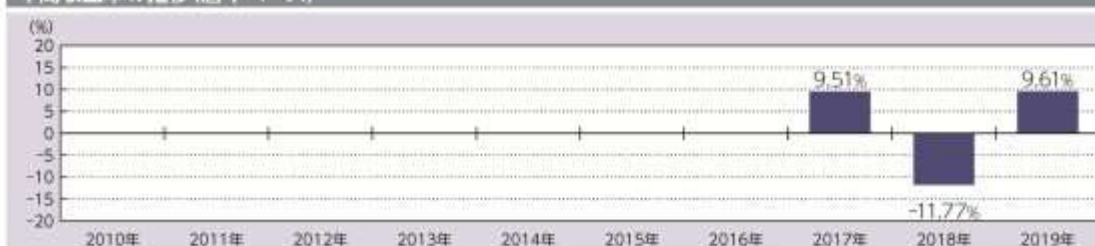
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位銘柄銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	42.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア・ソフトウェア	-	-	1.0%
新興国株式 インデックス マザーファンド	29.0%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	1.3%
		ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	1.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	13.1%	T 1.625% 07/31/20	アメリカ	国債	-	1.625%	2020/07/31	0.1%
		T 2.75% 05/31/23	アメリカ	国債	-	2.750%	2023/05/31	0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	9.7%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
		CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	国債	-	5.500%	2020/08/05	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	4.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	0.8%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.0%
		第136回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）



### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

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

##### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

###### マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

###### マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

###### （イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### （ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

###### 外貨建資産等の円換算

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

##### < 基準価額の照会方法 >

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

###### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2017年 8月25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6月11日から翌年6月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2018年6月12日から2019年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2018年 6月11日現在）	第2期 （2019年 6月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	275,342	-
コール・ローン	17,020,654	16,906,110
親投資信託受益証券	1,489,378,603	1,809,958,133
未収入金	-	10,842,236
流動資産合計	1,506,674,599	1,837,706,479
資産合計		
	1,506,674,599	1,837,706,479
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,629	5,456,540
未払受託者報酬	220,726	481,231
未払委託者報酬	2,207,294	4,812,247
未払利息	45	35
その他未払費用	22,257	48,063
流動負債合計	2,456,951	10,798,116
負債合計		
	2,456,951	10,798,116
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,414,189,671	1,761,088,776
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	90,027,977	65,819,587
（分配準備積立金）	14,133,811	44,568,595
元本等合計	1,504,217,648	1,826,908,363
純資産合計		
	1,504,217,648	1,826,908,363
負債純資産合計		
	1,506,674,599	1,837,706,479

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2017年 8月25日 至 2018年 6月11日	自	2018年 6月12日 至 2019年 6月10日
営業収益				
受取利息		5		8
有価証券売買等損益		13,484,481		14,023,180
営業収益合計		13,484,476		14,023,172
営業費用				
支払利息		7,428		15,513
受託者報酬		372,516		911,636
委託者報酬		3,725,087		9,116,272
その他費用		37,503		91,766
営業費用合計		4,142,534		10,135,187
営業利益又は営業損失( )		17,627,010		24,158,359
経常利益又は経常損失( )		17,627,010		24,158,359
当期純利益又は当期純損失( )		17,627,010		24,158,359
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		3,723,727		3,468,676
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		90,027,977
剰余金増加額又は欠損金減少額		155,032,102		39,328,952
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		155,032,102		39,328,952
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,653,388		35,910,307
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,653,388		35,910,307
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		90,027,977		65,819,587



## ( 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6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第2期計算期間は2018年 6月12日から2019年 6月10日までとなっております。

( 貸借対照表に関する注記 )

	第1期 (2018年 6月11日現在)	第2期 (2019年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,414,189,671口	1,761,088,776口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0637円 (10,637円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0374円 (10,374円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期 自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日			第2期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	14,133,811円	費用控除後の配当等収益額	A	34,736,063円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	75,894,166円	収益調整金額	C	21,250,992円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	9,832,532円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	90,027,977円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	65,819,587円
当ファンドの期末残存口数	F	1,414,189,671口	当ファンドの期末残存口数	F	1,761,088,776口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	636円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	373円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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2期 (2019年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 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	第2期
	自 2017年 8月25日 至 2018年 6月11日	自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	1,414,189,671円
期中追加設定元本額	1,987,723,866円	972,552,858円
期中一部解約元本額	574,034,195円	625,653,753円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	(2018年 6月11日現在)	(2019年 6月10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	12,144,627	17,948,052
合計	12,144,627	17,948,052

## （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	194,267,433	518,188,950	
	国内株式インデックス マザーファンド	54,358,974	77,662,666	
	外国株式インデックス マザーファンド	307,024,434	779,811,359	
	国内債券インデックス マザーファンド	10,018,960	14,311,082	
	外国債券インデックス マザーファンド	88,252,702	244,548,237	
	新興国債券インデックス マザーファンド	105,888,363	175,435,839	
合計		759,810,866	1,809,958,133	

(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 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,121,757,170
株式	272,077,325,220
派生商品評価勘定	68,755,170
未収入金	4,445,900
未収配当金	2,287,744,976
差入委託証拠金	205,610,000
流動資産合計	278,765,638,436
資産合計	278,765,638,436
負債の部	
流動負債	
前受金	68,755,170
未払金	1,431,692,380
未払解約金	540,212,329
未払利息	8,565

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	2,040,668,444
負債合計	2,040,668,444
純資産の部	
元本等	
元本	193,692,560,770
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	83,032,409,222
元本等合計	276,724,969,992
純資産合計	276,724,969,992
負債純資産合計	278,765,638,436

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 6月10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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	193,692,560,770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 1.4287円 (1万口当たり純資産額) (14,287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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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 6月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	131,918,382,031円
期中追加設定元本額	77,825,191,751円
期中一部解約元本額	16,051,013,012円
期末元本額	193,692,560,770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）	611,454,308円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,988,589,645円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,975,519円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,933,077,127円
世界経済インデックスファンド	2,010,807,500円
日本株式インデックス・オープン	5,425,882,142円
DCマイセレクション25	6,706,776,618円
DCマイセレクション50	19,092,641,814円
DCマイセレクション75	17,575,799,433円
DC日本株式インデックス・オープン	5,577,819,155円

区分	2019年 6月10日現在
DCマイセレクションS25	2,719,510,173円
DCマイセレクションS50	7,811,564,330円
DCマイセレクションS75	5,065,587,274円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,344,269,209円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	377,285,516円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	642,382,947円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	422,969,920円
DC世界経済インデックスファンド	1,764,261,855円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,130,239,933円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	16,342,633円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	43,826,513円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	41,876,524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）	305,679,025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）	109,553,402円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	384,463,278円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	64,480,138円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	547,086,891円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,908,077,990円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	758,076,556円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,377,310,436円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	679,149,541円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	49,978,708円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	850,275,616円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,847,094円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	481,271,565円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	602,754,780円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	56,015,261円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	910,300,890円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,162,966,236円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,376,549,350円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	1,030,901,947円
分散投資コア戦略ファンドS	2,177,045,792円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,825,074円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	263,862,541円
コア投資戦略ファンド（切替型）	579,919,294円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,961,101円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,202,686円
SMT インデックスバランス・オープン	76,484,511円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,820,304,270円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	673,595,588円



区分	2019年 6月10日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	12,219,671円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	54,358,974円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	7,999,765円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,200,968円
グローバル経済コア	320,922,395円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	10,229,143円
i - S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	46,162,889円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,122,715円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	147,126,210円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	23,429,560円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	54,470,374,276円
F O F s 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)	669,235,112円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		2,923,861,298
合計		2,923,861,298

(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 6月10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	4,553,264,830	-	4,622,020,000	68,755,170
	合計	4,553,264,830	-	4,622,020,000	68,755,170

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,400	2,667.00	14,401,800	
日本水産	165,700	654.00	108,367,800	
マルハニチロ	23,900	3,255.00	77,794,500	
カネコ種苗	5,000	1,284.00	6,420,000	
サカタのタネ	20,200	3,385.00	68,377,000	
ホクト	13,900	1,815.00	25,228,500	
ホクリヨウ	2,200	610.00	1,342,000	
住石ホールディングス	35,700	118.00	4,212,600	
日鉄鉱業	3,800	4,260.00	16,188,000	
三井松島ホールディングス	6,900	1,261.00	8,700,900	
国際石油開発帝石	664,900	898.70	597,545,630	
石油資源開発	23,800	2,340.00	55,692,000	
K & O エナジーグループ	8,000	1,682.00	13,456,000	
ヒノキヤグループ	4,600	2,165.00	9,959,000	
ショーボンドホールディングス	11,800	7,830.00	92,394,000	
ミライト・ホールディングス	46,600	1,698.00	79,126,800	
タマホーム	8,000	1,001.00	8,008,000	
サンヨーホームズ	2,400	663.00	1,591,200	
日本アクア	5,300	467.00	2,475,100	
ファーストコーポレーション	5,100	777.00	3,962,700	
ベステラ	3,200	1,377.00	4,406,400	
T A T E R U	20,200	235.00	4,747,000	
スペースバリューホールディングス	20,200	511.00	10,322,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	620.00	1,984,000	
第一カッター興業	2,000	1,805.00	3,610,000	
安藤・間	107,200	762.00	81,686,400	
東急建設	49,400	774.00	38,235,600	
コムシスホールディングス	58,800	2,700.00	158,760,000	
ミサワホーム	13,700	1,020.00	13,974,000	
ピーアールホールディングス	18,100	336.00	6,081,600	
高松コンストラクショングループ	10,600	2,324.00	24,634,400	
東建コーポレーション	5,200	6,730.00	34,996,000	
ソネック	1,700	774.00	1,315,800	
ヤマウラ	7,200	851.00	6,127,200	

大成建設	136,300	4,145.00	564,963,500
大林組	410,700	1,073.00	440,681,100
清水建設	419,000	928.00	388,832,000
飛鳥建設	12,200	1,325.00	16,165,000
長谷工コーポレーション	171,500	1,127.00	193,280,500
松井建設	16,100	651.00	10,481,100
銭高組	1,700	4,590.00	7,803,000
鹿島建設	320,900	1,545.00	495,790,500
不動テトラ	9,800	1,365.00	13,377,000
大末建設	5,500	958.00	5,269,000
鉄建建設	8,500	3,000.00	25,500,000
西松建設	29,800	2,146.00	63,950,800
三井住友建設	98,600	621.00	61,230,600
大豊建設	9,500	2,814.00	26,733,000
前田建設工業	98,200	915.00	89,853,000
佐田建設	10,600	373.00	3,953,800
ナカノフドー建設	11,900	453.00	5,390,700
奥村組	22,700	3,450.00	78,315,000
東鉄工業	16,400	3,085.00	50,594,000
イチケン	2,900	1,691.00	4,903,900
富士ピー・エス	5,600	456.00	2,553,600
浅沼組	5,000	3,560.00	17,800,000
戸田建設	160,000	622.00	99,520,000
熊谷組	19,700	3,050.00	60,085,000
青木あすなろ建設	7,500	834.00	6,255,000
北野建設	3,100	2,716.00	8,419,600
植木組	2,000	2,158.00	4,316,000
矢作建設工業	18,600	737.00	13,708,200
ピーエス三菱	15,400	616.00	9,486,400
日本ハウスホールディングス	26,100	421.00	10,988,100
大東建託	48,800	14,350.00	700,280,000
新日本建設	17,000	956.00	16,252,000
N I P P O	36,200	2,210.00	80,002,000
東亜道路工業	2,600	3,045.00	7,917,000
前田道路	42,800	2,290.00	98,012,000
日本道路	3,700	6,390.00	23,643,000
東亜建設工業	11,900	1,506.00	17,921,400
日本国土開発	22,300	538.00	11,997,400
若築建設	6,900	1,390.00	9,591,000
東洋建設	50,100	422.00	21,142,200
五洋建設	162,600	518.00	84,226,800
世紀東急工業	19,900	614.00	12,218,600

福田組	4,600	4,380.00	20,148,000
住友林業	97,400	1,278.00	124,477,200
日本基礎技術	14,000	370.00	5,180,000
巴コーポレーション	18,700	363.00	6,788,100
大和ハウス工業	378,800	3,388.00	1,283,374,400
ライト工業	26,300	1,414.00	37,188,200
積水ハウス	419,100	1,783.00	747,255,300
日特建設	11,600	594.00	6,890,400
北陸電気工事	6,600	862.00	5,689,200
ユアテック	21,900	773.00	16,928,700
四電工	2,100	2,725.00	5,722,500
中電工	17,600	2,285.00	40,216,000
関電工	62,200	906.00	56,353,200
きんでん	90,900	1,736.00	157,802,400
東京エネシス	14,100	941.00	13,268,100
トーエネック	3,800	3,040.00	11,552,000
住友電設	9,500	1,800.00	17,100,000
日本電設工業	23,300	2,379.00	55,430,700
協和エクシオ	53,600	2,628.00	140,860,800
新日本空調	11,700	1,769.00	20,697,300
九電工	27,000	3,210.00	86,670,000
三機工業	31,400	1,256.00	39,438,400
日揮	118,200	1,440.00	170,208,000
中外炉工業	4,200	1,693.00	7,110,600
ヤマト	13,400	573.00	7,678,200
太平電業	9,200	2,155.00	19,826,000
高砂熱学工業	33,600	1,743.00	58,564,800
三晃金属工業	1,900	2,530.00	4,807,000
朝日工業社	3,100	2,507.00	7,771,700
明星工業	24,800	662.00	16,417,600
大気社	18,800	3,365.00	63,262,000
ダイダン	9,400	2,276.00	21,394,400
日比谷総合設備	12,300	1,861.00	22,890,300
東芝プラントシステム	29,900	2,120.00	63,388,000
OSJBホールディングス	60,300	276.00	16,642,800
東洋エンジニアリング	16,100	481.00	7,744,100
新興プランテック	24,600	1,330.00	32,718,000
日本製粉	38,800	1,809.00	70,189,200
日清製粉グループ本社	138,400	2,523.00	349,183,200
日東富士製粉	900	5,490.00	4,941,000
昭和産業	11,200	3,080.00	34,496,000
鳥越製粉	10,900	786.00	8,567,400

中部飼料	15,000	1,197.00	17,955,000
フィード・ワン	82,300	174.00	14,320,200
東洋精糖	1,900	994.00	1,888,600
日本甜菜製糖	7,000	1,930.00	13,510,000
三井製糖	9,700	2,422.00	23,493,400
塩水港精糖	13,300	209.00	2,779,700
日新製糖	5,800	1,850.00	10,730,000
森永製菓	30,800	5,000.00	154,000,000
中村屋	3,200	4,325.00	13,840,000
江崎グリコ	36,800	5,030.00	185,104,000
名糖産業	5,900	1,446.00	8,531,400
井村屋グループ	5,200	2,136.00	11,107,200
不二家	6,800	1,978.00	13,450,400
山崎製パン	100,200	1,638.00	164,127,600
第一屋製パン	2,100	1,010.00	2,121,000
モロゾフ	2,100	5,030.00	10,563,000
亀田製菓	7,600	4,970.00	37,772,000
寿スピリッツ	13,000	5,320.00	69,160,000
カルビー	55,800	3,090.00	172,422,000
森永乳業	24,500	3,925.00	96,162,500
六甲バター	8,900	2,012.00	17,906,800
ヤクルト本社	90,700	6,450.00	585,015,000
明治ホールディングス	86,800	7,620.00	661,416,000
雪印メグミルク	29,500	2,272.00	67,024,000
プリマハム	17,200	2,062.00	35,466,400
日本ハム	50,700	4,620.00	234,234,000
林兼産業	4,100	615.00	2,521,500
丸大食品	13,100	1,955.00	25,610,500
S Foods	11,000	3,690.00	40,590,000
伊藤ハム米久ホールディングス	78,900	650.00	51,285,000
サッポロホールディングス	44,800	2,308.00	103,398,400
アサヒグループホールディングス	256,500	4,927.00	1,263,775,500
キリンホールディングス	554,100	2,313.50	1,281,910,350
宝ホールディングス	91,700	1,154.00	105,821,800
オエノンホールディングス	34,800	366.00	12,736,800
養命酒製造	3,800	2,046.00	7,774,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,800	2,725.00	255,605,000
サントリー食品インターナショナル	82,000	4,550.00	373,100,000
ダイドーグループホールディングス	6,900	4,595.00	31,705,500
伊藤園	37,200	5,330.00	198,276,000
キーコーヒー	12,000	2,127.00	25,524,000
ユニカフェ	3,400	990.00	3,366,000

ジャパンフーズ	1,700	1,197.00	2,034,900
日清オイリオグループ	15,800	3,250.00	51,350,000
不二製油グループ本社	29,900	3,210.00	95,979,000
かどや製油	1,300	4,140.00	5,382,000
J・オイルミルズ	6,300	4,170.00	26,271,000
キッコーマン	80,800	4,650.00	375,720,000
味の素	270,500	1,891.50	511,650,750
キューピー	68,200	2,465.00	168,113,000
ハウス食品グループ本社	45,800	4,395.00	201,291,000
カゴメ	49,100	2,525.00	123,977,500
焼津水産化学工業	5,900	1,116.00	6,584,400
アリアケジャパン	11,200	7,100.00	79,520,000
ピエトロ	1,600	1,618.00	2,588,800
エバラ食品工業	3,000	2,194.00	6,582,000
ニチレイ	63,600	2,700.00	171,720,000
東洋水産	63,000	4,380.00	275,940,000
イトアンド	4,200	1,655.00	6,951,000
大冷	1,400	1,817.00	2,543,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	885.00	2,920,500
日清食品ホールディングス	52,100	6,670.00	347,507,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,245.00	14,592,500
一正蒲鉾	4,800	1,130.00	5,424,000
フジッコ	13,300	2,144.00	28,515,200
ロック・フィールド	13,200	1,517.00	20,024,400
日本たばこ産業	707,300	2,514.00	1,778,152,200
ケンコーマヨネーズ	6,900	2,328.00	16,063,200
わらべや日洋ホールディングス	8,000	1,677.00	13,416,000
なとり	6,800	1,590.00	10,812,000
イフジ産業	2,100	664.00	1,394,400
ピクルスコーポレーション	2,900	1,906.00	5,527,400
北の達人コーポレーション	48,100	608.00	29,244,800
ユーグレナ	52,200	889.00	46,405,800
ミヨシ油脂	4,700	1,120.00	5,264,000
理研ビタミン	5,800	3,495.00	20,271,000
片倉工業	14,800	1,299.00	19,225,200
ゲンゼ	8,100	4,865.00	39,406,500
東洋紡	50,700	1,243.00	63,020,100
ユニチカ	35,300	375.00	13,237,500
富士紡ホールディングス	6,300	2,330.00	14,679,000
倉敷紡績	11,500	1,959.00	22,528,500
シキボウ	6,300	926.00	5,833,800
日本毛織	39,400	871.00	34,317,400

トーア紡コーポレーション	5,100	455.00	2,320,500
帝国繊維	13,500	2,290.00	30,915,000
帝人	97,600	1,824.00	178,022,400
東レ	927,400	810.80	751,935,920
サカイオーベックス	3,000	1,690.00	5,070,000
住江織物	3,500	2,995.00	10,482,500
日本フェルト	7,000	472.00	3,304,000
イチカワ	1,800	1,428.00	2,570,400
日東製網	1,400	1,383.00	1,936,200
アツギ	10,000	922.00	9,220,000
ダイニック	4,800	765.00	3,672,000
セーレン	29,500	1,492.00	44,014,000
ソトー	4,900	977.00	4,787,300
東海染工	1,700	1,122.00	1,907,400
小松マテーレ	19,800	805.00	15,939,000
ワコールホールディングス	34,900	2,840.00	99,116,000
ホギメディカル	14,900	3,465.00	51,628,500
レナウン	34,500	101.00	3,484,500
クラウドシアホールディングス	3,200	504.00	1,612,800
T S Iホールディングス	44,300	662.00	29,326,600
マツオカコーポレーション	3,800	2,698.00	10,252,400
ワールド	15,700	2,196.00	34,477,200
三陽商会	7,200	1,645.00	11,844,000
ナイガイ	4,600	494.00	2,272,400
オンワードホールディングス	72,000	602.00	43,344,000
ルックホールディングス	4,400	1,349.00	5,935,600
ゴールドウイン	10,800	13,910.00	150,228,000
デサント	29,200	1,907.00	55,684,400
キング	6,500	644.00	4,186,000
ヤマトインターナショナル	7,800	418.00	3,260,400
特種東海製紙	7,600	3,775.00	28,690,000
王子ホールディングス	538,100	583.00	313,712,300
日本製紙	57,300	1,872.00	107,265,600
三菱製紙	19,500	583.00	11,368,500
北越コーポレーション	79,300	560.00	44,408,000
中越パルプ工業	5,100	1,483.00	7,563,300
巴川製紙所	3,900	952.00	3,712,800
大王製紙	58,200	1,260.00	73,332,000
阿波製紙	3,100	443.00	1,373,300
レンゴー	123,200	857.00	105,582,400
トーモク	7,300	1,752.00	12,789,600
ザ・パックス	9,000	3,070.00	27,630,000

クラレ	201,700	1,308.00	263,823,600
旭化成	850,300	1,160.50	986,773,150
共和レザー	7,500	806.00	6,045,000
昭和電工	79,400	3,170.00	251,698,000
住友化学	940,900	486.00	457,277,400
住友精化	5,800	3,385.00	19,633,000
日産化学	73,400	4,710.00	345,714,000
ラサ工業	4,200	1,348.00	5,661,600
クレハ	11,000	7,450.00	81,950,000
多木化学	3,500	4,445.00	15,557,500
テイカ	9,700	2,414.00	23,415,800
石原産業	23,000	1,181.00	27,163,000
片倉コープアグリ	3,500	1,111.00	3,888,500
日東エフシー	8,300	1,198.00	9,943,400
日本曹達	18,900	2,712.00	51,256,800
東ソー	184,800	1,417.00	261,861,600
トクヤマ	34,400	2,532.00	87,100,800
セントラル硝子	26,100	2,414.00	63,005,400
東亜合成	75,000	1,231.00	92,325,000
大阪ソーダ	12,900	2,738.00	35,320,200
関東電化工業	28,300	749.00	21,196,700
デンカ	47,000	3,170.00	148,990,000
信越化学工業	210,600	9,316.00	1,961,949,600
日本カーバイド工業	4,000	1,323.00	5,292,000
堺化学工業	8,000	2,628.00	21,024,000
第一稀元素化学工業	13,000	847.00	11,011,000
エア・ウォーター	97,900	1,730.00	169,367,000
大陽日酸	98,500	2,162.00	212,957,000
日本化学工業	4,100	1,839.00	7,539,900
東邦アセチレン	1,800	1,338.00	2,408,400
日本パーカライジング	65,300	1,288.00	84,106,400
高压ガス工業	19,000	836.00	15,884,000
チタン工業	1,500	2,870.00	4,305,000
四国化成工業	20,100	1,083.00	21,768,300
戸田工業	2,500	2,209.00	5,522,500
ステラ ケミファ	7,000	3,070.00	21,490,000
保土谷化学工業	4,100	2,682.00	10,996,200
日本触媒	20,100	6,880.00	138,288,000
大日精化工業	9,900	3,050.00	30,195,000
カネカ	30,900	3,940.00	121,746,000
三菱瓦斯化学	122,900	1,411.00	173,411,900
三井化学	108,500	2,575.00	279,387,500



J S R	119,900	1,630.00	195,437,000
東京応化工業	20,500	3,360.00	68,880,000
大阪有機化学工業	11,100	993.00	11,022,300
三菱ケミカルホールディングス	799,100	742.60	593,411,660
K Hネオケム	18,200	2,840.00	51,688,000
ダイセル	176,100	985.00	173,458,500
住友ベークライト	20,700	3,870.00	80,109,000
積水化学工業	261,300	1,622.00	423,828,600
日本ゼオン	107,800	1,139.00	122,784,200
アイカ工業	35,900	3,730.00	133,907,000
宇部興産	60,400	2,173.00	131,249,200
積水樹脂	19,700	2,120.00	41,764,000
タキロンシーアイ	25,900	656.00	16,990,400
旭有機材	8,300	1,388.00	11,520,400
日立化成	55,300	3,090.00	170,877,000
ニチバン	6,300	2,425.00	15,277,500
リケンテクノス	32,600	496.00	16,169,600
大倉工業	6,100	1,733.00	10,571,300
積水化成成品工業	17,800	740.00	13,172,000
群栄化学工業	3,100	2,526.00	7,830,600
タイガースポリマー	6,400	589.00	3,769,600
ミライアル	3,500	1,175.00	4,112,500
ダイキアクシス	4,300	858.00	3,689,400
ダイキョーニシカワ	25,300	850.00	21,505,000
竹本容器	4,300	1,159.00	4,983,700
森六ホールディングス	6,500	2,492.00	16,198,000
日本化薬	76,100	1,290.00	98,169,000
カーリットホールディングス	12,900	666.00	8,591,400
日本精化	9,600	1,301.00	12,489,600
扶桑化学工業	12,100	2,089.00	25,276,900
トリケミカル研究所	2,700	4,615.00	12,460,500
A D E K A	58,900	1,615.00	95,123,500
日油	45,000	4,000.00	180,000,000
新日本理化	21,600	201.00	4,341,600
ハリマ化成グループ	9,900	1,012.00	10,018,800
花王	296,300	8,641.00	2,560,328,300
第一工業製薬	4,500	3,385.00	15,232,500
石原ケミカル	3,100	1,567.00	4,857,700
日華化学	4,100	861.00	3,530,100
ニイタカ	1,900	1,433.00	2,722,700
三洋化成工業	8,000	5,840.00	46,720,000
有機合成薬品工業	9,400	225.00	2,115,000

大日本塗料	13,500	1,030.00	13,905,000
日本ペイントホールディングス	98,600	4,355.00	429,403,000
関西ペイント	134,300	2,159.00	289,953,700
神東塗料	9,800	170.00	1,666,000
中国塗料	39,300	972.00	38,199,600
日本特殊塗料	8,900	1,245.00	11,080,500
藤倉化成	16,100	590.00	9,499,000
太陽ホールディングス	9,800	3,320.00	32,536,000
D I C	54,100	2,785.00	150,668,500
サカタインクス	26,100	981.00	25,604,100
東洋インキS Cホールディングス	25,300	2,375.00	60,087,500
T & K T O K A	9,300	972.00	9,039,600
富士フィルムホールディングス	253,500	5,381.00	1,364,083,500
資生堂	242,500	8,358.00	2,026,815,000
ライオン	170,000	2,139.00	363,630,000
高砂香料工業	8,400	3,025.00	25,410,000
マンダム	27,500	2,671.00	73,452,500
ミルボン	15,100	5,460.00	82,446,000
ファンケル	54,400	2,981.00	162,166,400
コーセー	20,700	17,910.00	370,737,000
コタ	6,400	1,197.00	7,660,800
シーボン	1,500	2,405.00	3,607,500
ポーラ・オルビスホールディングス	52,100	3,135.00	163,333,500
ノエビアホールディングス	11,700	6,100.00	71,370,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	929.00	2,601,200
エステー	8,700	1,728.00	15,033,600
アグロ カネショウ	5,000	2,101.00	10,505,000
コニシ	21,600	1,607.00	34,711,200
長谷川香料	16,200	1,850.00	29,970,000
星光P M C	8,200	736.00	6,035,200
小林製薬	34,200	8,160.00	279,072,000
荒川化学工業	11,000	1,268.00	13,948,000
メック	8,400	1,073.00	9,013,200
日本高純度化学	3,400	2,358.00	8,017,200
タカラバイオ	32,000	2,012.00	64,384,000
J C U	15,900	2,050.00	32,595,000
新田ゼラチン	7,700	706.00	5,436,200
O A T アグリオ	1,700	1,357.00	2,306,900
デクセリアルズ	31,500	712.00	22,428,000
アース製薬	9,200	5,000.00	46,000,000
北興化学工業	12,500	495.00	6,187,500
大成ラミック	4,000	2,793.00	11,172,000

クミアイ化学工業	50,500	712.00	35,956,000
日本農薬	21,700	410.00	8,897,000
アキレス	8,900	1,981.00	17,630,900
有沢製作所	19,200	843.00	16,185,600
日東電工	84,200	5,076.00	427,399,200
レック	13,100	1,230.00	16,113,000
三光合成	14,100	318.00	4,483,800
きもと	21,100	159.00	3,354,900
藤森工業	11,000	2,963.00	32,593,000
前澤化成工業	8,300	1,110.00	9,213,000
未来工業	6,600	2,154.00	14,216,400
ウェーブロックホールディングス	3,500	659.00	2,306,500
J S P	7,200	2,115.00	15,228,000
エフピコ	13,400	6,700.00	89,780,000
天馬	8,500	1,770.00	15,045,000
信越ポリマー	21,900	806.00	17,651,400
東リ	30,600	252.00	7,711,200
ニフコ	48,900	2,867.00	140,196,300
バルカー	9,900	2,200.00	21,780,000
ユニ・チャーム	258,800	3,335.00	863,098,000
ショーエイコーポレーション	1,100	748.00	822,800
協和発酵キリン	143,200	2,020.00	289,264,000
武田薬品工業	1,065,500	3,775.00	4,022,262,500
アステラス製薬	1,125,200	1,513.00	1,702,427,600
大日本住友製薬	90,500	2,090.00	189,145,000
塩野義製薬	156,000	6,073.00	947,388,000
田辺三菱製薬	127,600	1,290.00	164,604,000
わかもと製薬	14,500	268.00	3,886,000
あすか製薬	15,100	1,203.00	18,165,300
日本新薬	31,900	8,110.00	258,709,000
ビオフェルミン製薬	2,100	2,290.00	4,809,000
中外製薬	127,200	7,170.00	912,024,000
科研製薬	22,000	5,360.00	117,920,000
エーザイ	146,100	6,316.00	922,767,600
ロート製薬	62,600	3,000.00	187,800,000
小野薬品工業	288,200	1,968.50	567,321,700
久光製薬	36,100	4,580.00	165,338,000
持田製薬	18,500	4,980.00	92,130,000
参天製薬	227,200	1,604.00	364,428,800
扶桑薬品工業	4,300	2,064.00	8,875,200
日本ケミファ	1,600	2,943.00	4,708,800
ツムラ	37,800	3,125.00	118,125,000

日医工	32,100	1,215.00	39,001,500
キッセイ薬品工業	21,600	2,676.00	57,801,600
生化学工業	23,700	1,249.00	29,601,300
栄研化学	21,400	1,837.00	39,311,800
日水製薬	5,100	1,202.00	6,130,200
鳥居薬品	6,500	2,294.00	14,911,000
JCRファーマ	8,600	6,590.00	56,674,000
東和薬品	17,600	2,766.00	48,681,600
富士製薬工業	8,300	1,430.00	11,869,000
沢井製薬	25,100	5,940.00	149,094,000
ゼリア新薬工業	24,200	2,135.00	51,667,000
第一三共	349,200	6,150.00	2,147,580,000
キョーリン製薬ホールディングス	26,900	1,968.00	52,939,200
大幸薬品	5,400	2,117.00	11,431,800
ダイト	7,100	3,455.00	24,530,500
大塚ホールディングス	232,500	3,695.00	859,087,500
大正製薬ホールディングス	27,300	9,020.00	246,246,000
ペプチドリーム	61,100	5,880.00	359,268,000
日本コークス工業	103,100	92.00	9,485,200
ニチレキ	15,600	1,048.00	16,348,800
ユシロ化学工業	6,300	1,363.00	8,586,900
ビーピー・カストロール	4,400	1,459.00	6,419,600
富士石油	29,600	268.00	7,932,800
MORESCO	4,400	1,441.00	6,340,400
出光興産	140,900	3,105.00	437,494,500
JXTGホールディングス	2,052,700	528.10	1,084,030,870
コスモエネルギーホールディングス	35,300	2,244.00	79,213,200
横浜ゴム	70,700	1,947.00	137,652,900
TOYO TIRE	62,600	1,475.00	92,335,000
ブリヂストン	375,100	4,244.00	1,591,924,400
住友ゴム工業	109,600	1,254.00	137,438,400
藤倉コンポジット	10,700	394.00	4,215,800
オカモト	8,500	4,925.00	41,862,500
フコク	5,300	755.00	4,001,500
ニッタ	13,800	3,115.00	42,987,000
住友理工	23,700	840.00	19,908,000
三ツ星ベルト	16,100	2,065.00	33,246,500
バンドー化学	23,300	973.00	22,670,900
日東紡績	18,200	2,146.00	39,057,200
AGC	120,700	3,705.00	447,193,500
日本板硝子	58,400	716.00	41,814,400
石塚硝子	2,000	2,339.00	4,678,000

日本山村硝子	5,100	1,484.00	7,568,400
日本電気硝子	52,800	2,702.00	142,665,600
オハラ	4,900	1,302.00	6,379,800
住友大阪セメント	24,600	4,470.00	109,962,000
太平洋セメント	77,100	3,265.00	251,731,500
日本ヒューム	12,300	727.00	8,942,100
日本コンクリート工業	26,400	293.00	7,735,200
三谷セキサン	5,700	2,903.00	16,547,100
アジアパイルホールディングス	17,300	617.00	10,674,100
東海カーボン	110,800	1,148.00	127,198,400
日本カーボン	5,800	4,240.00	24,592,000
東洋炭素	7,200	2,157.00	15,530,400
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	4,640.00	33,872,000
TOTO	93,900	4,165.00	391,093,500
日本碍子	149,000	1,501.00	223,649,000
日本特殊陶業	102,900	1,958.00	201,478,200
MARUWA	4,200	5,290.00	22,218,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,020.00	9,664,000
黒崎播磨	2,400	6,110.00	14,664,000
ヨータイ	10,700	557.00	5,959,900
イソライト工業	6,300	458.00	2,885,400
東京窯業	15,600	307.00	4,789,200
ニッカトー	5,600	673.00	3,768,800
フジインコーポレーテッド	10,900	2,199.00	23,969,100
クニミネ工業	5,500	791.00	4,350,500
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,019.00	2,445,600
ニチアス	33,400	1,943.00	64,896,200
ニチハ	17,000	2,903.00	49,351,000
日本製鉄	560,800	1,824.00	1,022,899,200
神戸製鋼所	220,900	693.00	153,083,700
中山製鋼所	16,800	471.00	7,912,800
合同製鐵	5,900	2,060.00	12,154,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	325,900	1,516.50	494,227,350
東京製鐵	64,700	868.00	56,159,600
共英製鋼	13,600	1,847.00	25,119,200
大和工業	25,600	3,155.00	80,768,000
東京鐵鋼	5,000	1,173.00	5,865,000
大阪製鐵	8,000	1,751.00	14,008,000
淀川製鋼所	16,300	2,036.00	33,186,800
丸一鋼管	42,700	2,870.00	122,549,000
モリ工業	3,600	1,901.00	6,843,600
大同特殊鋼	19,800	4,010.00	79,398,000

日本高周波鋼業	4,500	451.00	2,029,500
日本冶金工業	99,900	211.00	21,078,900
山陽特殊製鋼	15,200	1,470.00	22,344,000
愛知製鋼	6,800	3,185.00	21,658,000
日立金属	130,000	1,192.00	154,960,000
日本金属	2,800	882.00	2,469,600
大太平洋金属	8,200	2,202.00	18,056,400
新日本電工	72,400	196.00	14,190,400
栗本鐵工所	6,100	1,356.00	8,271,600
虹技	1,800	1,303.00	2,345,400
三菱製鋼	9,000	1,232.00	11,088,000
日亜鋼業	17,700	329.00	5,823,300
日本精線	1,700	2,606.00	4,430,200
エンビプロ・ホールディングス	4,600	606.00	2,787,600
シンニッタン	18,800	335.00	6,298,000
新家工業	2,800	1,466.00	4,104,800
大紀アルミニウム工業所	20,100	708.00	14,230,800
日本軽金属ホールディングス	329,500	238.00	78,421,000
三井金属鉱業	32,600	2,442.00	79,609,200
東邦亜鉛	6,800	2,417.00	16,435,600
三菱マテリアル	79,800	2,910.00	232,218,000
住友金属鉱山	165,300	2,910.00	481,023,000
D O W Aホールディングス	28,200	3,460.00	97,572,000
古河機械金属	20,000	1,415.00	28,300,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,000	1,735.00	24,290,000
東邦チタニウム	21,700	1,166.00	25,302,200
U A C J	18,400	1,784.00	32,825,600
C Kサンエツ	2,300	2,827.00	6,502,100
古河電気工業	34,900	2,975.00	103,827,500
住友電気工業	451,300	1,351.50	609,931,950
フジクラ	146,100	372.00	54,349,200
昭和電線ホールディングス	14,000	769.00	10,766,000
東京特殊電線	1,600	1,649.00	2,638,400
タツタ電線	24,300	465.00	11,299,500
カナレ電気	2,100	1,897.00	3,983,700
平河ヒューテック	5,100	1,210.00	6,171,000
リョービ	14,900	2,083.00	31,036,700
アーレスティ	15,100	534.00	8,063,400
アサヒホールディングス	22,700	2,175.00	49,372,500
稲葉製作所	6,800	1,421.00	9,662,800
宮地エンジニアリンググループ	3,700	1,756.00	6,497,200
トーカロ	31,200	755.00	23,556,000

アルファCo	4,300	1,237.00	5,319,100
SUMCO	133,400	1,232.00	164,348,800
川田テクノロジーズ	2,700	8,370.00	22,599,000
RS Technologies	2,400	2,675.00	6,420,000
信和	6,400	960.00	6,144,000
東洋製罐グループホールディングス	76,900	2,177.00	167,411,300
ホッカンホールディングス	6,100	1,768.00	10,784,800
コロナ	6,700	994.00	6,659,800
横河ブリッジホールディングス	22,500	1,659.00	37,327,500
駒井ハルテック	2,300	1,649.00	3,792,700
高田機工	1,100	2,535.00	2,788,500
三和ホールディングス	124,700	1,099.00	137,045,300
文化シャッター	35,600	806.00	28,693,600
三協立山	16,800	1,191.00	20,008,800
アルインコ	9,600	997.00	9,571,200
東洋シャッター	2,900	635.00	1,841,500
LIXILグループ	178,100	1,543.00	274,808,300
日本フィルコン	9,300	507.00	4,715,100
ノーリツ	27,000	1,370.00	36,990,000
長府製作所	12,300	2,226.00	27,379,800
リンナイ	21,500	7,130.00	153,295,000
ダイニチ工業	6,500	604.00	3,926,000
日東精工	16,700	596.00	9,953,200
三洋工業	1,600	1,781.00	2,849,600
岡部	24,500	989.00	24,230,500
ジーテクト	13,300	1,540.00	20,482,000
東プレ	22,500	1,818.00	40,905,000
高周波熱錬	23,300	892.00	20,783,600
東京製綱	7,400	1,028.00	7,607,200
サンコール	6,800	526.00	3,576,800
モリテック スチール	9,500	393.00	3,733,500
パイオラックス	19,300	1,917.00	36,998,100
エイチワン	11,900	783.00	9,317,700
日本発條	120,200	840.00	100,968,000
中央発條	1,500	2,894.00	4,341,000
アドバネクス	1,600	1,718.00	2,748,800
立川ブラインド工業	5,300	1,266.00	6,709,800
三益半導体工業	10,800	1,543.00	16,664,400
日本ドライケミカル	3,400	1,104.00	3,753,600
日本製鋼所	36,700	1,795.00	65,876,500
三浦工業	52,300	3,330.00	174,159,000
タクマ	44,200	1,433.00	63,338,600

ツガミ	27,300	894.00	24,406,200
オークマ	15,400	5,380.00	82,852,000
東芝機械	13,700	2,427.00	33,249,900
アマダホールディングス	181,500	1,197.00	217,255,500
アイダエンジニアリング	32,800	750.00	24,600,000
滝澤鉄工所	3,800	1,438.00	5,464,400
F U J I	48,300	1,262.00	60,954,600
牧野フライス製作所	14,200	4,030.00	57,226,000
オーエスジー	59,500	2,140.00	127,330,000
ダイジェット工業	1,500	1,199.00	1,798,500
旭ダイヤモンド工業	32,000	646.00	20,672,000
D M G 森精機	76,500	1,461.00	111,766,500
ソディック	26,400	939.00	24,789,600
ディスコ	16,300	16,140.00	263,082,000
日東工器	6,700	2,231.00	14,947,700
日進工具	3,600	2,115.00	7,614,000
パンチ工業	8,600	494.00	4,248,400
富士ダイス	5,500	573.00	3,151,500
豊和工業	6,900	846.00	5,837,400
O K K	5,200	741.00	3,853,200
東洋機械金属	8,800	592.00	5,209,600
津田駒工業	2,700	1,535.00	4,144,500
島精機製作所	16,700	3,135.00	52,354,500
オプトラン	11,800	2,436.00	28,744,800
N C ホールディングス	4,100	486.00	1,992,600
イワキポンプ	5,200	1,063.00	5,527,600
フリュー	9,700	1,050.00	10,185,000
ヤマシンフィルタ	21,100	619.00	13,060,900
日阪製作所	15,000	931.00	13,965,000
やまびこ	23,500	928.00	21,808,000
平田機工	5,700	5,360.00	30,552,000
ペガサスミシン製造	11,500	546.00	6,279,000
マルマエ	5,100	736.00	3,753,600
タツモ	5,100	822.00	4,192,200
ナプテスコ	66,400	2,899.00	192,493,600
三井海洋開発	12,900	2,840.00	36,636,000
レオン自動機	11,900	1,667.00	19,837,300
S M C	35,700	37,750.00	1,347,675,000
新川	9,100	370.00	3,367,000
ホソカワミクロン	4,300	4,735.00	20,360,500
ユニオンツール	5,300	2,751.00	14,580,300
オイレス工業	17,000	1,568.00	26,656,000



日精エー・エス・ピー機械	4,100	3,015.00	12,361,500
サトーホールディングス	14,600	2,773.00	40,485,800
技研製作所	10,600	3,360.00	35,616,000
日本エアージェット	4,000	575.00	2,300,000
カワタ	3,400	1,074.00	3,651,600
日精樹脂工業	10,300	910.00	9,373,000
オカダアイヨン	4,200	1,279.00	5,371,800
ワイエイシーホールディングス	4,800	835.00	4,008,000
小松製作所	552,600	2,433.00	1,344,475,800
住友重機械工業	69,900	3,465.00	242,203,500
日立建機	49,000	2,719.00	133,231,000
日工	3,400	2,673.00	9,088,200
巴工業	5,200	2,396.00	12,459,200
井関農機	12,300	1,509.00	18,560,700
TOWA	10,600	788.00	8,352,800
丸山製作所	2,800	1,130.00	3,164,000
北川鉄工所	5,600	2,134.00	11,950,400
ローツェ	5,400	2,236.00	12,074,400
タカキタ	4,400	564.00	2,481,600
クボタ	653,900	1,742.00	1,139,093,800
荏原実業	3,700	1,986.00	7,348,200
三菱化工機	4,300	1,589.00	6,832,700
月島機械	24,300	1,397.00	33,947,100
帝国電機製作所	8,600	1,265.00	10,879,000
新東工業	29,200	959.00	28,002,800
澁谷工業	10,700	2,913.00	31,169,100
アイチ コーポレーション	21,300	691.00	14,718,300
小森コーポレーション	32,900	1,175.00	38,657,500
鶴見製作所	9,600	1,993.00	19,132,800
住友精密工業	2,000	2,805.00	5,610,000
酒井重工業	2,300	2,653.00	6,101,900
荏原製作所	54,200	2,930.00	158,806,000
石井鐵工所	2,000	1,978.00	3,956,000
西島製作所	12,600	1,048.00	13,204,800
北越工業	12,700	1,243.00	15,786,100
ダイキン工業	166,600	13,730.00	2,287,418,000
オルガノ	4,400	3,555.00	15,642,000
トーヨーカネツ	4,700	2,112.00	9,926,400
栗田工業	66,100	2,612.00	172,653,200
椿本チエイン	16,000	3,510.00	56,160,000
大同工業	6,000	858.00	5,148,000
木村化工機	10,700	352.00	3,766,400

アネスト岩田	19,100	998.00	19,061,800	
ダイフク	67,200	5,810.00	390,432,000	
サムコ	3,500	809.00	2,831,500	
加藤製作所	6,300	2,021.00	12,732,300	
油研工業	2,200	1,681.00	3,698,200	
タダノ	59,100	1,083.00	64,005,300	
フジテック	44,400	1,490.00	66,156,000	
C K D	34,000	1,083.00	36,822,000	
キトー	9,300	1,617.00	15,038,100	
平和	34,100	2,198.00	74,951,800	
理想科学工業	10,800	1,716.00	18,532,800	
S A N K Y O	30,600	4,245.00	129,897,000	
日本金銭機械	13,600	1,118.00	15,204,800	
マースグループホールディングス	7,800	2,067.00	16,122,600	
福島工業	7,600	3,640.00	27,664,000	
オーイズミ	5,400	388.00	2,095,200	
ダイコク電機	5,700	1,336.00	7,615,200	
竹内製作所	20,500	1,854.00	38,007,000	
アマノ	34,900	2,942.00	102,675,800	
J U K I	17,000	950.00	16,150,000	
蛇の目ミシン工業	11,300	438.00	4,949,400	
マックス	18,700	1,532.00	28,648,400	
グローリー	33,800	2,826.00	95,518,800	
新晃工業	11,400	1,655.00	18,867,000	
大和冷機工業	17,700	1,195.00	21,151,500	
セガサミーホールディングス	121,100	1,310.00	158,641,000	
日本ピストンリング	4,500	1,394.00	6,273,000	
リケン	5,700	4,420.00	25,194,000	
T P R	16,500	1,892.00	31,218,000	
ツバキ・ナカシマ	18,700	1,718.00	32,126,600	
ホシザキ	35,700	7,910.00	282,387,000	
大豊工業	10,100	811.00	8,191,100	
日本精工	250,800	916.00	229,732,800	
N T N	262,600	307.00	80,618,200	
ジェイテクト	117,100	1,233.00	144,384,300	
不二越	11,400	4,360.00	49,704,000	
日本トムソン	36,400	451.00	16,416,400	
T H K	76,100	2,382.00	181,270,200	
ユーシン精機	9,500	1,054.00	10,013,000	
前澤給装工業	4,800	1,964.00	9,427,200	
イーグル工業	15,200	1,043.00	15,853,600	
前澤工業	8,400	351.00	2,948,400	

日本ピラー工業	12,400	1,100.00	13,640,000
キット	49,600	762.00	37,795,200
マキタ	148,600	3,770.00	560,222,000
日立造船	97,300	362.00	35,222,600
三菱重工業	204,600	4,713.00	964,279,800
I H I	93,800	2,499.00	234,406,200
スター精密	20,900	1,412.00	29,510,800
日清紡ホールディングス	68,000	790.00	53,720,000
イビデン	74,900	1,820.00	136,318,000
コニカミノルタ	267,000	1,015.00	271,005,000
ブラザー工業	159,100	1,920.00	305,472,000
ミネベアミツミ	226,700	1,691.00	383,349,700
日立製作所	549,500	3,996.00	2,195,802,000
三菱電機	1,220,500	1,407.00	1,717,243,500
富士電機	79,200	3,780.00	299,376,000
東洋電機製造	4,900	1,285.00	6,296,500
安川電機	141,500	3,365.00	476,147,500
シンフォニアテクノロジー	17,100	1,229.00	21,015,900
明電舎	24,300	1,545.00	37,543,500
オリジン	3,400	1,453.00	4,940,200
山洋電気	6,000	4,060.00	24,360,000
デンヨー	11,400	1,389.00	15,834,600
東芝テック	15,300	2,800.00	42,840,000
芝浦メカトロニクス	2,300	2,598.00	5,975,400
マブチモーター	33,900	3,740.00	126,786,000
日本電産	146,900	14,255.00	2,094,059,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,900	1,283.00	8,852,700
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,178.00	6,714,600
東光高岳	6,400	1,185.00	7,584,000
ダブル・スコープ	18,000	1,478.00	26,604,000
ダイヘン	13,400	3,105.00	41,607,000
ヤーマン	18,000	955.00	17,190,000
JVCケンウッド	94,600	229.00	21,663,400
ミマキエンジニアリング	11,500	599.00	6,888,500
第一精工	5,300	1,437.00	7,616,100
日新電機	28,700	1,127.00	32,344,900
大崎電気工業	24,500	693.00	16,978,500
オムロン	129,700	5,440.00	705,568,000
日東工業	19,600	1,950.00	38,220,000
I D E C	16,400	2,029.00	33,275,600
正興電機製作所	2,600	772.00	2,007,200
不二電機工業	1,600	1,232.00	1,971,200

ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,000	2,080.00	91,520,000
サクサホールディングス	3,200	1,849.00	5,916,800
メルコホールディングス	5,200	3,150.00	16,380,000
テクノメディカ	2,900	2,184.00	6,333,600
日本電気	157,900	4,165.00	657,653,500
富士通	117,700	7,604.00	894,990,800
沖電気工業	53,000	1,309.00	69,377,000
岩崎通信機	5,700	785.00	4,474,500
電気興業	6,500	3,045.00	19,792,500
サンケン電気	14,300	2,245.00	32,103,500
ナカヨ	2,500	1,548.00	3,870,000
アイホン	7,000	1,672.00	11,704,000
ルネサスエレクトロニクス	128,800	500.00	64,400,000
セイコーエプソン	151,500	1,650.00	249,975,000
ワコム	89,300	344.00	30,719,200
アルバック	24,400	3,175.00	77,470,000
アクセル	5,700	559.00	3,186,300
E I Z O	11,200	3,980.00	44,576,000
日本信号	31,200	1,154.00	36,004,800
京三製作所	26,600	361.00	9,602,600
能美防災	16,300	2,155.00	35,126,500
ホーチキ	8,000	1,157.00	9,256,000
星和電機	7,200	509.00	3,664,800
エレコム	11,700	3,610.00	42,237,000
パナソニック	1,394,400	875.00	1,220,100,000
シャープ	121,200	1,034.00	125,320,800
アンリツ	78,600	1,776.00	139,593,600
富士通ゼネラル	37,400	1,585.00	59,279,000
ソニー	818,900	5,360.00	4,389,304,000
T D K	63,900	7,680.00	490,752,000
帝国通信工業	5,700	1,182.00	6,737,400
タムラ製作所	47,300	567.00	26,819,100
アルプスアルパイン	127,200	1,802.00	229,214,400
池上通信機	3,900	1,120.00	4,368,000
鈴木	7,100	630.00	4,473,000
日本トリム	2,400	5,230.00	12,552,000
ローランド ディー . ジー .	6,400	2,483.00	15,891,200
フォスター電機	13,900	1,519.00	21,114,100
S M K	3,500	2,661.00	9,313,500
ヨコオ	8,800	2,136.00	18,796,800
ホシデン	36,200	1,137.00	41,159,400
ヒロセ電機	17,500	12,010.00	210,175,000

日本航空電子工業	28,100	1,595.00	44,819,500
TOA	13,200	1,290.00	17,028,000
マクセルホールディングス	26,500	1,842.00	48,813,000
古野電気	16,100	946.00	15,230,600
ユニデンホールディングス	3,700	1,839.00	6,804,300
スミダコーポレーション	10,700	1,182.00	12,647,400
アイコム	6,800	2,341.00	15,918,800
リオン	5,700	2,130.00	12,141,000
本多通信工業	11,100	509.00	5,649,900
横河電機	122,200	2,142.00	261,752,400
新電元工業	4,400	3,605.00	15,862,000
アズビル	78,800	2,657.00	209,371,600
東亜ディーケーケー	6,400	868.00	5,555,200
日本光電工業	53,900	3,160.00	170,324,000
チノー	4,300	1,207.00	5,190,100
共和電業	13,100	414.00	5,423,400
日本電子材料	5,100	513.00	2,616,300
堀場製作所	24,200	5,260.00	127,292,000
アドバンテスト	83,200	2,846.00	236,787,200
小野測器	6,100	577.00	3,519,700
エスベック	11,000	2,286.00	25,146,000
キーエンス	59,900	64,000.00	3,833,600,000
日置電機	6,500	3,695.00	24,017,500
シスメックス	95,100	7,710.00	733,221,000
日本マイクロニクス	21,600	945.00	20,412,000
メガチップス	9,900	1,290.00	12,771,000
OBARA GROUP	6,400	3,770.00	24,128,000
澤藤電機	1,700	1,661.00	2,823,700
原田工業	5,400	784.00	4,233,600
コーセル	15,800	1,071.00	16,921,800
イリソ電子工業	11,200	5,380.00	60,256,000
オブテックスグループ	21,700	1,342.00	29,121,400
千代田インテグレ	5,300	2,062.00	10,928,600
アイ・オー・データ機器	4,800	1,070.00	5,136,000
レーザーテック	25,100	3,955.00	99,270,500
スタンレー電気	86,400	2,552.00	220,492,800
岩崎電気	5,000	1,358.00	6,790,000
ウシオ電機	71,100	1,377.00	97,904,700
岡谷電機産業	9,500	390.00	3,705,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	601.00	7,091,800
エノモト	3,800	764.00	2,903,200
日本セラミック	12,500	2,947.00	36,837,500

遠藤照明	6,600	743.00	4,903,800
古河電池	9,200	643.00	5,915,600
双信電機	6,700	565.00	3,785,500
山一電機	9,200	929.00	8,546,800
図研	8,100	1,596.00	12,927,600
日本電子	24,200	2,330.00	56,386,000
カシオ計算機	108,100	1,283.00	138,692,300
ファナック	116,000	19,260.00	2,234,160,000
日本シイエムケイ	31,500	684.00	21,546,000
エンプラス	5,600	3,150.00	17,640,000
大真空	4,800	1,086.00	5,212,800
ローム	58,400	7,040.00	411,136,000
浜松ホトニクス	87,600	3,910.00	342,516,000
三井ハイテック	13,800	1,101.00	15,193,800
新光電気工業	41,300	926.00	38,243,800
京セラ	186,000	6,853.00	1,274,658,000
太陽誘電	54,400	1,922.00	104,556,800
村田製作所	384,200	4,547.00	1,746,957,400
双葉電子工業	20,200	1,421.00	28,704,200
北陸電気工業	4,900	968.00	4,743,200
ニチコン	38,800	811.00	31,466,800
日本ケミコン	8,700	1,590.00	13,833,000
K O A	18,700	1,309.00	24,478,300
市光工業	18,800	586.00	11,016,800
小糸製作所	73,200	5,420.00	396,744,000
ミツバ	23,000	602.00	13,846,000
S C R E E Nホールディングス	21,200	3,995.00	84,694,000
キャノン電子	11,400	1,796.00	20,474,400
キャノン	657,000	3,110.00	2,043,270,000
リコー	367,100	1,073.00	393,898,300
象印マホービン	30,500	1,180.00	35,990,000
M U T O Hホールディングス	1,900	1,672.00	3,176,800
東京エレクトロン	81,400	15,595.00	1,269,433,000
トヨタ紡織	42,700	1,419.00	60,591,300
芦森工業	2,600	1,677.00	4,360,200
ユニプレス	23,700	1,781.00	42,209,700
豊田自動織機	98,800	5,900.00	582,920,000
モリタホールディングス	21,400	1,922.00	41,130,800
三櫻工業	15,700	406.00	6,374,200
デンソー	268,700	4,429.00	1,190,072,300
東海理化電機製作所	32,200	1,728.00	55,641,600
三井E & Sホールディングス	44,100	948.00	41,806,800

川崎重工業	95,000	2,459.00	233,605,000
名村造船所	36,700	316.00	11,597,200
日本車輛製造	4,400	2,560.00	11,264,000
三菱ロジスネクスト	14,500	1,176.00	17,052,000
近畿車輛	1,800	1,793.00	3,227,400
日産自動車	1,439,300	767.40	1,104,518,820
いすゞ自動車	385,800	1,259.50	485,915,100
トヨタ自動車	1,360,000	6,706.00	9,120,160,000
日野自動車	152,400	879.00	133,959,600
三菱自動車工業	451,700	514.00	232,173,800
エフテック	8,600	758.00	6,518,800
レシップホールディングス	4,400	756.00	3,326,400
G M B	2,500	821.00	2,052,500
ファルテック	2,200	767.00	1,687,400
武蔵精密工業	29,700	1,419.00	42,144,300
日産車体	23,800	1,047.00	24,918,600
新明和工業	51,100	1,352.00	69,087,200
極東開発工業	24,300	1,375.00	33,412,500
日信工業	22,400	1,435.00	32,144,000
トピー工業	10,100	2,419.00	24,431,900
ティラド	4,500	1,877.00	8,446,500
曙ブレーキ工業	67,000	121.00	8,107,000
タチエス	20,100	1,352.00	27,175,200
N O K	65,700	1,460.00	95,922,000
フタバ産業	34,100	561.00	19,130,100
K Y B	12,700	2,882.00	36,601,400
大同メタル工業	19,900	640.00	12,736,000
プレス工業	60,600	487.00	29,512,200
ミクニ	15,700	381.00	5,981,700
太平洋工業	25,600	1,504.00	38,502,400
ケーヒン	28,100	1,482.00	41,644,200
河西工業	15,100	779.00	11,762,900
アイシン精機	100,500	3,725.00	374,362,500
マツダ	383,000	1,128.50	432,215,500
今仙電機製作所	11,400	915.00	10,431,000
本田技研工業	1,029,500	2,780.00	2,862,010,000
スズキ	223,300	5,302.00	1,183,936,600
S U B A R U	378,900	2,622.50	993,665,250
安永	5,900	1,501.00	8,855,900
ヤマハ発動機	172,400	1,926.00	332,042,400
ショーワ	28,900	1,440.00	41,616,000
T B K	14,700	388.00	5,703,600

エクセディ	16,600	2,219.00	36,835,400
豊田合成	39,400	2,017.00	79,469,800
愛三工業	19,200	702.00	13,478,400
盟和産業	1,900	1,050.00	1,995,000
日本プラスト	9,700	707.00	6,857,900
ヨロズ	11,500	1,336.00	15,364,000
エフ・シー・シー	22,000	2,312.00	50,864,000
シマノ	49,200	17,000.00	836,400,000
テイ・エス テック	28,400	2,834.00	80,485,600
ジャムコ	6,100	2,233.00	13,621,300
テルモ	345,300	3,200.00	1,104,960,000
クリエートメディック	4,100	939.00	3,849,900
日機装	39,400	1,494.00	58,863,600
島津製作所	157,100	2,843.00	446,635,300
JMS	11,300	676.00	7,638,800
長野計器	9,600	708.00	6,796,800
ブイ・テクノロジー	5,700	4,680.00	26,676,000
東京計器	7,800	943.00	7,355,400
愛知時計電機	1,600	4,100.00	6,560,000
インターアクション	6,600	1,427.00	9,418,200
オーバル	12,000	237.00	2,844,000
東京精密	22,100	2,612.00	57,725,200
マニー	16,200	6,970.00	112,914,000
ニコン	212,700	1,519.00	323,091,300
トプコン	65,600	1,350.00	88,560,000
オリンパス	727,200	1,299.00	944,632,800
理研計器	10,800	1,961.00	21,178,800
タムロン	10,800	2,188.00	23,630,400
H O Y A	245,700	7,939.00	1,950,612,300
シード	5,200	1,129.00	5,870,800
ノーリツ鋼機	9,600	1,872.00	17,971,200
エー・アンド・デイ	11,200	781.00	8,747,200
朝日インテック	51,800	5,610.00	290,598,000
シチズン時計	133,600	524.00	70,006,400
リズム時計工業	4,200	1,273.00	5,346,600
大研医器	9,700	618.00	5,994,600
メニコン	16,700	3,695.00	61,706,500
シンシア	1,900	580.00	1,102,000
松風	6,000	1,319.00	7,914,000
セイコーホールディングス	18,800	2,134.00	40,119,200
ニプロ	84,500	1,209.00	102,160,500
中本パックス	3,400	1,485.00	5,049,000



スノーピーク	4,700	1,440.00	6,768,000
パラマウントベッドホールディングス	14,000	4,440.00	62,160,000
トランザクション	7,800	866.00	6,754,800
S H O - B I	3,600	367.00	1,321,200
ニホンフラッシュ	5,200	2,829.00	14,710,800
前田工織	13,400	1,933.00	25,902,200
永大産業	16,000	339.00	5,424,000
アートネイチャー	13,000	632.00	8,216,000
バンダイナムコホールディングス	126,200	5,420.00	684,004,000
アイフィスジャパン	2,700	619.00	1,671,300
共立印刷	20,300	179.00	3,633,700
S H O E I	5,900	4,745.00	27,995,500
フランスベッドホールディングス	17,300	993.00	17,178,900
パイロットコーポレーション	21,300	4,195.00	89,353,500
萩原工業	6,800	1,372.00	9,329,600
トッパン・フォームズ	26,100	917.00	23,933,700
フジシールインターナショナル	27,400	3,625.00	99,325,000
タカラトミー	51,100	1,329.00	67,911,900
廣済堂	11,300	642.00	7,254,600
エステールホールディングス	3,300	604.00	1,993,200
アーク	46,600	102.00	4,753,200
タカノ	4,800	788.00	3,782,400
プロネクサス	10,500	1,199.00	12,589,500
ホクシン	7,500	128.00	960,000
ウッドワン	4,100	1,010.00	4,141,000
大建工業	9,200	2,192.00	20,166,400
凸版印刷	172,300	1,648.00	283,950,400
大日本印刷	172,000	2,400.00	412,800,000
図書印刷	11,400	1,310.00	14,934,000
共同印刷	3,800	2,796.00	10,624,800
N I S S H A	25,000	1,115.00	27,875,000
光村印刷	1,100	2,055.00	2,260,500
宝印刷	5,900	1,596.00	9,416,400
アシックス	115,100	1,255.00	144,450,500
ツツミ	3,800	2,050.00	7,790,000
小松ウオール工業	3,700	1,802.00	6,667,400
ヤマハ	72,600	5,150.00	373,890,000
河合楽器製作所	3,800	2,953.00	11,221,400
クリナップ	11,300	526.00	5,943,800
ピジョン	73,800	4,175.00	308,115,000
兼松サステック	800	1,610.00	1,288,000
キングジム	10,100	884.00	8,928,400

リンテック	29,000	2,189.00	63,481,000
イトーキ	22,500	429.00	9,652,500
任天堂	69,800	39,700.00	2,771,060,000
三菱鉛筆	20,100	1,897.00	38,129,700
タカラスタANDARD	25,200	1,671.00	42,109,200
コクヨ	58,500	1,524.00	89,154,000
ナカバヤシ	12,000	516.00	6,192,000
グロープライド	5,900	3,425.00	20,207,500
オカムラ	42,600	1,075.00	45,795,000
美津濃	12,100	2,562.00	31,000,200
東京電力ホールディングス	974,200	584.00	568,932,800
中部電力	373,400	1,570.00	586,238,000
関西電力	498,000	1,300.50	647,649,000
中国電力	168,700	1,397.00	235,673,900
北陸電力	119,500	815.00	97,392,500
東北電力	285,800	1,142.00	326,383,600
四国電力	109,900	1,022.00	112,317,800
九州電力	251,500	1,095.00	275,392,500
北海道電力	114,200	644.00	73,544,800
沖縄電力	22,600	1,741.00	39,346,600
電源開発	97,100	2,469.00	239,739,900
エフオン	5,700	782.00	4,457,400
イーレックス	21,200	1,326.00	28,111,200
レノバ	20,000	924.00	18,480,000
東京瓦斯	239,400	2,726.00	652,604,400
大阪瓦斯	236,800	1,979.00	468,627,200
東邦瓦斯	60,400	4,330.00	261,532,000
北海道瓦斯	6,600	1,515.00	9,999,000
広島ガス	25,100	339.00	8,508,900
西部瓦斯	13,700	2,283.00	31,277,100
静岡ガス	37,500	857.00	32,137,500
メタウォーター	5,900	3,290.00	19,411,000
SBSホールディングス	12,000	1,600.00	19,200,000
東武鉄道	128,700	3,210.00	413,127,000
相鉄ホールディングス	41,800	3,100.00	129,580,000
東京急行電鉄	331,500	1,960.00	649,740,000
京浜急行電鉄	167,200	1,921.00	321,191,200
小田急電鉄	195,500	2,739.00	535,474,500
京王電鉄	68,200	7,250.00	494,450,000
京成電鉄	91,500	4,115.00	376,522,500
富士急行	16,600	4,095.00	67,977,000
新京成電鉄	3,100	2,059.00	6,382,900

東日本旅客鉄道	217,000	10,560.00	2,291,520,000
西日本旅客鉄道	109,400	8,870.00	970,378,000
東海旅客鉄道	109,300	23,130.00	2,528,109,000
西武ホールディングス	151,200	1,895.00	286,524,000
鴻池運輸	19,400	1,743.00	33,814,200
西日本鉄道	33,800	2,441.00	82,505,800
ハマキョウレックス	9,400	3,795.00	35,673,000
サカイ引越センター	6,400	6,640.00	42,496,000
近鉄グループホールディングス	115,600	5,370.00	620,772,000
阪急阪神ホールディングス	154,200	4,040.00	622,968,000
南海電気鉄道	51,600	2,836.00	146,337,600
京阪ホールディングス	51,500	4,930.00	253,895,000
神戸電鉄	3,000	3,985.00	11,955,000
名古屋鉄道	94,900	3,075.00	291,817,500
山陽電気鉄道	8,900	2,241.00	19,944,900
日本通運	44,600	5,740.00	256,004,000
ヤマトホールディングス	202,600	2,250.00	455,850,000
山九	32,100	5,570.00	178,797,000
丸運	6,600	283.00	1,867,800
丸全昭和運輸	9,400	3,425.00	32,195,000
センコーグループホールディングス	63,700	893.00	56,884,100
トナミホールディングス	2,800	5,710.00	15,988,000
ニッコンホールディングス	44,000	2,598.00	114,312,000
日本石油輸送	1,400	2,787.00	3,901,800
福山通運	14,800	3,955.00	58,534,000
セイノーホールディングス	86,600	1,433.00	124,097,800
エスライン	3,500	975.00	3,412,500
神奈川中央交通	2,900	3,900.00	11,310,000
日立物流	25,400	3,375.00	85,725,000
丸和運輸機関	6,100	4,605.00	28,090,500
C & F ロジホールディングス	11,700	1,347.00	15,759,900
九州旅客鉄道	97,000	3,420.00	331,740,000
S Gホールディングス	109,200	3,050.00	333,060,000
日本郵船	97,100	1,636.00	158,855,600
商船三井	68,900	2,396.00	165,084,400
川崎汽船	35,600	1,205.00	42,898,000
N S ユナイテッド海運	6,700	2,302.00	15,423,400
飯野海運	56,800	358.00	20,334,400
共栄タンカー	1,500	1,456.00	2,184,000
乾汽船	10,400	841.00	8,746,400
日本航空	211,600	3,495.00	739,542,000
A N A ホールディングス	211,300	3,705.00	782,866,500

パスコ	2,200	852.00	1,874,400
トランコム	3,200	6,330.00	20,256,000
日新	10,000	1,772.00	17,720,000
三菱倉庫	40,000	3,080.00	123,200,000
三井倉庫ホールディングス	14,100	1,623.00	22,884,300
住友倉庫	42,600	1,412.00	60,151,200
澁澤倉庫	6,300	1,794.00	11,302,200
東陽倉庫	20,900	321.00	6,708,900
日本トランスシティ	25,400	465.00	11,811,000
ケイヒン	2,200	1,224.00	2,692,800
中央倉庫	7,000	1,046.00	7,322,000
川西倉庫	2,300	1,057.00	2,431,100
安田倉庫	9,500	890.00	8,455,000
ファイズ	2,000	697.00	1,394,000
東洋埠頭	3,500	1,400.00	4,900,000
宇徳	9,900	508.00	5,029,200
上組	71,300	2,590.00	184,667,000
サンリツ	2,700	637.00	1,719,900
キムラユニティー	3,100	1,100.00	3,410,000
キューソー流通システム	2,900	2,036.00	5,904,400
近鉄エクスプレス	21,800	1,476.00	32,176,800
東海運	6,600	244.00	1,610,400
エーアイティー	7,500	958.00	7,185,000
内外トランスライン	3,600	1,218.00	4,384,800
日本コンセプト	4,200	1,169.00	4,909,800
NEC ネットエスアイ	13,300	2,787.00	37,067,100
クロスキャット	3,400	983.00	3,342,200
システナ	42,800	1,710.00	73,188,000
デジタルアーツ	6,400	9,150.00	58,560,000
日鉄ソリューションズ	18,000	3,470.00	62,460,000
キューブシステム	6,600	857.00	5,656,200
エイジア	2,500	1,232.00	3,080,000
コア	5,200	1,520.00	7,904,000
ソリトンシステムズ	7,000	1,177.00	8,239,000
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	1,588.00	8,575,200
T I S	40,000	5,550.00	222,000,000
ネオス	4,800	755.00	3,624,000
電算システム	4,600	3,850.00	17,710,000
グリー	83,000	529.00	43,907,000
コーエーテクモホールディングス	24,600	2,038.00	50,134,800
三菱総合研究所	5,200	3,265.00	16,978,000
電算	1,400	2,000.00	2,800,000

A G S	7,100	705.00	5,005,500
ファインデックス	10,300	918.00	9,455,400
ブレインパッド	2,300	7,310.00	16,813,000
K L a b	21,500	792.00	17,028,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,100	1,227.00	19,754,700
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,045.00	4,090,000
ネクソン	305,600	1,673.00	511,268,800
アイスタイル	31,000	708.00	21,948,000
エムアップ	4,200	2,042.00	8,576,400
エイチーム	8,400	1,546.00	12,986,400
エニグモ	4,300	2,774.00	11,928,200
テクノスジャパン	10,400	570.00	5,928,000
コロプラ	39,500	801.00	31,639,500
ブロードリーフ	59,700	553.00	33,014,100
クロス・マーケティンググループ	5,000	350.00	1,750,000
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,063.00	5,952,800
システム情報	6,300	823.00	5,184,900
メディアドゥホールディングス	3,800	3,395.00	12,901,000
じげん	17,200	784.00	13,484,800
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	915.00	1,647,000
サイバーリンクス	2,000	1,113.00	2,226,000
フィックスターズ	12,800	1,873.00	23,974,400
C A R T A H O L D I N G S	5,900	1,440.00	8,496,000
オブティム	5,300	3,450.00	18,285,000
セレス	4,000	1,792.00	7,168,000
ティーガイア	12,100	1,966.00	23,788,600
セック	2,000	3,340.00	6,680,000
日本アジアグループ	12,600	357.00	4,498,200
豆蔵ホールディングス	8,300	1,352.00	11,221,600
テクマトリックス	8,500	2,008.00	17,068,000
プロシップ	3,600	1,176.00	4,233,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	289,200	295.00	85,314,000
G M O ペイメントゲートウェイ	19,700	7,160.00	141,052,000
ザッパラス	6,800	392.00	2,665,600
システムリサーチ	1,700	2,993.00	5,088,100
インターネットイニシアティブ	19,600	2,126.00	41,669,600
さくらインターネット	14,700	532.00	7,820,400
ヴィンクス	4,200	1,295.00	5,439,000
G M O クラウド	2,700	3,155.00	8,518,500
S R A ホールディングス	6,400	2,428.00	15,539,200
M i n o r i ソリューションズ	2,500	1,819.00	4,547,500
システムインテグレータ	3,700	708.00	2,619,600

朝日ネット	10,100	608.00	6,140,800
e B A S E	7,300	1,102.00	8,044,600
アバント	4,400	2,299.00	10,115,600
アドソル日進	4,400	1,587.00	6,982,800
フリービット	7,300	1,076.00	7,854,800
コムチュア	6,800	4,115.00	27,982,000
サイバーコム	2,200	1,994.00	4,386,800
アステリア	8,200	1,000.00	8,200,000
マークラインズ	5,600	1,976.00	11,065,600
メディカル・データ・ビジョン	10,800	1,172.00	12,657,600
ショーケース	3,000	540.00	1,620,000
モバイルファクトリー	3,500	1,382.00	4,837,000
テラスカイ	2,000	1,513.00	3,026,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,400	1,896.00	10,238,400
P C Iホールディングス	2,500	2,080.00	5,200,000
パイプドHD	2,000	1,159.00	2,318,000
アイビーシー	2,300	1,305.00	3,001,500
ネオジャパン	2,500	996.00	2,490,000
P R T I M E S	1,100	2,769.00	3,045,900
ランドコンピュータ	2,000	1,158.00	2,316,000
ダブルスタンダード	1,100	4,310.00	4,741,000
オープンドア	6,000	3,070.00	18,420,000
マイネット	4,100	716.00	2,935,600
アカツキ	4,300	5,950.00	25,585,000
ベネフィットジャパン	1,100	867.00	953,700
U b i c o mホールディングス	2,300	1,725.00	3,967,500
L I N E	36,500	3,045.00	111,142,500
カナミックネットワーク	2,500	2,277.00	5,692,500
ノムラシステムコーポレーション	1,600	726.00	1,161,600
チェンジ	2,400	2,752.00	6,604,800
シンクロ・フード	5,400	570.00	3,078,000
オークネット	6,400	1,363.00	8,723,200
エイトレッド	1,400	1,907.00	2,669,800
A O I T Y O H o l d i n g s	13,300	743.00	9,881,900
マクロミル	21,400	1,169.00	25,016,600
ビーグリー	3,300	805.00	2,656,500
オロ	3,200	2,849.00	9,116,800
テモナ	2,000	441.00	882,000
ソルクシーズ	5,400	846.00	4,568,400
フェイス	5,000	903.00	4,515,000
プロトコーポレーション	5,500	1,879.00	10,334,500
ハイマックス	1,500	1,860.00	2,790,000

野村総合研究所	76,200	5,280.00	402,336,000
サイバネットシステム	10,000	674.00	6,740,000
C Eホールディングス	3,700	997.00	3,688,900
日本システム技術	2,100	1,588.00	3,334,800
インテージホールディングス	15,500	999.00	15,484,500
東邦システムサイエンス	3,800	914.00	3,473,200
ソースネクスト	46,900	431.00	20,213,900
インフォコム	13,200	2,420.00	31,944,000
F I G	11,300	323.00	3,649,900
アルテリア・ネットワークス	13,400	1,142.00	15,302,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,713.00	4,796,400
フォーカスシステムズ	8,300	861.00	7,146,300
クレスコ	3,700	3,295.00	12,191,500
フジ・メディア・ホールディングス	124,400	1,538.00	191,327,200
オービック	41,500	13,100.00	543,650,000
ジャストシステム	17,100	3,635.00	62,158,500
T D Cソフト	10,700	800.00	8,560,000
ヤフー	781,500	307.00	239,920,500
トレンドマイクロ	63,900	4,935.00	315,346,500
I Dホールディングス	4,800	1,097.00	5,265,600
日本オラクル	24,300	7,810.00	189,783,000
アルファシステムズ	3,800	2,800.00	10,640,000
フューチャー	16,400	1,952.00	32,012,800
C A C H o l d i n g s	8,700	1,590.00	13,833,000
ソフトバンク・テクノロジー	5,200	2,408.00	12,521,600
トーセ	3,500	845.00	2,957,500
オービックビジネスコンサルタント	12,300	5,240.00	64,452,000
伊藤忠テクノソリューションズ	54,600	2,734.00	149,276,400
アイティフォー	14,700	833.00	12,245,100
東計電算	1,800	3,060.00	5,508,000
エクスネット	2,400	924.00	2,217,600
大塚商会	64,800	4,350.00	281,880,000
サイボウズ	14,200	1,273.00	18,076,600
ソフトブレーン	9,800	491.00	4,811,800
電通国際情報サービス	7,500	3,520.00	26,400,000
デジタルガレージ	23,400	3,330.00	77,922,000
E Mシステムズ	9,900	1,527.00	15,117,300
ウェザーニューズ	4,100	3,285.00	13,468,500
C I J	9,600	990.00	9,504,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,300	2,107.00	2,739,100
日本エンタープライズ	13,600	172.00	2,339,200
WOWOW	5,800	2,622.00	15,207,600

スカラ	8,600	964.00	8,290,400
インテリジェント ウェイブ	4,800	834.00	4,003,200
I M A G I C A G R O U P	10,500	539.00	5,659,500
ネットワンシステムズ	42,400	2,990.00	126,776,000
システムソフト	30,500	93.00	2,836,500
アルゴグラフィックス	10,300	2,313.00	23,823,900
マーベラス	18,500	849.00	15,706,500
エイベックス	20,700	1,441.00	29,828,700
日本ユニシス	37,500	3,615.00	135,562,500
兼松エレクトロニクス	6,600	3,115.00	20,559,000
東京放送ホールディングス	79,600	1,892.00	150,603,200
日本テレビホールディングス	110,100	1,617.00	178,031,700
朝日放送グループホールディングス	12,200	732.00	8,930,400
テレビ朝日ホールディングス	33,000	1,780.00	58,740,000
スカパーJ S A Tホールディングス	91,900	424.00	38,965,600
テレビ東京ホールディングス	9,900	2,496.00	24,710,400
日本BS放送	4,200	1,067.00	4,481,400
ビジョン	3,800	5,430.00	20,634,000
スマートバリュー	3,800	726.00	2,758,800
ワイヤレスゲート	5,700	414.00	2,359,800
コネクシオ	8,600	1,370.00	11,782,000
クロップス	2,500	624.00	1,560,000
日本電信電話	819,100	4,942.00	4,047,992,200
K D D I	1,055,400	2,726.00	2,877,020,400
ソフトバンク	1,269,800	1,406.00	1,785,338,800
光通信	14,100	22,020.00	310,482,000
N T T ドコモ	758,300	2,494.00	1,891,200,200
エムティーアイ	11,900	686.00	8,163,400
G M O インターネット	43,700	1,753.00	76,606,100
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	613.00	1,777,700
カドカワ	35,100	1,463.00	51,351,300
学研ホールディングス	4,100	4,675.00	19,167,500
ゼンリン	24,000	2,094.00	50,256,000
昭文社	6,100	359.00	2,189,900
インプレスホールディングス	9,900	135.00	1,336,500
アイネット	6,900	1,263.00	8,714,700
松竹	7,900	13,150.00	103,885,000
東宝	78,800	4,795.00	377,846,000
東映	5,100	15,060.00	76,806,000
エヌ・ティ・ティ・データ	319,000	1,330.00	424,270,000
ピー・シー・エー	1,600	3,490.00	5,584,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,200	2,052.00	4,514,400



D T S	13,400	4,530.00	60,702,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,800	3,875.00	216,225,000
シーイーシー	12,900	2,027.00	26,148,300
カプコン	51,400	2,265.00	116,421,000
アイ・エス・ビー	2,500	1,693.00	4,232,500
ジャステック	7,200	970.00	6,984,000
S C S K	31,600	5,430.00	171,588,000
日本システムウエア	4,000	2,798.00	11,192,000
アイネス	15,400	1,127.00	17,355,800
T K C	10,200	4,525.00	46,155,000
富士ソフト	17,900	4,785.00	85,651,500
N S D	19,700	3,120.00	61,464,000
コナミホールディングス	49,000	5,140.00	251,860,000
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,574.00	10,296,000
J B C Cホールディングス	9,600	1,322.00	12,691,200
ミロク情報サービス	11,900	3,400.00	40,460,000
ソフトバンクグループ	500,500	10,150.00	5,080,075,000
ハウスイ	1,000	844.00	844,000
高千穂交易	4,600	997.00	4,586,200
伊藤忠食品	3,000	4,460.00	13,380,000
エレマテック	11,200	1,024.00	11,468,800
J A L U X	3,400	2,920.00	9,928,000
あらた	8,900	3,850.00	34,265,000
トーメンデバイス	1,800	2,269.00	4,084,200
東京エレクトロン デバイス	4,400	1,898.00	8,351,200
フィールズ	10,500	526.00	5,523,000
双日	663,900	352.00	233,692,800
アルフレッサ ホールディングス	133,600	2,829.00	377,954,400
横浜冷凍	33,700	936.00	31,543,200
神栄	1,700	784.00	1,332,800
ラサ商事	6,400	800.00	5,120,000
ラクーンホールディングス	5,800	657.00	3,810,600
アルコニックス	12,800	1,340.00	17,152,000
神戸物産	18,100	5,130.00	92,853,000
あい ホールディングス	17,200	1,716.00	29,515,200
ディーブイエックス	4,700	799.00	3,755,300
ダイワボウホールディングス	11,000	4,805.00	52,855,000
マクニカ・富士エレホールディングス	33,300	1,384.00	46,087,200
ラクト・ジャパン	5,200	4,130.00	21,476,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,600	1,053.00	23,797,800
八洲電機	9,300	825.00	7,672,500
メディアスホールディングス	6,800	728.00	4,950,400

レスターホールディングス	13,200	1,507.00	19,892,400
ジューテックホールディングス	2,800	929.00	2,601,200
大光	5,100	641.00	3,269,100
OCHIホールディングス	3,500	1,216.00	4,256,000
TOKAIホールディングス	63,500	899.00	57,086,500
黒谷	2,800	447.00	1,251,600
Cominix	2,100	843.00	1,770,300
三洋貿易	6,100	2,365.00	14,426,500
ビューティガレージ	1,900	1,242.00	2,359,800
ウイン・パートナーズ	7,800	1,098.00	8,564,400
ミタチ産業	3,600	691.00	2,487,600
シップヘルスケアホールディングス	25,000	4,650.00	116,250,000
明治電機工業	3,800	1,376.00	5,228,800
デリカフーズホールディングス	2,100	1,485.00	3,118,500
スターティアホールディングス	2,400	546.00	1,310,400
コメダホールディングス	27,800	2,128.00	59,158,400
富士興産	4,700	742.00	3,487,400
協栄産業	1,500	1,468.00	2,202,000
小野建	10,800	1,379.00	14,893,200
南陽	2,500	1,600.00	4,000,000
佐島電機	8,900	881.00	7,840,900
エコートレーディング	2,800	534.00	1,495,200
伯東	8,200	1,176.00	9,643,200
コンドーテック	9,300	961.00	8,937,300
中山福	6,900	559.00	3,857,100
ナガイレーベン	17,400	2,592.00	45,100,800
三菱食品	13,200	2,909.00	38,398,800
松田産業	8,800	1,529.00	13,455,200
第一興商	17,900	5,140.00	92,006,000
メディバルホールディングス	129,700	2,432.00	315,430,400
SPK	2,600	2,385.00	6,201,000
萩原電気ホールディングス	4,400	2,697.00	11,866,800
アズワン	8,600	9,510.00	81,786,000
スズデン	4,200	1,355.00	5,691,000
尾家産業	3,900	1,294.00	5,046,600
シモジマ	7,400	1,135.00	8,399,000
ドウシシャ	11,300	1,806.00	20,407,800
小津産業	2,600	1,712.00	4,451,200
高速	7,200	1,170.00	8,424,000
たけびし	4,200	1,342.00	5,636,400
リックス	2,700	1,456.00	3,931,200
丸文	10,700	565.00	6,045,500

ハビネット	10,000	1,301.00	13,010,000
橋本総業ホールディングス	2,400	1,498.00	3,595,200
日本ライフライン	37,700	1,769.00	66,691,300
タカショー	5,900	470.00	2,773,000
エクセル	4,500	1,687.00	7,591,500
マルカ	3,900	1,914.00	7,464,600
I D O M	40,600	286.00	11,611,600
日本エム・ディ・エム	7,000	1,480.00	10,360,000
進和	7,100	2,245.00	15,939,500
エスケイジャパン	2,900	521.00	1,510,900
ダイترون	5,500	1,236.00	6,798,000
シークス	15,300	1,244.00	19,033,200
田中商事	4,100	593.00	2,431,300
オーハシテクニカ	6,800	1,477.00	10,043,600
白銅	3,900	1,352.00	5,272,800
伊藤忠商事	840,700	1,936.50	1,628,015,550
丸紅	1,185,300	705.50	836,229,150
高島	1,900	1,710.00	3,249,000
長瀬産業	67,600	1,664.00	112,486,400
蝶理	7,700	1,626.00	12,520,200
豊田通商	134,200	3,190.00	428,098,000
三共生興	20,500	523.00	10,721,500
兼松	48,000	1,228.00	58,944,000
ツカモトコーポレーション	2,200	1,007.00	2,215,400
三井物産	990,200	1,757.00	1,739,781,400
日本紙パルプ商事	6,800	3,830.00	26,044,000
日立ハイテクノロジーズ	36,500	5,720.00	208,780,000
カメイ	15,700	1,182.00	18,557,400
東都水産	1,700	2,549.00	4,333,300
O U Gホールディングス	1,900	2,587.00	4,915,300
スターゼン	4,400	4,085.00	17,974,000
山善	47,000	1,000.00	47,000,000
椿本興業	2,700	3,045.00	8,221,500
住友商事	710,900	1,615.00	1,148,103,500
内田洋行	5,100	3,495.00	17,824,500
三菱商事	843,500	2,907.00	2,452,054,500
第一実業	5,500	3,110.00	17,105,000
キャノンマーケティングジャパン	34,400	2,413.00	83,007,200
西華産業	6,800	1,300.00	8,840,000
佐藤商事	10,800	970.00	10,476,000
菱洋エレクトロ	12,200	1,719.00	20,971,800
東京産業	12,000	468.00	5,616,000

ユアサ商事	12,300	3,025.00	37,207,500
神鋼商事	2,700	2,319.00	6,261,300
小林産業	7,200	338.00	2,433,600
阪和興業	20,900	2,857.00	59,711,300
正栄食品工業	8,400	3,280.00	27,552,000
カナデン	10,900	1,298.00	14,148,200
菱電商事	9,500	1,619.00	15,380,500
フルサト工業	6,600	1,516.00	10,005,600
岩谷産業	26,700	3,620.00	96,654,000
すてきナイスグループ	5,200	576.00	2,995,200
昭光通商	4,300	624.00	2,683,200
ニチモウ	1,900	1,738.00	3,302,200
極東貿易	3,700	1,472.00	5,446,400
イワキ	14,400	491.00	7,070,400
三愛石油	32,300	988.00	31,912,400
稲畑産業	28,900	1,399.00	40,431,100
G S I クレオス	3,200	1,152.00	3,686,400
明和産業	11,100	363.00	4,029,300
クワザワ	4,300	486.00	2,089,800
ワキタ	25,600	1,057.00	27,059,200
東邦ホールディングス	35,600	2,524.00	89,854,400
サンゲツ	35,700	2,174.00	77,611,800
ミツウロコグループホールディングス	16,000	796.00	12,736,000
シナネンホールディングス	5,000	1,808.00	9,040,000
伊藤忠エネクス	26,600	859.00	22,849,400
サンリオ	37,100	2,657.00	98,574,700
サンワテクノス	7,300	832.00	6,073,600
リョーサン	13,300	2,673.00	35,550,900
新光商事	11,300	1,880.00	21,244,000
トーホー	5,400	2,174.00	11,739,600
三信電気	8,300	1,888.00	15,670,400
東陽テクニカ	13,900	915.00	12,718,500
モスフードサービス	15,800	2,411.00	38,093,800
加賀電子	12,000	1,631.00	19,572,000
ソーダニッカ	12,400	540.00	6,696,000
立花エレテック	8,900	1,650.00	14,685,000
フォーバル	5,300	975.00	5,167,500
P A L T A C	21,700	5,850.00	126,945,000
三谷産業	14,100	282.00	3,976,200
西本Wismettacホールディングス	2,700	3,815.00	10,300,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,216.00	1,216,000
国際紙パルプ商事	28,100	269.00	7,558,900

ヤマタネ	6,000	1,369.00	8,214,000
丸紅建材リース	1,200	1,709.00	2,050,800
日鉄物産	8,600	4,320.00	37,152,000
泉州電業	4,000	2,657.00	10,628,000
トラスコ中山	25,000	2,429.00	60,725,000
オートバックスセブン	47,800	1,728.00	82,598,400
モリト	8,800	827.00	7,277,600
加藤産業	18,800	3,510.00	65,988,000
北恵	2,300	804.00	1,849,200
イノテック	7,200	850.00	6,120,000
イエローハット	22,700	1,452.00	32,960,400
J Kホールディングス	10,900	582.00	6,343,800
日伝	10,000	1,701.00	17,010,000
北沢産業	9,100	286.00	2,602,600
杉本商事	6,500	2,073.00	13,474,500
因幡電機産業	17,100	4,425.00	75,667,500
東テク	4,000	2,153.00	8,612,000
ミスミグループ本社	150,500	2,691.00	404,995,500
アルテック	8,900	212.00	1,886,800
タキヒヨー	3,600	1,876.00	6,753,600
蔵王産業	2,000	1,327.00	2,654,000
スズケン	54,800	6,940.00	380,312,000
ジェコス	8,300	976.00	8,100,800
ルネサスイーストン	11,100	455.00	5,050,500
ローソン	30,400	5,100.00	155,040,000
サンエー	9,100	4,370.00	39,767,000
カワチ薬品	9,400	1,945.00	18,283,000
エービーシー・マート	18,800	6,900.00	129,720,000
ハードオフコーポレーション	4,900	700.00	3,430,000
アスクル	12,600	2,731.00	34,410,600
ゲオホールディングス	18,400	1,378.00	25,355,200
アダストリア	16,700	2,411.00	40,263,700
ジーフット	7,500	655.00	4,912,500
くら寿司	7,100	4,245.00	30,139,500
キャンドウ	5,800	1,630.00	9,454,000
パルグループホールディングス	6,200	3,330.00	20,646,000
エディオン	51,100	972.00	49,669,200
サーラコーポレーション	24,600	583.00	14,341,800
ワッツ	5,500	688.00	3,784,000
ハローズ	4,600	2,218.00	10,202,800
フジオフードシステム	5,100	2,896.00	14,769,600
あみやき亭	2,600	3,395.00	8,827,000

ひらまつ	24,300	346.00	8,407,800
大黒天物産	2,900	3,450.00	10,005,000
ハニーズホールディングス	10,700	1,021.00	10,924,700
ファーマライズホールディングス	3,000	532.00	1,596,000
アルペン	9,300	1,642.00	15,270,600
ハブ	3,900	1,282.00	4,999,800
クオールホールディングス	17,800	1,529.00	27,216,200
ジーンズ	6,400	6,430.00	41,152,000
ビックカメラ	71,400	1,132.00	80,824,800
D C Mホールディングス	64,900	1,096.00	71,130,400
ペッパーフードサービス	9,600	1,993.00	19,132,800
Monotaro	76,000	2,394.00	181,944,000
東京一番フーズ	3,300	603.00	1,989,900
D Dホールディングス	2,700	2,054.00	5,545,800
きちりホールディングス	3,400	734.00	2,495,600
アークランドサービスホールディングス	8,800	1,902.00	16,737,600
J . フロント リテイリング	153,900	1,145.00	176,215,500
ドトール・日レスホールディングス	21,200	2,114.00	44,816,800
マツモトキヨシホールディングス	49,700	3,295.00	163,761,500
ブロンコビリー	6,300	2,264.00	14,263,200
Z O Z O	130,000	1,827.00	237,510,000
トレジャー・ファクトリー	3,700	817.00	3,022,900
物語コーポレーション	3,000	8,760.00	26,280,000
ココカラファイン	13,500	5,600.00	75,600,000
三越伊勢丹ホールディングス	225,000	897.00	201,825,000
Hamee	3,900	652.00	2,542,800
ウエルシアホールディングス	31,800	4,165.00	132,447,000
クリエイトSDホールディングス	17,800	2,438.00	43,396,400
丸善CHIホールディングス	14,000	374.00	5,236,000
ティーライフ	1,800	833.00	1,499,400
エー・ピーカンパニー	2,500	464.00	1,160,000
チムニー	3,700	2,456.00	9,087,200
シュッピン	8,300	765.00	6,349,500
ネクステージ	19,400	1,223.00	23,726,200
ジョイフル本田	35,300	1,252.00	44,195,600
鳥貴族	4,000	2,099.00	8,396,000
麒麟堂ホールディングス	4,800	1,708.00	8,198,400
ホットランド	6,400	1,584.00	10,137,600
すかいらーくホールディングス	112,100	2,005.00	224,760,500
S F Pホールディングス	5,200	1,851.00	9,625,200
綿半ホールディングス	4,500	2,405.00	10,822,500
ヨシックス	2,000	2,333.00	4,666,000

ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,100	956.00	33,555,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,000	677.00	3,385,000	
B E E N O S	4,300	1,827.00	7,856,100	
あさひ	10,000	1,315.00	13,150,000	
日本調剤	4,300	3,620.00	15,566,000	
コスモス薬品	5,300	17,910.00	94,923,000	
トーエル	6,000	733.00	4,398,000	
オンリー	2,200	808.00	1,777,600	
セブン&アイ・ホールディングス	503,800	3,688.00	1,858,014,400	
薬王堂	5,300	2,393.00	12,682,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,400	1,452.00	47,044,800	
ツルハホールディングス	26,100	8,870.00	231,507,000	
サンマルクホールディングス	9,500	2,380.00	22,610,000	
フェリシモ	2,800	971.00	2,718,800	
トリドールホールディングス	14,900	2,039.00	30,381,100	
T O K Y O B A S E	10,900	862.00	9,395,800	
ウイルプラスホールディングス	2,000	800.00	1,600,000	
ジャパンミート	6,100	1,731.00	10,559,100	
サツドラホールディングス	1,900	1,917.00	3,642,300	
デファクトスタンダード	1,400	347.00	485,800	
アレンザホールディングス	6,600	855.00	5,643,000	
パロックジャパンリミテッド	9,900	903.00	8,939,700	
クスリのアオキホールディングス	12,000	7,190.00	86,280,000	
力の源ホールディングス	4,700	725.00	3,407,500	
スシローグローバルホールディングス	13,200	7,540.00	99,528,000	
L I X I L ビバ	10,300	1,190.00	12,257,000	
メディカルシステムネットワーク	13,000	509.00	6,617,000	
はるやまホールディングス	5,800	833.00	4,831,400	
ノジマ	21,400	1,808.00	38,691,200	
カッパ・クリエイト	16,900	1,409.00	23,812,100	
ライトオン	9,200	727.00	6,688,400	
良品計画	17,000	19,000.00	323,000,000	
三城ホールディングス	15,200	332.00	5,046,400	
アドヴァン	18,500	1,082.00	20,017,000	
アルビス	4,600	2,512.00	11,555,200	
コナカ	14,500	418.00	6,061,000	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,642.00	2,627,200	
G - 7ホールディングス	3,600	3,175.00	11,430,000	
イオン北海道	12,300	721.00	8,868,300	
コジマ	20,900	478.00	9,990,200	
ヒマラヤ	4,400	862.00	3,792,800	

コーナン商事	15,800	2,299.00	36,324,200
エコス	4,500	1,401.00	6,304,500
ワタミ	15,900	1,484.00	23,595,600
マルシェ	3,300	780.00	2,574,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	72,000	6,760.00	486,720,000
西松屋チェーン	26,500	875.00	23,187,500
ゼンショーホールディングス	56,800	2,247.00	127,629,600
幸楽苑ホールディングス	7,700	2,845.00	21,906,500
ハークスレイ	2,600	1,044.00	2,714,400
サイゼリヤ	19,900	2,468.00	49,113,200
V Tホールディングス	54,600	461.00	25,170,600
魚力	3,400	1,481.00	5,035,400
フジ・コーポレーション	3,200	2,158.00	6,905,600
ユナイテッドアローズ	13,800	3,520.00	48,576,000
ハイデイ日高	17,400	2,006.00	34,904,400
京都きもの友禅	8,000	368.00	2,944,000
コロワイド	40,000	2,135.00	85,400,000
ピーシーデポコーポレーション	16,300	403.00	6,568,900
巷番屋	8,500	4,570.00	38,845,000
P L A N T	3,200	793.00	2,537,600
スギホールディングス	26,400	4,995.00	131,868,000
スクロール	18,800	345.00	6,486,000
ヨンドシーホールディングス	13,400	2,529.00	33,888,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	134,500	2,530.00	340,285,000
木曽路	14,800	2,574.00	38,095,200
S R Sホールディングス	14,300	1,011.00	14,457,300
タカキュー	10,000	174.00	1,740,000
ケーヨー	22,500	495.00	11,137,500
上新電機	14,200	2,239.00	31,793,800
日本瓦斯	19,600	2,667.00	52,273,200
ロイヤルホールディングス	21,000	2,774.00	58,254,000
いなげや	13,500	1,404.00	18,954,000
島忠	25,500	2,504.00	63,852,000
チヨダ	12,700	1,675.00	21,272,500
ライフコーポレーション	9,200	2,250.00	20,700,000
リンガーハット	14,900	2,313.00	34,463,700
M r M a x H D	16,800	445.00	7,476,000
テンアライド	11,100	416.00	4,617,600
A O K Iホールディングス	24,200	1,043.00	25,240,600
オークワ	17,300	1,110.00	19,203,000
コメリ	18,600	2,219.00	41,273,400
青山商事	21,100	2,122.00	44,774,200



しまむら	14,000	8,180.00	114,520,000
はせがわ	6,700	397.00	2,659,900
高島屋	94,400	1,136.00	107,238,400
松屋	24,400	882.00	21,520,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,800	1,225.00	75,705,000
近鉄百貨店	4,600	3,275.00	15,065,000
パルコ	11,700	1,075.00	12,577,500
丸井グループ	101,800	2,284.00	232,511,200
アクシアル リテイリング	10,000	3,785.00	37,850,000
イオン	462,600	1,895.50	876,858,300
イズミ	24,500	4,540.00	111,230,000
平和堂	24,500	1,947.00	47,701,500
フジ	14,600	1,791.00	26,148,600
ヤオコー	13,700	4,895.00	67,061,500
ゼビオホールディングス	14,600	1,249.00	18,235,400
ケーズホールディングス	125,000	1,026.00	128,250,000
Olympicグループ	7,300	709.00	5,175,700
日産東京販売ホールディングス	18,100	280.00	5,068,000
Genky DrugStores	5,900	2,549.00	15,039,100
総合メディカルホールディングス	10,500	1,735.00	18,217,500
ブックオフグループホールディングス	6,200	968.00	6,001,600
アインホールディングス	16,100	6,800.00	109,480,000
元気寿司	3,400	3,865.00	13,141,000
ヤマダ電機	366,400	511.00	187,230,400
アークランドサカモト	20,500	1,394.00	28,577,000
ニトリホールディングス	52,000	13,090.00	680,680,000
グルメ杵屋	8,700	1,157.00	10,065,900
愛眼	9,600	240.00	2,304,000
ケーユーホールディングス	6,400	887.00	5,676,800
吉野家ホールディングス	42,000	1,871.00	78,582,000
松屋フーズホールディングス	5,800	3,355.00	19,459,000
サガミホールディングス	16,200	1,342.00	21,740,400
関西スーパーマーケット	9,200	1,090.00	10,028,000
王将フードサービス	8,800	6,860.00	60,368,000
プレナス	13,500	1,873.00	25,285,500
ミニストップ	9,000	1,625.00	14,625,000
アークス	22,600	2,210.00	49,946,000
パローホールディングス	26,000	2,239.00	58,214,000
ベルク	6,000	5,140.00	30,840,000
大庄	6,500	1,580.00	10,270,000
ファーストリテイリング	16,100	64,420.00	1,037,162,000
サンドラッグ	45,300	2,786.00	126,205,800

サクスパー ホールディングス	10,300	954.00	9,826,200
ヤマザワ	2,600	1,635.00	4,251,000
やまや	2,100	2,060.00	4,326,000
ペルーナ	29,600	746.00	22,081,600
島根銀行	3,800	710.00	2,698,000
じもとホールディングス	81,300	95.00	7,723,500
めぶきフィナンシャルグループ	628,500	276.00	173,466,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,800	1,666.00	27,988,800
九州フィナンシャルグループ	199,400	441.00	87,935,400
ゆうちょ銀行	341,800	1,091.00	372,903,800
富山第一銀行	31,400	311.00	9,765,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	757,100	406.00	307,382,600
西日本フィナンシャルホールディングス	76,800	825.00	63,360,000
関西みらいフィナンシャルグループ	57,700	733.00	42,294,100
三十三フィナンシャルグループ	11,000	1,528.00	16,808,000
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	2,925.00	62,010,000
新生銀行	88,300	1,690.00	149,227,000
あおぞら銀行	67,200	2,620.00	176,064,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,285,800	508.70	4,214,986,460
りそなホールディングス	1,320,900	452.90	598,235,610
三井住友トラスト・ホールディングス	236,600	4,010.00	948,766,000
三井住友フィナンシャルグループ	848,400	3,783.00	3,209,497,200
千葉銀行	415,600	526.00	218,605,600
群馬銀行	242,900	393.00	95,459,700
武蔵野銀行	18,300	2,101.00	38,448,300
千葉興業銀行	36,400	273.00	9,937,200
筑波銀行	50,000	174.00	8,700,000
七十七銀行	38,300	1,682.00	64,420,600
青森銀行	9,600	2,887.00	27,715,200
秋田銀行	8,100	2,166.00	17,544,600
山形銀行	14,000	1,682.00	23,548,000
岩手銀行	8,700	3,060.00	26,622,000
東邦銀行	107,600	254.00	27,330,400
東北銀行	6,100	1,106.00	6,746,600
みちのく銀行	7,700	1,698.00	13,074,600
ふくおかフィナンシャルグループ	106,500	1,936.00	206,184,000
静岡銀行	304,000	826.00	251,104,000
十六銀行	16,500	2,301.00	37,966,500
八十二銀行	292,300	468.00	136,796,400
山梨中央銀行	15,100	1,280.00	19,328,000
大垣共立銀行	25,700	2,522.00	64,815,400
福井銀行	10,800	1,570.00	16,956,000

北國銀行	12,700	3,120.00	39,624,000
清水銀行	5,400	1,799.00	9,714,600
富山銀行	2,600	2,612.00	6,791,200
滋賀銀行	24,500	2,654.00	65,023,000
南都銀行	19,100	2,379.00	45,438,900
百五銀行	110,800	342.00	37,893,600
京都銀行	43,300	4,325.00	187,272,500
紀陽銀行	43,200	1,545.00	66,744,000
ほくほくフィナンシャルグループ	80,800	1,194.00	96,475,200
広島銀行	179,200	559.00	100,172,800
山陰合同銀行	72,500	727.00	52,707,500
中国銀行	104,400	1,073.00	112,021,200
鳥取銀行	4,700	1,411.00	6,631,700
伊予銀行	161,000	573.00	92,253,000
百十四銀行	13,200	2,343.00	30,927,600
四国銀行	17,900	967.00	17,309,300
阿波銀行	18,700	2,743.00	51,294,100
大分銀行	7,600	3,255.00	24,738,000
宮崎銀行	8,300	2,566.00	21,297,800
佐賀銀行	7,800	1,625.00	12,675,000
沖縄銀行	11,300	3,565.00	40,284,500
琉球銀行	28,500	1,160.00	33,060,000
セブン銀行	409,600	284.00	116,326,400
みずほフィナンシャルグループ	16,355,900	152.80	2,499,181,520
高知銀行	4,400	755.00	3,322,000
山口フィナンシャルグループ	151,300	792.00	119,829,600
長野銀行	4,500	1,711.00	7,699,500
名古屋銀行	10,000	3,590.00	35,900,000
北洋銀行	184,600	262.00	48,365,200
愛知銀行	4,600	3,790.00	17,434,000
中京銀行	5,300	2,211.00	11,718,300
大光銀行	4,600	1,646.00	7,571,600
愛媛銀行	17,600	1,125.00	19,800,000
トマト銀行	5,500	1,040.00	5,720,000
京葉銀行	54,400	658.00	35,795,200
栃木銀行	66,900	184.00	12,309,600
北日本銀行	4,200	1,743.00	7,320,600
東和銀行	21,100	728.00	15,360,800
福島銀行	10,500	263.00	2,761,500
大東銀行	5,800	581.00	3,369,800
トモニホールディングス	95,400	366.00	34,916,400
フィデアホールディングス	116,900	119.00	13,911,100

池田泉州ホールディングス	131,700	218.00	28,710,600
F P G	37,900	873.00	33,086,700
マーキュリアインベストメント	4,800	686.00	3,292,800
S B I ホールディングス	143,500	2,502.00	359,037,000
ジャフコ	19,800	3,895.00	77,121,000
大和証券グループ本社	966,100	480.00	463,728,000
野村ホールディングス	2,118,300	352.60	746,912,580
岡三証券グループ	102,900	407.00	41,880,300
丸三証券	36,000	583.00	20,988,000
東洋証券	44,000	120.00	5,280,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	143,900	355.00	51,084,500
光世証券	3,100	674.00	2,089,400
水戸証券	35,400	205.00	7,257,000
いちよし証券	25,400	769.00	19,532,600
松井証券	59,100	1,036.00	61,227,600
だいこう証券ビジネス	5,200	410.00	2,132,000
マネックスグループ	111,400	326.00	36,316,400
カブドットコム証券	89,600	557.00	49,907,200
極東証券	16,300	921.00	15,012,300
岩井コスモホールディングス	12,400	1,123.00	13,925,200
藍澤証券	21,800	676.00	14,736,800
マネーパートナーズグループ	14,500	286.00	4,147,000
スパークス・グループ	48,200	225.00	10,845,000
かんぽ生命保険	45,500	2,057.00	93,593,500
S O M P O ホールディングス	212,200	4,346.00	922,221,200
アニコム ホールディングス	9,900	3,740.00	37,026,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	314,700	3,555.00	1,118,758,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	98,900	2,553.00	252,491,700
第一生命ホールディングス	681,000	1,627.00	1,107,987,000
東京海上ホールディングス	430,400	5,534.00	2,381,833,600
T & D ホールディングス	372,300	1,115.50	415,300,650
アドバンスクリエイト	2,800	1,740.00	4,872,000
全国保証	33,900	4,210.00	142,719,000
ジェイリース	3,300	322.00	1,062,600
イントラスト	3,400	459.00	1,560,600
日本モーゲージサービス	2,200	1,132.00	2,490,400
C a s a	5,400	1,054.00	5,691,600
アルヒ	10,900	1,917.00	20,895,300
プレミアグループ	6,900	2,040.00	14,076,000
クレディセゾン	84,300	1,216.00	102,508,800
芙蓉総合リース	13,800	5,500.00	75,900,000
興銀リース	22,600	2,666.00	60,251,600

東京センチュリー	24,200	4,705.00	113,861,000
日本証券金融	53,000	555.00	29,415,000
アイフル	183,600	214.00	39,290,400
リコーリース	9,500	3,420.00	32,490,000
イオンフィナンシャルサービス	76,900	1,751.00	134,651,900
アコム	241,900	384.00	92,889,600
ジャックス	13,300	1,936.00	25,748,800
オリエントコーポレーション	325,600	113.00	36,792,800
日立キャピタル	28,400	2,416.00	68,614,400
アプラスフィナンシャル	57,800	71.00	4,103,800
オリックス	803,000	1,563.00	1,255,089,000
三菱UFJリース	271,500	551.00	149,596,500
九州リースサービス	5,900	628.00	3,705,200
日本取引所グループ	325,200	1,728.00	561,945,600
イー・ギャランティ	11,300	1,419.00	16,034,700
アサックス	5,000	552.00	2,760,000
NECキャピタルソリューション	4,900	1,753.00	8,589,700
いちご	156,100	330.00	51,513,000
日本駐車場開発	138,000	173.00	23,874,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,400	1,719.00	11,001,600
ヒューリック	252,400	861.00	217,316,400
三栄建築設計	5,600	1,512.00	8,467,200
野村不動産ホールディングス	80,600	2,341.00	188,684,600
三重交通グループホールディングス	26,200	602.00	15,772,400
サムティ	17,400	1,492.00	25,960,800
ディア・ライフ	18,300	429.00	7,850,700
コーセーアールイー	5,200	763.00	3,967,600
エー・ディー・ワークス	185,500	38.00	7,049,000
日本商業開発	8,300	1,481.00	12,292,300
プレサンスコーポレーション	19,800	1,607.00	31,818,600
ユニゾホールディングス	18,700	1,895.00	35,436,500
日本管理センター	9,000	1,113.00	10,017,000
サンセイランディック	4,900	738.00	3,616,200
エストラスト	1,600	720.00	1,152,000
フージャースホールディングス	26,200	626.00	16,401,200
オープンハウス	17,700	4,760.00	84,252,000
東急不動産ホールディングス	325,400	619.00	201,422,600
飯田グループホールディングス	101,000	1,773.00	179,073,000
イーランド	3,600	661.00	2,379,600
ムゲンエステート	10,500	584.00	6,132,000
ファーストブラザーズ	4,400	1,026.00	4,514,400
ハウズドゥ	6,600	1,400.00	9,240,000

シーアールイー	4,200	1,002.00	4,208,400
ケイアイスター不動産	4,100	1,571.00	6,441,100
グッドコムアセット	3,600	1,430.00	5,148,000
ジェイ・エス・ビー	900	3,540.00	3,186,000
テンポイノベーション	2,200	1,554.00	3,418,800
パーク24	70,800	2,311.00	163,618,800
パラカ	3,700	1,979.00	7,322,300
三井不動産	639,000	2,745.50	1,754,374,500
三菱地所	843,700	2,056.00	1,734,647,200
平和不動産	23,200	2,293.00	53,197,600
東京建物	132,400	1,169.00	154,775,600
ダイビル	36,500	990.00	36,135,000
京阪神ビルディング	22,400	1,038.00	23,251,200
住友不動産	270,800	4,151.00	1,124,090,800
テオーシー	29,200	639.00	18,658,800
東京楽天地	2,000	5,150.00	10,300,000
スターツコーポレーション	16,800	2,600.00	43,680,000
フジ住宅	16,800	770.00	12,936,000
空港施設	16,400	523.00	8,577,200
明和地所	8,900	535.00	4,761,500
ゴールドクレスト	10,100	1,867.00	18,856,700
日本エスリード	5,500	1,596.00	8,778,000
日神不動産	20,400	453.00	9,241,200
日本エスコン	23,400	694.00	16,239,600
タカラレーベン	57,800	374.00	21,617,200
サンヨーハウジング名古屋	8,100	892.00	7,225,200
イオンモール	61,000	1,638.00	99,918,000
毎日コムネット	4,200	741.00	3,112,200
ファースト住建	5,500	1,136.00	6,248,000
カチタス	13,700	4,235.00	58,019,500
トーセイ	17,800	922.00	16,411,600
穴吹興産	1,700	2,975.00	5,057,500
サンフロンティア不動産	17,700	1,024.00	18,124,800
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	1,008.00	11,793,600
インテリックス	5,100	675.00	3,442,500
ランドビジネス	5,100	784.00	3,998,400
グランディハウス	13,200	461.00	6,085,200
日本空港ビルデング	38,600	4,350.00	167,910,000
日本工営	7,900	2,454.00	19,386,600
LIFULL	40,900	589.00	24,090,100
ジェイエシーリクルートメント	9,400	2,524.00	23,725,600
日本M&Aセンター	87,000	2,660.00	231,420,000

メンバーズ	4,000	1,922.00	7,688,000
中広	1,500	570.00	855,000
アイティメディア	2,600	486.00	1,263,600
タケエイ	12,200	946.00	11,541,200
E・Jホールディングス	1,600	1,064.00	1,702,400
トラスト・テック	6,500	3,210.00	20,865,000
コシダカホールディングス	28,200	1,428.00	40,269,600
アルトナー	3,000	761.00	2,283,000
パソナグループ	14,300	1,775.00	25,382,500
CDS	3,000	1,312.00	3,936,000
リンクアンドモチベーション	21,700	607.00	13,171,900
GCA	12,000	725.00	8,700,000
エス・エム・エス	42,900	2,584.00	110,853,600
サニーサイドアップ	1,300	2,088.00	2,714,400
パーソルホールディングス	116,600	2,413.00	281,355,800
リニカル	6,700	1,116.00	7,477,200
クックパッド	37,100	342.00	12,688,200
エスクリ	3,400	779.00	2,648,600
アイ・ケイ・ケイ	5,900	679.00	4,006,100
学情	4,800	1,150.00	5,520,000
スタジオアリス	5,900	2,057.00	12,136,300
シミックホールディングス	6,500	2,023.00	13,149,500
NJS	2,600	1,718.00	4,466,800
総合警備保障	46,400	5,190.00	240,816,000
カカクコム	87,400	2,151.00	187,997,400
アイロムグループ	4,400	1,548.00	6,811,200
セントケア・ホールディング	8,800	468.00	4,118,400
サイネックス	2,200	639.00	1,405,800
ルネサンス	6,600	1,828.00	12,064,800
ディップ	18,900	1,735.00	32,791,500
オプトホールディング	7,200	1,528.00	11,001,600
ツクイ	27,700	561.00	15,539,700
キャリアデザインセンター	3,000	1,557.00	4,671,000
ベネフィット・ワン	32,400	2,036.00	65,966,400
エムスリー	245,600	2,104.00	516,742,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	607.00	4,613,200
ブラス	1,500	624.00	936,000
アウトソーシング	61,600	1,174.00	72,318,400
ウェルネット	11,200	1,009.00	11,300,800
ワールドホールディングス	3,300	1,626.00	5,365,800
ディー・エヌ・エー	62,900	2,165.00	136,178,500
博報堂DYホールディングス	162,200	1,783.00	289,202,600

ぐるなび	16,800	609.00	10,231,200
タカミヤ	12,200	778.00	9,491,600
ジャパンベストレスキューシステム	7,900	1,382.00	10,917,800
ファンコミュニケーションズ	32,300	557.00	17,991,100
ライク	4,700	1,289.00	6,058,300
ビジネス・ブレイクスルー	5,300	351.00	1,860,300
WDBホールディングス	5,400	2,542.00	13,726,800
ティア	7,000	650.00	4,550,000
C D G	1,200	1,306.00	1,567,200
バリューコマース	7,900	2,359.00	18,636,100
インフォマート	64,000	1,638.00	104,832,000
J Pホールディングス	33,800	287.00	9,700,600
エコナックホールディングス	22,200	127.00	2,819,400
E P Sホールディングス	17,600	1,817.00	31,979,200
レグス	3,000	1,434.00	4,302,000
プレステージ・インターナショナル	21,900	1,625.00	35,587,500
アミューズ	7,100	2,506.00	17,792,600
ドリームインキュベータ	3,600	1,653.00	5,950,800
クイック	7,300	1,619.00	11,818,700
T A C	7,000	196.00	1,372,000
ケネディクス	102,700	546.00	56,074,200
電通	142,100	3,700.00	525,770,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,079.00	4,963,400
ぴあ	3,400	4,935.00	16,779,000
イオンファンタジー	3,800	2,245.00	8,531,000
シーティーエス	13,400	656.00	8,790,400
ネクシィーズグループ	4,100	2,277.00	9,335,700
みらかホールディングス	32,700	2,670.00	87,309,000
アルプス技研	10,300	1,832.00	18,869,600
ダイオーズ	2,800	1,394.00	3,903,200
日本空調サービス	13,400	683.00	9,152,200
オリエンタルランド	137,800	13,625.00	1,877,525,000
ダスキン	30,000	2,982.00	89,460,000
明光ネットワークジャパン	13,800	946.00	13,054,800
ファルコホールディングス	6,500	1,756.00	11,414,000
ラウンドワン	36,200	1,591.00	57,594,200
リゾートトラスト	49,400	1,727.00	85,313,800
ビー・エム・エル	15,100	3,205.00	48,395,500
ワタベウェディング	2,100	609.00	1,278,900
りらいあコミュニケーションズ	21,200	1,260.00	26,712,000
リソー教育	59,500	463.00	27,548,500
早稲田アカデミー	3,500	760.00	2,660,000



ユー・エス・エス	142,500	2,128.00	303,240,000
東京個別指導学院	4,300	942.00	4,050,600
サイバーエージェント	67,100	3,950.00	265,045,000
楽天	543,700	1,195.00	649,721,500
クリーク・アンド・リバー社	7,000	1,218.00	8,526,000
テー・オー・ダブリュー	10,400	776.00	8,070,400
山田コンサルティンググループ	5,700	2,017.00	11,496,900
セントラルスポーツ	4,400	3,215.00	14,146,000
フルキャストホールディングス	11,700	2,080.00	24,336,000
エン・ジャパン	17,000	3,980.00	67,660,000
リソルホールディングス	1,300	3,925.00	5,102,500
テクノプロ・ホールディングス	23,400	5,780.00	135,252,000
アトラ	2,800	285.00	798,000
インターワークス	2,500	627.00	1,567,500
アイ・アールジャパンホールディングス	4,800	2,822.00	13,545,600
K e e P e r 技研	4,400	1,443.00	6,349,200
ファーストロジック	2,900	559.00	1,621,100
三機サービス	2,500	1,147.00	2,867,500
G u n o s y	8,200	1,982.00	16,252,400
デザインワン・ジャパン	2,800	286.00	800,800
イー・ガーディアン	6,000	1,848.00	11,088,000
リブセンス	6,900	263.00	1,814,700
ジャパンマテリアル	32,000	1,412.00	45,184,000
ベクトル	14,300	1,075.00	15,372,500
ウチヤマホールディングス	6,000	542.00	3,252,000
チャーム・ケア・コーポレーション	3,800	1,645.00	6,251,000
ライクキッズネクスト	2,900	975.00	2,827,500
キャリアリンク	4,600	441.00	2,028,600
I B J	8,000	894.00	7,152,000
アサンテ	4,700	2,173.00	10,213,100
N・フィールド	7,700	717.00	5,520,900
バリューHR	2,600	3,500.00	9,100,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,200	5,780.00	24,276,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	1,204.00	5,899,600
E R Iホールディングス	3,400	952.00	3,236,800
アビスト	1,900	2,715.00	5,158,500
シグマクシス	5,700	1,258.00	7,170,600
ウィルグループ	7,700	883.00	6,799,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,600	270.00	4,482,000
日本ビューホテル	3,800	1,317.00	5,004,600
リクルートホールディングス	835,400	3,479.00	2,906,356,600
エラン	8,100	2,034.00	16,475,400

土木管理総合試験所	5,400	473.00	2,554,200
ネットマーケティング	4,400	467.00	2,054,800
日本郵政	955,900	1,207.00	1,153,771,300
ベルシステム24ホールディングス	19,600	1,563.00	30,634,800
鎌倉新書	8,600	1,598.00	13,742,800
ソネット・メディア・ネットワークス	1,600	812.00	1,299,200
一蔵	1,500	662.00	993,000
LITALICO	2,700	1,670.00	4,509,000
グローバルキッズCOMPANY	1,900	921.00	1,749,900
エボラブルアジア	5,100	2,350.00	11,985,000
アトラエ	3,100	3,160.00	9,796,000
ストライク	4,500	2,047.00	9,211,500
ソラスト	28,700	943.00	27,064,100
セラク	3,900	614.00	2,394,600
インソース	4,600	2,520.00	11,592,000
ベikalレント・コンサルティング	8,300	3,705.00	30,751,500
Orchestra Holdings	2,100	1,370.00	2,877,000
アイモバイル	3,800	858.00	3,260,400
キャリアインデックス	4,200	770.00	3,234,000
MS - Japan	4,800	1,597.00	7,665,600
船場	2,000	954.00	1,908,000
グレイステクノロジー	4,200	2,659.00	11,167,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,200	2,344.00	21,564,800
フルテック	1,700	1,172.00	1,992,400
グリーンズ	4,500	1,540.00	6,930,000
ツナググループ・ホールディングス	1,700	512.00	870,400
ソウルドアウト	1,200	2,619.00	3,142,800
MS&Consulting	2,000	1,101.00	2,202,000
日総工産	7,800	1,469.00	11,458,200
キュービーネットホールディングス	7,100	2,323.00	16,493,300
RPAホールディングス	2,400	5,090.00	12,216,000
スプリックス	4,000	1,860.00	7,440,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	720.00	3,456,000
リログループ	63,800	2,961.00	188,911,800
東祥	7,300	2,793.00	20,388,900
エイチ・アイ・エス	20,800	2,844.00	59,155,200
ラックランド	2,400	2,424.00	5,817,600
共立メンテナンス	17,900	5,180.00	92,722,000
イチネンホールディングス	12,200	1,115.00	13,603,000
建設技術研究所	8,100	1,503.00	12,174,300
スペース	7,700	1,210.00	9,317,000
長大	4,800	730.00	3,504,000

燦ホールディングス	2,600	2,390.00	6,214,000	
スバル興業	800	5,890.00	4,712,000	
東京テアトル	4,700	1,338.00	6,288,600	
タナベ経営	2,400	1,203.00	2,887,200	
ナガワ	3,300	5,780.00	19,074,000	
よみうりランド	2,600	5,230.00	13,598,000	
東京都競馬	7,700	3,415.00	26,295,500	
カナモト	17,500	2,748.00	48,090,000	
東京ドーム	43,700	1,088.00	47,545,600	
西尾レントオール	11,900	2,977.00	35,426,300	
トランス・コスモス	13,000	2,395.00	31,135,000	
乃村工藝社	54,600	1,398.00	76,330,800	
藤田観光	4,700	2,741.00	12,882,700	
KNT-CTホールディングス	6,200	1,385.00	8,587,000	
日本管財	12,600	1,877.00	23,650,200	
トーカイ	11,300	2,339.00	26,430,700	
白洋舎	1,400	2,846.00	3,984,400	
セコム	123,800	9,235.00	1,143,293,000	
セントラル警備保障	5,600	5,480.00	30,688,000	
丹青社	22,100	1,143.00	25,260,300	
メイテック	14,500	5,490.00	79,605,000	
応用地質	12,700	1,085.00	13,779,500	
船井総研ホールディングス	24,200	2,677.00	64,783,400	
進学会ホールディングス	5,500	607.00	3,338,500	
オオバ	9,400	660.00	6,204,000	
いであ	2,500	1,126.00	2,815,000	
学究社	3,900	1,299.00	5,066,100	
ベネッセホールディングス	42,800	2,580.00	110,424,000	
イオンディライト	14,400	3,210.00	46,224,000	
ナック	7,500	938.00	7,035,000	
ニチイ学館	16,700	1,525.00	25,467,500	
ダイセキ	19,600	2,773.00	54,350,800	
ステップ	4,400	1,490.00	6,556,000	
合 計	141,973,400		272,077,325,220	

## (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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2019年 6月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	631,449,415
国債証券	387,504,033,150
地方債証券	25,545,808,945
特殊債券	31,820,039,078
社債券	18,800,888,310
未収入金	316,681,000
未収利息	1,132,118,525
前払費用	34,587,560
流動資産合計	465,785,605,983
資産合計	465,785,605,983
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	138,488,610
未払利息	1,312
流動負債合計	438,489,922
負債合計	438,489,922
純資産の部	
元本等	
元本	325,773,760,165
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	139,573,355,896
元本等合計	465,347,116,061
純資産合計	465,347,116,061
負債純資産合計	465,785,605,983

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2019年 6月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	325,773,760,165口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 102,404,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4284円 (1万口当たり純資産額) (14,284円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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。

	2019年 6月10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 6月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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)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	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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	274,944,322,915円
期中追加設定元本額	71,665,093,322円
期中一部解約元本額	20,835,656,072円
期末元本額	325,773,760,165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）	3,873,476,642円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,446,700円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,242,195,272円
世界経済インデックスファンド	1,816,499,850円
D Cマイセレクション2 5	20,066,443,415円
D Cマイセレクション5 0	21,916,058,637円
D Cマイセレクション7 5	5,870,597,600円
D C日本債券インデックス・オープン	457,057,019円
D C日本債券インデックス・オープンS	84,082,917,860円
D C日本債券インデックス・オープンP	38,806,557,867円
D CマイセレクションS 2 5	8,132,741,290円
D CマイセレクションS 5 0	8,970,194,721円
D CマイセレクションS 7 5	1,692,020,224円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	1,176,407,556円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	1,263,341,902円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	423,672,991円
D C世界経済インデックスファンド	1,592,145,509円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	85,468,774円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,937,984円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	50,535,901円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,941,064円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	221,383,996円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	323,113,574円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	61,444,152円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	152,085,188円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	4,479,866,950円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	967,880,528円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,638,733,153円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	809,197,278円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	109,142,351円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,290,760,692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）	29,254,801円

区分	2019年 6月10日現在
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,481,318,409円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,823,783,488円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	166,695,170円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,524,182,637円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,096,413,011円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,362,245円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	764,037,252円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	52,184,766円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,722,501円
SMT インデックスバランス・オープン	65,682,154円
SMT 世界経済インデックス・オープン	9,419,590円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	10,018,960円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,839,200円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,142,130円
グローバル経済コア	238,146,947円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,917,359円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	502,921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）	76,776,725,119円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,147,294,100
地方債証券	23,050,786
特殊債券	41,140,998
社債券	55,683,100
合計	2,267,168,984

(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390回利付国債(2年)	3,320,000,000	3,329,794,000	
	第391回利付国債(2年)	2,850,000,000	2,859,262,500	
	第392回利付国債(2年)	730,000,000	732,547,700	
	第393回利付国債(2年)	740,000,000	742,760,200	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,044,201,600	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,441,600	
	第396回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,019,266,100	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,366,609,600	
	第398回利付国債(2年)	2,360,000,000	2,372,012,400	
	第399回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,196,354,600	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	633,578,400	
	第401回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,720,157,400	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,623,140,400	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,973,349,600	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,805,477,400	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,619,982,000	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,363,680,600	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,370,880,000	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,589,416,800	
	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,847,472,000	
	第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,791,618,600	
	第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,207,184,100	
	第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,752,420,000	
	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	5,981,479,000	
	第137回利付国債(5年)	3,430,000,000	3,479,632,100	
	第138回利付国債(5年)	8,960,000,000	9,097,267,200	
	第139回利付国債(5年)	4,120,000,000	4,186,579,200	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	624,968,000	
	第2回利付国債(40年)	470,000,000	715,043,900	
	第3回利付国債(40年)	550,000,000	844,393,000	
	第4回利付国債(40年)	850,000,000	1,318,469,000	
第5回利付国債(40年)	890,000,000	1,339,458,900		

第6回利付国債(40年)	640,000,000	951,097,600	
第7回利付国債(40年)	720,000,000	1,032,516,000	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	1,073,880,000	
第9回利付国債(40年)	1,090,000,000	1,098,796,300	
第10回利付国債(40年)	1,760,000,000	2,082,942,400	
第11回利付国債(40年)	1,730,000,000	1,988,981,000	
第310回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,431,375,600	
第311回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,093,608,000	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,891,038,700	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,385,896,500	
第314回利付国債(10年)	470,000,000	480,824,100	
第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,229,364,400	
第316回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,200,911,400	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	916,566,500	
第318回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,014,017,600	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,766,874,600	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,710,390,400	
第321回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,553,683,600	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	773,317,500	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	1,003,077,000	
第324回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,319,744,000	
第325回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,408,823,900	
第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,714,879,600	
第327回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,326,860,800	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,857,476,600	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,344,612,500	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,504,051,200	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,429,459,200	
第332回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,560,991,700	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,423,899,000	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,908,435,500	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,762,157,400	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	530,986,500	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,481,231,000	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,541,042,000	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,040,932,000	
第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	4,493,318,400	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,550,427,300	
第342回利付国債(10年)	3,460,000,000	3,538,542,000	
第343回利付国債(10年)	2,830,000,000	2,896,674,800	
第344回利付国債(10年)	2,420,000,000	2,478,176,800	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,028,470,400	

第346回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,930,041,400	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,326,477,600	
第348回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,373,245,400	
第349回利付国債(10年)	3,210,000,000	3,289,222,800	
第350回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,034,717,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,743,784,000	
第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	3,981,453,900	
第353回利付国債(10年)	4,710,000,000	4,819,130,700	
第354回利付国債(10年)	2,700,000,000	2,760,102,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	142,752,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	202,806,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	151,435,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	147,433,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	63,398,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	247,205,200	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	233,569,800	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	61,937,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	284,484,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	183,355,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	110,835,900	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	245,212,100	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	371,017,300	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	402,495,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	462,495,200	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	504,754,000	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	771,021,900	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	462,493,200	
第19回利付国債(30年)	380,000,000	511,046,800	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	662,908,800	
第21回利付国債(30年)	320,000,000	432,691,200	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	555,608,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	598,740,600	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	530,829,600	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	478,502,500	
第26回利付国債(30年)	430,000,000	596,964,700	
第27回利付国債(30年)	950,000,000	1,342,359,500	
第28回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,606,046,400	
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,975,344,000	
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,523,918,100	
第31回利付国債(30年)	960,000,000	1,330,243,200	
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,893,661,200	
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,269,563,400	

第34回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,978,886,300
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,318,967,300
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,315,930,400
第37回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,232,761,600
第38回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,425,466,800
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,288,589,600
第40回利付国債(30年)	720,000,000	972,086,400
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,235,904,900
第42回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,451,912,700
第43回利付国債(30年)	960,000,000	1,280,294,400
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,443,722,400
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,418,010,000
第46回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,420,881,000
第47回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,766,910,600
第48回利付国債(30年)	1,590,000,000	2,018,441,400
第49回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,602,518,400
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,198,121,800
第51回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,229,236,800
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,605,511,600
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,196,305,600
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,490,916,700
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,166,880,000
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,413,153,000
第57回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,302,134,800
第58回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,505,490,000
第59回利付国債(30年)	170,000,000	186,413,500
第60回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,509,342,700
第61回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,480,396,500
第62回利付国債(30年)	670,000,000	697,094,800
第47回利付国債(20年)	90,000,000	92,752,200
第48回利付国債(20年)	130,000,000	135,361,200
第49回利付国債(20年)	140,000,000	145,731,600
第50回利付国債(20年)	220,000,000	228,223,600
第51回利付国債(20年)	100,000,000	104,478,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,805,800
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,692,800
第54回利付国債(20年)	200,000,000	212,240,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,657,600
第56回利付国債(20年)	150,000,000	160,138,500
第57回利付国債(20年)	240,000,000	255,492,000
第58回利付国債(20年)	300,000,000	321,042,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,682,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	370,212,500

第 6 1 回利付国債(20年)	240,000,000	251,232,000	
第 6 2 回利付国債(20年)	320,000,000	333,456,000	
第 6 3 回利付国債(20年)	200,000,000	216,492,000	
第 6 4 回利付国債(20年)	320,000,000	349,436,800	
第 6 5 回利付国債(20年)	220,000,000	241,375,200	
第 6 6 回利付国債(20年)	330,000,000	360,554,700	
第 6 7 回利付国債(20年)	130,000,000	143,326,300	
第 6 8 回利付国債(20年)	190,000,000	212,228,100	
第 6 9 回利付国債(20年)	390,000,000	433,742,400	
第 7 0 回利付国債(20年)	400,000,000	453,244,000	
第 7 1 回利付国債(20年)	200,000,000	224,590,000	
第 7 2 回利付国債(20年)	630,000,000	708,214,500	
第 7 3 回利付国債(20年)	360,000,000	404,820,000	
第 7 4 回利付国債(20年)	200,000,000	226,018,000	
第 7 5 回利付国債(20年)	130,000,000	147,676,100	
第 7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	303,555,600	
第 7 7 回利付国債(20年)	290,000,000	327,737,700	
第 7 8 回利付国債(20年)	170,000,000	192,062,600	
第 7 9 回利付国債(20年)	270,000,000	306,690,300	
第 8 0 回利付国債(20年)	220,000,000	251,237,800	
第 8 1 回利付国債(20年)	390,000,000	445,103,100	
第 8 2 回利付国債(20年)	600,000,000	688,590,000	
第 8 3 回利付国債(20年)	290,000,000	334,544,000	
第 8 4 回利付国債(20年)	470,000,000	539,080,600	
第 8 5 回利付国債(20年)	290,000,000	336,139,000	
第 8 6 回利付国債(20年)	210,000,000	246,296,400	
第 8 7 回利付国債(20年)	550,000,000	641,283,500	
第 8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	495,335,400	
第 8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	410,284,000	
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	742,196,700	
第 9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	533,461,500	
第 9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	1,035,047,200	
第 9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	481,212,900	
第 9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	720,769,900	
第 9 5 回利付国債(20年)	610,000,000	733,769,000	
第 9 6 回利付国債(20年)	320,000,000	379,712,000	
第 9 7 回利付国債(20年)	400,000,000	479,984,000	
第 9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	524,286,400	
第 9 9 回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,375,837,000	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	580,790,400	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	877,855,550	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	410,000,000	505,644,800	

第103回利付国債(20年)	400,000,000	489,652,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	434,102,400	
第105回利付国債(20年)	680,000,000	823,160,400	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	463,573,400	
第107回利付国債(20年)	260,000,000	315,923,400	
第108回利付国債(20年)	660,000,000	789,228,000	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	623,558,000	
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,157,974,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,197,125,500	
第112回利付国債(20年)	790,000,000	966,967,900	
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,781,223,500	
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,158,756,800	
第115回利付国債(20年)	700,000,000	870,345,000	
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,322,615,000	
第117回利付国債(20年)	780,000,000	964,766,400	
第118回利付国債(20年)	660,000,000	811,786,800	
第119回利付国債(20年)	530,000,000	640,112,800	
第120回利付国債(20年)	790,000,000	936,576,600	
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,833,780,000	
第122回利付国債(20年)	440,000,000	532,914,800	
第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,599,027,200	
第124回利付国債(20年)	540,000,000	668,331,000	
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,037,259,000	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	906,141,700	
第127回利付国債(20年)	670,000,000	823,738,200	
第128回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,590,453,900	
第129回利付国債(20年)	550,000,000	671,462,000	
第130回利付国債(20年)	1,045,000,000	1,279,059,100	
第131回利付国債(20年)	640,000,000	775,468,800	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,020,784,800	
第133回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,325,991,600	
第134回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,230,690,000	
第135回利付国債(20年)	590,000,000	718,566,900	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	686,924,100	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,367,094,400	
第138回利付国債(20年)	320,000,000	382,268,800	
第139回利付国債(20年)	510,000,000	615,876,000	
第140回利付国債(20年)	1,750,000,000	2,140,705,000	
第141回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,973,521,900	
第142回利付国債(20年)	520,000,000	644,420,400	
第143回利付国債(20年)	720,000,000	874,440,000	
第144回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,765,176,000	
第145回利付国債(20年)	2,455,000,000	3,023,357,050	

第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,591,169,000	
第147回利付国債(20年)	1,690,000,000	2,064,774,400	
第148回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,260,979,600	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,075,457,400	
第150回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,766,017,100	
第151回利付国債(20年)	1,735,000,000	2,026,774,950	
第152回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,524,996,800	
第153回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,562,732,000	
第154回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,319,530,400	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,462,032,800	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,040,164,000	
第157回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,123,968,200	
第158回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,334,356,700	
第159回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,006,846,600	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	2,126,455,500	
第161回利付国債(20年)	1,710,000,000	1,833,769,800	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,198,440,500	
第163回利付国債(20年)	1,680,000,000	1,801,648,800	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,874,909,600	
第165回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,094,163,200	
第166回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,438,496,400	
第167回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,176,460,100	
第168回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,082,728,500	
国債証券合計	350,190,000,000	387,504,033,150	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,764,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,480,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	137,411,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	135,789,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,091,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,880,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,625,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,934,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	240,774,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	240,104,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	102,110,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	102,387,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	102,295,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	205,208,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	102,681,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,340,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	103,484,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	102,920,000	

第751回東京都公募公債	100,000,000	102,247,000	
第764回東京都公募公債	150,000,000	152,196,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	101,435,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	101,240,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,804,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,861,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,307,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,426,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	304,992,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	140,548,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	119,800,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,160,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,878,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,107,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,636,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,240,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	240,516,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,927,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,574,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,774,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,217,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,501,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,721,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	154,639,100	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,134,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,022,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,717,600	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,728,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,484,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	120,128,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,399,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,275,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	105,415,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	119,352,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	103,126,000	
第4回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	210,144,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,159,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,414,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,483,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	125,411,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	108,944,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,681,163	



平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,411,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,525,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,320,000	
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	101,568,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	122,311,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,578,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,358,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,464,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,389,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,227,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,350,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,702,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,640,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,164,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	108,696,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	121,434,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,773,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,956,844	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,380,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	119,170,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	111,606,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,044,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	197,195,820	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,991,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,038,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,118,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,899,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,473,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,322,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,255,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,245,000	
	100,000,000	110,664,000	

平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）			
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	122,312,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,796,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,962,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	136,492,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,867,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	108,144,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	119,985,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,734,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,514,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,392,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,209,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,473,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,846,400	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,506,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,001,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,174,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	365,113,600	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,289,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,504,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,788,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,988,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,600,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,590,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,508,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,860,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,429,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,953,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,919,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,990,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,420,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,079,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,894,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,704,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,652,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,466,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,573,312	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,139,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,510,000	

第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,390,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,053,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,426,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,435,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,223,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,202,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,703,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,566,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,227,456	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,587,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,116,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,330,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,457,000	
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	243,656,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,513,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	139,370,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	119,435,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	129,782,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,589,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,555,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	103,361,700	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,678,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,658,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,074,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,606,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	141,205,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	242,092,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,016,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	121,123,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,638,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,164,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,474,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,501,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,926,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	111,262,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,787,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,323,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	119,608,000	

	第89回川崎市公募公債	100,000,000	101,051,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,415,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,989,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,770,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,577,600	
	平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	121,358,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,644,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	102,472,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,367,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,698,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,444,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,143,450	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	173,027,700	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	205,166,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	203,552,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,480,000	
	地方債証券合計	24,136,220,000	25,545,808,945	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,866,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,705,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,094,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,903,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,009,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,122,000	
	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	103,347,000	
	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	206,992,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,202,000	
	第14回道路債券	100,000,000	106,608,000	
	第17回道路債券	100,000,000	105,304,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	466,148,000	
	第21回道路債券	100,000,000	134,881,000	
	第28回道路債券	200,000,000	273,864,000	
	第33回道路債券	200,000,000	277,842,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,369,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	161,481,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,458,000	

第42回道路債券	100,000,000	112,436,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,851,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,579,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,805,000	
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	153,191,000	
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	243,130,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,651,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,660,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,880,000	
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	136,564,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,136,000	
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	203,878,000	
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	123,402,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,049,000	
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	102,550,000	
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	102,461,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,351,000	
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	307,527,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,389,000	
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	308,567,140	
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	205,662,000	
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	102,890,000	
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	102,745,000	
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	308,364,000	
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	120,216,000	
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	103,226,000	
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	309,672,000	

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	205,418,000	
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	204,614,000	
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	307,866,000	
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	207,614,000	
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	153,464,160	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,885,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,372,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	237,190,000	
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	105,621,000	
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	103,512,000	
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	103,356,000	
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	103,188,000	
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	102,872,000	
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	306,285,000	
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	204,656,000	
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	101,177,000	
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	98,758,000	
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	107,319,930	
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	318,856,640	
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	207,318,550	
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	101,368,000	
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	304,029,000	
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	101,524,000	
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	530,223,200	
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	203,146,000	
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	218,605,280	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,080,000	

第3回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	313,143,000	
第3回公営企業債券(20年)	110,000,000	114,241,600	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	110,630,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,416,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,181,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,262,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,334,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,636,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,891,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,119,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,392,690	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,522,980	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,649,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	119,775,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,499,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,905,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,742,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,198,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,294,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,592,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,726,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,724,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,525,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,905,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,699,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,380,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,666,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,338,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,467,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,109,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,903,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,131,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,355,870	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,542,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,515,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,153,800	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,137,160	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,142,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,257,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,466,000	

F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,936,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,247,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,818,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	112,205,000	
第 1 9 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,949,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	123,558,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,425,880	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,544,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,093,700	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,796,100	
第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	101,638,000	
第 1 2 7 回都市再生債券	400,000,000	400,144,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,897,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	106,026,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,876,400	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,706,000	15,368,358	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,910,000	15,655,798	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,309,000	16,214,068	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	261,174,000	263,057,064	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	182,776,000	183,896,416	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,272,000	16,106,920	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,332,000	17,265,863	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,270,000	13,674,735	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	27,360,000	28,602,691	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,897,000	16,726,664	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,299,000	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,431,000	15,129,604	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,754,000	17,750,527	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,364,000	15,080,045	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,595,000	17,569,956	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,070,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,674,000	16,020,238	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,996,000	16,344,712	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,036,000	23,768,911	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,437,000	24,268,083	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,890,000	27,093,262	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,086,000	30,291,031	



第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,111,000	32,581,005	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,210,000	33,690,258	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,600,000	70,754,848	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,770,000	15,392,850	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,953,000	35,211,598	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,743,000	15,354,539	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,639,000	15,434,336	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,005,000	38,606,721	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,598,000	14,253,831	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,674,000	38,323,864	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,428,000	35,869,246	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,496,000	16,472,093	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,074,000	71,485,456	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,453,000	38,917,951	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,214,000	16,008,779	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,650,000	50,710,559	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,431,000	48,331,769	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,359,000	48,289,191	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,319,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,878,000	102,872,810	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,018,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,053,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,483,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,082,000	109,481,774	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,593,000	55,257,887	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,558,000	55,642,103	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,577,000	56,796,977	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,351,000	49,985,136	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,265,000	49,535,610	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,090,000	56,400,692	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	183,892,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,767,000	51,127,810	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,931,000	57,486,939	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,187,000	58,858,129	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,157,000	59,710,203	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,642,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,674,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,270,000	125,641,258	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,472,000	63,951,780	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,794,000	132,124,938	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,166,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,793,000	74,498,878	

第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,603,000	78,243,812
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,900,000	77,923,713
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,616,000	160,345,916
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,581,000	78,735,750
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,212,000	83,668,335
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,816,000
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,871,000	90,101,863
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,182,000	90,220,078
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,627,000
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,241,000	90,684,026
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,718,000	91,591,311
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,325,000	92,074,595
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,339,000
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,238,000	93,926,877
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,621,000	94,441,928
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,787,000	94,379,224
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,091,000	94,721,023
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,616,000	95,320,747
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,212,000	191,223,392
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,991,000	95,668,739
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,348,000	193,259,929
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,891,000	96,611,373
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,562,000	193,708,178
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,959,000	97,692,979
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,614,000	196,645,995
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,888,000	196,918,469
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	135,722,000
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,446,000	99,564,476
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,028,000	100,385,573

	第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,390,000	99,843,220
	第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,162,000	200,220,903
	第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,451,000	100,390,811
	第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,864,000	100,965,499
	第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,768,000
	第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,338,000
	第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,565,000
	第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	209,166,000
	第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,073,000
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,999,000
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,929,000
	い第786号商工債	300,000,000	300,744,000
	い第795号商工債	200,000,000	199,890,000
	い第795号農林債	100,000,000	99,967,000
	い第796号農林債	200,000,000	199,932,000
	第309回信金中金債(5年)	100,000,000	100,260,000
	第317回信金中金債(5年)	200,000,000	200,094,000
	第337回信金中金債(5年)	100,000,000	100,212,000
	第338回信金中金債(5年)	100,000,000	100,217,000
	第339回信金中金債(5年)	200,000,000	200,444,000
	第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,251,000
	第350回信金中金債(5年)	100,000,000	100,163,000
	第218号商工債(3年)	300,000,000	300,375,000
	第221号商工債(3年)	200,000,000	200,226,000
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	102,858,000
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,978,000
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,880,000
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,679,000
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,169,000
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,804,000
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,574,000
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,909,000
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,964,000
	特殊債券合計	30,047,850,000	31,820,039,078
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,997,000
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,736,000

第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	100,173,000	
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	200,000,000	200,894,000	
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,168,000	
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,342,000	
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,775,000	
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円 貨社債	200,000,000	199,924,000	
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	199,826,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	100,157,000	
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	100,236,000	
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	100,565,000	
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	105,570,000	
第11回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	300,000,000	300,753,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	200,000,000	200,904,000	
第9回オーストラリア・ニュージーランド銀 行円貨社債	100,000,000	100,290,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,998,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,737,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,099,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,299,000	
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	100,443,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	102,830,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,804,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,951,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,557,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,784,000	
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	100,339,000	
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	103,146,000	
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	100,111,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
	100,000,000	101,596,000	

第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債			
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,440,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,828,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,331,000	
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	101,216,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,012,000	
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	100,639,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,095,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,876,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,283,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,633,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,243,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,811,000	
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	100,454,000	
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	101,128,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,225,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,848,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,656,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,691,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,454,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,078,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,609,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,887,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,296,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,221,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,174,000	
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	100,243,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	201,034,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,366,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,305,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,966,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,074,000	
第2回ユニバーファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,789,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,494,000	

第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,838,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,460,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,191,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	124,573,000	
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	101,721,000	
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	102,969,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,422,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,672,000	
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	102,599,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	102,086,000	
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	308,310,000	
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	101,726,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,273,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
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	100,696,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,140,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,153,000	
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	200,782,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,990,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,243,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,496,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,790,000	
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	100,536,000	
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	200,566,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,012,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,456,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,343,000	

第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,079,000	
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	104,184,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,326,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,411,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,841,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,894,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,343,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,995,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,834,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,681,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,068,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,929,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,197,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	120,063,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,009,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,034,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,270,400	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	136,821,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	132,385,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,006,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,524,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,682,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,598,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,132,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,276,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,366,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,003,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,271,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,432,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,747,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,999,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,481,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,152,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	202,770,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,685,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,262,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,432,000	

第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,690,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,403,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,861,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,064,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,846,400	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,653,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,170,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,730,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,575,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,201,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,232,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,310,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,803,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,162,510	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,104,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,189,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,816,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,726,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,552,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,847,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,478,000	
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	101,397,000	
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	202,326,000	
社債券合計	18,266,000,000	18,800,888,310	
合計		463,670,769,483	

(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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表



	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,988,151,524
コール・ローン	138,359,821
株式	332,606,967,436
投資信託受益証券	257,882,607
投資証券	9,203,873,608
派生商品評価勘定	54,334,070
未収入金	19,502,508
未収配当金	701,140,507
差入委託証拠金	2,150,398,580
流動資産合計	352,120,610,661
資産合計	352,120,610,661
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,996,466
前受金	3,369,784
未払解約金	1,767,814,720
未払利息	287
流動負債合計	1,824,181,257
負債合計	1,824,181,257
純資産の部	
元本等	
元本	137,917,434,727
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	212,378,994,677
元本等合計	350,296,429,404
純資産合計	350,296,429,404
負債純資産合計	352,120,610,661

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2019年 6月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,917,434,727口

		2019年 6月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,5399円 (25,399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 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2019年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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。		

	2019年 6月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	137,398,170,903円
期中追加設定元本額	17,810,137,669円
期中一部解約元本額	17,290,873,845円
期末元本額	137,917,434,727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）	2,429,390,246円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,779,266円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,129,793,610円
世界経済インデックスファンド	7,433,351,694円
外国株式インデックス・オープン	888,632,475円

区分	2019年 6月10日現在
DCマイセレクション25	1,073,736,940円
DCマイセレクション50	4,803,011,870円
DCマイセレクション75	5,040,821,715円
DC外国株式インデックス・オープン	8,387,556,369円
DCマイセレクションS25	432,734,522円
DCマイセレクションS50	1,950,857,111円
DCマイセレクションS75	1,453,432,756円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	110,505,626円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	188,087,883円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	123,824,340円
DC世界経済インデックスファンド	6,430,501,225円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,764,713,596円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,911,548円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,445,891円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	56,991,390円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	62,735,546円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	218,776,813円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	36,550,241円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	310,175,619円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	746,384,031円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	378,068,512円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,464,250,673円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,902,664,886円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	84,016,205円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	365,034,251円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	9,617,282円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	126,670,238円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,007,272,335円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,127,453,573円
外国株式ファンド・シリーズ1	923,576,839円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,574,357,241円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,658,744,232円
分散投資コア戦略ファンドA	2,305,347,866円
分散投資コア戦略ファンドS	4,690,745,601円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	856,757,630円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,004,524,508円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,176,977,958円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	836,649,052円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,637,643円
SMT インデックスバランス・オープン	276,062,860円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,683,436,442円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,915,194,239円
SMT 世界経済インデックス・オープン	69,295,240円

区分	2019年 6月10日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	307,024,434円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	47,475,778円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,277,445円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	43,494,743円
グローバル経済コア	1,140,793,887円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	6,130,198円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	325,485円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,320,547円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	56,087,488円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	58,867円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	66,613円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,359円
D C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）	1,429,471,762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）	786,902,715円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,190,791,447円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,784,306,740
投資信託受益証券	1,727,776
投資証券	216,672,047
合計	6,002,706,563

(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 6月10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	8,284,653,583	-	8,288,023,367	3,369,784
	合計	8,284,653,583	-	8,288,023,367	3,369,784

## (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 6月10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	105,028,000	-	105,028,000	-
	アメリカドル	105,028,000	-	105,028,000	-
	売建	1,651,963,720	-	1,653,995,900	2,032,180
	アメリカドル	1,171,584,000	-	1,171,908,000	324,000
	ユーロ	238,463,550	-	239,518,500	1,054,950
	イギリスポンド	139,037,610	-	139,440,600	402,990
	オーストラリアドル	102,878,560	-	103,128,800	250,240
合計		1,756,991,720	-	1,759,023,900	2,032,180

### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	70.05	3,108,819.00	
	APACHE CORP	34,273	28.95	992,203.35	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	23.32	1,035,408.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	25.44	912,761.76	
	CHENIERE ENERGY INC	18,402	67.60	1,243,975.20	
	CHEVRON CORP	161,747	121.48	19,649,025.56	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	55.48	421,592.52	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	100.22	1,751,945.82	
	CONOCOPHILLIPS	96,852	58.96	5,710,393.92	

CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	38.92	297,621.24
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	25.69	972,649.09
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	97.02	1,308,508.74
EOG RESOURCES INC	49,840	84.60	4,216,464.00
EXXON MOBIL	358,711	74.58	26,752,666.38
HALLIBURTON CO	76,620	21.63	1,657,290.60
HELMERICH & PAYNE	8,315	51.89	431,465.35
HESS CORP	22,081	56.55	1,248,680.55
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	40.09	565,669.90
KINDER MORGAN INC	167,254	21.13	3,534,077.02
MARATHON OIL CORP	74,537	13.31	992,087.47
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	46.99	2,712,262.80
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	20.85	631,984.35
NOBLE ENERGY INC	38,291	20.69	792,240.79
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,462	47.84	3,083,862.08
ONEOK INC	34,074	65.99	2,248,543.26
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	17.54	359,131.50
PHILLIPS 66	38,115	85.52	3,259,594.80
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	144.98	2,095,685.90
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	23.36	231,030.40
SCHLUMBERGER	119,098	35.60	4,239,888.80
TARGA RESOURCES CORP	20,002	38.54	770,877.08
TECHNIPFMC PLC	36,005	22.58	812,992.90
VALERO ENERGY CORP	35,352	74.73	2,641,854.96
WILLIAMS COS	105,155	27.76	2,919,102.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,003	223.06	4,238,809.18
ALBEMARLE CORP	8,647	69.08	597,334.76
AVERY DENNISON CORP	7,457	112.15	836,302.55
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	25.41	447,368.46
BALL CORP	27,142	65.90	1,788,657.80
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	101.12	1,117,679.36
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,052	42.03	884,815.56
CHEMOURS CO/THE	15,493	22.58	349,831.94
CORTEVA INC	64,411	26.31	1,694,653.41
CROWN HOLDINGS INC	10,321	59.62	615,338.02
DOW INC	65,790	51.30	3,375,027.00
DUPONT DE NEMOURS INC	64,411	73.64	4,743,226.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	71.33	845,831.14
ECOLAB INC	21,748	198.75	4,322,415.00
FMC CORP	12,118	80.72	978,164.96
FREEMPORT-MCMORAN INC	112,473	10.35	1,164,095.55
INT'L PAPER CO	33,803	44.97	1,520,120.91



INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	151.32	1,312,549.68
LINDE PLC	47,208	200.05	9,443,960.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,177	79.22	1,994,521.94
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	230.63	1,150,613.07
MOSAIC CO/THE	31,911	22.15	706,828.65
NEWMONT GOLDCORP CORP	69,458	35.67	2,477,566.86
NUCOR CORP	27,868	50.84	1,416,809.12
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	95.70	850,773.00
PPG INDUSTRIES INC	19,958	113.99	2,275,012.42
SEALED AIR CORP	14,689	44.80	658,067.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,287	473.98	3,453,892.26
STEEL DYNAMICS INC	18,273	25.93	473,818.89
VULCAN MATERIALS CO	10,740	134.38	1,443,241.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	63.47	219,288.85
WESTROCK CO	21,244	36.42	773,706.48
3 M COMPANY	49,155	166.61	8,189,714.55
ACUITY BRANDS INC	3,505	130.68	458,033.40
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	47.20	534,776.00
ALLEGION PLC	7,435	104.14	774,280.90
AMETEK INC	19,001	85.77	1,629,715.77
ARCONIC INC	36,550	23.54	860,387.00
BOEING CO	45,639	353.70	16,142,514.30
CATERPILLAR	49,668	124.46	6,181,679.28
CUMMINS INC	12,585	161.95	2,038,140.75
DEERE&CO	26,347	148.71	3,918,062.37
DOVER CORP	12,008	96.05	1,153,368.40
EATON CORP	37,641	79.08	2,976,650.28
EMERSON ELECTRIC CO	53,427	63.68	3,402,231.36
FASTENAL CO	46,922	32.26	1,513,703.72
FLOWSERVE CORP	10,826	49.29	533,613.54
FLUOR CORP	11,267	29.39	331,137.13
FORTIVE CORP	25,813	78.97	2,038,452.61
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	51.99	665,991.90
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	173.97	3,657,023.37
GENERAL ELECTRIC CO	745,767	9.98	7,442,754.66
GRAINGER (WW) INC	3,976	271.12	1,077,973.12
HARRIS CORP	9,793	198.21	1,941,070.53
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	42.11	641,166.86
HEICO CORP	3,640	127.95	465,738.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	102.27	659,539.23
HONEYWELL INTL INC	62,478	172.26	10,762,460.28
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	218.20	768,500.40

IDEX CORP	6,916	161.58	1,117,487.28
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	151.14	4,236,151.92
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	125.35	2,547,362.70
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	79.40	954,864.40
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	65.77	1,321,977.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	38.05	780,025.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	69,399	39.11	2,714,194.89
L3 TECHNOLOGIES INC	6,974	256.37	1,787,924.38
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	278.31	802,924.35
LOCKHEED MARTIN CORP	22,009	355.23	7,818,257.07
MASCO CORP	24,547	37.96	931,804.12
MIDDLEBY CORP	4,364	133.71	583,510.44
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,287	318.29	4,547,409.23
OWENS CORNING	7,979	52.60	419,695.40
PACCAR INC	30,075	70.22	2,111,866.50
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	165.54	1,877,223.60
PENTAIR PLC	13,583	36.44	494,964.52
RAYTHEON COMPANY	24,615	185.91	4,576,174.65
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	157.13	1,651,593.43
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	365.37	3,186,026.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	45.79	633,184.12
SMITH (A.O.) CORP	12,146	43.83	532,359.18
SNAP-ON INC	4,900	162.44	795,956.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	84.29	714,863.49
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	137.69	1,822,189.46
TEXTRON	21,877	49.11	1,074,379.47
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	468.88	1,909,279.36
UNITED RENTALS INC	6,446	122.23	787,894.58
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,171	132.15	9,273,097.65
WABCO HOLDINGS INC	3,841	131.06	503,401.46
WABTEC CORP	11,163	67.37	752,051.31
XYLEM INC	16,060	79.56	1,277,733.60
CINTAS CORP	7,934	232.62	1,845,607.08
COPART INC	17,540	74.65	1,309,361.00
COSTAR GROUP INC	3,008	539.88	1,623,959.04
EQUIFAX INC	10,799	130.17	1,405,705.83
IHS MARKIT LTD	32,775	59.60	1,953,390.00
MANPOWER GROUP	5,123	88.78	454,819.94
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	22.75	625,716.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	86.79	1,602,230.19
ROBERT HALF INTL INC	9,566	53.84	515,033.44
ROLLINS INC	10,546	38.49	405,915.54

TRANSUNION	15,344	69.58	1,067,635.52
VERISK ANALYTICS INC	13,480	146.47	1,974,415.60
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	93.88	2,159,991.04
WASTE MANAGEMENT INC	36,731	114.36	4,200,557.16
AMERCO	602	392.69	236,399.38
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	30.92	306,726.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	79.69	912,291.12
CSX CORP	68,519	78.07	5,349,278.33
DELTA AIR LINES INC	15,095	55.07	831,281.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	72.56	1,001,545.68
FEDEX CORP	21,697	158.02	3,428,559.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	87.39	623,440.26
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	117.50	1,027,302.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	30.17	322,819.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	203.04	4,632,154.56
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	136.16	714,159.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	50.37	577,492.05
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	44.16	695,475.84
UNION PACIFIC CORP	62,195	171.97	10,695,674.15
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	83.27	499,869.81
UNITED PARCEL SERVICE B	59,561	98.23	5,850,677.03
XPO LOGISTICS INC	10,037	53.78	539,789.86
APTIV PLC	23,291	73.40	1,709,559.40
AUTOLIV INC	6,639	66.39	440,763.21
BORGWARNER INC	15,953	39.77	634,450.81
FORD MOTOR COMPANY	315,578	9.76	3,080,041.28
GENERAL MOTORS CO	106,331	35.49	3,773,687.19
HARLEY-DAVIDSON	14,677	34.65	508,558.05
LEAR CORP	5,287	133.30	704,757.10
TESLA INC	10,812	204.50	2,211,054.00
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	34.21	395,022.87
DR HORTON INC	28,998	45.60	1,322,308.80
GARMIN LTD	9,564	78.95	755,077.80
HANESBRANDS INC	31,136	16.25	505,960.00
HASBRO INC	10,617	105.92	1,124,552.64
LEGGETT & PLATT INC	10,594	37.92	401,724.48
LENNAR CORP-CL A	23,545	53.36	1,256,361.20
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	172.49	1,461,335.28
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	146.95	743,860.90
NEWELL BRANDS INC	37,563	14.57	547,292.91
NIKE B	107,381	83.41	8,956,649.21
NVR INC	264	3,391.00	895,224.00

POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	87.68	411,306.88
PULTE GROUP INC	21,959	32.75	719,157.25
PVH CORP	7,252	88.37	640,859.24
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	110.88	507,608.64
TAPESTRY INC	25,989	30.25	786,167.25
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	25.90	413,105.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	22.89	372,717.87
VF CORP	28,754	84.71	2,435,751.34
WHIRLPOOL CORP	5,324	128.74	685,411.76
ARAMARK	19,980	35.56	710,488.80
BLOCK H & R INC	16,984	27.21	462,134.64
CARNIVAL CORPORATION	35,126	52.23	1,834,630.98
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,041	709.87	1,448,844.67
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	121.32	1,216,960.92
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	287.00	991,011.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	92.51	2,176,112.73
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	56.08	1,813,683.28
MARRIOTT INTL A	25,016	132.52	3,315,120.32
MCDONALD'S CORP	65,135	205.48	13,383,939.80
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	19.37	342,112.94
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	26.28	1,173,559.68
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	52.59	938,100.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	120.97	1,679,668.45
STARBUCKS CORP	104,538	82.48	8,622,294.24
VAIL RESORTS INC	3,574	237.13	847,502.62
WYNN RESORTS LTD	8,052	111.02	893,933.04
YUM BRANDS INC	27,323	109.07	2,980,119.61
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,388	45.38	2,785,787.44
ALPHABET INC-CL A	25,292	1,068.37	27,021,214.04
ALPHABET INC-CL C	26,644	1,066.04	28,403,569.76
ALTICE USA INC- A	12,457	24.71	307,812.47
CBS CORP-CL B	28,628	48.42	1,386,167.76
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	394.04	5,371,553.28
COMCAST CORP-CL A	383,994	41.48	15,928,071.12
DISCOVERY INC - A	12,804	28.42	363,889.68
DISCOVERY INC-C	23,672	26.49	627,071.28
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	37.10	675,887.80
ELECTRONIC ARTS INC	26,819	96.99	2,601,174.81
FACEBOOK INC-A	203,629	173.35	35,299,087.15
FOX CORP - CLASS A	30,270	34.01	1,029,482.70
FOX CORP- CLASS B	12,152	33.68	409,279.36
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	228.18	1,452,137.52

INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	21.95	742,656.30
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	102.22	885,531.86
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.24	407,139.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	25.61	1,185,000.31
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	38.12	712,577.16
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	35.80	545,341.40
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	35.69	227,844.96
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	62.19	785,895.03
NETFLIX INC	36,840	360.87	13,294,450.80
NEWS CORP-CLASS A	33,479	11.72	392,373.88
OMNICOM GROUP	19,030	79.31	1,509,269.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.31	687,671.55
SNAP INC - A	57,914	13.87	803,267.18
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	111.65	1,066,480.80
THE WALT DISNEY CO	152,138	138.04	21,001,129.52
TRIPADVISOR INC	10,393	45.27	470,491.11
TWITTER INC	61,378	37.93	2,328,067.54
VIACOM INC-CLASS B	31,895	29.28	933,885.60
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	46.54	463,631.48
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	155.35	960,995.10
AMAZON.COM	35,539	1,804.03	64,113,422.17
AUTOZONE INC	2,085	1,099.14	2,291,706.90
BEST BUY COMPANY INC	21,836	63.72	1,391,389.92
BOOKING HOLDINGS INC	3,901	1,778.29	6,937,109.29
BURLINGTON STORES INC	6,004	163.38	980,933.52
CARMAX INC	14,253	79.89	1,138,672.17
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	133.15	2,973,239.50
DOLLAR TREE INC	19,630	102.64	2,014,823.20
EBAY	78,686	37.51	2,951,511.86
EXPEDIA GROUP INC	11,152	122.60	1,367,235.20
GAP	21,891	18.21	398,635.11
GENUINE PARTS CO	12,722	102.29	1,301,333.38
GRUBHUB INC	8,261	65.22	538,782.42
HOME DEPOT	95,597	197.30	18,861,288.10
KOHL'S CORP	14,645	48.18	705,596.10
L BRANDS INC	19,499	22.70	442,627.30
LKQ CORP	24,693	26.56	655,846.08
LOWES COMPANIES	67,906	96.76	6,570,584.56
MACY'S INC	25,926	20.43	529,668.18
MERCADOLIBRE INC	3,727	604.49	2,252,934.23
NORDSTROM INC	10,094	31.67	319,676.98
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,012	382.26	2,680,407.12

QURATE RETAIL INC	35,071	12.89	452,065.19
ROSS STORES INC	31,827	99.16	3,155,965.32
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	86.85	3,633,456.60
TIFFANY & CO	9,326	90.47	843,723.22
TJX COMPANIES INC	106,813	51.92	5,545,730.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,304	108.57	1,227,275.28
ULTA BEAUTY INC	4,911	338.16	1,660,703.76
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	154.28	821,849.56
COSTCO WHOLESALE CORP	37,583	256.01	9,621,623.83
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	7.71	261,369.00
KROGER CO	68,147	23.93	1,630,757.71
SYSCO CORP	42,872	71.50	3,065,348.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	51.97	3,503,141.79
WALMART INC	122,729	106.06	13,016,637.74
ALTRIA GROUP INC	158,456	51.38	8,141,469.28
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	39.58	1,891,844.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	56.50	1,245,260.00
BUNGE LIMITED	11,767	55.15	648,950.05
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	43.08	606,221.76
COCA-COLA CO	342,026	51.49	17,610,918.74
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	57.61	983,748.36
CONAGRA BRANDS INC	39,943	29.63	1,183,511.09
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	188.40	2,640,991.20
GENERAL MILLS INC	50,246	51.81	2,603,245.26
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	138.01	1,728,023.21
HORMEL FOODS CORP	23,465	42.05	986,703.25
INGREDION INC	5,835	80.71	470,942.85
JM SMUCKER CO	9,442	124.53	1,175,812.26
KELLOGG CO	21,051	55.99	1,178,645.49
KRAFT HEINZ CO/THE	53,058	28.74	1,524,886.92
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	60.99	788,234.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	157.80	1,574,212.80
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	56.97	860,247.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	54.02	6,603,080.68
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	65.92	2,302,717.44
PEPSICO INC	119,352	133.47	15,929,911.44
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,107	78.17	10,404,974.19
TYSON FOODS INC	24,363	82.45	2,008,729.35
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	77.98	1,658,166.72
CLOROX COMPANY	10,995	156.63	1,722,146.85
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,032	73.99	5,255,657.68
COTY INC-CL A	30,534	13.52	412,819.68

ESTEE LAUDER CO-CL A	18,908	176.86	3,344,068.88
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	134.91	3,969,456.93
PROCTER & GAMBLE CO	210,947	108.77	22,944,705.19
ABBOTT LABORATORIES	148,700	80.74	12,006,038.00
ABIOMED INC	3,502	267.87	938,080.74
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	307.66	1,927,182.24
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	83.48	1,072,467.56
ANTHEM INC	21,803	278.13	6,064,068.39
BAXTER INTERNATIONAL	44,084	77.58	3,420,036.72
BECTON DICKINSON & CO	22,592	238.38	5,385,480.96
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,205	41.28	4,796,942.40
CARDINAL HEALTH	25,252	43.85	1,107,300.20
CENTENE CORP	35,914	54.21	1,946,897.94
CERNER CORP	25,778	72.74	1,875,091.72
CIGNA CORP	32,709	157.47	5,150,686.23
CVS HEALTH CORP	111,050	53.92	5,987,816.00
DANAHER CORP	54,225	137.52	7,457,022.00
DAVITA INC	11,875	47.69	566,318.75
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	55.94	997,633.96
DEXCOM INC	7,827	125.98	986,045.46
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	183.81	3,278,986.59
HCA HEALTHCARE INC	22,986	128.41	2,951,632.26
HENRY SCHEIN INC	12,492	69.76	871,441.92
HOLOGIC INC	24,459	47.00	1,149,573.00
HUMANA INC	11,944	248.87	2,972,503.28
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	264.92	1,908,748.60
INTUITIVE SURGICAL INC	9,805	499.04	4,893,087.20
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	166.98	1,473,932.46
MCKESSON CORP	16,655	130.28	2,169,813.40
MEDTRONIC PLC	113,614	97.11	11,033,055.54
QUEST DIAGNOSTICS	12,284	99.34	1,220,292.56
RESMED INC	12,398	117.40	1,455,525.20
STERIS PLC	7,229	138.02	997,746.58
STRYKER CORP	29,041	194.30	5,642,666.30
TELEFLEX INC	3,697	305.28	1,128,620.16
THE COOPER COS INC	4,135	321.95	1,331,263.25
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,621	246.77	20,141,614.17
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	123.71	896,650.08
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	130.69	1,076,493.53
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,212	162.20	1,656,386.40
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	288.33	1,269,516.99
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	120.73	2,093,699.66

ABBVIE INC	127,283	77.43	9,855,522.69
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	69.52	1,903,944.24
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	118.40	2,255,283.20
ALKERMES PLC	12,547	22.83	286,448.01
ALLERGAN PLC	29,318	127.13	3,727,197.34
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	70.40	520,889.60
AMGEN	53,917	175.51	9,462,972.67
BEIGENE LTD-ADR	2,369	122.50	290,202.50
BIOGEN INC	17,262	227.23	3,922,444.26
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	80.64	1,305,722.88
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140,314	46.75	6,559,679.50
CELGENE CORP	59,466	96.04	5,711,114.64
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	23,667	32.69	773,674.23
EXACT SCIENCES CORP	10,748	108.05	1,161,321.40
GILEAD SCIENCES INC	111,360	65.35	7,277,376.00
ILLUMINA INC	12,711	335.49	4,264,413.39
INCYTE CORP	16,120	80.83	1,302,979.60
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	63.68	715,508.48
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	138.74	1,977,738.70
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	130.97	651,051.87
JOHNSON & JOHNSON	227,778	138.55	31,558,641.90
LILLY (ELI) & CO	75,567	118.35	8,943,354.45
MERCK & CO	220,538	82.46	18,185,563.48
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,243	790.88	1,773,943.84
MYLAN NV	42,644	17.40	742,005.60
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	33.00	445,731.00
PERKINELMER INC	9,475	92.92	880,417.00
PERRIGO CO PLC	11,333	44.02	498,878.66
PFIZER	467,485	42.92	20,064,456.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	306.72	2,122,809.12
SEATTLE GENETICS INC	9,601	70.55	677,350.55
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	9.26	747,189.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,582	281.69	9,741,403.58
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	173.51	3,753,715.34
WATERS CORP	6,513	208.77	1,359,719.01
ZOETIS INC	41,718	110.06	4,591,483.08
BANK OF AMERICA CORP	789,496	27.53	21,734,824.88
BB&T CORP	64,191	48.83	3,134,446.53
CIT GROUP INC	10,713	48.95	524,401.35
CITIGROUP	197,425	65.69	12,968,848.25
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	33.86	1,354,738.60
COMERICA INC	14,360	70.14	1,007,210.40



EAST WEST BANCORP INC	13,827	44.23	611,568.21
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	26.83	1,561,962.11
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	97.94	1,383,500.44
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	13.26	1,135,891.38
JPMORGAN CHASE & CO	276,755	109.16	30,210,575.80
KEY CORP	87,033	16.71	1,454,321.43
M & T BANK CORP	11,745	165.76	1,946,851.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	15.98	586,785.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,173	132.88	5,205,308.24
REGIONS FINL CORP	83,851	13.88	1,163,851.88
SIGNATURE BANK	4,354	116.66	507,937.64
SUNTRUST BANKS	38,353	62.67	2,403,582.51
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	212.94	934,806.60
US BANCORP	129,139	52.67	6,801,751.13
WELLS FARGO & CO	363,409	45.63	16,582,352.67
ZIONS BANCORPORATION	15,186	43.64	662,717.04
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	89.28	395,778.24
ALLY FINANCIAL INC	36,028	29.85	1,075,435.80
AMERICAN EXPRESS	61,108	121.11	7,400,789.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	149.87	1,775,959.50
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	20.87	473,623.78
BANK NEW YORK CO	71,617	44.40	3,179,794.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	109,623	205.81	22,561,509.63
BLACKROCK INC	9,909	444.11	4,400,685.99
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	90.26	3,567,075.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	111.31	1,054,105.70
CME GROUP INC	30,723	202.11	6,209,425.53
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	78.14	2,310,209.10
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	46.06	972,234.48
EATON VANCE CORP	10,061	40.34	405,860.74
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	292.16	952,441.60
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	33.64	876,994.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	189.81	5,339,355.30
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,543	85.38	4,229,981.34
INVESCO LTD	30,943	20.58	636,806.94
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	18.00	462,708.00
KKR & CO INC -A	44,859	23.96	1,074,821.64
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	334.61	1,074,767.32
MOODY'S CORP	15,058	189.91	2,859,664.78
MORGAN STANLEY	108,193	42.70	4,619,841.10
MSCI INC	7,907	240.30	1,900,052.10
NASDAQ INC	9,070	96.16	872,171.20

NORTHERN TRUST CORP	17,320	88.27	1,528,836.40
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	105.69	2,120,775.54
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,870	83.75	994,112.50
S&P GLOBAL INC	21,709	224.67	4,877,361.03
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	43.00	4,379,335.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	53.84	581,579.68
STATE STREET CORP	32,349	56.62	1,831,600.38
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	33.78	1,793,549.10
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	52.11	1,219,582.44
VOYA FINANCIAL INC	14,081	53.82	757,839.42
AFLAC	65,227	54.55	3,558,132.85
ALLEGHANY CORP	1,276	690.74	881,384.24
ALLSTATE CORP	30,108	100.72	3,032,477.76
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	100.88	707,471.44
AMERICAN INT'L GROUP	76,910	52.91	4,069,308.10
AON PLC	20,104	190.24	3,824,584.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	35.64	1,231,397.64
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	87.79	1,314,391.88
ASSURANT INC	4,769	104.34	497,597.46
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	43.03	574,321.41
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	37.96	395,391.36
CHUBB LTD	38,690	149.44	5,781,833.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	102.64	1,274,070.32
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	233.32	505,371.12
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	252.65	847,135.45
FNF GROUP	24,961	39.81	993,697.41
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	54.97	1,743,098.70
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	62.77	1,116,678.30
LOEWS CORP	22,051	53.84	1,187,225.84
MARKEL CORP	1,132	1,090.00	1,233,880.00
MARSH & MCLENNAN COS	42,543	99.18	4,219,414.74
METLIFE INC	71,520	48.33	3,456,561.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	55.37	1,282,092.35
PROGRESSIVE CORP	48,681	83.18	4,049,285.58
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,290	99.42	3,508,531.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	151.25	821,438.75
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	176.35	572,961.15
TORCHMARK CORP	8,473	88.87	752,995.51
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	149.53	3,297,286.03
UNUM GROUP	18,574	33.51	622,414.74
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	186.88	2,042,598.40
WR BERKLEY CORP	13,990	64.31	899,696.90

CBRE GROUP INC-A	26,855	49.26	1,322,877.30
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.71	662,277.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	131.76	483,954.48
WEYERHAEUSER CO	62,107	23.79	1,477,525.53
ACCENTURE PLC-CL A	53,858	182.92	9,851,705.36
ADOBE INC	41,223	278.16	11,466,589.68
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	79.42	1,126,016.76
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	142.82	573,565.12
ANSYS INC	6,865	193.29	1,326,935.85
AUTODESK INC	18,213	165.30	3,010,608.90
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	166.92	6,141,487.56
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	131.02	1,264,343.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	25,271	65.57	1,657,019.47
CDK GLOBAL INC	10,687	47.78	510,624.86
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	111.99	1,209,603.99
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	95.86	1,088,202.72
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	62.78	3,036,229.14
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	129.11	400,241.00
DOCUSIGN INC	8,693	48.16	418,654.88
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	23.03	374,168.41
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	49.18	1,155,631.64
EPAM SYSTEMS INC	4,620	176.75	816,585.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,276	122.54	3,342,401.04
FIRST DATA CORP- CLASS A	47,683	26.63	1,269,798.29
FISERV INC	33,784	89.74	3,031,776.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	258.99	1,888,555.08
FORTINET INC	12,963	73.82	956,928.66
GARTNER INC	8,145	157.48	1,282,674.60
GLOBAL PAYMENTS INC	13,947	160.91	2,244,211.77
GODADDY INC - CLASS A	14,919	73.20	1,092,070.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	76,740	133.31	10,230,209.40
INTUIT INC	22,104	257.47	5,691,116.88
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,223	135.39	977,921.97
LEIDOS HOLDINGS	10,999	79.42	873,540.58
MASTERCARD INC-CLASS A	77,757	265.80	20,667,810.60
MICROSOFT CORP	618,610	131.40	81,285,354.00
MONGODB INC	2,694	169.97	457,899.18
OKTA INC	8,635	127.31	1,099,321.85
ORACLE CORP	210,752	53.26	11,224,651.52
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	195.54	1,576,834.56
PAYCHEX INC	27,697	87.60	2,426,257.20
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	222.45	942,743.10

PAYPAL HOLDINGS INC	94,486	114.02	10,773,293.72
PTC INC	9,984	88.76	886,179.84
RED HAT INC	15,009	185.44	2,783,268.96
SABRE CORP	24,114	21.62	521,344.68
SALESFORCE.COM INC	64,577	161.27	10,414,332.79
SERVICENOW INC	14,979	274.55	4,112,484.45
SPLUNK INC	13,187	111.34	1,468,240.58
SQUARE INC - A	27,989	68.46	1,916,126.94
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20,656	58.40	1,206,310.40
SYMANTEC CORP	58,346	19.15	1,117,325.90
SYNOPSYS INC	12,264	123.90	1,519,509.60
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	6,719	125.21	841,285.99
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	129.10	1,835,543.80
TWILIO INC - A	8,003	144.11	1,153,312.33
VERISIGN INC	9,541	207.09	1,975,845.69
VISA INC-CLASS A SHARES	149,028	170.05	25,342,211.40
VMWARE INC-CLASS A	6,787	169.23	1,148,564.01
WESTERN UNION CO	38,757	20.15	780,953.55
WIX.COM LTD	3,961	144.78	573,473.58
WORKDAY INC-CLASS A	12,522	211.47	2,648,027.34
WORLDPAY INC-CLASS A	25,793	123.95	3,197,042.35
AMPHENOL CORPORATION	26,216	93.19	2,443,069.04
APPLE INC	402,575	190.15	76,549,636.25
ARISTA NETWORKS INC	4,324	246.44	1,065,606.56
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	66.58	443,822.28
CDW CORP/DE	12,482	104.86	1,308,862.52
CISCO SYSTEMS	374,632	55.93	20,953,167.76
COGNEX CORP	16,230	44.33	719,475.90
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	16.54	246,991.82
CORNING	66,228	30.58	2,025,252.24
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	54.30	754,227.00
F5 NETWORKS INC	5,350	140.43	751,300.50
FLEX LTD	40,465	9.51	384,822.15
FLIR SYSTEMS INC	11,686	50.70	592,480.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	14.09	1,827,980.24
HP INC	134,066	19.71	2,642,440.86
IPG PHOTONICS CORP	3,207	131.80	422,682.60
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	26.74	837,068.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	82.13	1,302,006.89
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	163.58	2,279,650.88
NETAPP INC	20,586	61.30	1,261,921.80
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	43.56	994,736.16

TE CONNECTIVITY LTD	28,434	90.91	2,584,934.94
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	42.51	876,641.22
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	36.94	870,934.38
XEROX CORP	16,718	34.16	571,086.88
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	188.37	866,502.00
AT&T INC	616,020	32.49	20,014,489.80
CENTURYLINK INC	83,301	10.54	877,992.54
SPRINT CORP	64,825	7.10	460,257.50
T-MOBILE US INC	28,273	77.03	2,177,869.19
VERIZON COMMUNICATIONS	349,784	57.24	20,021,636.16
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	32.68	499,644.52
AES CORP	52,646	16.70	879,188.20
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	49.00	943,544.00
AMEREN CORPORATION	21,002	75.88	1,593,631.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	89.54	3,708,925.88
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,134	116.29	1,876,222.86
ATMOS ENERGY CORP	9,385	104.21	978,010.85
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	28.82	1,233,265.44
CMS ENERGY CORP	24,527	57.79	1,417,415.33
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	88.31	2,427,995.14
DOMINION ENERGY INC	68,162	75.79	5,165,997.98
DTE ENERGY COMPANY	15,603	128.58	2,006,233.74
DUKE ENERGY CORP	59,862	87.04	5,210,388.48
EDISON INTL	28,962	62.64	1,814,179.68
ENTERGY CORP	15,636	100.60	1,572,981.60
EVERGY INC	21,330	60.48	1,290,038.40
EVERSOURCE ENERGY	28,103	76.30	2,144,258.90
EXELON CORP	80,900	49.95	4,040,955.00
FIRSTENERGY CORP	43,246	43.04	1,861,307.84
NEXTERA ENERGY INC	40,931	204.39	8,365,887.09
NISOURCE INC	32,308	28.54	922,070.32
NRG ENERGY INC	26,737	34.73	928,576.01
OGE ENERGY CORP	15,686	43.55	683,125.30
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	97.68	919,754.88
PPL CORPORATION	59,613	31.02	1,849,195.26
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	44,554	60.01	2,673,685.54
SEMPRA ENERGY	23,257	134.49	3,127,833.93
SOUTHERN CO	88,512	54.71	4,842,491.52
UGI CORP	13,950	53.71	749,254.50
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.31	718,627.91
WEC ENERGY GROUP INC	27,947	82.96	2,318,483.12
XCEL ENERGY INC	44,934	59.43	2,670,427.62

	ADVANCED MICRO DEVICES	78,474	32.41	2,543,342.34
	ANALOG DEVICES	32,237	100.69	3,245,943.53
	APPLIED MATERIALS	80,718	41.51	3,350,604.18
	BROADCOM INC	33,711	274.87	9,266,142.57
	INTEL CORP	386,406	46.03	17,786,268.18
	KLA-TENCOR CORP	13,856	109.42	1,516,123.52
	LAM RESEARCH CORP	12,864	186.68	2,401,451.52
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	24.05	1,316,424.85
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,692	56.53	1,395,838.76
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	83.67	1,735,650.48
	MICRON TECHNOLOGY	95,275	33.99	3,238,397.25
	NVIDIA CORP	48,914	145.50	7,116,987.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	92.64	2,323,225.92
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	19.06	686,083.76
	QORVO INC	10,609	64.38	683,007.42
	QUALCOMM	102,656	68.69	7,051,440.64
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	70.15	1,017,876.50
	TEXAS INSTRUMENTS	81,032	111.17	9,008,327.44
	XILINX INC	22,116	107.49	2,377,248.84
	アメリカドル 小計	25,733,357		2,092,037,533.53 (227,027,913,138)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	13.65	391,877.85
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	35.50	3,668,144.00
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.94	1,057,526.04
	ENBRIDGE	173,856	47.14	8,195,571.84
	ENCANA CORP	138,637	6.70	928,867.90
	HUSKY ENERGY INC	31,439	12.47	392,044.33
	IMPERIAL OIL	24,763	36.43	902,116.09
	INTER PIPELINE LTD	30,317	20.42	619,073.14
	KEYERA CORP	14,929	32.30	482,206.70
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	48.40	2,046,158.40
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	17.59	322,776.50
	SUNCOR ENERGY	134,430	40.52	5,447,103.60
	TC ENERGY CORP	76,314	66.63	5,084,801.82
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	16.98	339,005.70
	VERMILION ENERGY INC	10,067	28.45	286,406.15
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	61.34	1,316,295.06
	BARRICK GOLD CORP	149,092	18.01	2,685,146.92
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	63.80	838,268.20
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	10.69	608,261.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	102.89	1,724,230.62
	KINROSS GOLD CORP	107,615	4.61	496,105.15

KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	49.86	849,265.38
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.31	392,753.33
METHANEX CORP	7,099	56.05	397,898.95
NUTRIEN LTD	51,428	68.65	3,530,532.20
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	28.38	1,296,313.26
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	54.25	234,739.75
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	30.47	1,122,453.86
BOMBARDIER B	151,366	2.07	313,327.62
CAE INC	25,999	34.40	894,365.60
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	23.98	352,817.74
WSP GLOBAL INC	9,471	71.20	674,335.20
THOMSON REUTERS CORP	16,142	88.81	1,433,571.02
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	121.15	7,411,230.10
CP RAILWAY LIMITED	11,825	311.71	3,685,970.75
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	59.43	1,662,732.54
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	48.96	864,584.64
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	89.03	1,902,125.95
STARS GROUP INC/THE	11,841	22.41	265,356.81
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.98	486,096.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	27.71	996,091.37
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	135.40	732,378.60
DOLLARAMA INC	26,700	42.80	1,142,760.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	85.40	3,087,893.20
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	31.00	356,469.00
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	70.75	1,104,973.50
METRO INC	19,179	50.20	962,785.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	103.01	709,017.83
SAPUTO INC	20,412	40.13	819,133.56
AURORA CANNABIS INC	53,000	10.13	536,890.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	56.11	920,204.00
CRONOS GROUP INC	15,900	21.12	335,808.00
BANK MONTREAL	55,382	98.97	5,481,156.54
BANK NOVA SCOTIA	106,056	70.40	7,466,342.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	103.48	3,931,205.20
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	61.89	1,747,030.92
ROYAL BANK OF CANADA	123,447	103.22	12,742,199.34
TORONTO-DOMINION BANK	154,324	75.33	11,625,226.92
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	73,316	63.41	4,648,967.56
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.96	391,344.16
IGM FINANCIAL INC	7,685	37.34	286,957.90
ONEX CORP	6,603	75.36	497,602.08
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	633.37	1,459,917.85

	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	30.90	735,049.20	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	51.61	424,750.30	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,102	118.67	1,317,474.34	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	172,987	23.73	4,104,981.51	
	POWER CORP OF CANADA	29,774	28.30	842,604.20	
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	30.33	629,044.20	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,941	53.83	2,903,644.03	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	22.07	275,102.55	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	10.55	415,670.00	
	CGI INC - CL A	21,192	100.17	2,122,802.64	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,182.79	2,011,925.79	
	OPEN TEXT CORP	24,643	54.64	1,346,493.52	
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,392	405.69	3,404,550.48	
	BCE INC	12,539	62.24	780,427.36	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	70.92	2,276,177.40	
	TELUS CORP	16,454	50.07	823,851.78	
	ALTAGAS INCOME LTD	31,487	19.60	617,145.20	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	46.00	241,086.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.30	395,409.20	
	EMERA INC	4,086	53.10	216,966.60	
	FORTIS INC	38,447	51.87	1,994,245.89	
	HYDRO ONE LTD	32,299	22.92	740,293.08	
	カナダドル 小計	3,406,826		156,204,508.71 (12,769,718,587)	
ユーロ	ENAGAS	18,299	25.43	465,343.57	
	ENI	216,297	13.96	3,019,506.12	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	13.64	543,985.21	
	NESTE OIL OYJ	33,258	30.12	1,001,730.96	
	OMV AG	12,139	42.38	514,450.82	
	REPSOL SA	124,649	14.66	1,827,354.34	
	SNAM SPA	205,372	4.72	970,793.44	
	TENARIS SA	40,648	10.73	436,356.28	
	TOTAL SA	203,962	47.79	9,748,363.79	
	VOPAK	6,360	37.63	239,326.80	
	AIR LIQUIDE	36,297	116.90	4,243,119.30	
	AKZO NOBEL	19,742	79.14	1,562,381.88	
	ARCELORMITTAL	53,985	13.48	727,933.74	
	ARKEMA	5,335	75.96	405,246.60	
	BASF SE	77,211	61.28	4,731,490.08	
	COVESTRO AG	16,178	41.37	669,283.86	
	CRH PLC	71,124	28.57	2,032,012.68	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	24.20	325,586.80	



FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	35.20	202,822.40
HEIDELBERGCEMENT AG	13,833	67.80	937,877.40
IMERYS SA	3,000	39.96	119,880.00
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	104.15	1,586,621.10
LANXESS	7,293	46.30	337,665.90
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	25.53	499,494.45
SOLVAY SA	6,906	86.58	597,921.48
STORA ENSO OYJ R	47,237	9.39	443,744.37
SYMRISE AG	11,581	87.90	1,017,969.90
THYSSEN KRUPP	33,044	11.67	385,623.48
UMICORE	17,605	26.77	471,285.85
UPM KYMMENE OYJ	43,990	22.45	987,575.50
VOESTALPINE AG	8,140	24.03	195,604.20
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,861	37.30	778,115.30
AIRBUS SE	48,982	120.92	5,922,903.44
ALSTOM	13,816	41.83	577,923.28
ANDRITZ AG	5,242	32.60	170,889.20
BOUYGUES ORD	16,815	31.65	532,194.75
BRENTAG AG	11,626	43.00	499,918.00
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.06	749,789.56
DASSAULT AVIATION SA	213	1,222.00	260,286.00
EIFFAGE	6,079	87.76	533,493.04
FERROVIAL SA	39,067	21.67	846,581.89
GEA GROUP AG	13,382	25.15	336,557.30
HOCHTIEF AG	1,354	106.90	144,742.60
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	47.16	557,101.08
KION GROUP AG	5,887	50.48	297,175.76
KNORR-BREMSE AG	4,123	98.75	407,146.25
KONE OYJ-B	30,120	49.27	1,484,012.40
LEGRAND SA	21,794	61.94	1,349,920.36
LEONARDO SPA	35,425	10.53	373,202.37
METSO OYJ	9,561	30.13	288,072.93
MTU AERO ENGINES AG	4,753	201.30	956,778.90
PRYSMIAN SPA	25,673	16.60	426,300.16
SAFRAN SA	28,935	122.35	3,540,197.25
SAINT-GOBAIN	40,731	33.56	1,367,136.01
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,763	73.16	3,494,341.08
SIEMENS	65,680	104.24	6,846,483.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	14.43	252,482.58
THALES SA	9,665	102.80	993,562.00
VINCI S.A.	43,091	90.28	3,890,255.48
WARTSILA OYJ	34,386	13.08	449,768.88

BUREAU VERITAS SA	19,558	21.12	413,064.96
EENREDE	18,941	42.55	805,939.55
RANDSTAD NV	9,588	47.17	452,265.96
SOCIETE BIC SA	2,424	70.05	169,801.20
TELEPERFORMANCE	4,523	175.80	795,143.40
WOLTERS KLUWER	22,886	64.02	1,465,161.72
ADP	2,382	153.40	365,398.80
AENA SME SA	5,610	172.50	967,725.00
ATLANTIA SPA	42,039	23.12	971,941.68
BOLLORE	61,805	3.92	242,770.04
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	17.58	409,238.12
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	27.32	2,321,817.52
FRAPORT AG	3,561	74.50	265,294.50
GETLINK	36,478	14.08	513,610.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	62.32	1,803,914.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	53.00	264,523.00
CONTINENTAL AG	9,928	124.20	1,233,057.60
DAIMLER AG	78,530	47.60	3,738,420.65
FAURECIA	5,945	34.87	207,302.15
FERRARI NV	9,947	132.85	1,321,458.95
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	11.67	1,124,742.93
MICHELIN	15,337	104.05	1,595,814.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	26.14	269,032.88
PEUGEOT SA	52,883	20.54	1,086,216.82
PIRELLI & C SPA	39,097	5.19	202,913.43
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	56.50	792,582.00
RENAULT SA	17,362	53.69	932,165.78
VALEO SA	19,350	24.38	471,753.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	141.88	2,269,938.12
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	145.10	376,389.40
ADIDAS AG	15,081	265.25	4,000,235.25
ESSILORLUXOTTICA	25,039	107.00	2,679,173.00
HERMES INTERNATIONAL	2,600	611.40	1,589,640.00
HUGO BOSS AG	4,852	53.62	260,164.24
KERING	6,332	479.60	3,036,827.20
LVMH	23,422	357.05	8,362,825.10
MONCLER SPA	15,736	34.70	546,039.20
PUMA AG	772	557.00	430,004.00
SEB SA	2,075	152.90	317,267.50
ACCOR	17,931	34.25	614,136.75
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	66.12	472,295.16
SODEXO	8,135	104.15	847,260.25

AXEL SPRINGER SE	3,827	56.05	214,503.35
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	16.19	193,891.44
JC DECAUX SA	4,674	25.98	121,430.52
PUBLICIS GROUPE	17,601	49.58	872,657.58
RTL GROUP	3,513	43.88	154,150.44
SES	31,369	13.91	436,499.63
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	49.24	246,101.52
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	73.00	498,590.00
VIVENDI	77,307	24.44	1,889,383.08
DELIVERY HERO SE	8,671	38.29	332,012.59
INDITEX	93,820	25.08	2,353,005.60
ZALANDO SE	9,155	36.16	331,044.80
CARREFOUR	53,759	16.78	902,076.02
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	32.38	119,385.06
COLRUYT SA	4,160	67.50	280,800.00
JERONIMO MARTINS	20,234	14.56	294,607.04
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	20.42	2,005,938.28
METRO AG	13,712	14.49	198,755.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	64,009	75.47	4,830,759.23
DANONE (GROUPE)	52,307	72.26	3,779,703.82
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.78	373,378.28
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	90.90	972,720.90
HEINEKEN NV	22,649	97.10	2,199,217.90
KERRY GROUP PLC-A	13,146	105.90	1,392,161.40
PERNOD-RICARD	18,484	160.20	2,961,136.80
REMY COINTREAU	1,575	120.80	190,260.00
BEIERSDORF AG	9,190	105.45	969,085.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	78.60	677,374.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	83.52	1,314,270.72
LOREAL	21,190	245.10	5,193,669.00
UNILEVER NV-CVA	123,171	54.14	6,668,477.94
BIOMERIEUX	3,246	74.50	241,827.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	86.95	298,238.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	66.32	1,193,494.72
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	45.90	1,686,687.30
KONINKLIJKE PHILIPS	80,612	35.43	2,856,083.16
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	174.80	567,400.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	36.18	452,250.00
BAYER	78,314	52.87	4,140,461.18
EUROFINS SCIENTIFIC	971	368.60	357,910.60
GRIFOLS SA	27,685	24.26	671,638.10
IPSEN	2,722	112.70	306,769.40

MERCK KGAA	10,480	89.46	937,540.80
ORION OYJ-CLASS B	7,975	30.58	243,875.50
QIAGEN N.V.	21,801	34.45	751,044.45
RECORDATI SPA	7,493	38.10	285,483.30
SANOFI	96,647	78.32	7,569,393.04
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	129.00	387,516.00
UCB (GROUPE)	10,465	68.92	721,247.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	19.09	633,743.95
AIB GROUP PLC	70,200	3.61	253,983.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	4.92	2,737,823.06
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.94	416,560.52
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	3.96	5,417,009.54
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	4.65	390,600.00
BANKIA SA	110,053	2.17	239,585.38
BANKINTER SA	58,881	6.35	374,129.87
BNP PARIBAS	94,302	40.81	3,848,936.13
CAIXABANK	286,347	2.61	749,083.75
COMMERZBANK AG	80,494	6.25	503,167.99
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.29	955,261.86
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	32.06	883,573.60
FINECOBANK SPA	44,137	9.30	410,474.10
ING GROEP NV-CVA	332,029	9.85	3,272,145.79
INTESA SANPAOLO	1,286,795	1.83	2,358,437.87
KBC GROEP NV	22,703	57.80	1,312,233.40
MEDIOBANCA	53,990	8.43	455,351.66
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.52	256,294.80
SOCIETE GENERALE	63,719	22.10	1,408,508.49
UNICREDIT SPA	177,131	10.02	1,774,852.62
AMUNDI SA	4,764	58.75	279,885.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	5.96	961,456.69
DEUTSCHE BOERSE	15,674	126.35	1,980,409.90
EURAZEO SA	3,357	63.85	214,344.45
EXOR NV	10,345	58.72	607,458.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	84.94	530,620.18
NATIXIS	69,996	4.00	279,984.00
WENDEL	2,023	116.60	235,881.80
AEGON	166,267	4.22	702,478.07
AGEAS	16,065	44.39	713,125.35
ALLIANZ SE-REG	35,781	204.30	7,310,058.30
ASSICURAZIONI GENERALI	89,649	15.85	1,421,384.89
AXA	165,661	22.40	3,710,806.40
CNP ASSURANCES	11,830	19.82	234,470.60

HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	139.60	656,957.60
MAPFRE SA	90,939	2.66	242,443.37
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	221.10	2,800,231.50
NN GROUP NV	27,631	36.18	999,689.58
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.10	419,010.57
SAMPO OYJ-A SHS	39,991	40.07	1,602,439.37
SCOR SE	13,354	38.22	510,389.88
AROUNDTOWN SA	59,250	7.50	444,375.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	35.81	1,038,812.29
VONOVIA SE	43,942	44.72	1,965,086.24
ADYEN NV	884	707.80	625,695.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	71.40	2,606,814.00
ATOS SE	7,634	70.12	535,296.08
CAPGEMINI SA	13,238	99.36	1,315,327.68
DASSAULT SYSTEMES SA	11,783	135.35	1,594,829.05
SAP SE	84,279	113.72	9,584,207.88
WIRECARD AG	9,864	146.55	1,445,569.20
WORLDLINE SA	7,022	58.85	413,244.70
INGENICO GROUP	4,681	75.96	355,568.76
NOKIA OYJ	489,813	4.44	2,175,994.25
1&1 DRILLISCH AG	3,773	27.06	102,097.38
CELLNEX TELECOM SA	16,559	31.65	524,092.35
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	15.38	4,299,915.00
ELISA A	11,722	41.65	488,221.30
ILIAD SA	2,053	101.85	209,098.05
KPN (KON.)	261,596	2.85	745,810.19
ORANGE	176,815	13.72	2,426,785.87
PROXIMUS	13,141	26.16	343,768.56
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.44	381,772.78
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	200,564.71
TELEFONICA	410,000	7.47	3,062,700.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.55	171,301.58
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	32.52	309,362.76
E.ON SE	183,255	9.92	1,818,805.87
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	12.65	629,160.40
ENDESA	24,774	23.58	584,170.92
ENEL	681,211	5.89	4,013,014.00
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.47	819,561.76
ENGIE	162,096	13.21	2,142,098.64
FORTUM OYJ	38,328	19.41	744,138.12
IBERDROLA SA	520,818	8.87	4,619,655.66
INNOGY SE	11,000	41.60	457,600.00

	NATURGY ENERGY GROUP SA	32,230	25.90	834,757.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	19.67	779,561.44
	RWE STAMM	42,828	23.47	1,005,173.16
	SUEZ	28,043	12.48	350,116.85
	TERNA SPA	130,230	5.74	747,520.20
	UNIPER SE	14,751	26.31	388,098.81
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	21.34	976,134.28
	VERBUND AG	7,463	46.18	344,641.34
	ASML HOLDING NV	35,211	173.80	6,119,671.80
	INFINEON TECHNOLOGIES	99,840	14.92	1,490,211.84
	STMICROELECTRONICS	57,598	14.12	813,571.75
	ユーロ 小計	16,423,001		319,326,118.88 (39,222,827,182)
イギリスポンド	BP PLC	1,694,881	5.51	9,352,353.35
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	380,747	25.23	9,606,246.81
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,895	25.30	8,120,247.97
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	4.02	217,458.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	19.73	1,725,476.22
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.05	288,640.80
	BHP GROUP PLC	179,682	18.24	3,277,759.04
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	52.00	519,948.00
	EVRAZ PLC	43,000	6.33	272,190.00
	FRESNILLO PLC	17,743	8.12	144,073.16
	GLENCORE PLC	941,686	2.60	2,456,858.77
	JOHNSON MATTHEY PLC	18,160	31.43	570,768.80
	MONDI PLC	34,071	16.78	571,881.73
	RIO TINTO PLC REG	97,151	45.18	4,389,767.93
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	19.54	821,090.34
	BAE SYSTEMS PLC	282,016	4.76	1,342,396.16
	BUNZL PLC	27,712	21.79	603,844.48
	DCC PLC	9,127	68.56	625,747.12
	FERGUSON PLC	19,208	53.48	1,027,243.84
	MEGGITT PLC	66,268	5.11	339,027.08
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.70	697,081.35
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	9.09	1,355,233.35
	SMITHS GROUP PLC	37,146	14.84	551,432.37
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	85.60	537,311.20
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	14.81	275,351.59
	EXPERIAN PLC	81,220	24.00	1,949,280.00
	G4S PLC	132,555	2.14	284,595.58
	INTERTEK GROUP PLC	14,722	54.32	799,699.04
	RELX PLC	171,324	18.72	3,207,185.28

RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	3.78	596,913.42
EASYJET PLC	11,633	9.10	105,860.30
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.65	545,049.85
BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.82	629,544.96
PERSIMMON PLC	26,389	20.41	538,599.49
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.57	426,053.40
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	35.66	377,960.34
CARNIVAL PLC	13,721	39.28	538,960.88
COMPASS GROUP PLC	136,301	18.44	2,514,071.94
GVC HOLDINGS PLC	42,500	6.31	268,515.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	52.15	836,538.15
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.73	243,401.42
TUI AG-DI	37,945	7.43	282,007.24
WHITBREAD PLC	14,664	47.20	692,140.80
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.96	477,179.64
INFORMA PLC	100,899	7.91	798,716.48
ITV PLC	295,435	1.08	320,694.69
PEARSON	66,305	7.99	530,174.78
WPP PLC	113,065	9.88	1,117,534.46
KINGFISHER PLC	170,994	2.09	358,061.43
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.20	298,254.91
NEXT PLC	11,202	57.16	640,306.32
OCADO GROUP PLC	38,762	11.13	431,421.06
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.95	329,020.62
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.97	292,813.29
TESCO	856,393	2.29	1,964,565.54
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	25.24	728,047.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	197,242	30.14	5,944,873.88
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	29.12	522,995.20
DIAGEO	204,601	34.07	6,970,756.07
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	20.73	1,725,668.85
RECKITT BENCKISER PLC	60,995	63.95	3,900,630.25
UNILEVER PLC	93,214	49.14	4,580,535.96
NMC HEALTH PLC	9,509	22.00	209,198.00
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	16.93	1,202,487.11
ASTRAZENECA	108,675	60.28	6,550,929.00
GLAXOSMITHKLINE	425,464	15.65	6,659,362.52
BARCLAYS	1,471,691	1.51	2,223,136.42
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,693,900	6.50	11,025,595.10
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.57	3,438,583.04
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.14	848,398.98
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.92	1,615,951.48

	3I GROUP PLC	79,251	10.55	836,494.30
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	19.39	524,072.29
	INVESTEC PLC	54,280	4.67	253,704.72
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	54.12	1,423,139.52
	SCHRODERS PLC	8,614	29.62	255,146.68
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	10.44	467,413.75
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.75	532,874.21
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.90	339,729.50
	AVIVA PIC	348,023	4.17	1,451,255.91
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.28	372,985.20
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.70	1,323,037.80
	PRUDENTIAL	217,306	16.24	3,529,049.44
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.70	493,439.67
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	19.39	563,570.35
	SAGE GROUP PLC	89,321	7.54	674,016.26
	HALMA PLC	32,374	18.92	612,516.08
	BT GROUP PLC	730,298	2.07	1,513,177.45
	VODAFONE GROUP PLC	2,309,362	1.29	2,999,861.23
	CENTRICA PLC	440,558	0.95	422,318.89
	NATIONAL GRID PLC	283,108	8.22	2,329,695.73
	SEVERN TRENT PLC	18,112	20.78	376,367.36
	SSE PLC	93,277	11.20	1,045,168.78
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.34	491,613.72
	イギリスポンド 小計	25,354,816		153,062,348.27 (21,133,318,425)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.63	324,211.73
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	619.50	416,304.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,729.00	2,218,677.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	49.52	1,997,339.68
	SIKA AG-BR	10,500	154.80	1,625,400.00
	ABB LTD	153,407	19.09	2,928,539.63
	GEBERIT AG-REG	3,021	452.40	1,366,700.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	208.40	308,223.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	214.50	808,236.00
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	55.38	732,345.12
	SGS SA	437	2,585.00	1,129,645.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	135.35	685,818.45
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	78.62	3,517,773.28
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	265.10	658,243.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.80	200,050.40
	DUFREY AG-REG	2,548	82.88	211,178.24
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,983.00	317,280.00



	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	78,200.00	625,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	6,910.00	718,640.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	261,828	101.40	26,549,359.20	
	ALCON INC	37,545	58.34	2,190,375.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	221.00	1,127,984.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	839.40	653,892.60	
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	321.30	2,090,699.10	
	NOVARTIS	184,125	87.30	16,074,112.50	
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,430	269.40	16,010,442.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	140.50	505,940.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	224,271	11.39	2,554,446.69	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	40.07	848,562.39	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	74.50	253,076.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	706.40	1,053,242.40	
	UBS GROUP AG	334,926	11.63	3,895,189.38	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	171.60	665,293.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	468.60	1,381,901.40	
	SWISS RE LTD	26,239	98.86	2,593,987.54	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,661	334.10	4,230,040.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	82.35	516,910.95	
	TEMENOS AG - REG	5,252	175.80	923,301.60	
	SWISSCOM	2,064	493.40	1,018,377.60	
	スイスフラン 小計	1,507,605		105,927,340.78 (11,608,577,276)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	260.10	3,691,079.10	
	BOLIDEN AB	26,315	222.40	5,852,456.00	
	BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	26,315	4.24	111,707.17	
	ALFA LAVAL AB	25,639	199.55	5,116,262.45	
	ASSA ABLOY AB-B	88,864	197.85	17,581,742.40	
	ATLAS COPCO A	59,675	266.30	15,891,452.50	
	ATLAS COPCO B	36,538	242.80	8,871,426.40	
	EPIROC AB-A	53,833	93.04	5,008,622.32	
	EPIROC AB-B	29,972	89.14	2,671,704.08	
	SANDVIK AB	100,730	154.60	15,572,858.00	
	SKANSKA B	28,530	163.35	4,660,375.50	
	SKF AB-B	28,335	156.30	4,428,760.50	
	VOLVO B	125,906	138.20	17,400,209.20	
	SECURITAS B	22,844	164.25	3,752,127.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	221.90	4,031,923.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	82.86	3,207,676.32	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	149.44	11,052,881.28	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	393.60	2,255,328.00	

	SWEDISH MATCH AB	15,149	433.00	6,559,517.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	54,928	289.80	15,918,134.40	
	NORDEA BANK ABP	250,593	68.91	17,268,363.63	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	87.26	12,103,834.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	91.94	12,539,328.84	
	SWEDBANK AB-A	80,216	139.45	11,186,121.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	198.15	2,534,734.80	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	425.60	17,210,412.80	
	KINNEVIK AB - B	18,104	250.00	4,526,000.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	331.40	2,412,592.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	93.60	25,155,468.00	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	469.90	10,104,729.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	516.00	3,196,104.00	
	TELE2 AB-B SHS	38,012	131.10	4,983,373.20	
	TELIA CO AB	235,437	40.65	9,570,514.05	
	スウェーデンクローナ 小計	2,128,759		286,427,819.34 (3,305,377,035)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	236.50	2,438,551.50	
	EQUINOR ASA	80,907	170.60	13,802,734.20	
	NORSK HYDRO	106,150	31.59	3,353,278.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	393.00	5,293,710.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	228.40	1,592,176.40	
	MOWI ASA	40,968	208.00	8,521,344.00	
	ORKLA	69,804	76.94	5,370,719.76	
	DNB ASA	80,217	152.90	12,265,179.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	175.00	3,250,450.00	
	TELENOR ASA	60,821	185.20	11,264,049.20	
	ノルウェークローネ 小計	488,193		67,152,192.86 (844,774,586)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	724.20	6,575,011.80	
	NOVOZYMES A/S	17,687	306.10	5,413,990.70	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	548.40	9,717,648.00	
	ISS A/S	14,253	196.70	2,803,565.10	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	6,915.00	2,067,585.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,292.00	3,704,336.00	
	DSV A/S	16,873	611.20	10,312,777.60	
	PANDORA A/S	8,431	230.40	1,942,502.40	
	CARLSBERG AS-B	9,692	895.40	8,678,216.80	
	COLOPLAST-B	9,476	739.00	7,002,764.00	
	DEMANT A/S	7,420	225.80	1,675,436.00	
	GENMAB A/S	4,888	1,176.00	5,748,288.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	256.60	1,249,898.60	

	NOVO NORDISK A/S-B	144,978	323.75	46,936,627.50
	DANSKE BANK A/S	59,378	109.75	6,516,735.50
	TRYG A/S	9,828	215.00	2,113,020.00
	ORSTED A/S	15,908	560.60	8,918,024.80
	デンマーククローネ 小計	351,289		131,376,427.80 (2,161,142,237)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	26.19	540,273.51
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.93	823,152.33
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.08	1,172,412.60
	SANTOS	156,437	6.79	1,062,207.23
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	21.89	280,476.57
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	34.64	2,895,557.60
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	13.39	463,240.44
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.41	410,803.78
	AMCOR PLC-CDI	105,214	15.72	1,653,964.08
	BHP GROUP LTD	253,437	37.84	9,590,056.08
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	10.93	539,155.04
	BORAL LIMITED	81,732	5.28	431,544.96
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	7.85	1,057,206.60
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.42	515,048.58
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	18.30	683,742.90
	NEWCREST MINING LIMITED	70,314	28.57	2,008,870.98
	ORICA LTD	29,211	20.71	604,959.81
	RIO TINTO LTD	32,522	98.00	3,187,156.00
	SOUTH32 LTD	408,172	3.24	1,322,477.28
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	44.51	410,382.20
	BRAMBLES LTD	129,297	12.73	1,645,950.81
	SEEK LTD	26,358	21.00	553,518.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.21	830,927.27
	TRANSURBAN GROUP	238,575	14.26	3,402,079.50
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.51	1,556,711.52
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.35	374,550.80
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	38.39	212,027.97
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	42.47	138,579.61
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.48	747,470.08
REA GROUP LTD	3,593	90.35	324,627.55	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.15	187,426.45	
WESFARMERS LTD	100,277	37.65	3,775,429.05	
COLES GROUP LTD	93,277	12.94	1,207,004.38	
WOOLWORTHS GROUP LTD	113,612	31.51	3,579,914.12	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.86	454,841.80	
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	14.94	872,122.50	

	COCHLEAR LIMITED	4,811	200.39	964,076.29
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	70.53	863,851.44
	SONIC HEALTHCARE LTD	32,669	26.48	865,075.12
	CSL LIMITED	38,043	203.80	7,753,163.40
	AUST AND NZ BANKING GROUP	248,111	28.37	7,038,909.07
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.51	338,556.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.50	487,991.00
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,029	80.00	12,082,320.00
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	26.90	6,395,770.90
	WESTPAC BANKING	288,399	27.98	8,069,404.02
	AMP LTD	244,230	2.13	520,209.90
	ASX LTD	15,814	79.29	1,253,892.06
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	7.98	351,662.64
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	119.21	3,196,854.57
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.59	1,589,004.45
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.35	718,615.20
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.67	1,319,795.31
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.20	1,358,557.20
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.69	740,635.44
	TELSTRA CORP	342,339	3.72	1,273,501.08
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.39	201,125.25
	AGL ENERGY LTD	51,344	20.91	1,073,603.04
	AUSNET SERVICES	120,230	1.85	223,026.65
	オーストラリアドル 小計	6,049,222		108,195,470.01 (8,205,544,445)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.27	403,913.88
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	8.69	738,215.50
	A2 MILK CO LTD	66,854	14.40	962,697.60
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.64	711,745.12
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	11.38	413,287.46
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.78	550,524.46
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.38	484,182.72
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,264,566.74 (308,072,301)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	75.85	17,748,596.60
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	15.28	2,490,640.00
	MTR CORP	142,000	48.30	6,858,600.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	51.90	6,176,100.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	20.90	1,431,650.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	46.80	9,266,400.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	11.52	774,144.00
	SANDS CHINA LTD	202,800	34.95	7,087,860.00

	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	9.50	931,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.67	1,144,440.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	15.64	2,202,112.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	43.55	2,787,200.00	
	WH GROUP LTD	699,000	7.22	5,046,780.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	24.00	2,619,840.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	30.35	9,408,500.00	
	HANG SENG BANK	68,000	195.10	13,266,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	103,000	250.60	25,811,800.00	
	AIA GROUP LTD	1,035,400	74.30	76,930,220.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	58.40	12,614,166.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.16	2,968,680.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	40.65	5,090,518.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	40.40	2,383,600.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	30.25	1,951,125.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.86	5,829,190.00	
	SINO LAND CO	315,400	12.86	4,056,044.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	128,500	126.40	16,242,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	96.15	3,894,075.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	33.45	3,217,890.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	20.45	1,860,950.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	54.20	5,149,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	52.60	3,419,000.00	
	PCCW LTD	357,000	4.60	1,642,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	62.50	3,125,000.00	
	CLP HOLDINGS	148,000	88.70	13,127,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	16.92	15,185,767.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	55.10	6,116,100.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	73.80	1,749,060.00	
	香港ドル 小計	7,501,884		301,605,048.88 (4,174,213,876)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.05	679,415.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.36	252,520.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	4.08	444,720.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.40	279,860.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.50	416,250.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.16	396,930.28	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.98	254,976.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.86	367,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.33	296,143.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	34.98	346,302.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.27	113,130.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.35	598,310.00	
	DBS GROUP	156,300	24.39	3,812,157.00	
	OCBC BANK	264,200	10.64	2,811,088.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	119,800	24.23	2,902,754.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.49	466,627.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.27	611,817.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	8.47	264,264.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.94	329,650.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.39	395,523.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.28	2,189,213.04	
	シンガポールドル 小計	3,510,376		18,229,274.32	(1,450,321,064)
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	18.40	1,246,710.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	523.50	764,310.00	
	BANK HAPOLIM BM	84,067	25.45	2,139,505.15	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.68	3,471,365.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	13.80	1,373,100.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	80.39	659,198.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	223.80	967,487.40	
	NICE LTD	4,894	491.00	2,402,954.00	
	イスラエルシェケル 小計	410,855		13,024,630.35	(395,167,284)
	合 計	93,432,449		332,606,967,436	(332,606,967,436)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	967,366.80	
		LENDLEASE GROUP	44,009	573,437.27	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	682,936.00	
		オーストラリアドル 小計	223,440	2,223,740.07	(168,648,446)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,700,055.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,747,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,447,555.00	(89,234,161)
		投資信託受益証券合計	818,940	257,882,607	(257,882,607)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	774,855.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,478,969.80	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,095	7,881,203.70	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	112,760	1,014,840.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,452,900.98	
	BOSTON PROPERTIES	13,590	1,850,414.40	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	933,373.48	
	CROWN CASTLE INTL CORP	34,765	4,700,923.30	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,027	1,975,132.00	
	DUKE REALTY CORP	29,929	941,566.34	
	EQUINIX INC	6,911	3,452,735.60	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	895,909.30	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,438,746.52	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,688,348.97	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	1,104,872.16	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	795,225.10	
	HCP INC	41,014	1,301,374.22	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,241,783.06	
	INVITATION HOMES INC	24,000	639,600.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,669	769,426.11	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	649,010.31	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	584,597.90	
	MACERICH CO/THE	10,128	358,835.04	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,201,107.21	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	772,777.18	
	PROLOGIS INC	53,238	4,162,679.22	
	PUBLIC STORAGE	13,613	3,338,043.73	
	REALTY INCOME CORP	24,440	1,775,566.00	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	962,864.37	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	2,065,203.00	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,938	4,238,009.82	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	714,252.18	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	955,829.70	
	UDR INC	24,799	1,144,225.86	
	VENTAS INC	30,413	1,965,288.06	
	VEREIT INC	77,798	703,293.92	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	1,052,214.30	
	WELLTOWER INC	31,753	2,642,802.19	
	WP CAREY INC	13,017	1,106,835.51	
	アメリカドル 小計	977,679	68,725,635.54 (7,458,105,968)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	215,952.20	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	413,892.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	187,399.68	

カナダドル 小計		30,576	817,244.68 (66,809,752)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	338,121.00
	GECINA SA	4,459	593,492.90
	ICADE	2,845	222,052.25
	KLEPIERRE	17,225	506,759.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,040	1,642,256.00
ユーロ 小計		40,147	3,302,681.65 (405,668,387)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	426,770.83
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	497,323.70
	SEGRO PLC	102,202	731,153.10
イギリスポンド 小計		240,166	1,655,247.63 (228,540,040)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,265,510.50
	GOODMAN GROUP	140,271	2,004,472.59
	GPT GROUP	136,015	822,890.75
	MIRVAC GROUP	306,089	958,058.57
	SCENTRE GROUP	486,663	1,868,785.92
	STOCKLAND	207,412	931,279.88
	VICINITY CENTERS	291,115	759,810.15
オーストラリアドル 小計		1,661,655	8,610,808.36 (653,043,706)
香港ドル	LINK REIT	179,500	17,393,550.00
香港ドル 小計		179,500	17,393,550.00 (240,726,732)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	576,700.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	488,430.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	510,765.00
	SUNTEC REIT	173,000	321,780.00
シンガポールドル 小計		813,800	1,897,675.00 (150,979,023)
投資証券合計		3,943,523	9,203,873,608 (9,203,873,608)
合計			9,461,756,215 (9,461,756,215)

(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 616銘柄	96.8%			66.4%
	投資証券 39銘柄			3.2%	2.2%
カナダドル	株式 85銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			11.5%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	98.9%			6.2%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.9%			2.4%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄			7.2%	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		2.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.3%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.6%			0.4%
	投資証券 4銘柄			9.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	174,656,943
コール・ローン	3,213,377,639
国債証券	311,337,431,492
派生商品評価勘定	15,160,124
未収入金	235,713
未収利息	1,906,153,624
前払費用	279,782,153
差入委託証拠金	238,767,267
流動資産合計	317,165,564,955
資産合計	317,165,564,955
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,815,315
前受金	5,966,212
未払金	78,579,276
未払解約金	1,160,572,426
未払利息	6,677
流動負債合計	1,247,939,906
負債合計	1,247,939,906
純資産の部	
元本等	
元本	114,007,040,111
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	201,910,584,938
元本等合計	315,917,625,049
純資産合計	315,917,625,049
負債純資産合計	317,165,564,955

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2019年 6月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	114,007,040,111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 2.7710円 (1万口当たり純資産額) (27,710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 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年 6月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、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。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	92,353,094,819円
期中追加設定元本額	39,140,642,598円
期中一部解約元本額	17,486,697,306円
期末元本額	114,007,040,111円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,811,192,608円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	736,651,711円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	497,109,792円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,986,350,877円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,899,457円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,176,134,122円
世界経済インデックスファンド	6,483,141,478円
D C マイセレクション 2 5	1,649,869,863円
D C マイセレクション 5 0	1,257,234,424円
D C マイセレクション 7 5	803,897,854円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,842,815,737円
D C マイセレクション S 2 5	669,432,623円
D C マイセレクション S 5 0	517,367,342円
D C マイセレクション S 7 5	231,372,531円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	50,418,327円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	65,047,071円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	31,084,229円
D C 世界経済インデックスファンド	5,609,978,727円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	613,387,076円

区分	2019年 6月10日現在
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	44,224,837円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,882,570円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,887,912円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	60,119,392円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	127,947,061円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	194,461,185円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	158,821,181円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	449,248,663円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,236,949,175円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	622,121,689円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,204,789,758円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	871,432,461円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	89,762,849円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	640,926,774円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	38,253,498円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	242,891,404円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	300,852,210円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,014,855,624円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	783,917,215円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	843,186,808円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,372,962円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,410,439,035円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,735,282,821円
分散投資コア戦略ファンドA	1,231,092,844円
分散投資コア戦略ファンドS	3,077,432,900円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	245,430,186円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,561,243,481円
コア投資戦略ファンド（切替型）	633,079,220円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	236,959,712円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	111,085,433円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,081,661,135円
SMT インデックスバランス・オープン	236,478,334円
外国債券SMTBセクション（SMA専用）	24,336,018,088円
SMT 世界経済インデックス・オープン	59,578,861円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	88,252,702円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	121,901,713円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,154,933円
グローバル経済コア	998,547,520円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,243,764円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	64,221円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	165,200,732円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	15,219,769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

区分	2019年 6月10日現在
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)	885,923,501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)	11,281,378,182円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,293,691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)	18,695,687,084円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,870,485,582	
合計	3,870,485,582	

(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 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,641,982,031	-	1,647,948,243	5,966,212
	合計	1,641,982,031	-	1,647,948,243	5,966,212

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	2,117,564,603	-	2,123,943,200	6,378,597
	アメリカドル	1,051,646,633	-	1,050,086,400	1,560,233
	カナダドル	100,249,846	-	101,345,200	1,095,354
	ユーロ	812,670,164	-	819,276,100	6,605,936
	イギリスポンド	152,997,960	-	153,235,500	237,540
合計		2,117,564,603	-	2,123,943,200	6,378,597

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,414,941.39	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,661,421.92	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,924,804.70	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,756,687.50	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,460,830.06	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,443,892.58	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,865,234.40	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,903,964.82	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,413,349.64	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,540,282.22	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,628,714.86	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,909,570.30	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,452,832.02	
		T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,969,140.64	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,843,750.00	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,951,835.96	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,462,734.37	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,707,375.00	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,951,406.24	



T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,160,906.23	
T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,943,945.30	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,776,156.31	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,931,039.10	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,472,382.83	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,085,863.32	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,959,375.00	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,987,753.91	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,979,003.90	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,484,472.65	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,465,869.15	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,915,976.54	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,069,791.04	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,035,703.12	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,529,060.52	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,495,019.52	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,532,466.77	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,176,812.52	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,792,429.67	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,445,996.05	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,529,482.39	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,987,148.42	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,127,003.95	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,988,203.12	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,177,097.64	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,013,593.72	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,503,027.35	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,464,695.31	
T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,744,873.03	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,013,007.79	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,005,937.52	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,677,468.75	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,405,273.42	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,009,902.34	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,209,484.37	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,490,765.66	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,141,093.72	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,542,187.50	
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,118,949.22	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,858,125.02	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,136,457.01	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,511,298.82	

T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,367,996.06
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,096,562.48
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,829,089.03
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,533,925.77
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,375,278.15
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,069,531.24
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,112,918.01
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,069,836.92
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,524,746.08
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,025,312.50
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,697,621.13
T 2.25% 08/15/46	6,700,000.00	6,276,539.09
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,416,894.54
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,336,744.16
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,480,609.36
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	14,896,074.29
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,697,656.25
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,557,171.89
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,603,095.66
T 2.375% 05/15/27	6,950,000.00	7,138,410.19
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,805,175.75
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,074,335.90
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,255,468.75
T 2.5% 01/31/24	5,000,000.00	5,142,968.75
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,160,351.55
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	6,226,664.09
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	16,282,148.52
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,149,509.75
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,987,000.00
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	15,782,500.00
T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	14,014,300.85
T 2.5% 06/30/20	6,500,000.00	6,533,007.84
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,671,037.09
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,086,523.40
T 2.625% 02/15/29	5,000,000.00	5,236,328.15
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,439,867.18
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,534,619.12
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,731,880.87
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,391,085.92
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,403,390.62
T 2.625% 07/31/20	12,700,000.00	12,789,792.93
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,540,820.34
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,104,628.92

T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,886,777.31	
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,394,093.75	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,120,468.75	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,985,812.55	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,859,765.64	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	10,997,519.50	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,217,031.28	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,212,695.34	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,123,984.39	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	10,294,363.33	
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,211,000.00	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,164,140.62	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,369,312.50	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	9,362,507.81	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,212,523.50	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	12,210,664.12	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	9,978,452.36	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	16,995,843.82	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	11,559,960.99	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,952,060.53	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,540,937.50	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,161,230.42	
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,474,804.66	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,556,140.62	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,511,718.75	
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,071,718.72	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,443,312.50	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,006,640.64	
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,063,281.30	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,810,316.39	
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,057,812.48	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,565,214.87	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,201,015.61	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,016,171.89	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,350,449.18	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,823,640.60	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,001,562.50	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,672,291.00	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,410,406.25	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,228,782.86	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,504,834.00	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,011,640.62	

T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,210,398.43
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,608,316.41
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,535,546.90
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,426,392.59
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,225,445.33
T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,643,125.00
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	15,690,375.07
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,610,800.79
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	7,624,738.31
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	9,681,171.87
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	4,634,943.75
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,414,138.65
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	8,997,070.35
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,397,187.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,438,437.50
T 3.75% 11/15/43	6,000,000.00	7,333,125.00
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,907,230.48
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,830,335.93
T 3% 02/15/49	8,650,000.00	9,413,632.80
T 3% 05/15/42	1,950,000.00	2,119,863.29
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,797,500.00
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	8,418,437.50
T 3% 08/15/48	6,350,000.00	6,898,679.68
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	15,945,703.20
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,633,984.40
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,557,632.81
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,169,578.12
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	5,670,972.67
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,313,203.13
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,513,640.62
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,514,355.48
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,568,007.82
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,412,700.00
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,334,453.13
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,281,054.69
T 4.625% 02/15/40	1,700,000.00	2,318,773.44
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,100,500.00
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,541,117.19
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,596,289.06
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,652,523.44
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,136,375.00
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,543,500.00
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,128,187.50

	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,907,656.25
	T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,666,382.82
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,941,585.93
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,946,964.84
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>1,311,640,000.00</b>	<b>1,351,452,223.35</b> (146,659,595,277)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,028,157.50
	CAN 0.75% 03/01/21	4,590,000.00	4,537,077.30
	CAN 0.75% 09/01/20	4,200,000.00	4,159,155.00
	CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,607,660.85
	CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,414,172.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,315,789.50
	CAN 1.75% 03/01/23	1,900,000.00	1,927,578.50
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,717,509.50
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,907,432.80
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,482,382.50
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,395,979.00
	CAN 2.25% 06/01/25	2,850,000.00	2,993,853.75
	CAN 2.25% 06/01/29	1,120,000.00	1,202,224.80
	CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,230,426.70
	CAN 2.75% 06/01/22	2,210,000.00	2,298,510.50
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,551,868.95
	CAN 2.75% 12/01/64	960,000.00	1,285,382.40
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,240,954.50
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,166,737.90
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,124,231.95
	CAN 2% 12/01/51	400,000.00	428,604.00
	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,206,594.80
	CAN 3.5% 06/01/20	5,210,000.00	5,302,685.90
	CAN 3.5% 12/01/45	2,490,000.00	3,423,102.60
	CAN 4.0% 06/01/41	2,330,000.00	3,298,511.10
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,023,862.45
	CAN 5.75% 06/01/33	1,750,000.00	2,662,240.00
	CAN 5% 06/01/37	2,010,000.00	3,048,034.35
CAN 8.0% 06/01/27	910,000.00	1,359,767.50	
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>67,420,000.00</b>	<b>74,340,488.60</b> (6,077,334,943)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	19,825,228.50
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	42,700,696.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,070,000.00	22,357,175.30
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	45,064,799.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	55,880,000.00	54,438,296.00

	MBONO 7.25% 12/09/21	25,330,000.00	24,976,519.85	
	MBONO 7.5% 06/03/27	42,070,000.00	41,114,379.95	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	21,570,560.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	32,690,000.00	30,935,364.25	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,630,000.00	8,363,160.40	
	MBONO 8.5% 05/31/29	21,000,000.00	21,813,120.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	24,710,941.75	
	MBONO 8% 06/11/20	33,750,000.00	33,751,518.75	
	MBONO 8% 09/05/24	10,400,000.00	10,484,604.00	
	MBONO 8% 11/07/47	15,460,000.00	14,921,837.40	
	MBONO 8% 12/07/23	33,800,000.00	34,080,540.00	
	メキシコペソ 小計	452,680,000.00	451,108,741.65 (2,539,742,215)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,000,000.00	2,059,220.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,570,000.00	1,642,353.45	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,240,353.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,258,459.60	
	BGB 0.8% 06/22/28	3,160,000.00	3,375,401.40	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,190,000.00	1,278,274.20	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	940,907.50	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	897,044.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,750,000.00	1,986,451.25	
	BGB 1.7% 06/22/50	900,000.00	1,032,124.50	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,320,231.00	
	BGB 1% 06/22/26	1,730,000.00	1,876,288.80	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,609,319.20	
	BGB 2.15% 06/22/66	570,000.00	723,013.65	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,960,059.20	
	BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,028,708.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,467,313.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,629,976.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,905,017.50	
	BGB 3% 06/22/34	1,450,000.00	1,970,963.25	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,730,000.00	4,569,637.80	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,615,103.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,270,000.00	2,635,855.90	
	BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,204,007.40	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,502,736.50	
	BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,302,929.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,124,713.80	
	BGB 5% 03/28/35	2,780,000.00	4,640,014.60	
	BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,995,105.60	
	BTPS 0.05% 04/15/21	2,190,000.00	2,178,053.55	

BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,392,036.35	
BTPS 0.35% 06/15/20	3,480,000.00	3,493,711.20	
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,566,080.90	
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,401,785.00	
BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,265,751.50	
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,561,253.00	
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,171,382.20	
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,469,375.00	
BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,982,700.00	
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,463,528.50	
BTPS 1.25% 12/01/26	4,200,000.00	4,029,858.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,936,221.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,263,085.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,064,458.50	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,287,994.50	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	2,874,061.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,545,964.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,830,796.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,032,710.00	
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,599,712.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	3,858,046.50	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,589,075.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	3,700,000.00	3,755,685.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,488,376.50	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,804,125.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,457,037.50	
BTPS 2.45% 10/01/23	3,000,000.00	3,134,220.00	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,070,419.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,684,896.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	2,806,785.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	817,061.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,950,000.00	3,098,916.00	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,540,000.00	2,547,315.20	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,645,314.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,189,091.50	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,400,000.00	2,471,628.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	2,029,293.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	2,665,721.85	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,930,000.00	4,325,279.40	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,024,770.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,294,835.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	2,790,000.00	2,981,059.20	

BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,376,094.00
BTPS 3.85% 09/01/49	1,320,000.00	1,458,996.00
BTPS 3% 08/01/29	1,620,000.00	1,715,782.50
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,281,632.75
BTPS 4.5% 03/01/26	3,600,000.00	4,195,674.00
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,379,271.00
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,782,099.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,310,556.00
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,259,946.35
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	3,719,746.80
BTPS 4% 02/01/37	4,200,000.00	4,860,702.00
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,611,002.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,400,000.00	4,396,506.00
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,007,929.20
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,878,397.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,949,991.25
BTPS 5.75% 02/01/33	3,350,000.00	4,518,815.00
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,337,418.00
BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,120,401.50
BTPS 5% 08/01/34	3,690,000.00	4,713,163.20
BTPS 5% 09/01/40	3,520,000.00	4,527,001.60
BTPS 6.5% 11/01/27	4,170,000.00	5,574,351.75
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	6,499,104.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,905,827.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,058,568.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,190,000.00	4,414,479.25
DBR 0.25% 02/15/29	910,000.00	955,409.00
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,375,841.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,025,529.55
DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,634,141.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,516,950.40
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	4,997,843.25
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,131,888.80
DBR 1.25% 08/15/48	2,530,000.00	3,180,374.45
DBR 1.5% 02/15/23	2,620,000.00	2,833,621.70
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,205,543.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,533,014.80
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,000,858.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,837,200.75
DBR 1.75% 07/04/22	3,650,000.00	3,926,177.25
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,470,112.00
DBR 1% 08/15/25	3,910,000.00	4,290,540.75
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,589,850.00



DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,079,177.75	
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,047,131.50	
DBR 2.5% 07/04/44	4,430,000.00	6,842,976.70	
DBR 2.5% 08/15/46	4,190,000.00	6,607,085.30	
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,529,944.00	
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,285,281.00	
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	11,021,605.90	
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,389,125.00	
DBR 3% 07/04/20	7,190,000.00	7,469,079.85	
DBR 4.0% 01/04/37	3,360,000.00	5,678,450.40	
DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,361,561.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,751,496.25	
DBR 4.75% 07/04/34	3,380,000.00	5,832,173.10	
DBR 4.75% 07/04/40	2,510,000.00	4,912,835.55	
DBR 5.5% 01/04/31	2,930,000.00	4,893,993.65	
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,753,566.40	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,640,240.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,127,231.25	
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,019,580.25	
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,063,850.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	5,011,917.25	
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,241,217.75	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,609,103.40	
FRTR 0.5% 05/25/29	2,600,000.00	2,707,419.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	5,000,000.00	5,350,650.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	6,510,000.00	6,956,683.65	
FRTR 0% 02/25/21	3,500,000.00	3,537,817.50	
FRTR 0% 03/25/23	3,900,000.00	3,982,368.00	
FRTR 0% 03/25/24	8,040,000.00	8,217,724.20	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,150,225.00	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,649,067.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,406,699.00	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,820,000.00	5,346,464.50	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,520,000.00	7,485,775.00	
FRTR 1.5% 05/25/50	1,600,000.00	1,789,720.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,012,211.15	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,201,849.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,940,000.00	3,520,958.70	
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,749,407.85	
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,258,408.50	
FRTR 1% 11/25/25	6,930,000.00	7,522,376.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,522,468.00	

FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,294,742.30
FRTR 2.5% 05/25/30	5,460,000.00	6,854,238.30
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,684,486.25
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,216,525.00
FRTR 2% 05/25/48	4,040,000.00	5,070,866.60
FRTR 3.25% 05/25/45	4,170,000.00	6,461,832.00
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,856,174.75
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,170,111.90
FRTR 3.75% 04/25/21	6,470,000.00	7,004,907.25
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,412,214.40
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,579,218.75
FRTR 4.5% 04/25/41	5,690,000.00	10,046,377.80
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,983,840.00
FRTR 4% 04/25/55	2,300,000.00	4,276,884.50
FRTR 4% 04/25/60	2,100,000.00	4,049,209.50
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	7,898,499.60
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,240,442.50
FRTR 5.75% 10/25/32	5,410,000.00	9,295,326.75
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,673,528.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,355,775.00
IRISH 0.8% 03/15/22	1,570,000.00	1,624,581.05
IRISH 0.9% 05/15/28	1,060,000.00	1,131,841.50
IRISH 0% 10/18/22	630,000.00	639,040.50
IRISH 1.1% 05/15/29	680,000.00	735,076.60
IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	566,152.60
IRISH 1.35% 03/18/31	730,000.00	805,292.20
IRISH 1.5% 05/15/50	610,000.00	656,274.60
IRISH 1.7% 05/15/37	940,000.00	1,074,368.30
IRISH 1% 05/15/26	1,880,000.00	2,023,077.40
IRISH 2.4% 05/15/30	1,480,000.00	1,801,944.40
IRISH 2% 02/18/45	1,260,000.00	1,538,119.80
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,735,254.15
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,502,611.35
IRISH 5.4% 03/13/25	1,980,000.00	2,621,628.90
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	247,331.65
NETHER 0.25% 07/15/25	1,880,000.00	1,959,223.20
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,655,952.00
NETHER 0.5% 01/15/40	850,000.00	882,300.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,780,579.80
NETHER 0.75% 07/15/27	3,630,000.00	3,930,908.85
NETHER 0.75% 07/15/28	1,490,000.00	1,618,512.50
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,558,502.50
NETHER 0% 01/15/24	2,650,000.00	2,715,587.50

NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,138,262.75	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,810,645.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,010,000.00	2,674,707.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,230,000.00	3,631,733.40	
NETHER 2% 07/15/24	2,750,000.00	3,106,413.75	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,219,350.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,060,000.00	2,153,534.30	
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,677,707.20	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,550,000.00	4,497,231.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,470,000.00	4,111,524.95	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,712,451.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	259,343.00	
OBL 0.25% 10/16/20	2,250,000.00	2,277,281.25	
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,985,927.00	
OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,836,933.80	
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,570,112.95	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,641,704.00	
OBL 0% 10/13/23	2,930,000.00	3,014,120.30	
RAGB 0.5% 02/20/29	780,000.00	815,829.30	
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,210,859.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,430,000.00	1,534,361.40	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,546,565.70	
RAGB 0% 07/15/23	1,380,000.00	1,408,848.90	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,120,267.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,877,845.05	
RAGB 1.5% 02/20/47	970,000.00	1,156,467.95	
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	767,532.80	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,090,000.00	1,211,415.10	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,539,069.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	764,165.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,320,000.00	1,708,726.80	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,130,000.00	1,786,569.55	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,707,090.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,373,980.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,234,376.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	640,000.00	1,303,024.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	3,000,000.00	3,146,895.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,040,000.00	3,324,710.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,866,473.20	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	198,231.80	
RFGB 0.375% 09/15/20	1,330,000.00	1,346,239.30	
RFGB 0.5% 04/15/26	1,100,000.00	1,158,399.00	

RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,105,450.50
RFGB 0.5% 09/15/28	350,000.00	368,116.00
RFGB 0.5% 09/15/29	430,000.00	450,096.05
RFGB 0.75% 04/15/31	760,000.00	813,386.20
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	322,903.50
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	864,148.25
RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	776,271.60
RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	637,459.50
RFGB 1.375% 04/15/47	350,000.00	420,344.75
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	701,613.25
RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	825,359.15
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,355,583.20
RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	906,580.80
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	672,576.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	861,056.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,434,043.45
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,624,858.00
SPGB 0.05% 10/31/21	1,700,000.00	1,716,328.50
SPGB 0.25% 07/30/24	450,000.00	457,929.00
SPGB 0.35% 07/30/23	2,280,000.00	2,331,288.60
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,350,749.60
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,920,922.25
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,252,910.00
SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,053,730.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,496,614.65
SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	6,783,099.40
SPGB 1.4% 07/30/28	3,100,000.00	3,364,631.50
SPGB 1.45% 04/30/29	3,540,000.00	3,845,909.10
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,839,525.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,338,530.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,210,000.00	3,511,932.60
SPGB 1.85% 07/30/35	1,650,000.00	1,834,560.75
SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,313,086.00
SPGB 1.95% 07/30/30	3,270,000.00	3,722,780.55
SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,814,789.45
SPGB 2.35% 07/30/33	2,750,000.00	3,268,182.50
SPGB 2.7% 10/31/48	1,670,000.00	2,098,563.75
SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,066,402.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,550,000.00	3,323,083.50
SPGB 3.45% 07/30/66	1,560,000.00	2,281,944.60
SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,947,803.90
SPGB 4.2% 01/31/37	2,900,000.00	4,343,344.50
SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,104,058.75

	SPGB 4.65% 07/30/25	3,550,000.00	4,556,762.25
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,430,000.00	5,645,728.55
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,753,833.25
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,239,811.50
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,700,000.00	4,511,416.50
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,638,999.60
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,400,000.00	4,279,608.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,800,000.00	3,377,766.00
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,480,000.00	3,866,923.80
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,500,000.00	5,683,282.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,050,000.00	4,716,306.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,892,114.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,598,992.50
	ユーロ 小計	831,130,000.00	974,776,698.85 (119,731,821,919)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,100,000.00	5,101,275.00
	UKT 0.75% 07/22/23	3,930,000.00	3,963,739.05
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,105,726.50
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,168,874.80
	UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,755,207.00
	UKT 1.5% 07/22/47	3,070,000.00	3,142,881.80
	UKT 1.625% 10/22/28	4,650,000.00	4,992,030.75
	UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,435,296.10
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,356,672.00
	UKT 1.75% 01/22/49	910,000.00	988,405.60
	UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,853,941.20
	UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,537,037.00
	UKT 1.75% 09/07/37	3,720,000.00	4,001,157.60
	UKT 1% 04/22/24	4,030,000.00	4,112,292.60
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,679,687.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,650,000.00	3,755,500.50
	UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,447,335.00
	UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,428,037.80
	UKT 2% 09/07/25	1,170,000.00	1,270,894.95
	UKT 3.25% 01/22/44	3,520,000.00	4,879,864.00
	UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	4,879,660.80
	UKT 3.5% 07/22/68	2,610,000.00	4,680,917.55
	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,378,855.60
	UKT 3.75% 09/07/20	3,470,000.00	3,605,486.15
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,043,362.70
	UKT 4.25% 03/07/36	3,180,000.00	4,646,806.80
UKT 4.25% 06/07/32	2,500,000.00	3,481,075.00	

	UKT 4.25% 09/07/39	2,190,000.00	3,338,337.45
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	866,299.95
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,714,064.75
	UKT 4.25% 12/07/46	2,470,000.00	4,076,636.20
	UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,719,618.70
	UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,047,943.10
	UKT 4.5% 09/07/34	2,930,000.00	4,308,198.75
	UKT 4.5% 12/07/42	2,800,000.00	4,569,782.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,210,000.00	3,136,332.55
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,043,097.00
	UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,442,145.25
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,137,336.50
	UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,121,787.50
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,846,575.00
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	850,363.60
	イギリスポンド 小計	115,580,000.00	146,910,539.65 (20,283,938,209)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,055,307.75
	SGB 0.75% 11/12/29	5,470,000.00	5,872,263.80
	SGB 1.5% 11/13/23	12,450,000.00	13,571,807.25
	SGB 1% 11/12/26	8,660,000.00	9,446,414.60
	SGB 2.5% 05/12/25	10,690,000.00	12,522,960.85
	SGB 3.5% 03/30/39	7,150,000.00	11,151,640.50
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,730,087.35
	SGB 5% 12/01/20	14,100,000.00	15,274,177.50
	スウェーデンクローナ 小計	83,600,000.00	95,624,659.60 (1,103,508,571)
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,260,000.00	5,333,350.70
	NGB 1.75% 02/17/27	5,460,000.00	5,620,605.90
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,970,433.00
	NGB 1.75% 09/06/29	3,970,000.00	4,076,951.80
	NGB 2% 04/26/28	5,730,000.00	6,015,468.60
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,870,080.00
	NGB 3.75% 05/25/21	12,440,000.00	13,064,425.80
	NGB 3% 03/14/24	7,000,000.00	7,581,805.00
	ノルウェークローネ 小計	59,100,000.00	61,533,120.80 (774,086,659)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,526,242.00
	DGB 0.5% 11/15/27	14,090,000.00	15,161,333.15
	DGB 1.5% 11/15/23	10,280,000.00	11,266,417.40
	DGB 1.75% 11/15/25	9,410,000.00	10,806,585.15
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,666,584.50
	DGB 4.5% 11/15/39	20,590,000.00	38,959,574.40

	デンマーククローネ 小計	74,470,000.00	97,386,736.60 (1,602,011,817)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,111,526.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,778,059.50
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,680,000.00	5,820,778.80
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,890,000.00	1,937,939.85
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,450,000.00	6,558,392.25
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,900,000.00	4,954,537.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,800,000.00	4,935,264.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,940,000.00	1,992,030.80
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,606,444.80
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,639,591.35
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,775,178.60
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,520,000.00	5,798,677.20
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	777,495.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,052,124.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,259,451.25
	ポーランドズロチ 小計	63,520,000.00	65,997,490.40 (1,902,707,648)
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	5,100,000.00	5,147,251.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,194,026.20
	ACGB 2.25% 11/21/22	770,000.00	800,965.55
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,250,000.00	3,584,685.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,781,445.85
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	907,076.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,030,000.00	1,179,458.15
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,374,335.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,401,649.75
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,360,000.00	3,777,328.80
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,784,681.60
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,560,000.00	5,089,302.00
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,766,301.95
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,220,000.00	1,496,037.20
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,920,000.00	2,492,832.00
	ACGB 3% 03/21/47	2,130,000.00	2,540,035.65
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,590,000.00	5,485,325.40
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,855,989.50
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,826,263.75
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,669,400.00
ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,280,182.65	
ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,090,537.70	
	オーストラリアドル 小計	72,850,000.00	82,525,111.20 (6,258,704,433)

シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	247,472.50	
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	780,799.50	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	863,043.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,116.35	
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	691,057.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	648,903.15	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,101,329.25	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,010,000.00	1,053,712.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	651,644.80	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,661,712.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	300,676.60	
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	719,184.70	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	413,833.50	
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,996.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,202.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,090,255.10	
	SIGB 3.375% 09/01/33	730,000.00	828,320.05	
	SIGB 3.5% 03/01/27	780,000.00	866,860.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,111,671.75	
	シンガポールドドル 小計		15,490,000.00	16,106,792.40
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,502,200.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,703,955.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,359,068.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,707,216.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,156,698.75	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,298,050.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,114,129.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,199,342.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	2,934,072.05	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	760,811.25	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,235.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,139,904.45	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,220,000.00	2,254,898.40	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,748,100.50	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,082,072.25	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,948,127.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,000,000.00	1,015,660.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,064,489.70	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,597,073.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,057,090.00	
MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,415,547.00		



	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,302,421.20	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,218,904.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,340,000.00	1,386,504.70	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,860,000.00	1,993,603.80	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	873,904.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,658,670.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,532,721.60	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	667,293.00	
	マレーシアリングット 小計	54,010,000.00	55,203,763.65 (1,440,818,231)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	33,260,000.00	36,989,942.70	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,862,384.30	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,698,385.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,740,071.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	14,100,000.00	14,227,464.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,621,587.85	
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	23,503,412.40	
	SAGB 8.5% 01/31/37	24,700,000.00	21,867,280.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,075,758.30	
	SAGB 8.75% 02/28/48	35,250,000.00	31,224,097.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	13,050,000.00	12,093,108.75	
	SAGB 8% 01/31/30	17,400,000.00	15,985,641.00	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,432,072.25	
	南アフリカランド 小計	251,670,000.00	231,321,206.05 (1,681,705,167)	
	合計		311,337,431,492 (311,337,431,492)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 193銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 298銘柄	100.0%	38.5%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
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	6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	22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	29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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2019年 6月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	620,194,706
コール・ローン	20,791,180
株式	50,281,591,273
新株予約権証券	89,012
投資信託受益証券	702,145,432
投資証券	138,007,538
派生商品評価勘定	15,515,647
未収入金	645,948
未収配当金	144,972,002
差入委託証拠金	165,363,324
流動資産合計	52,089,316,062
資産合計	52,089,316,062
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,514,975
前受金	11,000,672
未払金	14,684
未払解約金	15,688,565
未払利息	43
流動負債合計	31,218,939
負債合計	31,218,939
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,516,351,824
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	32,541,745,299
元本等合計	52,058,097,123

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	52,058,097,123
負債純資産合計	52,089,316,062

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10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) 新株予約権証券 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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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>(4) 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、当該先物取引に係るものであります。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			19,516,351,824口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		2.6674円 (26,674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 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク		<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>	

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 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	17,360,701,477円
期中追加設定元本額	3,252,431,633円
期中一部解約元本額	1,096,781,286円
期末元本額	19,516,351,824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	7,140,890,199円
世界経済インデックスファンド	3,230,877,518円
D C 新興国株式インデックス・オープン	4,052,256,031円
D C 世界経済インデックスファンド	2,803,845,076円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	191,372,469円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	379,289,794円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	429,947,606円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	367,399,449円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,806,389円
S M T インデックスバランス・オープン	120,369,294円
S M T 世界経済インデックス・オープン	42,669,468円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	194,267,433円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	28,650,201円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,133,509円
グローバル経済コア	500,013,517円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	14,438,484円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	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）2040	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）2050	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）2060	36,269円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,875,887,922
新株予約権証券	4,610
投資信託受益証券	4,944,685
投資証券	156,858

合計	1,880,671,139
----	---------------

(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 6月10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	909,865,321	-	920,865,993	11,000,672
合計		909,865,321	-	920,865,993	11,000,672

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	5,425,000 5,425,000	- -	5,425,000 5,425,000	- -
合計		5,425,000	-	5,425,000	-

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	507,578	7.05	3,582,485.52	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	1.03	107,224.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	38,742	79.00	3,060,618.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	199.00	1,714,783.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	103,060	6.44	663,706.40	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	3.84	616,906.09	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	24,530	70.08	1,719,062.40	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	7,076	13.16	93,120.16	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	15.64	242,592.04	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.79	267,324.70	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	21.20	1,409,736.40	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	26.50	410,988.50	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	12.50	232,750.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	41.92	298,638.08	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	16.16	409,656.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	36.05	194,742.10	
	51JOB INC-ADR	1,655	71.08	117,637.40	
	DP WORLD PLC	21,152	17.98	380,312.96	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	17.56	525,957.12	
	NIO INC - ADR	53,878	2.76	148,703.28	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	31.26	341,796.84	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,433	89.29	1,199,432.57	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	33,143	35.26	1,168,622.18	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	40.87	1,361,216.22	
	58.COM INC-ADR	9,450	57.63	544,603.50	
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	91.78	486,250.44	
BAIDU INC - SPON ADR	24,875	109.81	2,731,523.75		



	IQIYI INC-ADR	11,977	17.88	214,148.76
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	30.54	396,928.38
	NETEASE INC-ADR	6,498	258.26	1,678,173.48
	SINA CORP	5,725	40.19	230,087.75
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	13.61	123,483.53
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	42.40	222,557.60
	YY INC-ADR	4,344	74.75	324,714.00
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	125,894	154.23	19,416,631.62
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	42.04	147,476.32
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	33.95	1,292,510.45
	JD.COM INC-ADR	68,369	26.80	1,832,289.20
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	19.78	350,620.28
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	7.23	262,007.97
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,845	14.41	574,166.45
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	26.66	97,122.38
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	56.11	226,403.85
	BBVA BANCO FRANCES SA-ADR	4,996	9.48	47,362.08
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	147,287	4.19	617,868.96
	CREDICORP LTD	6,431	228.97	1,472,506.07
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	8,771	27.41	240,413.11
	SBERBANK-SPONSORED ADR	233,869	15.70	3,671,743.30
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.22	252,864.84
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	38.31	77,424.51
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	1.14	62,270.20
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	34.90	153,734.50
	GLOBANT SA	3,122	93.17	290,876.74
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.16	325,208.64
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	6,359	15.34	97,547.06
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	5,650	26.03	147,069.50
	アメリカドル 小計	2,478,330		58,876,601.18 (6,389,288,760)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,455,661	8.10	11,790,854.10
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	295,492	50.60	14,951,895.20
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	243.65	3,532,925.00
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	41.63	4,031,948.76
	ALFA S.A.B. -A	242,900	17.75	4,311,475.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	72.47	2,717,625.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	316.67	7,379,994.35
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	199.30	6,194,244.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	192.00	3,260,160.00
	ALSEA SAB DE CV	34,300	36.13	1,239,259.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	209,790	36.97	7,755,936.30

	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	79.53	2,497,242.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	103.34	1,126,406.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	53.91	25,261,147.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	104.97	3,534,864.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	189.79	33,998,980.60	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	188.02	4,880,999.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	41.32	5,470,768.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	36.87	6,702,966.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	29.13	4,943,361.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	218,200	101.95	22,245,490.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	26.26	6,630,650.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	14.47	43,957,544.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	82.64	3,115,528.00	
	メキシコペソ 小計	7,238,155		231,532,264.86 (1,303,526,651)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	47.32	870,688.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,100	29.85	8,301,285.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	341,340	26.76	9,134,258.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	20.21	1,527,876.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	32.76	484,848.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	16.59	1,045,170.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	13.90	1,209,300.00	
	SUZANO SA	50,679	30.36	1,538,614.44	
	VALE SA	285,178	48.66	13,876,761.48	
	EMBRAER SA	69,700	18.54	1,292,238.00	
	WEG SA	66,872	19.20	1,283,942.40	
	CCR SA	101,100	13.62	1,376,982.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	38.80	2,289,277.60	
	RUMO SA	97,700	19.10	1,866,070.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.50	1,450,932.00	
	B2W CIA DIGITAL	23,600	31.07	733,252.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	15.90	1,013,084.40	
	LOJAS RENNER S.A.	66,407	44.36	2,945,814.52	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,100	198.45	1,408,995.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	27,700	24.81	687,237.00	
	ATACADA0 DISTRIBUICAO COMERC	41,500	23.37	969,855.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	87.25	1,291,300.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	71.55	1,509,705.00	
	AMBEV SA	438,500	17.61	7,721,985.00	
	BRF SA	52,500	26.16	1,373,400.00	
	JBS SA	90,300	21.65	1,954,995.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	37.52	236,376.00	

	NATURA COSMETICOS SA	20,700	57.17	1,183,419.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	20,500	41.79	856,695.00	
	HYPERA SA	35,300	28.05	990,165.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	32.95	3,834,127.90	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	365,953	37.29	13,646,387.37	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	52.36	4,246,396.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	442,781	35.07	15,528,329.67	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	410,067	12.40	5,084,830.80	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	37.09	7,065,756.27	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	30.99	1,744,737.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	9,600	98.54	945,984.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	55.51	405,223.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	13.38	763,502.94	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	26.10	1,184,940.00	
	CIELO SA	99,269	6.70	665,102.30	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	49.47	2,394,348.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	11.09	808,461.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	36.98	654,546.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	35.97	866,877.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	15.15	999,778.80	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	47.65	1,243,665.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	46.20	773,850.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13,000	88.12	1,145,560.00	
	ブラジルリアル 小計	4,843,318		136,426,924.29 (3,813,132,533)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,125.00	318,701,250.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,809.00	245,960,685.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	21,600.00	212,911,200.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,754	6,339.40	150,586,107.60	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	4,249.90	301,050,166.30	
	CENCOSUD SA	137,988	1,280.00	176,624,640.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	9,350.00	87,170,050.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,400.00	36,508,800.00	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	98.22	229,371,201.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	4,984	45,311.00	225,830,024.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	49.95	313,677,058.95	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.69	95,369,694.26	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,806.00	126,264,912.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	395.82	64,616,823.36	
	COLBUN SA	475,888	133.20	63,388,281.60	
	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	113.59	245,647,575.79	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	64.00	163,921,792.00	

	チリペソ 小計	31,198,454		3,057,600,262.46 (479,431,721)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,875.00	1,405,814,625.00
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	7,350.00	235,280,850.00
	GRUPO ARGOS SA	17,723	17,020.00	301,645,460.00
	BANCOLOMBIA SA	20,302	38,000.00	771,476,000.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	39,760.00	1,521,933,280.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,170.00	355,338,360.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	33,440.00	696,220,800.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	30,800.00	386,878,800.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,400.00	878,891,400.00
	コロンビアペソ 小計	984,893		6,553,479,575.00 (217,575,521)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	22.30	200,700.00
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	17.72	77,223.76
	OPAP SA	17,668	9.52	168,199.36
	JUMBO SA	8,599	16.18	139,131.82
	ALPHA BANK AE	129,138	1.59	205,975.11
	EUROBANK ERGASIAS SA	182,882	0.80	147,037.12
	NATIONAL BANK OF GREECE	27,165	2.30	62,479.50
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	12.12	245,951.16
	ユーロ 小計	399,103		1,246,697.83 (153,131,894)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	126.90	1,472,420.70
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	7.49	874,494.95
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	18.70	445,265.70
	KOC HOLDING AS	62,460	16.81	1,049,952.60
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	5.33	230,085.44
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	26.34	259,080.24
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	13.03	810,348.73
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	57.10	186,031.80
	ARCELIK AS	15,358	17.88	274,601.04
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,412	82.05	1,756,854.60
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	19.99	224,487.70
	AKBANK T.A.S.	276,321	6.38	1,762,927.98
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.40	2,015,932.80
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.21	901,392.52
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.14	931,036.92
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	12.85	1,221,983.60
	トルコリラ 小計	1,279,881		14,416,897.32 (267,865,952)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	890.00	6,642,070.00

	MONETA MONEY BANK AS	68,748	77.40	5,321,095.20	
	CEZ AS	13,737	536.00	7,363,032.00	
	チェココルナ 小計	89,948		19,326,197.20	(92,572,484)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,286.00	108,017,392.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,100.00	77,407,800.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	12,480.00	243,971,520.00	
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		429,396,712.00	(164,630,699)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	82.00	906,674.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	90.18	2,382,014.52	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	146,497	5.63	824,778.11	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	49.62	206,965.02	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	93.10	1,222,589.20	
	CCC SA	3,138	152.50	478,545.00	
	LPP SA	124	7,290.00	903,960.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	219.50	1,471,528.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.34	666,046.68	
	DINO POLSKA SA	4,430	125.70	556,851.00	
	ALIOR BANK SA	8,830	49.80	439,734.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	9.60	316,963.20	
	BANK PEKAO SA	15,510	111.55	1,730,140.50	
	M BANK SA	1,663	426.60	709,435.80	
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	42.04	3,216,270.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	377.00	1,362,855.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	42.40	2,160,322.40	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.33	352,593.43	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	8.96	568,924.16	
	ポーランドズロチ 小計	548,414		20,477,190.22	(590,357,394)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.11	304,780.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.94	1,332,480.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,377,400	5.10	12,124,740.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	16.08	5,531,520.00	
	CNOOC LTD-R	1,626,000	12.16	19,772,160.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.03	1,813,740.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	4.28	8,457,280.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.71	952,820.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.77	941,800.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	75,400	3.47	261,638.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	44.00	4,840,000.00	
	BBMG CORPORATION - H	131,000	2.33	305,230.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.18	525,770.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	2.43	816,480.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	5.93	1,956,900.00
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	144,000	4.36	627,840.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	6.89	1,446,900.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.58	284,968.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.82	815,060.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.00	830,000.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	3.33	972,360.00
MMG LIMITED	168,000	2.43	408,240.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	6.00	774,000.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.31	658,690.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	7.74	700,470.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.80	2,041,200.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.53	561,720.00
BOC AVIATION LTD	32,500	66.60	2,164,500.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	395,000	6.91	2,729,450.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	136,000	6.00	816,000.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	25.20	4,019,400.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	9.21	1,763,715.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	5.70	1,710,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.01	1,361,700.00
CITIC LTD	502,000	10.76	5,401,520.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	6.52	3,332,046.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	10.04	2,891,520.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	0.64	356,800.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	15.72	550,200.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	2.03	290,290.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.74	460,320.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	16.50	627,000.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	6.33	452,595.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	14.52	617,100.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	143,800	11.80	1,696,840.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	8.05	252,898.80
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	41.80	2,604,140.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	7.25	2,791,786.50
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	15.92	2,165,120.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.06	1,090,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.02	828,360.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.52	704,160.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	4.25	280,500.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	13.98	1,363,707.06

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.02	883,520.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.10	352,600.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	2.84	416,060.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	7.38	770,058.72
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.10	754,800.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	14.08	1,801,141.76
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.82	310,200.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	8.45	743,600.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.72	552,240.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	8.18	2,045,000.00
BYD CO LTD-H	68,500	47.75	3,270,875.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	2.32	580,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.31	1,678,460.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	22.75	618,800.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	471,000	12.84	6,047,640.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	5.95	2,098,862.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.75	1,955,666.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	9.06	833,520.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	48.30	5,361,300.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	20.00	2,320,000.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.17	294,768.00
LI NING CO LTD	135,000	13.44	1,814,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	93.30	6,531,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	11.70	315,900.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.60	2,320,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	30.35	977,270.00
TENCENT HOLDINGS LTD	513,900	330.40	169,792,560.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.75	445,468.50
MEITUAN DIANPING-CLASS B	81,600	59.65	4,867,440.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	19.92	836,640.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	6.78	1,322,100.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.37	244,110.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	28.95	7,440,150.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	33.65	4,778,300.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.50	662,750.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	12.20	1,805,600.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	45.30	1,268,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.16	652,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.73	3,208,800.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	37.90	1,288,600.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	58.10	3,863,650.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	7.11	2,033,460.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	6.85	1,671,400.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.26	1,959,384.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	28.60	2,848,560.00
3SBIO INC	119,000	12.02	1,430,380.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	6.62	662,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	11.52	5,207,040.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	9.50	1,496,250.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.89	645,740.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	16.70	1,369,400.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	5.50	448,250.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	21.35	1,184,925.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.74	558,540.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	6.90	3,995,100.00
SSY GROUP LTD	114,000	6.00	684,000.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	9.71	359,270.00
WUXI APPTec CO LTD-H	3,500	85.80	300,300.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	72.45	3,224,025.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.42	8,269,560.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	3.20	23,706,240.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	6.22	5,893,294.50
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.35	4,137,720.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,580,620	6.18	53,028,231.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.40	758,200.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	354,423	37.10	13,149,093.30
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.58	3,076,812.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	4.00	604,000.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,109,515	5.57	34,029,998.55
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	4.29	3,131,700.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.77	1,472,640.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.08	1,846,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	11.44	709,280.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.07	1,336,995.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.31	1,214,370.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	13.78	1,818,960.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	13.88	2,762,120.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.99	1,126,590.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.72	772,592.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	13.12	776,704.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	7.92	2,192,256.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	11.98	1,902,424.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	710,000	17.64	12,524,400.00



CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	28.95	7,839,660.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.37	327,430.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	19.32	2,740,039.68
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	34.15	2,288,050.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.03	2,096,760.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.18	5,016,695.84
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	474,000	85.25	40,408,500.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	21.45	229,515.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.96	1,414,320.00
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP	69,000	9.22	636,180.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	20.30	3,775,800.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.56	2,635,680.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	27.50	10,478,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	32.65	7,937,574.15
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	28.00	3,382,400.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.64	1,280,640.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	770,285	10.54	8,118,803.90
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	8.78	1,123,840.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	13.96	960,448.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.44	536,640.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	7.96	708,440.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	11.58	1,088,520.00
LONGFOR PROPERTIES	123,500	29.10	3,593,850.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.79	937,440.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	21.70	2,875,250.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.71	358,245.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	225,091	3.13	704,534.83
SOHO CHINA LTD	113,000	2.53	285,890.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	33.05	6,973,550.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.73	999,940.00
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.50	364,301.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	8.20	1,984,400.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	19.58	1,292,280.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.48	1,222,920.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	40.75	2,913,625.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	10.30	875,500.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	4.94	1,165,840.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	20.35	1,363,450.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.89	475,410.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	17.88	377,268.00
LENOVO GROUP LTD	578,000	5.63	3,254,140.00
MEITU INC	143,000	2.50	357,500.00

SUNNY OPTICAL TECH	61,100	67.55	4,127,305.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	323,200	9.21	2,976,672.00	
ZTE CORP-H	82,908	20.05	1,662,305.40	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	557,500	70.40	39,248,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	4.01	5,437,560.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,672,000	1.91	7,013,520.00	
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	8.40	4,267,200.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	39.15	1,526,850.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.10	1,672,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.18	2,925,560.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	25.85	4,451,370.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.03	1,272,590.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	2.06	339,900.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	37.55	3,229,300.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	11.56	2,027,624.00	
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	1.93	266,340.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	72.50	5,444,750.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	15.98	3,547,560.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.24	596,160.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.93	1,824,100.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.18	667,080.00	
TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.66	260,360.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	15.20	684,000.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	8.76	2,321,400.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	221,725	3.95	875,813.75	
香港ドル 小計	82,687,096		808,006,600.38 (11,182,811,349)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.29	1,360,967.72
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	25.60	642,560.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.40	1,764,840.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.46	643,578.00
	GAMUDA BHD	139,200	3.40	473,280.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.92	378,944.00
	IJM CORP BHD	198,100	2.18	431,858.00
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.25	376,303.50
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	2.90	187,920.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	7.62	408,386.28
	MISC BHD	125,040	7.00	875,280.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.88	271,600.00
	GENTING BHD	205,300	6.41	1,315,973.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.15	705,915.00

	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	29.72	323,948.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	34.28	291,380.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.28	143,920.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.32	776,044.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.60	1,348,080.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	148.50	1,024,650.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.92	996,705.60	
	QL RESOURCES BHD	83,200	6.80	565,760.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.58	1,131,470.68	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	158,600	5.27	835,822.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.51	1,263,443.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	5.06	497,904.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.84	271,104.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.45	579,390.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.28	2,278,689.60	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	19.00	1,164,548.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	18.98	283,428.34	
	MALAYAN BANKING BHD	359,804	8.99	3,234,637.96	
	PUBLIC BANK BERHAD	256,420	23.42	6,005,356.40	
	RHB BANK BHD	53,119	5.75	305,434.25	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.06	177,280.76	
	SP SETIA BHD	185,105	2.09	386,869.45	
	AXIATA GROUP BERHAD	281,687	4.66	1,312,661.42	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.81	1,499,277.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.56	1,489,524.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.52	248,343.04	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	18.28	1,380,140.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	12.78	3,763,390.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.15	290,219.75	
	マレーシアリングット 小計	6,507,182		43,706,828.05 (1,140,748,212)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	14.70	5,362,560.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	4.76	3,948,420.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	125.00	15,587,500.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	47.00	45,176,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	60.00	7,206,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	46.75	9,649,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	61.75	13,889,674.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,600	460.00	26,956,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	66.00	28,254,600.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	11.70	9,558,900.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	471,100	11.50	5,417,650.00	

	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	38.50	6,229,685.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,235	17.00	8,010,995.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	56.00	1,948,800.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102,700	48.00	4,929,600.00	
	CP ALL PCL-NVDR	491,700	81.25	39,950,625.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	28.00	9,539,600.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.60	4,464,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	819,600	26.00	21,309,600.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	172.00	5,641,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	32,700	201.00	6,572,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	192.00	24,268,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	40,800	191.00	7,792,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	19.20	4,747,200.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	182,300	131.00	23,881,300.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	1.92	2,566,080.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	55.25	4,961,450.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	172,500	74.75	12,894,375.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	537,100	11.00	5,908,100.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	194.50	20,597,550.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	150,800	58.25	8,784,100.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	49.75	3,283,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	5.00	4,807,045.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	307.00	7,122,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	54.00	10,017,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	105.00	5,502,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	63.00	3,420,900.00	
	タイパーツ 小計	11,666,638		430,158,709.50 (1,488,349,134)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	55.35	13,169,979.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	15.52	9,166,112.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	10.44	3,606,498.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	63.40	14,604,824.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	963.00	21,961,215.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	137.50	8,695,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	275.20	16,789,952.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	169.00	10,711,220.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	81.80	4,895,321.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	139.80	24,286,195.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	142,732	70.95	10,126,835.40	
	SECURITY BANK CORP	30,810	171.90	5,296,239.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	923.00	20,647,510.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,350	879.00	5,581,650.00	

	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.45	10,482,865.00	
	AYALA LAND INC	637,000	49.80	31,722,600.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	6.07	3,872,660.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	26.30	2,445,900.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	39.35	34,925,092.50	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	2,240.00	4,009,600.00	
	PLDT INC	6,225	1,230.00	7,656,750.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	35.10	3,141,450.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	388.80	11,317,968.00	
	フィリピンペソ 小計	6,788,488		279,113,936.70 (583,348,127)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,295.00	1,863,893,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	3,060.00	1,368,738,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	25,350.00	3,267,615,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,750.00	1,892,550,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	21,200.00	4,028,000,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	10,200.00	884,340,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	11,550.00	2,709,630,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,700.00	703,950,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	7,450.00	12,822,940,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,650.00	879,450,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	550,200	4,900.00	2,695,980,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	80,475.00	2,478,630,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,380.00	3,102,502,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,800.00	1,577,800,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,600.00	2,832,060,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	44,500.00	5,277,700,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,405.00	3,872,039,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	915,000	29,100.00	26,626,500,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,675.00	13,953,886,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,400.00	6,805,680,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	2,470.00	1,652,677,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	4,100.00	20,033,010,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,350.00	922,590,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	705.00	1,135,332,000.00		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	3,900.00	17,718,090,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	2,060.00	1,630,490,000.00		
	インドネシアルピア 小計	26,839,096		142,736,073,800.00 (1,084,794,160)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	50,600.00	213,886,200.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	81,700.00	277,861,700.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	160,500.00	896,553,000.00	

HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	21,350.00	228,573,100.00
HYUNDAI STEEL CO	7,242	40,100.00	290,404,200.00
KOREA ZINC CO LTD	783	449,000.00	351,567,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	93,900.00	98,688,900.00
LG CHEM LTD	4,436	330,500.00	1,466,098,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	188,500.00	90,291,500.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	256,000.00	358,400,000.00
OCI COMPANY LTD	1,127	93,000.00	104,811,000.00
POSCO	7,270	234,000.00	1,701,180,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,159	57,400.00	66,526,600.00
CJ CORP	1,230	101,000.00	124,230,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,753	117,500.00	205,977,500.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,915.00	40,647,050.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	33,250.00	143,241,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	40,550.00	274,118,000.00
HANWHA CORPORATION	2,825	25,800.00	72,885,000.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	43,100.00	94,863,100.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	52,000.00	331,760,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	116,500.00	386,547,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	309,500.00	250,695,000.00
KCC CORP	870	261,000.00	227,070,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	34,450.00	178,313,200.00
LG CORP	8,323	74,300.00	618,398,900.00
LOTTE CORP	2,370	42,700.00	101,199,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	17,100.00	102,394,800.00
SAMSUNG C&T CORP	7,702	92,800.00	714,745,600.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	15,850.00	293,478,600.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,780.00	289,034,780.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	238,000.00	659,022,000.00
S-1 CORPORATION	960	96,600.00	92,736,000.00
CJ LOGISTICS	862	156,000.00	134,472,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	161,000.00	234,255,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	32,500.00	178,880,000.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,320.00	128,459,520.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,066	35,750.00	252,609,500.00
HANON SYSTEMS	19,000	11,550.00	219,450,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,414	220,000.00	1,411,080,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	140,000.00	1,844,640,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	87,200.00	252,182,400.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	79,600.00	239,038,800.00
KIA MOTORS CORPORATION	21,570	41,150.00	887,605,500.00
FILA KOREA LTD	4,080	78,500.00	320,280,000.00

HLB INC	2,398	72,500.00	173,855,000.00
LG ELECTRONICS INC	9,197	78,300.00	720,125,100.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,607	79,900.00	288,199,300.00
KANGWON LAND INC	13,208	30,850.00	407,466,800.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	27,450.00	139,171,500.00
KAKAO CORP	4,122	120,000.00	494,640,000.00
NAVER CORP	13,191	111,000.00	1,464,201,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	459,500.00	758,175,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	119,000.00	293,335,000.00
PEARL ABYSS CORP	338	202,300.00	68,377,400.00
CJ ENM CO LTD	830	189,000.00	156,870,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	93,500.00	285,268,500.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	84,400.00	103,136,800.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	159,000.00	164,406,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	293,500.00	155,555,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	187,500.00	102,937,500.00
EMART	1,661	146,000.00	242,506,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,000.00	45,885,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	280,000.00	217,000,000.00
KT&G CORP	10,696	101,000.00	1,080,296,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	83,300.00	166,016,900.00
OTTOGI CORPORATION	68	694,000.00	47,192,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	180,000.00	517,140,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	95,200.00	67,592,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,295,000.00	1,199,170,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	775,000.00	104,625,000.00
PACIFIC CORP	2,115	64,000.00	135,360,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,731	57,300.00	213,786,300.00
CELLTRION INC	7,739	196,500.00	1,520,713,500.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	51,500.00	57,268,000.00
HANMI PHARM CO LTD	481	407,500.00	196,007,500.00
HANMI SCIENCE CO LTD	628	67,500.00	42,390,000.00
HELIXMITH CO LTD	1,231	190,700.00	234,751,700.00
MEDY-TOX INC	326	433,100.00	141,190,600.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	305,500.00	477,496,500.00
SILLAJEN INC	5,667	54,500.00	308,851,500.00
YUHAN CORPORATION	630	247,500.00	155,925,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	7,070.00	164,137,120.00
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	37,500.00	991,537,500.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,850.00	392,370,500.00
KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	44,300.00	1,690,443,700.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	36,776	44,900.00	1,651,242,400.00

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	45,214	13,750.00	621,692,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	74,500.00	342,849,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,600.00	236,299,200.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	13,900.00	157,042,200.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	37,300.00	70,832,700.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	35,000.00	202,160,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	60,500.00	254,644,500.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	3,215.00	96,118,855.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	29,850.00	128,892,300.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	33,450.00	132,963,750.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	271,500.00	843,822,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	81,400.00	603,743,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	207,000.00	646,047,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	16,650.00	400,782,150.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	94,200.00	133,293,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	95,500.00	535,086,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	429,313	44,200.00	18,975,634,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	73,732	36,250.00	2,672,785,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,221	230,000.00	1,200,830,000.00	
	LG UPLUS CORP	14,194	14,150.00	200,845,100.00	
	SK TELECOM	1,647	255,000.00	419,985,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	25,700.00	628,801,900.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	41,400.00	59,284,800.00	
	SK HYNIX INC	50,048	65,400.00	3,273,139,200.00	
	韓国ウォン 小計	1,340,129		68,123,340,125.00 (6,260,534,957)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	115.00	12,562,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	45.85	10,736,969.60	
	CHINA STEEL	1,120,261	24.35	27,278,355.35	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	107.50	33,761,557.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	110.00	42,770,640.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	78.50	36,718,532.00	
	TAIWAN CEMENT	438,721	43.15	18,930,811.15	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	306.00	3,672,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	32.75	11,397,917.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,619	232.00	4,783,608.00	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.79	1,274,687.37	
	EVA AIRWAYS CORP	159,403	15.45	2,462,776.35	
	EVERGREEN MARINE	132,968	11.95	1,588,967.60	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	46.65	8,257,050.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	40.15	7,108,999.15	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	412.00	4,918,044.00	



FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	243.50	8,015,046.00
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	38.65	1,546,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	225.50	5,742,132.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	219.50	3,512,000.00
POU CHEN	273,780	37.20	10,184,616.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	68.50	1,514,398.00
TATUNG CO LTD	210,000	22.10	4,641,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	510.00	13,260,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	301.00	13,708,744.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	57.40	2,052,394.40
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	81.20	36,247,274.00
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	139.00	1,807,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	412,224	20.70	8,533,036.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.45	11,876,571.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,628,237	21.05	34,274,388.85
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	913,614	27.40	25,033,023.60
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	994,153	22.70	22,567,273.10
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	549,972	21.30	11,714,403.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	31.70	28,604,146.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	12.50	14,461,112.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	945,114	14.25	13,467,874.50
TAIWAN BUSINESS BANK	199,639	13.55	2,705,108.45
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	747,205	20.70	15,467,143.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	306,000	57.90	17,717,400.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	128,177	115.50	14,804,443.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	18.05	13,937,361.65
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	40.75	29,827,003.25
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163,157	24.00	3,915,768.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	43.15	28,007,888.30
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,142,638	8.75	9,998,082.50
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	48.50	2,042,820.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	40.70	1,361,008.00
ACER INC	255,803	18.85	4,821,886.55
ADVANTECH CO LTD	28,402	259.50	7,370,319.00
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	216.50	13,659,418.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	9.06	8,562,515.40
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	190.50	10,991,850.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	76.30	2,196,829.60
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	7.15	5,541,250.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	19.60	8,462,496.00
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	148.00	27,661,644.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	61.10	5,673,135.00

	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,113,248	71.10	79,151,932.80	
	INVENTEC CO LTD	280,511	22.95	6,437,727.45	
	LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	3,470.00	31,368,800.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	45.45	10,246,793.40	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	80.10	4,806,000.00	
	PEGATRON CORP	159,474	50.00	7,973,700.00	
	QUANTA COMPUTER INC	242,270	58.20	14,100,114.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	37.70	4,829,370.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	146.50	3,955,500.00	
	WISTRON CORP	242,695	22.85	5,545,580.75	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	39.05	5,611,172.60	
	YAGEO CORPORATION	22,764	245.00	5,577,180.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	93.20	2,043,130.40	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	347,315	113.50	39,420,252.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	78.50	12,324,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	118.50	18,035,700.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	58.70	17,217,590.50	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	290.00	5,220,000.00	
	MEDIATEK INC	138,804	307.00	42,612,828.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	59.20	6,097,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	149.50	7,930,227.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	267.50	3,102,732.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	74.10	3,539,757.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,944	204.00	6,720,576.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,207,389	232.00	512,114,248.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	13.05	12,749,850.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	58.20	5,179,800.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	169.50	5,424,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	13.95	2,845,800.00	
	新台湾ドル 小計	29,510,042		1,617,893,783.82 (5,581,733,554)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	403.00	26,646,360.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	265.55	11,132,918.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	311.40	18,504,945.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	163.80	31,738,707.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	150,637	167.50	25,231,697.50	
	PETRONET LNG LTD	49,423	238.05	11,765,145.15	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,198	1,314.90	334,244,950.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	222.25	8,264,366.25	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,418.35	35,402,016.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	871.45	23,827,185.90	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	194.80	23,640,343.60	

JSW STEEL LTD	80,284	262.40	21,066,521.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,255.70	10,181,215.60
SHREE CEMENT LTD	901	20,739.25	18,686,064.25
TATA STEEL LTD	25,839	482.10	12,456,981.90
ULTRATECH CEMENT LTD	9,271	4,572.85	42,394,892.35
UNITED PHOSPHORUS LTD	36,136	1,019.45	36,838,845.20
VEDANTA LTD	110,508	164.20	18,145,413.60
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	90.00	12,924,270.00
HAVELLS INDIA LTD	23,476	788.65	18,514,347.40
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,513.85	67,496,516.10
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	425.20	26,586,055.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	524.30	13,870,356.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,661.20	13,887,632.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,961.40	24,763,226.80
BHARAT FORGE LTD	13,392	457.40	6,125,500.80
BOSCH LTD	431	17,052.00	7,349,412.00
EICHER MOTORS LTD	1,254	19,997.75	25,077,178.50
HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,762.80	8,976,337.20
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	644.05	40,541,659.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	6,948.25	66,001,426.75
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	114.55	8,801,678.35
TATA MOTORS LTD	147,050	169.50	24,924,975.00
PAGE INDUSTRIES LTD	601	19,961.45	11,996,831.45
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,268.95	35,300,920.05
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	340.20	16,774,241.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,296.65	14,296,862.90
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,478	2,899.30	15,882,365.40
ITC LTD	316,525	275.25	87,123,506.25
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	11,503.85	27,551,720.75
UNITED SPIRITS LTD	32,483	551.30	17,907,877.90
DABUR INDIA LTD	58,111	404.15	23,485,560.65
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	691.50	19,317,744.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,830.75	109,277,467.50
MARICO LTD	42,465	373.85	15,875,540.25
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	619.40	12,596,118.40
CIPLA LTD	31,308	549.50	17,203,746.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,566.25	14,187,092.50
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,580.70	26,901,216.80
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	527.35	8,456,584.60
LUPIN LTD	16,340	730.20	11,931,468.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,106.45	14,115,321.45
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	399.25	33,117,787.50

	AXIS BANK LTD	162,301	804.00	130,490,004.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	147,455	2,210.85	326,000,886.75	
	ICICI BANK LTD	222,300	416.60	92,610,180.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	731.10	19,679,749.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	556.30	15,560,267.30	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	342.05	57,268,747.40	
	YES BANK LTD	152,956	139.90	21,398,544.40	
	BAJAJ FINANCE LTD	16,731	3,509.45	58,716,607.95	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	414.90	11,587,742.10	
	REC LTD	48,168	151.70	7,307,085.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,092.60	13,260,886.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	8,202.35	25,976,842.45	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,537	1,191.70	5,406,742.90	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,079.60	49,487,784.40	
	INFOSYS LTD	308,929	739.10	228,329,423.90	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	80,692	2,181.75	176,049,771.00	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	750.75	36,077,291.25	
	WIPRO LTD	118,712	295.05	35,025,975.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	160,097	357.10	57,170,638.70	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	279.65	10,012,588.60	
	IDEA CELLULAR LTD	467,944	13.40	6,270,449.60	
	GAIL INDIA LTD	87,384	313.85	27,425,468.40	
	NTPC LTD	260,019	135.15	35,141,567.85	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,781	191.75	31,980,256.75	
	TATA POWER CO LTD	93,250	66.30	6,182,475.00	
	インドルピー 小計	5,649,904		3,093,727,092.95 (4,888,088,806)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	130.92	9,557,160.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	127.42	8,473,430.00	
	MCB BANK LTD	53,300	182.69	9,737,377.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		27,767,967.00 (20,548,295)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	2,599	213.00	553,587.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	30,296	25.93	785,575.28	
	INDUSTRIES QATAR	15,948	112.16	1,788,727.68	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	47.40	966,912.60	
	MASRAF AL RAYAN	40,654	37.10	1,508,263.40	
	QATAR ISLAMIC BANK	11,423	172.00	1,964,756.00	
	QATAR NATIONAL BANK	41,282	184.05	7,597,952.10	
	QATAR INSURANCE CO	18,964	34.61	656,344.04	
	BARWA REAL ESTATE CO	20,749	35.12	728,704.88	
	OOREDOO QSC	7,280	64.16	467,084.80	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	165.01	624,067.82
	カタールリアル 小計	213,376		17,641,975.60 (524,495,934)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	172.23	3,382,252.74
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,431	787.00	5,061,197.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	42,469	223.11	9,475,258.59
	GOLD FIELDS LTD	64,581	75.77	4,893,302.37
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	458.00	2,460,376.00
	MONDI LTD	9,893	319.64	3,162,198.52
	SAPPI LIMITED	49,985	55.60	2,779,166.00
	SASOL LTD	51,446	379.45	19,521,184.70
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	204.58	5,667,275.16
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	125.03	5,067,340.87
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	202.83	4,320,076.17
	NASPERS LTD-N SHS	39,483	3,459.75	136,601,309.25
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	172.67	4,149,605.44
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	72.14	3,417,055.38
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	46.20	3,866,200.80
	BID CORP LTD	33,071	314.59	10,403,805.89
	CLICKS GROUP LTD	20,499	199.88	4,097,340.12
	PICK N PAY STORES LTD	15,477	70.64	1,093,295.28
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	167.91	7,521,024.72
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	188.49	2,754,404.37
	TIGER BRANDS LTD	13,023	220.00	2,865,060.00
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	23.91	3,742,943.13
	NETCARE LTD	99,170	18.69	1,853,487.30
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	100.69	3,750,098.36
	ABSA GROUP LTD	61,049	170.00	10,378,330.00
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,269.80	4,091,295.60
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	258.95	9,849,681.15
	STANDARD BANK GROUP LTD	109,999	195.14	21,465,204.86
	FIRSTRAND LTD	312,664	66.80	20,885,955.20
	INVESTEC LTD	28,883	90.00	2,599,470.00
	PSG GROUP LTD	18,494	242.69	4,488,308.86
REINET INVESTMENTS SCA	11,647	248.90	2,898,938.30	
REMGRO LTD	46,153	188.16	8,684,148.48	
RMB HOLDINGS LTD	74,398	81.75	6,082,036.50	
DISCOVERY LIMITED	34,996	143.21	5,011,777.16	
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	106.78	664,812.28	
MMI HOLDINGS LTD	68,078	18.65	1,269,654.70	
OLD MUTUAL LTD	407,000	21.20	8,628,400.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	33.24	1,343,161.92	

	SANLAM LTD	172,493	76.71	13,231,938.03	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	126.00	3,895,164.00	
	MTN GROUP LTD	156,559	108.55	16,994,479.45	
	TELKOM SA LTD	11,353	96.70	1,097,835.10	
	VODACOM GROUP	58,903	124.03	7,305,739.09	
	南アフリカランド 小計	2,659,819		402,771,588.84 (2,928,149,450)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	8.74	1,612,879.60	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.04	648,083.52	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	223,903	14.68	3,286,896.04	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	1.78	1,134,326.36	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	3.84	117,292.80	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.88	337,728.84	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	4.50	1,352,799.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	16.16	2,719,259.36	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,853,374		11,209,265.52 (331,682,166)	
香港・オフショア 人民元	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	8.59	328,997.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	38.28	1,126,963.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.30	243,810.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.71	249,318.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.55	267,895.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	32.97	352,779.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	15.66	369,576.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.47	287,980.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	21.92	249,888.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	14.94	253,980.00	
	CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	24,100	12.12	292,092.00	
	CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	101,300	5.00	506,500.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	126,000	5.67	714,420.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	16,640	21.22	353,100.80	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	21,900	17.24	377,556.00	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	62,300	4.83	300,909.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	11.95	500,705.00	
	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.54	215,604.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.84	218,003.24	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	22.64	235,456.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	8.70	225,330.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.86	234,400.00	
	COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	193,400	2.64	510,576.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	8.38	513,694.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.18	201,294.00		

SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	69.80	371,266.20
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.44	285,936.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	43.00	356,900.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	21.45	800,085.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	13,300	20.89	277,837.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	24.56	1,046,256.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	9,900	52.60	520,740.00
HEILAN HOME CO LTD -A	21,400	8.54	182,756.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	49.12	1,011,872.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	15.56	404,560.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	73.93	1,094,164.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	14.64	248,880.00
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	21,060	10.01	210,810.60
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	13.03	221,510.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.58	484,564.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.72	393,660.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	7,300	99.02	722,846.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	10,800	24.09	260,172.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	17,602	30.00	528,060.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4,700	111.70	524,990.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	3,400	862.13	2,931,242.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	66.80	293,920.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	8,200	58.01	475,682.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	18.67	500,356.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	11,700	97.29	1,138,293.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	28.09	387,080.20
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	8,100	27.52	222,912.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,800	12.50	272,500.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	20,700	12.85	265,995.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	25.07	255,714.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	7,493	39.70	297,472.10
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	14,160	57.98	820,996.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	20.96	146,720.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	26.43	296,861.76
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	13.50	263,250.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	102.70	400,530.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.77	1,333,072.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.83	338,140.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	7.23	417,894.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.20	414,100.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	21.96	527,040.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	35,000	11.47	401,450.00

CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.16	894,284.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	6.20	1,191,640.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	34,200	7.51	256,842.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	54,100	17.86	966,226.00	
PING AN BANK CO LTD-A	52,000	11.92	619,840.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67,700	11.47	776,519.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.78	152,482.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	7.10	1,309,950.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,200	15.28	430,896.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	10.48	1,066,864.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.08	263,872.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	10.00	317,000.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110,500	4.65	513,825.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	23,800	77.11	1,835,218.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	29.30	410,200.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	25,000	21.01	525,250.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	43,900	12.54	550,506.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	37.84	484,352.00	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	28.09	303,372.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.32	380,472.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	48,100	5.29	254,449.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	24,800	23.70	587,760.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	107,000	6.08	650,560.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	87,800	5.44	477,632.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	17.52	1,205,376.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	4.18	1,246,894.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.66	849,000.00	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	113,300	4.63	524,579.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	21.92	357,296.00	
香港・オフショア人民元 小計	4,634,337		50,883,067.90 (794,793,520)	
合 計	229,670,376		50,281,591,273 (50,281,591,273)	

## (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
新株予約権証券	タイバーツ	MINOR INTL PCL -CW21	8,090.00	25,726.20	
		タイバーツ 小計	8,090.00	25,726.20 (89,012)	
新株予約権証券合計				89,012 (89,012)	



投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES MSCI SAUDI CAPD USDA	1,100,000	5,225,550.00	
	アメリカドル 小計		1,100,000	5,225,550.00	(567,076,686)
	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	5,370,066.00	
	メキシコペソ 小計		43,300	5,370,066.00	(30,233,471)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	11,000	534,600.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,799,490.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	849,642.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	567,082.88	
	ブラジルリアル 小計		122,562	3,750,814.88	(104,835,275)
	投資信託受益証券合計			1,265,862	702,145,432
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,787,100.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	7,787,100.00	(43,841,373)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	991,560.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,084,078.47	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	4,877,066.50	
	南アフリカランド 小計		892,610	12,952,704.97	(94,166,165)
投資証券合計			1,201,010	138,007,538	(138,007,538)
合計				840,241,982	(840,241,982)

## 有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 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	91.8%				12.5%
	投資信託受益証券 1銘柄			8.2%		1.1%
	株式 24銘柄	94.6%				2.5%

メキシコペソ	投資信託受益証券	1銘柄			2.2%		0.1%
	投資証券	1銘柄				3.2%	0.1%
ブラジルレアル	株式	50銘柄	97.3%				7.5%
	投資信託受益証券	4銘柄			2.7%		0.2%
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%
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%				1.2%
香港ドル	株式	206銘柄	100.0%				21.9%
マレーシアリンギット	株式	43銘柄	100.0%				2.2%
タイバーツ	株式	37銘柄	100.0%				2.9%
	新株予約権証券	1銘柄			0.0%		0.0%
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	26銘柄	100.0%				2.1%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%				12.2%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%				10.9%
インドルピー	株式	78銘柄	100.0%				9.6%
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	44銘柄	96.9%				5.7%
	投資証券	3銘柄				3.1%	0.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	8銘柄	100.0%				0.6%
香港・オフショア人民元	株式	96銘柄	100.0%				1.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2019年 6月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	637,087,137
コール・ローン	653,539,872
国債証券	46,248,842,492
派生商品評価勘定	1,037,742
未収入金	180,849,179
未収利息	990,888,187
前払費用	89,300,791
流動資産合計	48,801,545,400
資産合計	48,801,545,400
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,000
前受収益	46,639
未払金	370,035,955
未払解約金	23,215,698
未払利息	1,358
流動負債合計	393,317,650
負債合計	393,317,650
純資産の部	
元本等	
元本	29,218,077,103
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,190,150,647
元本等合計	48,408,227,750
純資産合計	48,408,227,750
負債純資産合計	48,801,545,400

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10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 6月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,218,077,103口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6568円 (1万口当たり純資産額) (16,568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 6月10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>

	2019年 6月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 6月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	26,413,348,921円
期中追加設定元本額	5,382,159,956円
期中一部解約元本額	2,577,431,774円
期末元本額	29,218,077,103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	4,171,773,514円
世界経済インデックスファンド	5,395,618,021円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,117,833,244円
DC世界経済インデックスファンド	4,678,737,857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）	1,873,637,987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）	100,189,178円
分散投資コア戦略ファンドA	141,127,771円
分散投資コア戦略ファンドS	448,638,756円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	205,574,451円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,149,210,236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）	202,166,764円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,362,755円
SMT インデックスバランス・オープン	204,078,294円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,438,407,844円
SMT 世界経済インデックス・オープン	71,839,420円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	105,888,363円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	144,264,029円

区分	2019年 6月10日現在
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,901,094円
グローバル経済コア	819,575,627円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	15,565,999円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	1,823,233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	22,339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	23,809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	25,278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	26,454円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	127,355,600円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,196,771,990
合計	1,196,771,990

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	104,722,804	-	105,760,546	1,037,742
	マレーシアリン ギット	104,722,804	-	105,760,546	1,037,742
	売建	16,686,000	-	16,704,000	18,000
	トルコリラ	16,686,000	-	16,704,000	18,000
合計		121,408,804	-	122,464,546	1,019,742

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,200,000.00	36,492,456.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	90,425,650.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	47,200,000.00	42,092,488.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	78,356,782.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	89,334,140.00	
		MBONO 7.25% 12/09/21	55,800,000.00	55,021,311.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000.00	83,362,410.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	48,827,904.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	58,198,987.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	23,257,920.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	55,500,000.00	57,648,960.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	49,555,123.75	
		MBONO 8% 09/05/24	25,000,000.00	25,203,375.00	
		MBONO 8% 11/07/47	28,500,000.00	27,507,915.00	
		MBONO 8% 12/07/23	77,600,000.00	78,244,080.00	
			メキシコペソ 小計		844,900,000.00
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000.00	15,084,344.20	
		BLTN 0% 07/01/20	32,750,000.00	30,756,284.80	
		BLTN 0% 07/01/21	14,600,000.00	12,819,313.92	
		BLTN 0% 07/01/22	13,250,000.00	10,777,087.57	
		BNTNF 10% 01/01/21	23,800,000.00	25,038,233.79	
		BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000.00	31,134,603.34	
		BNTNF 10% 01/01/25	18,600,000.00	20,482,463.77	
		BNTNF 10% 01/01/27	15,000,000.00	16,660,749.45	
		BNTNF 10% 01/01/29	3,800,000.00	4,249,648.78	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,585,500.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	508,781.25	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,985,500.00	
	ブラジルレアル 小計		172,050,000.00	171,082,510.87 (4,781,756,178)	
チリペソ	チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	9,530,000,000.00	9,749,952,400.00	



	チリペソ 小計	9,530,000,000.00	9,749,952,400.00 (1,528,792,536)
コロンビア ペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	22,787,129,750.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	9,600,000,000.00	10,025,184,000.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	54,050,000,000.00	66,994,164,250.00
	コロンビアペソ 小計	87,300,000,000.00	99,806,478,000.00 (3,313,575,069)
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,550,000.00	6,009,512.25
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,400,000.00	6,872,864.00
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,250,000.00	7,824,526.25
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,350,000.00	8,127,924.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	5,900,000.00	6,776,858.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,350,000.00	8,460,364.50
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	7,955,902.50
	ペルーヌエボソル 小計	46,300,000.00	52,027,951.50 (1,696,111,218)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	16,900,000.00	14,150,623.50
	URUGUA 9.875% 06/20/22	18,450,000.00	18,119,560.50
	ウルグアイペソ 小計	35,350,000.00	32,270,184.00 (99,392,166)
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,367,564.00
	ドミニカペソ 小計	20,400,000.00	20,367,564.00 (43,790,262)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,468,440.50
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	6,998,367.75
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	7,056,903.75
	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,300,000.00	6,156,564.50
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	8,314,050.00
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	6,643,362.00
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	7,577,664.00
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	7,972,915.50
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	3,988,842.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	4,148,234.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	4,774,770.00
	TURKGB 8.8% 09/27/23	6,050,000.00	4,161,885.75
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	3,809,419.50
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	8,590,541.75
	TURKGB 9.4% 07/08/20	7,000,000.00	6,129,620.00
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,298,990.00
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	4,905,313.75
	トルコリラ 小計	128,250,000.00	95,995,884.75 (1,783,603,538)

チェココロナ	CZGB 0.25% 02/10/27	32,200,000.00	29,201,053.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	22,400,000.00	21,397,264.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	53,900,000.00	49,998,179.00	
	CZGB 1% 06/26/26	35,800,000.00	34,444,970.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	54,127,015.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	48,800,000.00	52,727,424.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	35,000,000.00	38,701,950.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	36,500,000.00	37,536,782.50	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	39,849,955.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	38,000,000.00	41,790,880.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	38,800,000.00	46,649,046.00	
	チェココロナ 小計		430,800,000.00	446,424,518.50
ハンガリーフォリント	HGB 0.5% 04/21/21	370,000,000.00	370,688,200.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	596,000,000.00	610,795,700.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	356,183,025.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	373,000,000.00	387,763,340.00	
	HGB 3% 06/26/24	466,000,000.00	497,098,510.00	
	HGB 3% 10/27/27	571,000,000.00	600,455,035.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	597,000,000.00	721,787,925.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	496,000,000.00	593,610,320.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	268,000,000.00	362,065,320.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	262,180,065.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	561,665,355.00	
ハンガリーフォリント 小計		4,790,500,000.00	5,324,292,795.00	(2,041,333,857)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,676,329.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,800,000.00	10,956,060.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,674,202.75	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,500,000.00	6,664,872.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	14,950,000.00	15,201,234.75	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000.00	14,155,820.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	8,950,000.00	9,202,211.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,500,000.00	2,567,050.00	
	POLGB 2% 04/25/21	11,700,000.00	11,782,836.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,534,961.50	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,768,626.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,563,492.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,498,204.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,830,501.25	
ポーランドズロチ 小計		146,700,000.00	152,076,401.25	(4,384,362,648)
	RFLB 6.5% 02/28/24	135,100,000.00	130,497,818.50	

ロシアルーブル	RFLB 6.9% 05/23/29	89,000,000.00	84,966,520.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	172,078,515.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	161,929,777.50	
	RFLB 7.25% 05/10/34	64,000,000.00	61,502,080.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	100,000,000.00	99,921,000.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	173,584,684.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	123,708,480.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	44,400,000.00	44,772,072.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	63,059,062.50	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	174,800,990.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	164,887,937.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	150,366,300.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	96,178,428.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	105,836,416.00	
	RFLB 7% 12/15/21	151,000,000.00	150,237,450.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	182,743,440.00	
RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	131,918,280.00		
ロシアルーブル 小計		2,270,250,000.00	2,272,989,251.00	(3,818,621,941)
マレーシアリンギット	MGS 3.62% 11/30/21	7,800,000.00	7,849,920.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	10,800,000.00	10,862,910.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,234,625.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	6,000,000.00	6,069,480.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,757,692.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	7,000,000.00	7,126,175.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	11,550,000.00	11,683,287.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,176,546.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	4,500,000.00	4,587,142.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,399,528.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,741,241.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,152,789.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	6,000,000.00	6,182,220.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,900,000.00	7,395,627.00	
マレーシアリンギット 小計		112,300,000.00	114,219,184.00	(2,981,120,702)
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	99,912,361.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000.00	98,167,580.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	49,200,000.00	50,206,878.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	59,000,000.00	62,298,100.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	89,500,000.00	89,994,040.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	38,700,000.00	42,048,324.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	195,179,554.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,652,780.00	

	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	154,527,244.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	64,100,000.00	67,000,204.50	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	44,000,000.00	50,121,500.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	76,000,000.00	84,259,680.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	116,589,700.00	
	タイバーツ 小計	1,110,200,000.00	1,199,957,946.00 (4,151,854,493)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	24,242,625.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	20,001,800.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	22,565,000.00	
	フィリピンペソ 小計	65,000,000.00	66,809,425.00 (139,631,698)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,491,433,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,345,339,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,565,785,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,572,752,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	35,300,000,000.00	33,147,406,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	31,739,940,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	24,923,035,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	21,406,671,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	32,600,000,000.00	30,429,492,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	33,700,000,000.00	33,455,506,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	44,300,000,000.00	41,857,519,500.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	26,000,000,000.00	26,640,770,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	23,600,000,000.00	24,117,194,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,850,404,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	18,778,945,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	35,000,000,000.00	35,828,625,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000.00	49,702,635,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	32,528,112,500.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	10,000,000,000.00	9,991,750,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	46,106,100,000.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	33,771,579,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,442,701,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	34,491,275,000.00		
	インドネシアルピア 小計	626,600,000,000.00	622,184,970,000.00 (4,728,605,772)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000.00	96,701,007.75	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,757,235.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	36,700,000.00	25,503,747.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	16,600,000.00	16,662,167.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	36,200,000.00	36,527,248.00	

	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,867,261.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	40,850,000.00	37,113,042.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	41,432,742.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000.00	47,459,582.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000.00	65,902,776.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	31,250,000.00	28,958,593.75	
	SAGB 8% 01/31/30	48,100,000.00	44,190,191.50	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	32,090,275.00	
	南アフリカランド 小計	582,850,000.00	532,165,869.50 (3,868,845,871)	
	合計		46,248,842,492 (46,248,842,492)	

## 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%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.3%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	3.3%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	7.2%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	3.7%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 17銘柄	100.0%	3.9%
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 11銘柄	100.0%	4.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.5%
ロシアルーブル	国債証券 18銘柄	100.0%	8.3%
マレーシアリンギット	国債証券 14銘柄	100.0%	6.4%
タイバーツ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.0%
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%	10.2%
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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

## 【純資産額計算書】

（2019年 6月28日現在）

資産総額	1,889,606,320円
負債総額	11,223,689円
純資産総額（ - ）	1,878,382,631円
発行済口数	1,773,489,272口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0591円
（1万口当たり純資産額）	（10,591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 6月28日現在）

資産総額	280,802,911,720円
負債総額	2,931,985,702円
純資産総額（ - ）	277,870,926,018円
発行済口数	194,430,825,769口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4292円
（1万口当たり純資産額）	（14,292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 6月28日現在）

資産総額	476,800,679,579円
負債総額	7,181,276,253円
純資産総額（ - ）	469,619,403,326円
発行済口数	328,262,311,279口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4306円
（1万口当たり純資産額）	（14,306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 6月28日現在)

資産総額	354,546,589,558円
負債総額	2,241,592,942円
純資産総額（ - ）	352,304,996,616円
発行済口数	136,875,682,111口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5739円
（1万口当たり純資産額）	（25,739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 6月28日現在)

資産総額	377,536,876,275円
負債総額	136,698,040円
純資産総額（ - ）	377,400,178,235円
発行済口数	136,020,652,964口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7746円
（1万口当たり純資産額）	（27,746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 6月28日現在)

資産総額	54,892,468,196円
負債総額	77,734,036円
純資産総額（ - ）	54,814,734,160円
発行済口数	19,669,904,372口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7867円
（1万口当たり純資産額）	（27,867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 6月28日現在)

資産総額	50,131,705,644円
負債総額	22,173,137円
純資産総額（ - ）	50,109,532,507円
発行済口数	29,425,853,463口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7029円
（1万口当たり純資産額）	（17,029円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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 6月28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 9月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年6月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	520	12,240,884
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	90	389,085
単位型公社債投資信託	1	10,065
合計	611	12,640,034

## 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5 年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 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		3,432,867	-	13,731
	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)通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

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 9月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社東京スター銀行	26,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ごうぎん証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社山陰合同銀行	20,705	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 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】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 9月11日	有価証券届出書
2018年 9月11日	有価証券報告書
2019年 3月11日	有価証券届出書
2019年 3月11日	半期報告書



**独立監査人の監査報告書**

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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8月9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

中島紀子

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SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2018年6月12日から2019年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2019年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。