【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年10月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣ世界経済インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＤＣ世界経済インデックスファンド

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

2019年10月22日から2020年 4月20日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞
当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条

第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

DR(預託証券)とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　）

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券
①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］
(1)年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］
(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資形態による属性区分］

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

［為替ヘッジによる属性区分］

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

［特殊型］

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

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

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

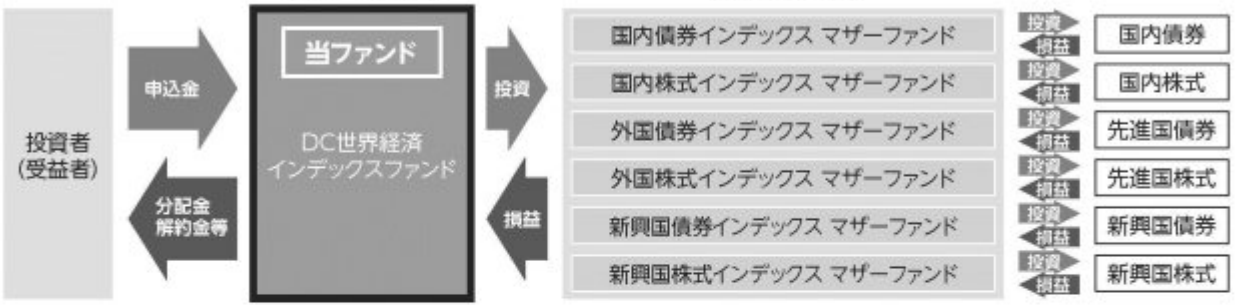
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

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

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

ファンドのしくみ

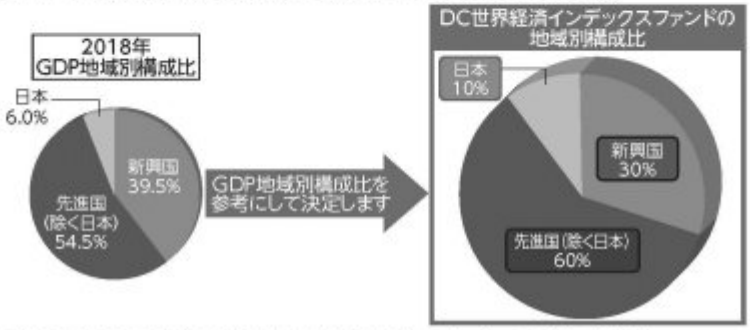


？ ファミリーファンド方式とは

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

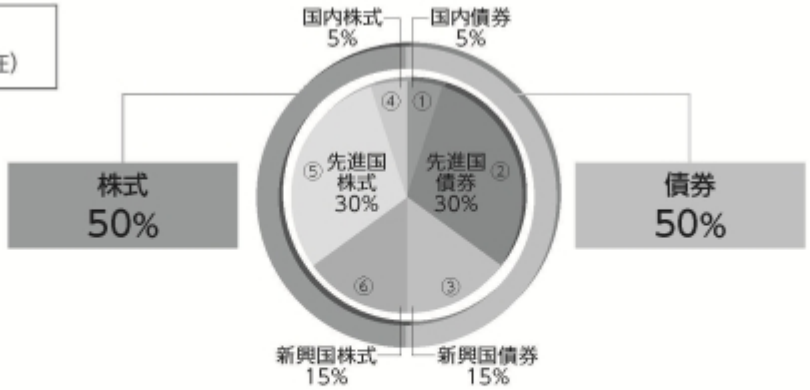
2. 世界経済全体の発展を享受します。

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



(出所)IMF「世界経済見通し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8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
(2019年8月末現在)



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

●基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス

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

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

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

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

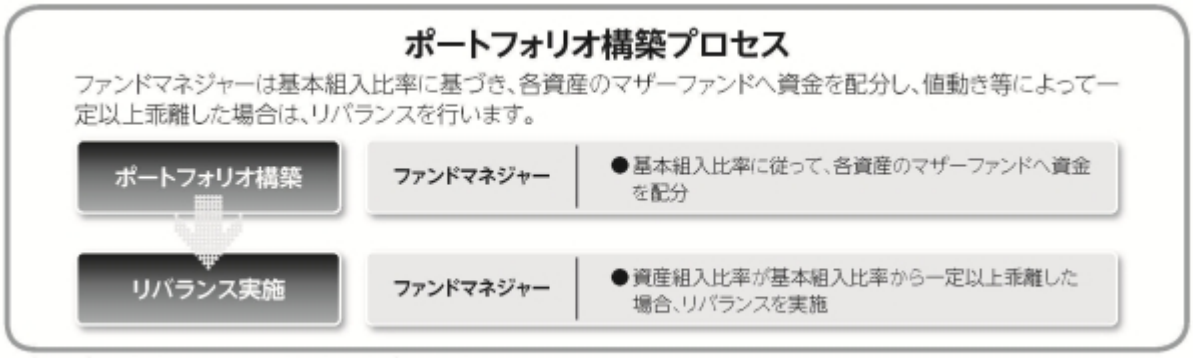
※2「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の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

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

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

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

※6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。
同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。



※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

●原則として、毎年1月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%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。

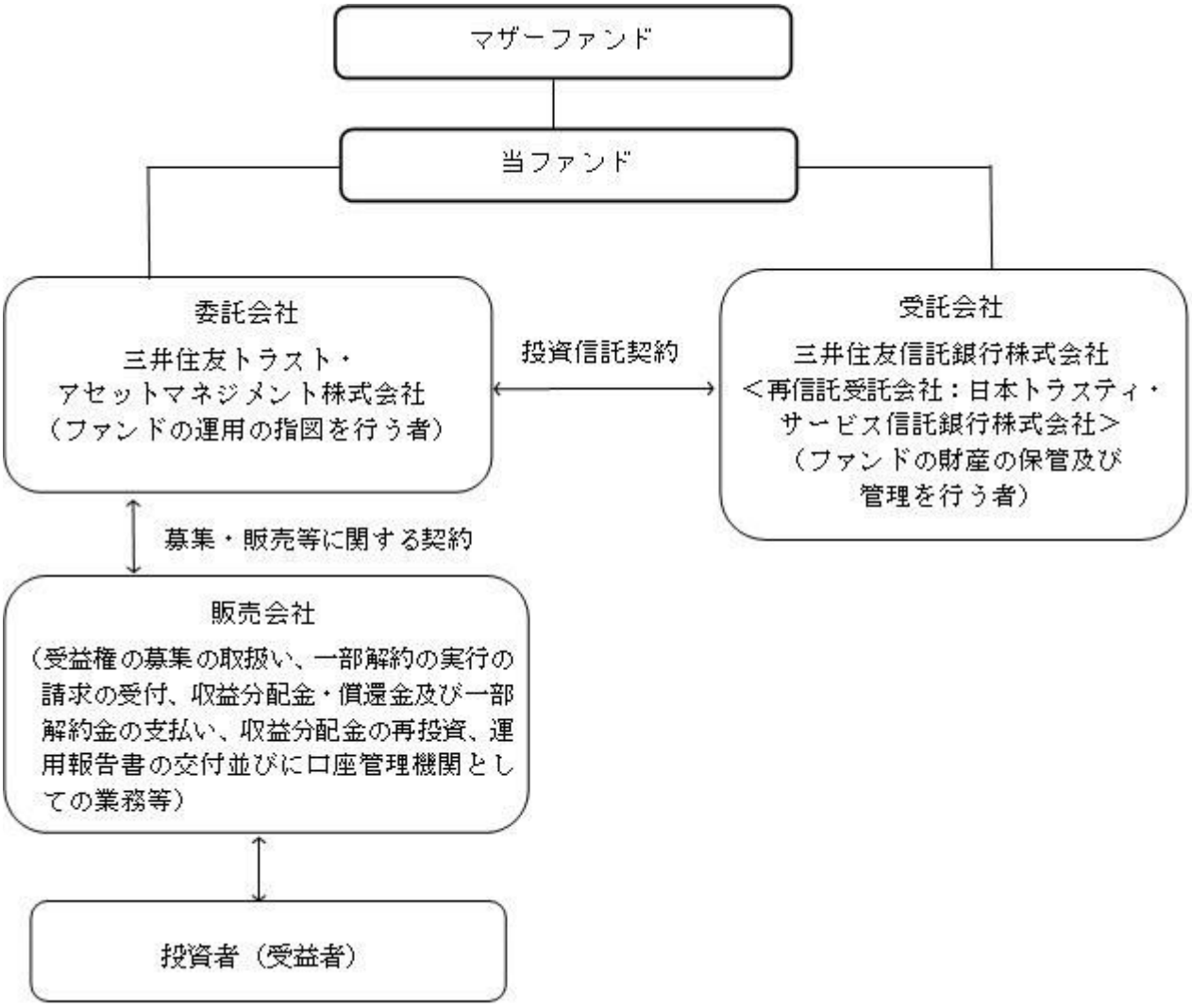
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2011年10月13日	**本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始**
2012年 4月 1日	**本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更**

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2019年 8月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株　主　名	**住　　所**	**持株数**	**持株比率**

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

（イ）基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

（ロ）運用方法

①投資対象

「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下総称して、またはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して、またはそれぞれを「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

②投資態度

1)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、先進国および新興国の公社債および株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の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。

2)株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

3)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

4)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。

5)実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

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

（2）【投資対象】

（イ）本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。

1.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。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として、次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第7号から第28号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス マザーファンド
2.国内株式インデックス マザーファンド
3.外国債券インデックス マザーファンド
4.外国株式インデックス マザーファンド
5.新興国債券インデックス マザーファンド
6.新興国株式インデックス マザーファンド
7.株券または新株引受権証書
8.国債証券
9.地方債証券
10.特別の法律により法人の発行する債券
11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16.コマーシャル・ペーパー
17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
18.外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号から第17号の証券または証書の性質を有するもの
19.投資信託また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。）
20.投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22.オプションを表示する証券または証書（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。）
23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28.外国の者に対する権利で第27号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券または証書、第18号ならびに第23号の証券または証書のうち第7号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第8号から第12号までの証券および第18号ならびに第23号の証券または証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するもの、および第20号に記載する証券のうち投資法人債券およ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19号および第20号の証券（「投資法人債券」および「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。

（ハ）委託者は、信託金を、前記（ロ）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第5号の権利の性質を有するもの

（ニ）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（ハ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①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。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤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。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。
⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。
②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の

10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤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。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（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

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託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。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

②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。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託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。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

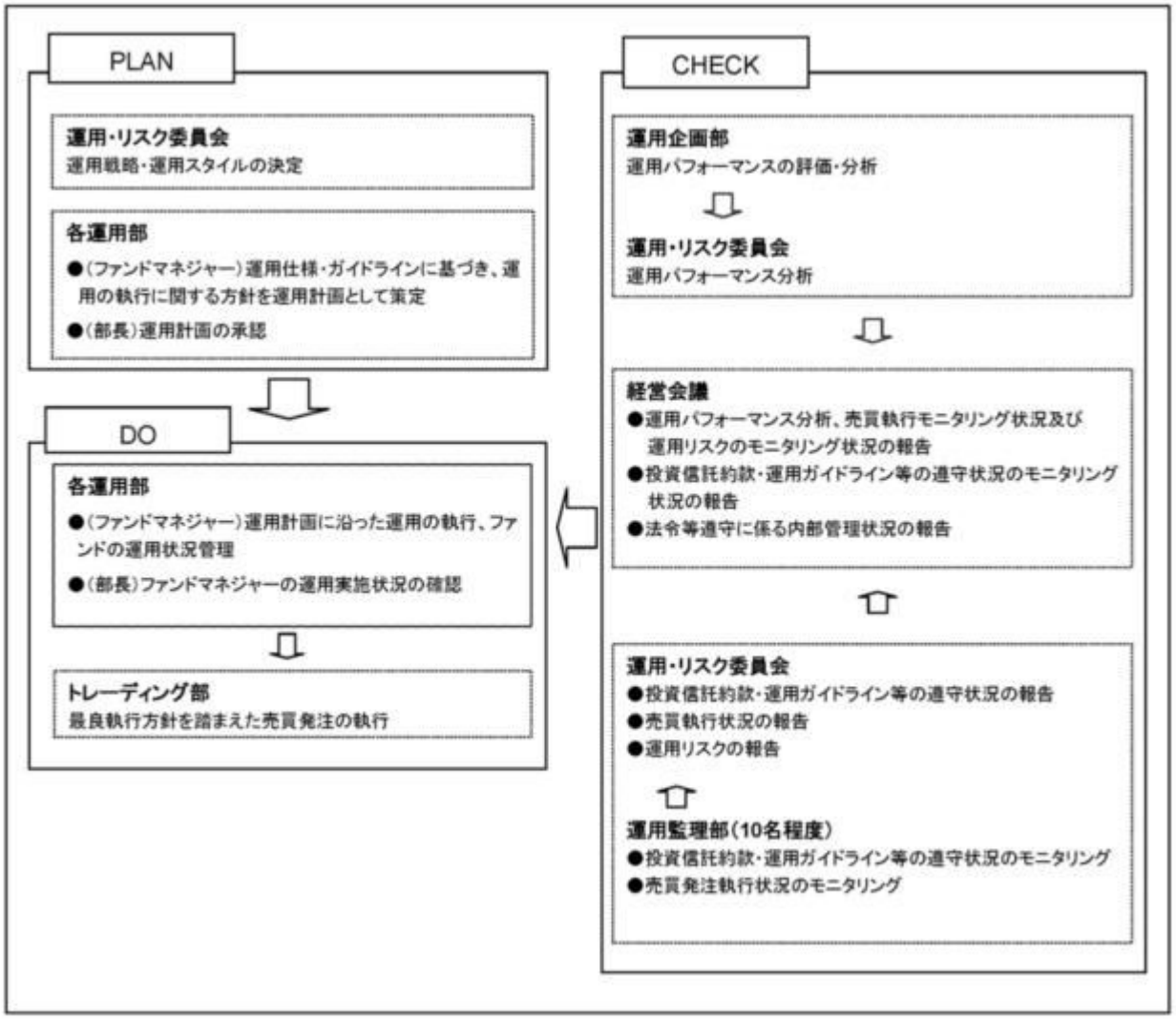
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう

調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（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回の毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式への投資割合

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%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（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、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

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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

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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1.投資信託財産に属する株券および新株引受権証書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および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の

行使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5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

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）およ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。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよ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、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ワ．資金の借入れ

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用なら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、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間また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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

を行うこととします。

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

＜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。

①株価変動リスク

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

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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＞

①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。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

④確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

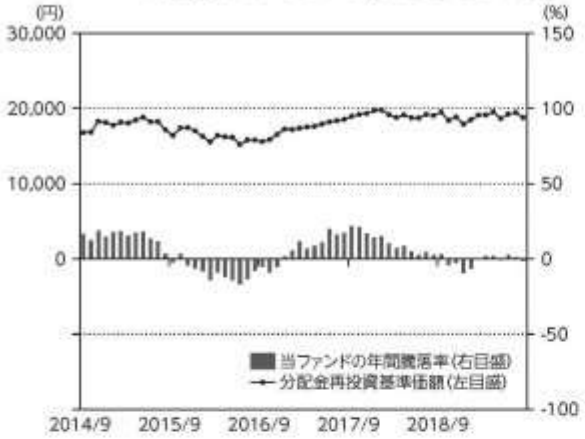
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

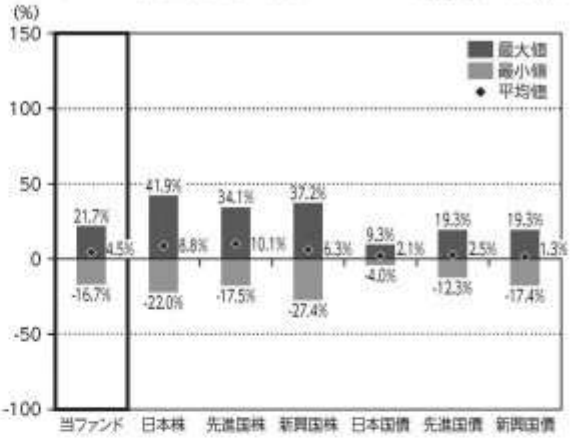
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



＊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



＊2014年9月～2019年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

＊当ファンドの年間騰落率は、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。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより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。
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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.55%（税抜　0.5%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	**年率　0.253%　（税抜　0.23%）**	**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　0.253%　（税抜　0.23%）**	**運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価**
受託会社	**年率　0.044%　（税抜　0.04%）**	**運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価**

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

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

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、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を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤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。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。
※上記は、2019年 8月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は、2019年8月30日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド】

（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	53,484,298,238	99.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	359,117,927	0.67
合計(純資産総額)		53,843,416,165	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)

日本	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	6,626,697,911	2.3865	15,815,252,127	2.5126	16,650,241,171	30.92
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	5,843,032,724	2.6867	15,698,950,974	2.8013	16,368,087,569	30.40
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	4,870,057,314	1.6482	8,027,060,409	1.6513	8,041,925,642	14.94
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	2,923,753,208	2.7007	7,896,390,137	2.5520	7,461,418,186	13.86
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	1,840,347,749	1.4246	2,621,935,307	1.3935	2,564,524,588	4.76
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	1,652,267,523	1.4032	2,318,566,604	1.4514	2,398,101,082	4.45

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.33
合計	99.33

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末　(2012年 1月20日)	1,025,601	1,025,601	10,256	10,256
第2期計算期間末　(2013年 1月21日)	1,004,274,493	1,004,274,493	13,065	13,065
第3期計算期間末　(2014年 1月20日)	3,713,263,544	3,713,263,544	15,542	15,542
第4期計算期間末　(2015年 1月20日)	9,559,617,115	9,559,617,115	17,595	17,595
第5期計算期間末　(2016年 1月20日)	15,897,276,318	15,897,276,318	15,649	15,649
第6期計算期間末　(2017年 1月20日)	28,537,465,034	28,537,465,034	17,273	17,273
第7期計算期間末　(2018年 1月22日)	42,648,568,450	42,648,568,450	20,051	20,051
第8期計算期間末　(2019年 1月21日)	47,847,821,861	47,847,821,861	18,396	18,396
2018年 8月末日	47,283,372,210	—	19,059	—
9月末日	48,869,778,036	—	19,517	—

10月末日	46,702,837,685	—	18,416	—
11月末日	48,475,674,258	—	18,858	—
12月末日	46,057,390,503	—	17,896	—
2019年 1月末日	48,674,287,524	—	18,501	—
2月末日	50,951,389,477	—	19,106	—
3月末日	51,605,698,040	—	19,135	—
4月末日	52,599,884,100	—	19,512	—
5月末日	51,350,967,423	—	18,660	—
6月末日	53,806,425,374	—	19,223	—
7月末日	55,090,072,977	—	19,454	—
8月末日	53,843,416,165	—	18,782	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2011年10月13日～2012年 1月20日	0
第2期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	0
第3期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	0
第4期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第5期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第6期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第7期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第8期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2011年10月13日～2012年 1月20日	2.6
第2期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	27.4
第3期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	19.0
第4期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	13.2
第5期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	△11.1
第6期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	10.4
第7期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	16.1
第8期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	△8.3
第9期中間計算期間	2019年 1月22日～2019年 7月21日	5.2

(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	2011年10月13日～2012年 1月20日	1,000,000	―	1,000,000
第2期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	782,250,108	14,602,081	768,648,027
第3期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	1,934,557,452	314,068,781	2,389,136,698
第4期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	3,515,942,108	471,799,448	5,433,279,358
第5期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	5,701,447,613	976,078,824	10,158,648,147
第6期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	7,507,607,238	1,145,068,823	16,521,186,562
第7期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	6,197,741,110	1,448,870,684	21,270,056,988
第8期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	6,146,205,344	1,406,405,161	26,009,857,171
第9期中間計算期間	2019年 1月22日～2019年 7月21日	2,891,759,212	879,471,490	28,022,144,893

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

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	417,447,168,900	83.63
地方債証券	日本	26,735,763,697	5.36
特殊債券	日本	34,039,921,341	6.82
社債券	日本	17,290,672,440	3.46
	フランス	1,405,576,000	0.28
	オーストラリア	502,298,000	0.10
	アメリカ	105,336,000	0.02
	イギリス	100,667,000	0.02
	小計	19,404,549,440	3.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,561,590,728	0.31
合計(純資産総額)		499,188,994,106	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)

日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	9,070,000,000	101.35	9,192,714,800	101.96	9,248,044,100	0.100	2023/12/20	1.85
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	5,970,000,000	101.95	6,086,703,600	102.22	6,102,534,000	0.100	2024/6/20	1.22
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	5,970,000,000	101.51	6,060,272,600	102.07	6,094,056,600	0.100	2024/3/20	1.22
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	101.75	6,003,309,000	0.100	2023/6/20	1.20
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	101.59	5,770,709,600	0.100	2023/3/20	1.16
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	5,540,000,000	100.81	5,585,261,800	101.06	5,598,945,600	0.100	2022/3/20	1.12
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	5,350,000,000	102.32	5,474,549,900	103.96	5,562,020,500	0.100	2028/3/20	1.11
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,800,000,000	100.89	4,842,768,000	101.18	4,856,880,000	0.100	2022/6/20	0.97
日本	国債証券	第１２７回利付国債（５年）	4,780,000,000	100.50	4,804,234,600	100.60	4,808,919,000	0.100	2021/3/20	0.96
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	101.32	4,802,757,600	0.100	2022/9/20	0.96
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	103.02	4,708,014,000	1.000	2021/12/20	0.94
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,400,000,000	102.02	4,488,880,000	103.92	4,572,700,000	0.100	2028/12/20	0.92
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	104.76	4,525,804,800	0.400	2025/9/20	0.91
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	4,430,000,000	101.41	4,492,612,600	101.84	4,511,866,400	0.100	2023/9/20	0.90
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,060,000,000	102.17	4,148,272,400	103.15	4,187,971,200	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,940,000,000	102.12	4,023,833,200	103.87	4,092,832,600	0.100	2029/3/20	0.82
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	104.56	4,067,422,900	0.400	2025/6/20	0.81
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	103.96	4,044,121,800	0.100	2028/9/20	0.81
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	3,830,000,000	102.44	3,923,615,400	103.94	3,981,016,900	0.100	2028/6/20	0.80
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	3,810,000,000	102.14	3,891,876,900	101.92	3,883,228,200	1.200	2020/12/20	0.78
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	104.42	3,780,076,400	0.500	2024/9/20	0.76
日本	国債証券	第３９８回利付国債（２年）	3,660,000,000	100.47	3,677,264,000	100.57	3,681,118,200	0.100	2021/3/1	0.74
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	104.32	3,578,176,000	0.300	2025/12/20	0.72
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	3,390,000,000	102.19	3,464,562,900	103.97	3,524,888,100	0.100	2027/12/20	0.71
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	103.59	3,501,443,400	0.300	2024/12/20	0.70
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	3,250,000,000	103.65	3,368,625,000	104.12	3,383,997,500	0.600	2023/12/20	0.68
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	100.83	3,367,889,000	0.100	2021/9/20	0.67
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	102.69	3,224,497,400	1.200	2021/6/20	0.65
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	101.45	3,215,965,000	0.100	2022/12/20	0.64
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	123.84	3,145,663,000	1.500	2034/6/20	0.63

(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	83.63
地方債証券	5.36
特殊債券	6.82
社債券	3.89
合計	99.69

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	286,171,156,655	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,113,704,821	1.08
合計(純資産総額)		289,284,861,476	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	3,171,000,000	1.10

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	1,473,100	6,608.16	9,734,486,983	6,960.00	10,252,776,000	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	887,200	5,359.80	4,755,221,128	6,042.00	5,360,462,400	1.85
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,029,300	5,238.17	5,391,658,139	4,824.00	4,965,343,200	1.72
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	8,975,200	506.20	4,543,297,535	510.40	4,580,942,080	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	887,300	4,926.60	4,371,377,220	5,096.00	4,521,680,800	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,154,100	3,833.58	4,424,341,140	3,590.00	4,143,219,000	1.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	64,900	62,736.24	4,071,582,364	62,900.00	4,082,210,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	918,900	3,807.78	3,498,972,388	3,484.00	3,201,447,600	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	75,700	39,010.93	2,953,127,780	40,290.00	3,049,953,000	1.05
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,063,400	2,789.53	2,966,396,098	2,835.00	3,014,739,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	904,900	3,608.09	3,264,965,880	3,219.00	2,912,873,100	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,115,200	2,750.22	3,067,047,934	2,523.50	2,814,207,200	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,716,700	155.29	2,751,381,962	154.70	2,740,773,490	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	378,300	5,482.14	2,073,895,449	7,018.00	2,654,909,400	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	466,200	5,556.21	2,590,306,314	5,472.00	2,551,046,400	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	118,400	22,678.92	2,685,185,084	21,015.00	2,488,176,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	228,100	9,322.82	2,126,537,325	10,715.00	2,444,091,500	0.84
日本	株式	花王	化学	316,500	8,632.43	2,732,164,619	7,674.00	2,428,821,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	235,100	10,418.90	2,449,485,126	10,115.00	2,378,036,500	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	180,500	13,781.45	2,487,551,956	13,155.00	2,374,477,500	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	913,600	2,837.03	2,591,914,550	2,585.00	2,361,656,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	125,600	18,386.23	2,309,311,640	18,455.00	2,317,948,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	149,300	13,513.87	2,017,621,810	15,470.00	2,309,671,000	0.80
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	266,100	7,907.94	2,104,304,103	8,649.00	2,301,498,900	0.80
日本	株式	資生堂	化学	262,700	8,044.42	2,113,269,704	8,690.00	2,282,863,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	159,100	13,722.81	2,183,300,324	13,855.00	2,204,330,500	0.76
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	821,400	2,517.98	2,068,274,900	2,682.00	2,202,994,800	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	595,100	3,771.97	2,244,703,063	3,629.00	2,159,617,900	0.75
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	545,800	3,755.95	2,050,001,791	3,757.00	2,050,570,600	0.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,375,500	1,422.35	1,956,454,450	1,490.50	2,050,182,750	0.71

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.81
		食料品	4.04
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.17
		医薬品	5.65
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.54
		機械	4.83
		電気機器	13.56
		輸送用機器	7.69
		精密機器	2.16
		その他製品	2.23
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.75
		海運業	0.15
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.98
		卸売業	4.83
		小売業	4.75
		銀行業	5.65
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.26
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.53
		サービス業	5.21
		小計	98.92
合計			98.92

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	210	円	3,186,143,520	3,171,000,000	1.10

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

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

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	182,963,895,938	47.11
	フランス	37,861,434,447	9.75
	イタリア	34,097,488,311	8.78
	ドイツ	24,299,663,162	6.26
	イギリス	23,728,976,138	6.11
	スペイン	21,343,997,452	5.50
	ベルギー	9,565,096,277	2.46
	オーストラリア	7,392,866,413	1.90
	カナダ	7,309,863,929	1.88
	オランダ	7,105,574,246	1.83
	オーストリア	5,338,923,350	1.37
	メキシコ	2,803,074,293	0.72
	アイルランド	2,751,723,342	0.71
	フィンランド	2,195,745,653	0.57
	ポーランド	2,140,073,529	0.55
	デンマーク	2,009,342,320	0.52
	南アフリカ	1,991,043,373	0.51
	マレーシア	1,731,839,489	0.45
	シンガポール	1,516,425,658	0.39
	スウェーデン	1,262,218,497	0.33
	ノルウェー	870,582,174	0.22
	小計	380,279,847,991	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	8,086,846,879	2.08
合計(純資産総額)		388,366,694,870	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	1,612,594,518	0.42
	買建	ドイツ	1,990,148,445	0.51

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,435,271,700	1.14

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	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	10,591.68	2,542,005,257	10,629.78	2,551,147,550	1.625	2020/7/31	0.66
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,003.27	2,200,655,952	11,152.93	2,230,586,521	2.750	2023/5/31	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	19,200,000	9,814.18	1,884,323,702	11,280.60	2,165,875,480	2.250	2046/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	10,880.16	2,040,030,589	11,356.28	2,129,303,965	2.375	2027/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,065.45	1,991,781,432	11,407.43	2,053,338,938	2.625	2026/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,715.30	1,982,330,777	10,798.62	1,997,744,777	2.125	2021/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,458.90	1,715,397,655	13,124.52	1,964,740,924	3.000	2049/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,238.45	1,689,345,538	11,832.86	1,952,422,347	2.500	2046/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	10,956.23	1,829,690,601	11,400.78	1,903,931,059	2.625	2025/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,231.80	1,637,088,650	11,842.01	1,894,721,850	2.500	2046/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,194.10	1,782,101,151	11,875.28	1,890,544,626	2.875	2028/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,519.99	1,840,999,052	10,767.01	1,884,227,643	1.750	2023/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/43	12,500,000	12,806.07	1,600,758,909	14,416.18	1,802,022,643	3.750	2043/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	15,000,000	11,104.62	1,665,694,452	11,699.78	1,754,968,156	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,426.98	1,645,485,690	12,130.61	1,746,808,995	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,186.20	1,677,930,203	11,606.63	1,740,995,281	3.000	2025/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/20	15,970,000	10,559.22	1,686,308,114	10,603.79	1,693,425,313	1.375	2020/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,190.77	1,595,804,633	11,851.16	1,689,975,490	2.875	2028/5/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	10,828.04	1,624,206,990	11,041.89	1,656,284,719	2.250	2024/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,665.12	1,562,441,484	11,282.26	1,652,851,806	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	10,856.89	1,628,534,589	10,975.36	1,646,304,094	2.375	2023/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	10,951.14	1,598,867,406	11,266.46	1,644,903,479	2.375	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	10,760.77	1,614,116,578	10,893.43	1,634,015,453	2.500	2022/1/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,617.78	1,597,977,109	10,701.72	1,610,609,643	1.750	2021/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,589.25	1,588,388,523	10,698.81	1,604,822,125	1.625	2022/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,584.03	1,550,561,417	10,787.80	1,580,413,875	1.875	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,617.63	1,394,116,057	13,141.98	1,577,038,563	3.125	2044/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,461.24	1,369,618,814	13,085.43	1,563,709,021	3.000	2048/8/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	6,640,000	20,071.17	1,332,726,122	22,848.39	1,517,133,255	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	13,040,000	10,977.33	1,431,444,153	11,481.87	1,497,236,811	2.375	2029/5/15	0.39

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.92
合計	97.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	54	アメリカドル	6,479,270.57	689,783,144	6,473,671.74	689,187,093	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	32	アメリカドル	4,218,534.26	449,105,157	4,212,000	448,409,520	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	27	アメリカドル	4,477,139.25	476,636,245	4,461,750	474,997,905	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,810,365	330,583,235	2,813,875	330,996,116	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	30	ユーロ	4,061,950	477,807,179	4,084,200	480,424,446	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	56	ユーロ	9,881,404	1,162,349,552	10,020,640	1,178,727,883	0.30

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	21,080,000.00	2,224,318,597	2,241,858,000	0.58
	カナダドル	買建	2,230,000.00	177,464,554	178,489,200	0.05
	ユーロ	買建	14,650,000.00	1,728,124,331	1,723,279,500	0.44
	イギリスポンド	買建	2,250,000.00	288,149,802	291,645,000	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。

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	214,395,920,923	62.00
	イギリス	19,541,973,468	5.65
	カナダ	12,898,242,695	3.73
	スイス	12,748,925,456	3.69
	フランス	12,355,106,889	3.57
	ドイツ	10,279,795,735	2.97
	オーストラリア	7,543,621,382	2.18
	アイルランド	6,281,734,225	1.82
	オランダ	6,052,089,310	1.75
	スペイン	3,450,275,832	1.00
	香港	3,085,590,205	0.89
	スウェーデン	2,842,163,152	0.82
	イタリア	2,369,896,869	0.69
	デンマーク	2,205,057,601	0.64
	シンガポール	1,396,257,885	0.40
	バミューダ	1,380,158,362	0.40
	フィンランド	1,371,391,386	0.40
	ベルギー	1,245,971,418	0.36
	ジャージー	912,316,921	0.26
	ノルウェー	772,503,044	0.22
	ケイマン	759,637,782	0.22
	イスラエル	725,690,671	0.21
	キュラソー	406,505,840	0.12
	ルクセンブルク	347,510,232	0.10
	ニュージーランド	298,205,328	0.09

	オーストリア	277,172,318	0.08
	ポルトガル	189,142,443	0.05
	リベリア	168,290,220	0.05
	パナマ	164,538,614	0.05
	パプアニューギニア	55,180,212	0.02
	マン島	34,710,797	0.01
	英ヴァージン諸島	32,637,746	0.01
	モーリシャス	8,353,519	0.00
	小計	326,596,568,480	94.44
投資信託受益証券	オーストラリア	186,212,859	0.05
	香港	84,512,128	0.02
	小計	270,724,987	0.08
投資証券	アメリカ	7,824,841,941	2.26
	オーストラリア	636,118,284	0.18
	フランス	366,515,847	0.11
	香港	217,883,651	0.06
	イギリス	206,202,047	0.06
	シンガポール	152,197,454	0.04
	カナダ	64,036,683	0.02
	小計	9,467,795,907	2.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,472,679,278	2.74
合計(純資産総額)		345,807,768,652	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,589,842,594	1.91
	買建	カナダ	376,260,648	0.11
	買建	ドイツ	1,608,220,152	0.47
	買建	イギリス	632,885,084	0.18
	買建	オーストラリア	382,725,733	0.11

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	903,902,870	0.26

(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	620,342	13,450.67	8,344,019,294	14,704.25	9,121,667,079	2.64
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	392,086	18,974.36	7,439,583,189	22,251.20	8,724,385,807	2.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,663	195,324.34	6,965,852,175	190,180.14	6,782,394,475	1.96
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	204,769	19,612.53	4,016,039,803	19,755.78	4,045,371,765	1.17
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,716	120,810.97	3,227,586,097	126,990.81	3,392,686,507	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,523	121,392.77	3,098,307,788	127,138.79	3,244,963,347	0.94
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,504	11,549.20	3,193,402,448	11,627.56	3,215,067,182	0.93
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	261,093	10,675.28	2,787,242,682	11,898.06	3,106,500,441	0.90
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	226,749	14,577.27	3,305,382,926	13,652.43	3,095,674,941	0.90
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	148,232	17,454.01	2,587,243,226	19,287.35	2,859,003,681	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	213,814	11,164.52	2,387,132,107	12,900.82	2,758,376,526	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	360,671	7,717.82	2,783,594,995	7,285.05	2,627,509,082	0.76
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	110,807	21,257.22	2,355,448,791	21,632.67	2,397,051,486	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	622,137	3,406.81	2,119,502,902	3,742.06	2,328,079,581	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	77,481	27,027.31	2,094,103,391	29,955.71	2,320,998,738	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	94,028	20,392.41	1,917,457,809	24,200.48	2,275,523,410	0.66
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	153,426	14,123.36	2,166,891,095	14,674.44	2,251,441,613	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	770,049	2,969.07	2,286,336,550	2,909.55	2,240,497,454	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	352,577	6,248.34	2,203,023,556	6,168.29	2,174,798,030	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	162,402	12,588.41	2,044,383,309	12,511.17	2,031,840,524	0.59
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	219,928	8,556.47	1,881,808,969	9,232.21	2,030,421,745	0.59

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	345,522	5,240.21	1,810,610,564	5,860.62	2,024,974,180	0.59
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,179	25,741.37	2,089,658,831	24,551.80	1,993,090,994	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	381,705	4,643.04	1,772,273,398	4,989.78	1,904,624,051	0.55
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	366,517	5,741.38	2,104,316,232	5,032.36	1,844,447,029	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	386,179	4,524.62	1,747,314,058	4,702.33	1,815,944,264	0.53
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	364,038	4,852.25	1,766,404,892	4,917.38	1,790,115,874	0.52
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	474,281	4,441.72	2,106,627,742	3,761.23	1,783,880,779	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,573	37,780.23	1,721,758,497	38,617.30	1,759,906,231	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	59,906	29,009.31	1,737,831,760	29,195.01	1,748,956,598	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	5.30
		素材	4.15
		資本財	6.72
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.03
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.93
		メディア・娯楽	5.94
		小売	4.81
		食品・生活必需品小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	5.03
		家庭用品・パーソナル用品	2.22
		ヘルスケア機器・サービス	4.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.86
		銀行	7.22
		各種金融	4.14
		保険	3.74
		不動産	0.55
		ソフトウェア・サービス	9.55

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11
		電気通信サービス	2.36
		公益事業	3.57
		半導体・半導体製造装置	2.93
		小計	94.44
投資信託受益証券	—	—	0.08
投資証券	—	—	2.74
合計			97.26

(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	423	アメリカドル	62,363,983.5	6,639,269,683	61,899,705	6,589,842,594	1.91
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	4,683,804	375,219,538	4,696,800	376,260,648	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	3,340,778	360,369,722	3,340,840	360,376,410	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	311	ユーロ	10,664,479.5	1,254,462,723	10,608,210	1,247,843,742	0.36
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	33	オーストラリアドル	5,420,106	387,971,187	5,346,825	382,725,733	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	68	イギリスポンド	4,995,860	647,863,124	4,880,360	632,885,084	0.18

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,978,000.00	634,393,359	636,178,760	0.18
	カナダドル	買建	385,000.00	30,726,487	30,833,320	0.01
	ユーロ	買建	878,000.00	103,197,629	103,279,140	0.03
	イギリスポンド	買建	433,000.00	56,082,814	56,141,500	0.02
	スイスフラン	買建	469,000.00	50,664,198	50,591,030	0.01

	スウェーデンクローナ	買建	1,405,000.00	15,321,525	15,286,400	0.00
	オーストラリアドル	買建	162,000.00	11,593,076	11,592,720	0.00

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

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

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	インドネシア	4,888,637,812	9.89
	メキシコ	4,805,588,153	9.73
	タイ	4,625,129,878	9.36
	ブラジル	4,505,678,337	9.12
	ポーランド	4,285,900,594	8.67
	南アフリカ	3,967,284,486	8.03
	ロシア	3,826,472,427	7.74
	コロンビア	3,195,111,525	6.47
	マレーシア	2,945,194,013	5.96
	ハンガリー	2,136,785,776	4.32
	チェコ	2,124,772,148	4.30
	ペルー	1,847,682,041	3.74
	チリ	1,666,525,218	3.37
	トルコ	1,660,938,639	3.36
	フィリピン	141,571,971	0.29
	ドミニカ共和国	96,984,713	0.20
	ウルグアイ	88,125,605	0.18
	小計	46,808,383,336	94.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,604,838,059	5.27
合計(純資産総額)		49,413,221,395	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)

コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	55,400,000,000	3.81	2,114,651,481	3.91	2,168,952,297	9.850	2027/6/28	4.39
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000	2,615.23	749,265,065	2,792.70	800,111,036	10.000	2023/1/1	1.62
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	35,400,000	2,083.99	737,734,369	2,214.46	783,920,276	0.000	2022/1/1	1.59
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	354.83	624,861,388	444.87	783,427,613	3.400	2036/6/17	1.59
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	2.91	690,368,936	3.02	716,293,534	4.375	2023/3/21	1.45
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000	748.99	651,252,293	781.79	679,770,818	10.500	2026/12/21	1.38
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	21,100,000	2,648.51	558,836,367	2,865.46	604,612,829	10.000	2025/1/1	1.22
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	365.12	499,859,246	429.28	587,694,697	3.650	2031/6/20	1.19
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,714.20	574,054,649	2,763.34	584,447,480	2.500	2023/1/25	1.18
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	21,200,000	2,653.31	562,502,652	2,686.65	569,570,093	10.000	2021/1/1	1.15
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	560.90	461,343,087	599.92	493,439,793	10.000	2024/12/5	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000	502.42	460,720,094	523.79	480,324,380	6.500	2021/6/10	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000	486.77	415,215,323	544.42	464,397,698	7.500	2027/6/3	0.94
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	15,900,000	2,569.58	408,563,769	2,916.04	463,650,636	10.000	2027/1/1	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000	614.83	457,438,960	621.35	462,285,032	8.750	2048/2/28	0.94
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000	407.47	387,101,403	455.48	432,708,480	4.875	2029/6/22	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	77,600,000	515.93	400,362,163	548.92	425,967,569	8.000	2023/12/7	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	494.02	401,151,189	522.53	424,298,583	6.500	2022/6/9	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000	2,558.74	358,223,630	2,825.05	395,508,103	2.500	2027/7/25	0.80
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	13,950,000	2,588.93	361,155,921	2,812.59	392,357,699	2.500	2026/7/25	0.79
チリ	国債証券	BTPCL 5% 03/01/35	2,060,000,000	18.64	384,116,802	18.93	389,981,902	5.000	2035/3/1	0.79
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000	0.75	365,819,371	0.79	383,752,133	8.375	2024/3/15	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	63,700,000	533.60	339,906,689	583.06	371,410,799	8.500	2029/5/31	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,750.67	349,335,461	2,914.43	370,133,312	3.250	2025/7/25	0.75
チリ	国債証券	BTPCL 6% 01/01/43	1,620,000,000	22.15	358,836,526	22.60	366,187,765	6.000	2043/1/1	0.74
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000	0.75	341,882,438	0.79	357,456,375	8.375	2026/9/15	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000	332.32	325,677,526	364.34	357,059,599	2.125	2026/12/17	0.72
タイ	国債証券	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000	342.68	341,660,460	352.02	350,973,676	1.875	2022/6/17	0.71
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	17,500,000	1,967.39	344,293,701	1,975.37	345,691,087	0.000	2023/7/1	0.70
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000	512.92	329,807,726	530.60	341,176,057	7.250	2021/12/9	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	94.73
合計	94.73

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	ケイマン	8,454,128,841	15.90
	中国	5,944,195,489	11.18
	韓国	5,802,623,683	10.91
	台湾	5,551,970,784	10.44
	インド	4,441,957,394	8.35
	ブラジル	3,623,250,348	6.81
	南アフリカ	2,558,132,151	4.81
	ロシア	1,919,371,172	3.61
	香港	1,603,228,290	3.02
	タイ	1,495,126,514	2.81
	サウジアラビア	1,327,627,205	2.50
	メキシコ	1,194,782,162	2.25
	マレーシア	1,079,357,336	2.03
	インドネシア	1,076,573,364	2.02
	フィリピン	556,713,652	1.05
	カタール	515,418,168	0.97
	ポーランド	494,272,904	0.93
	バミューダ	486,127,077	0.91
	チリ	441,366,624	0.83
	アラブ首長国連邦	398,766,071	0.75
	トルコ	271,368,393	0.51
	コロンビア	205,338,999	0.39
	アメリカ	178,649,174	0.34
	ギリシャ	155,779,811	0.29
	ハンガリー	143,051,759	0.27

	チェコ	83,453,695	0.16
	エジプト	72,991,210	0.14
	アルゼンチン	58,882,831	0.11
	ルクセンブルク	51,858,926	0.10
	ジャージー	40,891,605	0.08
	シンガポール	29,504,572	0.06
	マン島	28,439,999	0.05
	ペルー	26,999,470	0.05
	パキスタン	16,424,880	0.03
	小計	50,328,624,553	94.65
投資信託受益証券	ブラジル	140,668,035	0.26
	メキシコ	26,849,602	0.05
	小計	167,517,637	0.32
投資証券	南アフリカ	104,179,378	0.20
	メキシコ	44,763,396	0.08
	小計	148,942,774	0.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,526,248,333	4.75
合計(純資産総額)		53,171,333,297	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	2,431,376,064	4.57

(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	―	95,933,486	0.18
	売建	―	155,416	△0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	129,785	15,747.31	2,043,765,577	18,397.35	2,387,700,407	4.49
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	520,700	3,828.05	1,993,269,096	4,345.11	2,262,500,860	4.26
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,249,389	784.35	1,764,310,352	861.05	1,936,858,892	3.64
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	436,138	3,902.96	1,702,231,331	3,827.87	1,669,483,927	3.14
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	40,026	18,582.56	743,785,646	23,788.73	952,168,027	1.79
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,580,620	87.25	748,702,856	78.29	671,853,107	1.26
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	495,000	1,057.11	523,271,767	1,221.30	604,543,500	1.14
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	557,500	993.05	553,626,825	882.72	492,121,139	0.93
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	254,198	1,648.26	418,984,396	1,862.62	473,475,550	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	147,455	2,737.39	403,642,580	3,192.67	470,775,892	0.89
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,109,515	72.73	444,376,796	66.35	405,410,920	0.76
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	442,781	867.98	384,326,408	869.97	385,209,198	0.72
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	308,929	994.13	307,118,676	1,210.42	373,935,385	0.70
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	493,504	481.19	237,473,730	739.68	365,037,052	0.69
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	233,869	1,272.19	297,527,440	1,438.27	336,367,842	0.63
ブラジル	株式	VALE SA	素材	285,178	1,392.11	397,000,856	1,150.95	328,226,189	0.62
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	50,048	6,385.74	319,593,559	6,465.06	323,563,323	0.61
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	36,794	8,041.98	295,896,921	8,514.67	313,288,797	0.59
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	365,953	765.85	280,265,349	828.12	303,054,462	0.57
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,408,200	45.45	336,773,068	40.16	297,566,651	0.56
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,196,248	257.22	307,708,984	243.74	291,574,684	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	24,875	19,514.11	485,413,685	11,160.20	277,610,020	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	80,692	2,863.79	231,085,749	3,350.17	270,332,321	0.51
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,626,000	182.75	297,161,745	150.62	244,919,502	0.46
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	371,740	652.68	242,628,076	650.75	241,913,522	0.45
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	3,276.81	241,606,400	3,175.19	234,113,846	0.44
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	412,820	559.23	230,864,524	557.83	230,287,302	0.43
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,037,840	76.92	233,699,817	75.34	228,887,878	0.43

ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	68,369	2,310.18	157,944,833	3,272.58	223,743,049	0.42
ブラジル	株式	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	各種金融	190,503	658.26	125,401,293	1,130.28	215,321,883	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国		—
		エネルギー	7.12
		素材	6.93
		資本財	2.99
		商業・専門サービス	0.21
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.18
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	1.41
		メディア・娯楽	6.67
		小売	8.44
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	3.82
		家庭用品・パーソナル用品	1.06
		ヘルスケア機器・サービス	0.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.91
		銀行	17.15
		各種金融	2.37
		保険	3.74
		不動産	2.47
		ソフトウェア・サービス	1.89
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.48
		電気通信サービス	4.49
		公益事業	2.65
		半導体・半導体製造装置	5.29
		小計	94.65
投資信託受益証券	—	—	0.32
投資証券	—	—	0.28
合計			95.25

(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	468	アメリカドル	23,294,136	2,479,893,719	22,838,400	2,431,376,064	4.57

(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	901,461.06	95,545,868	95,933,486	0.18
	ブラジルレアル	売建	6,090.00	154,868	155,416	△0.00

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

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

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2011年10月13日
作成基準日：2019年 8 月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	18,782円
純資産総額	538.43億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年 1 月	0円
2016年 1 月	0円
2017年 1 月	0円
2018年 1 月	0円
2019年 1 月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	30.9%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.8%
外国債券インデックスマザーファンド	30.4%	T 1.625% 07/31/20	アメリカ	国債	-	1.625%	2020/07/31	0.2%
		T 2.75% 05/31/23	アメリカ	国債	-	2.750%	2023/05/31	0.2%
新興国債券インデックスマザーファンド	14.9%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.7%
		BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	国債	-	10.000%	2023/01/01	0.2%
新興国株式インデックスマザーファンド	13.9%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.6%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.6%
国内株式インデックスマザーファンド	4.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	4.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.1%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.1%

※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)

※2011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＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

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

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

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞

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

＜一部解約受付の中止等＞

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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1万口当たりに換算した価額で表示することがあり

ます。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①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。

②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。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2011年10月13日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。
ただし、第1計算期間は2011年10月13日から2012年1月20日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合
②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則とし

て取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2018年1月23日から2019年1月21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】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2018年 1月22日現在）	第8期 （2019年 1月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	426,945,969	469,277,170
親投資信託受益証券	42,277,358,576	47,526,006,019
未収入金	90,000,000	24,760,000
流動資産合計	42,794,304,545	48,020,043,189
資産合計	42,794,304,545	48,020,043,189
負債の部		
流動負債		
未払解約金	39,472,614	43,323,551
未払受託者報酬	8,369,436	10,175,695
未払委託者報酬	96,248,496	117,020,454
未払利息	707	1,310
その他未払費用	1,644,842	1,700,318
流動負債合計	145,736,095	172,221,328
負債合計	145,736,095	172,221,328
純資産の部		
元本等		
元本	21,270,056,988	26,009,857,171
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,378,511,462	21,837,964,690
（分配準備積立金）	6,739,052,544	6,352,229,130
元本等合計	42,648,568,450	47,847,821,861
純資産合計	42,648,568,450	47,847,821,861
負債純資産合計	42,794,304,545	48,020,043,189

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2017年 1月21日 至　2018年 1月22日	第8期 自　2018年 1月23日 至　2019年 1月21日
営業収益		
受取利息	371	73
有価証券売買等損益	5,507,122,060	△3,515,252,557
営業収益合計	5,507,122,431	△3,515,252,484
営業費用		
支払利息	216,505	391,920
受託者報酬	14,992,767	19,382,519
委託者報酬	172,416,773	222,898,817
その他費用	1,646,402	1,724,087
営業費用合計	189,272,447	244,397,343
営業利益又は営業損失（△）	5,317,849,984	△3,759,649,827
経常利益又は経常損失（△）	5,317,849,984	△3,759,649,827
当期純利益又は当期純損失（△）	5,317,849,984	△3,759,649,827
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（△）	152,100,183	△139,630,195
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,016,278,472	21,378,511,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,264,775,723	5,474,329,972
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,264,775,723	5,474,329,972
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,068,292,534	1,394,857,112
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,068,292,534	1,394,857,112
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,378,511,462	21,837,964,690

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第8期計算期間は2018年 1月23日から2019年 1月21日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第7期 (2018年 1月22日現在)	第8期 (2019年 1月21日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	21,270,056,988口	26,009,857,171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 2.0051円 (1万口当たり純資産額) (20,051円)	1口当たり純資産額 1.8396円 (1万口当たり純資産額) (18,396円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第7期
自 2017年 1月21日
至 2018年 1月22日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－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	5,165,847,007円
収益調整金額	C	14,639,458,918円
分配準備積立金額	D	1,573,205,537円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,378,511,462円
当ファンドの期末残存口数	F	21,270,056,988口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,050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

第8期
自 2018年 1月23日
至 2019年 1月21日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－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	15,485,735,560円
分配準備積立金額	D	6,352,229,130円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,837,964,690円
当ファンドの期末残存口数	F	26,009,857,171口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,396円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21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8期 (2019年 1月21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7期 自 2017年 1月21日 至 2018年 1月22日	第8期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	16,521,186,562円	21,270,056,988円
期中追加設定元本額	6,197,741,110円	6,146,205,344円
期中一部解約元本額	1,448,870,684円	1,406,405,161円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第7期 (2018年 1月22日現在)	第8期 (2019年 1月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,443,483,219	△3,355,631,706
合計	5,443,483,219	△3,355,631,706

（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	2,635,967,059	7,107,094,384	
	国内株式インデックス　マザーファンド	1,657,199,380	2,360,017,637	
	外国株式インデックス　マザーファンド	6,145,071,526	14,593,315,859	
	国内債券インデックス　マザーファンド	1,503,978,693	2,108,427,729	
	外国債券インデックス　マザーファンド	5,268,652,676	14,117,881,710	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	4,398,097,631	7,239,268,700	
合計		21,608,966,965	47,526,006,019	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,415,183,631
国債証券	358,669,301,350
地方債証券	24,001,239,006
特殊債券	30,151,440,493
社債券	17,798,047,580
未収入金	118,704
未収利息	787,006,103
前払費用	22,895,937
流動資産合計	432,845,232,804
資産合計	432,845,232,804
負債の部	
流動負債	
未払金	996,696,500
未払解約金	342,599,418

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
未払利息	3,951
その他未払費用	96,830
流動負債合計	1,339,396,699
負債合計	1,339,396,699
純資産の部	
元本等	
元本	307,793,237,795
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	123,712,598,310
元本等合計	431,505,836,105
純資産合計	431,505,836,105
負債純資産合計	432,845,232,804

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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 1月21日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		307,793,237,795口
2． 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	101,286,000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	1.4019円
	(1万口当たり純資産額)	(14,019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 1月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 1月21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。

	2019年 1月21日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	256,411,785,507円
期中追加設定元本額	74,298,418,731円
期中一部解約元本額	22,916,966,443円
期末元本額	307,793,237,795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
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,881,613,255円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	16,283,081円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	14,614,886,155円
世界経済インデックスファンド	1,826,217,347円
ＤＣマイセレクション２５	19,416,341,404円
ＤＣマイセレクション５０	20,585,659,894円
ＤＣマイセレクション７５	5,697,730,073円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	449,431,322円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	79,504,622,214円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	36,801,224,002円
ＤＣマイセレクションＳ２５	7,703,587,418円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,233,363,322円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,642,481,221円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,208,301,501円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,169,887,992円

区分	2019年 1月21日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	381,687,947円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,503,978,693円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	88,937,566円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,759,987円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	53,241,020円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,074,459円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	237,071,507円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	354,693,227円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	67,106,176円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	172,261,864円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,626,941,407円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	997,552,380円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,737,484,490円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	806,526,944円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	113,988,943円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,349,067,151円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	106,840,845円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,521,665,013円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,963,876,697円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	168,758,138円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,138,109,133円
日本債券ファンド・シリーズ１	10,156,889,205円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	57,441,298円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	701,524,729円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	61,681,623円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,299,671円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	69,301,358円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	7,167,365円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	11,059,057円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	19,144,891円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,463,878円
グローバル経済コア	257,667,730円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	7,946,600円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	257,645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）	69,242,045,484円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	738,738,600
地方債証券	1,686,287
特殊債券	△2,524,806
社債券	△11,239,030
合計	726,661,051

(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３８５回利付国債（２年）	360,000,000	361,072,800	
	第３８６回利付国債（２年）	2,610,000,000	2,618,508,600	
	第３８７回利付国債（２年）	1,710,000,000	1,715,779,800	
	第３８８回利付国債（２年）	2,130,000,000	2,137,668,000	
	第３８９回利付国債（２年）	2,780,000,000	2,790,369,400	
	第３９０回利付国債（２年）	4,320,000,000	4,337,107,200	
	第３９１回利付国債（２年）	2,850,000,000	2,861,970,000	
	第３９２回利付国債（２年）	560,000,000	562,480,800	
	第３９３回利付国債（２年）	740,000,000	743,448,400	
	第３９４回利付国債（２年）	820,000,000	824,009,800	
	第３９５回利付国債（２年）	350,000,000	351,760,500	
	第３９６回利付国債（２年）	1,370,000,000	1,377,206,200	
	第１２３回利付国債（５年）	3,140,000,000	3,150,173,600	
	第１２４回利付国債（５年）	1,950,000,000	1,957,566,000	
	第１２５回利付国債（５年）	3,610,000,000	3,626,497,700	
	第１２６回利付国債（５年）	2,960,000,000	2,975,569,600	
	第１２７回利付国債（５年）	4,780,000,000	4,807,915,200	
	第１２８回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,620,304,000	
	第１２９回利付国債（５年）	3,200,000,000	3,222,656,000	

第１３０回利付国債（５年）	1,360,000,000	1,370,526,400	
第１３１回利付国債（５年）	5,540,000,000	5,586,536,000	
第１３２回利付国債（５年）	4,000,000,000	4,036,320,000	
第１３３回利付国債（５年）	4,740,000,000	4,786,215,000	
第１３４回利付国債（５年）	3,170,000,000	3,203,031,400	
第１３５回利付国債（５年）	5,790,000,000	5,854,153,200	
第１３６回利付国債（５年）	5,900,000,000	5,969,384,000	
第１３７回利付国債（５年）	3,430,000,000	3,471,846,000	
第１３８回利付国債（５年）	280,000,000	283,600,800	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	581,552,000	
第２回利付国債（４０年）	470,000,000	662,027,900	
第３回利付国債（４０年）	520,000,000	736,455,200	
第４回利付国債（４０年）	850,000,000	1,210,068,500	
第５回利付国債（４０年）	890,000,000	1,221,062,200	
第６回利付国債（４０年）	590,000,000	795,025,000	
第７回利付国債（４０年）	720,000,000	929,685,600	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	960,192,000	
第９回利付国債（４０年）	1,090,000,000	958,251,700	
第１０回利付国債（４０年）	1,810,000,000	1,879,377,300	
第１１回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,073,199,300	
第３０６回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,191,411,000	
第３０７回利付国債（１０年）	700,000,000	711,998,000	
第３０８回利付国債（１０年）	1,490,000,000	1,521,021,800	
第３０９回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,494,075,500	
第３１０回利付国債（１０年）	1,410,000,000	1,437,579,600	
第３１１回利付国債（１０年）	1,080,000,000	1,097,528,400	
第３１２回利付国債（１０年）	3,810,000,000	3,909,974,400	
第３１３回利付国債（１０年）	1,250,000,000	1,289,625,000	
第３１４回利付国債（１０年）	470,000,000	482,863,900	
第３１５回利付国債（１０年）	3,140,000,000	3,243,620,000	
第３１６回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,205,778,600	
第３１７回利付国債（１０年）	890,000,000	919,957,400	
第３１８回利付国債（１０年）	1,960,000,000	2,020,740,400	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,772,979,300	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,724,923,000	
第３２１回利付国債（１０年）	3,070,000,000	3,182,945,300	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	775,215,000	
第３２３回利付国債（１０年）	970,000,000	1,005,230,400	
第３２４回利付国債（１０年）	1,280,000,000	1,322,099,200	
第３２５回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,412,342,200	
第３２６回利付国債（１０年）	860,000,000	889,093,800	
第３２７回利付国債（１０年）	1,150,000,000	1,193,424,000	

第３２８回利付国債（１０年）	2,320,000,000	2,393,752,800	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,345,872,500	
第３３０回利付国債（１０年）	1,440,000,000	1,504,900,800	
第３３１回利付国債（１０年）	1,380,000,000	1,429,238,400	
第３３２回利付国債（１０年）	3,430,000,000	3,558,968,000	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,421,429,200	
第３３４回利付国債（１０年）	2,790,000,000	2,904,864,300	
第３３５回利付国債（１０年）	4,220,000,000	4,377,828,000	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	529,920,600	
第３３７回利付国債（１０年）	3,380,000,000	3,471,699,400	
第３３８回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,533,716,500	
第３３９回利付国債（１０年）	3,890,000,000	4,028,406,200	
第３４０回利付国債（１０年）	3,870,000,000	4,013,190,000	
第３４１回利付国債（１０年）	3,930,000,000	4,053,441,300	
第３４２回利付国債（１０年）	2,910,000,000	2,961,536,100	
第３４３回利付国債（１０年）	3,150,000,000	3,205,377,000	
第３４４回利付国債（１０年）	2,420,000,000	2,462,108,000	
第３４５回利付国債（１０年）	1,980,000,000	2,013,976,800	
第３４６回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,969,231,200	
第３４７回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,408,133,300	
第３４８回利付国債（１０年）	1,340,000,000	1,360,435,000	
第３４９回利付国債（１０年）	3,210,000,000	3,255,999,300	
第３５０回利付国債（１０年）	3,940,000,000	3,990,668,400	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	2,680,000,000	2,712,856,800	
第３５２回利付国債（１０年）	3,740,000,000	3,781,588,800	
第３５３回利付国債（１０年）	220,000,000	222,178,000	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	142,000,100	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	201,316,800	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	150,146,400	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	146,172,400	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	62,667,500	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	244,262,100	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	230,400,000	
第８回利付国債（３０年）	50,000,000	60,932,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	279,352,800	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	179,699,200	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	108,753,300	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	240,901,000	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	364,254,500	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	395,052,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	454,172,000	
第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	495,459,600	

第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	755,774,400	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	453,067,800	
第１９回利付国債（３０年）	340,000,000	447,038,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	648,067,200	
第２１回利付国債（３０年）	320,000,000	422,656,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	542,256,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	584,090,500	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	517,172,400	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	465,020,500	
第２６回利付国債（３０年）	430,000,000	579,988,300	
第２７回利付国債（３０年）	600,000,000	822,354,000	
第２８回利付国債（３０年）	1,130,000,000	1,554,981,700	
第２９回利付国債（３０年）	1,330,000,000	1,811,526,500	
第３０回利付国債（３０年）	960,000,000	1,294,176,000	
第３１回利付国債（３０年）	1,020,000,000	1,359,986,400	
第３２回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,750,994,400	
第３３回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,834,099,800	
第３４回利付国債（３０年）	1,185,000,000	1,594,773,000	
第３５回利付国債（３０年）	1,690,000,000	2,210,469,300	
第３６回利付国債（３０年）	1,660,000,000	2,176,741,400	
第３７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,821,861,000	
第３８回利付国債（３０年）	1,060,000,000	1,349,719,200	
第３９回利付国債（３０年）	940,000,000	1,219,640,600	
第４０回利付国債（３０年）	680,000,000	868,346,400	
第４１回利付国債（３０年）	930,000,000	1,166,861,700	
第４２回利付国債（３０年）	830,000,000	1,042,081,600	
第４３回利付国債（３０年）	900,000,000	1,130,724,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,395,469,800	
第４５回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,330,945,000	
第４６回利付国債（３０年）	970,000,000	1,174,000,700	
第４７回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,654,900,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,601,896,500	
第４９回利付国債（３０年）	1,090,000,000	1,293,524,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,110,884,700	
第５１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,003,431,000	
第５２回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,480,633,000	
第５３回利付国債（３０年）	1,070,000,000	1,054,859,500	
第５４回利付国債（３０年）	1,240,000,000	1,284,268,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,000,000,000	1,034,720,000	
第５６回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,302,512,400	
第５７回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,197,966,800	
第５８回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,382,478,000	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	170,833,000	

第６０回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,342,263,000	
第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	175,287,000	
第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	298,685,500	
第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	175,734,100	
第４７回利付国債（２０年）	90,000,000	93,572,100	
第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	136,671,600	
第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	146,910,400	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	229,904,400	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	105,266,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	116,694,600	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	85,322,400	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	213,890,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	149,647,400	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	161,103,000	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	256,941,600	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	322,752,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	214,634,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	371,479,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	251,647,200	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	333,635,200	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	217,402,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	350,867,200	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	242,365,200	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	361,914,300	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	143,847,600	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	213,200,900	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	435,594,900	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	455,612,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	225,626,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	710,917,200	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	406,148,400	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	226,830,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	148,128,500	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	304,295,400	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	328,636,700	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	192,485,900	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	307,459,800	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	251,946,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	446,257,500	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	690,588,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	335,321,200	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	540,171,000	

第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	336,835,000	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	246,949,500	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	642,796,000	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	496,154,400	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	410,847,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	742,713,300	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	533,983,500	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,035,170,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	480,798,800	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	720,355,100	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	733,201,700	
第９６回利付国債（２０年）	320,000,000	379,212,800	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	479,112,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	523,190,800	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,371,881,000	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	578,808,000	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	875,324,450	
第１０２回利付国債（２０年）	410,000,000	503,996,600	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	487,932,000	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	432,345,600	
第１０５回利付国債（２０年）	680,000,000	819,134,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	461,426,400	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	314,106,000	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	784,264,800	
第１０９回利付国債（２０年）	230,000,000	274,102,500	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,151,438,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,189,016,300	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	960,173,900	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,767,999,500	
第１１４回利付国債（２０年）	940,000,000	1,149,704,600	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	863,765,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,311,379,000	
第１１７回利付国債（２０年）	750,000,000	919,552,500	
第１１８回利付国債（２０年）	690,000,000	840,716,700	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	633,768,700	
第１２０回利付国債（２０年）	790,000,000	926,796,400	
第１２１回利付国債（２０年）	1,690,000,000	2,044,139,500	
第１２２回利付国債（２０年）	200,000,000	239,602,000	
第１２３回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,569,859,700	
第１２４回利付国債（２０年）	500,000,000	612,165,000	
第１２５回利付国債（２０年）	450,000,000	563,157,000	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	896,038,500	
第１２７回利付国債（２０年）	670,000,000	814,351,500	

	第１２８回利付国債（２０年）	1,240,000,000	1,509,848,800	
	第１２９回利付国債（２０年）	280,000,000	337,509,200	
	第１３０回利付国債（２０年）	935,000,000	1,128,778,750	
	第１３１回利付国債（２０年）	640,000,000	764,672,000	
	第１３２回利付国債（２０年）	840,000,000	1,005,522,000	
	第１３３回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,306,497,600	
	第１３４回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,212,090,000	
	第１３５回利付国債（２０年）	590,000,000	707,528,000	
	第１３６回利付国債（２０年）	570,000,000	676,191,000	
	第１３７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,225,387,200	
	第１３８回利付国債（２０年）	320,000,000	376,038,400	
	第１３９回利付国債（２０年）	510,000,000	606,002,400	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,750,000,000	2,106,037,500	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,170,000,000	1,410,364,800	
	第１４２回利付国債（２０年）	520,000,000	633,880,000	
	第１４３回利付国債（２０年）	720,000,000	858,758,400	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,733,071,200	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,045,000,000	2,471,116,650	
	第１４６回利付国債（２０年）	1,830,000,000	2,214,647,700	
	第１４７回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,382,985,200	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,573,908,700	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,540,000,000	3,008,833,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,010,000,000	2,353,026,600	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,765,000,000	2,012,311,800	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,160,000,000	2,461,449,600	
	第１５３回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,894,987,200	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,915,351,200	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,160,000,000	2,391,768,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,870,000,000	1,882,080,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,010,000,000	1,952,514,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,890,000,000	1,927,516,500	
	第１５９回利付国債（２０年）	1,830,000,000	1,894,324,500	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,950,000,000	2,050,756,500	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,710,000,000	1,765,609,200	
	第１６２回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,112,012,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,680,000,000	1,728,417,600	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,795,681,800	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,047,404,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,360,000,000	1,418,847,200	
国債証券合計		329,930,000,000	358,669,301,350	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	111,538,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,174,000	

第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	132,171,000	
第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	129,860,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	119,002,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	120,107,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	236,962,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	235,906,000	
第６９５回東京都公募公債	100,000,000	102,532,000	
第６９６回東京都公募公債	100,000,000	102,801,000	
第７００回東京都公募公債	100,000,000	102,638,000	
第７０２回東京都公募公債	200,000,000	205,904,000	
第７１６回東京都公募公債	100,000,000	102,932,000	
第７１７回東京都公募公債	100,000,000	102,539,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	103,746,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	103,091,000	
第７６４回東京都公募公債	150,000,000	152,248,500	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	101,422,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	101,087,000	
平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	205,600,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	103,159,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	101,345,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,362,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,438,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	135,981,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,892,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,554,000	
第１７２回神奈川県公募公債	100,000,000	101,517,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	205,090,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	101,207,000	
第２２６回神奈川県公募公債	200,000,000	202,436,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	237,178,000	
第３４５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,358,000	
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,041,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,050,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,342,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,700,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,881,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	154,823,320	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,286,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,164,000	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,414,000	
平成２２年度第２回京都府公募公債	100,000,000	101,898,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	118,420,000	

平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	103,631,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	103,411,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	105,797,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	103,297,000	
第４回兵庫県公募公債（１２年）	200,000,000	210,372,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,953,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	103,607,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	102,617,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	117,393,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	100,758,000	
平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	106,110,849	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	102,755,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	102,742,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	101,087,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,254,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,203,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	121,518,000	
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	103,068,000	
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,782,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,799,000	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,589,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	103,396,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,522,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,742,000	
平成２８年度第１３回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,488,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,538,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	99,808,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	120,986,000	
平成２２年度第１回広島県公募公債	100,000,000	101,807,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	103,040,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	129,132,166	
平成２９年度第１回広島県公募公債	200,000,000	201,992,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	119,683,000	
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	102,492,000	
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	198,073,970	

平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	103,355,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	103,317,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	103,283,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	103,105,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,460,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,674,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	101,088,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	119,693,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,265,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	111,259,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	120,819,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	205,616,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	111,397,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	129,613,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	103,070,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	98,981,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,005,000	
平成２２年度第８回千葉県公募公債	120,000,000	122,156,400	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	103,762,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	102,490,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	103,346,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,459,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	220,000,000	222,492,600	
第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,442,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,629,000	
第９７回共同発行市場公募地方債	356,000,000	366,858,000	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,701,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,026,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,139,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,352,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,902,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,872,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,740,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,386,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,670,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,137,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,095,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,408,000	

第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,921,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,251,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,046,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,830,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,824,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,744,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,742,602	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,253,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,110,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,448,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,325,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,117,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,093,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,602,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,094,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,471,629	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,174,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,647,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	205,862,000	
平成２２年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,811,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,095,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	241,216,000	
平成２２年度第５回大阪市公募公債	100,000,000	101,942,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	134,333,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	118,806,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	122,037,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	102,830,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,465,000	
平成２２年度第２回京都市公募公債	102,000,000	103,765,620	
平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	103,037,000	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	102,924,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	103,358,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	202,190,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	142,370,400	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	241,750,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	113,766,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	120,103,000	
平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	102,980,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	101,091,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	202,952,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,731,000	

	平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	202,778,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	111,654,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	103,049,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,421,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	118,271,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,985,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,549,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	200,000,000	200,866,000	
	平成２８年度第４回北九州市公募公債	145,000,000	146,484,800	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	120,428,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	205,978,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,344,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	102,790,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	154,957,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,580,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	106,080,450	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,914,200	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	205,880,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	203,730,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,087,000	
地方債証券合計		22,780,220,000	24,001,239,006	
特殊債券	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,662,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,964,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,915,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,910,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,005,000	
	第５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,873,000	
	第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,074,000	
	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	208,446,000	
	第１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,187,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	107,262,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	105,818,000	
	第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	469,640,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	132,842,000	

第２８回道路債券	200,000,000	269,356,000	
第３３回道路債券	200,000,000	273,246,000	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,270,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,727,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,949,000	
第４２回道路債券	100,000,000	113,399,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,248,000	
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,863,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,729,000	
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	142,299,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,258,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,695,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,764,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,104,000	
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	131,047,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,200,000	
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	204,800,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,929,000	
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	102,508,000	
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,046,000	
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	102,875,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,511,000	
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	308,646,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,730,000	
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	309,593,550	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,356,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,235,000	
	100,000,000	103,056,000	

第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,210,000	
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	118,187,000	
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	103,548,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,617,000	
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	205,936,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,012,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,511,000	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,244,000	
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	153,880,040	
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	103,584,000	
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	232,136,000	
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	105,847,440	
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	103,752,000	
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	103,576,000	
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	103,381,000	
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	103,038,000	
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	306,615,000	
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	205,144,000	
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	101,353,000	
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	107,294,250	
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	318,771,320	
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	207,259,100	
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	101,311,000	
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	303,723,000	
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	101,203,000	
	520,000,000	527,306,000	

	第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
	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	201,674,000	
	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	216,895,420	
	第２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,466,000	
	第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	315,663,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	114,483,600	
	第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	109,530,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	111,189,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	134,327,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	44,578,800	
	第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	239,858,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,831,000	
	第１５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,446,000	
	第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,352,000	
	第１９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	118,132,000	
	第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,893,650	
	第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,023,940	
	第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,178,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,729,000	
	第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,838,000	
	第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	513,945,000	
	第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,887,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,512,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,495,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,811,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,022,000	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,166,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,694,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,631,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	222,496,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,930,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,465,000	
	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,114,000	
	第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,910,000	
	第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,134,000	
	第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,205,270	
	第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,314,000	
	第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,239,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,590,600	
		156,000,000	158,143,440	

	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券			
	第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,398,000	
	Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,437,000	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,863,000	
	Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,734,000	
	Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,016,000	
	第７回阪神高速道路債券	100,000,000	113,014,000	
	第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,954,000	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,094,000	
	第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,315,000	
	第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,272,600	
	第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,507,670	
	第４３回都市再生債券	100,000,000	102,112,000	
	第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,817,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	106,480,000	
	第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,923,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,414,000	16,130,596	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,734,000	16,555,472	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	16,145,000	17,152,932	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	282,822,000	284,069,245	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	197,550,000	198,132,772	
	第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,351,000	17,270,416	
	第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	17,192,000	18,171,084	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,942,000	14,398,739	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	28,790,000	30,244,182	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	16,694,000	17,567,763	
	第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,618,000	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	15,204,000	16,011,636	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	17,562,000	18,545,120	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	15,090,000	15,839,822	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	17,365,000	18,266,243	
	第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,079,000	
	第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	17,359,000	17,764,853	
	第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	17,735,000	18,137,407	
	第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,666,000	25,549,340	

第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,149,000	26,149,020	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,273,000	28,557,437	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,777,000	32,005,808	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,770,000	34,152,114	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,732,000	35,097,541	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,006,000	74,014,455	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,575,000	16,193,794	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,039,000	37,263,275	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,591,000	16,197,333	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,398,000	16,199,311	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,872,000	40,423,815	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,364,000	15,079,901	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,803,000	40,434,844	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,565,000	38,034,633	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,192,000	17,139,070	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,828,000	75,147,091	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,313,000	40,708,711	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,139,000	16,972,417	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,716,000	52,613,945	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,320,000	50,074,970	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,520,000	50,325,105	
第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,698,000	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,246,000	106,876,290	
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,507,000	
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,560,000	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,234,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,460,000	113,384,084	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,762,000	57,170,432	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,672,000	57,552,667	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,863,000	58,880,160	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,905,000	52,424,204	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,749,000	51,867,312	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,433,000	58,468,511	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	181,651,500	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,135,000	53,324,089	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,993,000	60,330,117	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,084,000	61,538,940	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,375,000	61,668,062	
第８７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,035,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,930,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,724,000	130,546,772	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,834,000	66,030,527	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,822,000	135,437,877	

第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,561,000	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,214,000	76,508,696	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,118,000	80,309,209	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,165,000	79,739,224	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,654,000	164,495,640	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,869,000	80,620,111	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,475,000	85,460,595	
第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,775,000	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,767,000	91,335,201	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,031,000	91,385,110	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,539,000	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,169,000	91,933,907	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,617,000	92,784,200	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,192,000	93,276,177	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,240,000	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,004,000	94,995,742	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,435,000	95,548,388	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,586,000	95,413,627	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,978,000	95,804,308	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,294,000	96,175,469	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,576,000	192,894,042	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,699,000	96,506,699	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,922,000	195,071,151	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,611,000	97,398,379	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,078,000	195,296,809	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,648,000	98,402,819	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,456,000	197,524,720	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,068,000	198,114,431	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	128,635,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,037,000	100,169,983	

	第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,464,000	100,872,410	
	第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,390,000	
	第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,919,000	
	第１６９回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,334,000	
	第１９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,923,000	
	第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,547,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	112,825,000	
	い第７７９号商工債	100,000,000	100,191,000	
	い第７８６号商工債	300,000,000	300,855,000	
	い第７９５号商工債	200,000,000	199,608,000	
	い第７８０号農林債	100,000,000	100,341,000	
	い第７９５号農林債	100,000,000	99,960,000	
	い第７９６号農林債	200,000,000	199,916,000	
	第３０３回信金中金債（５年）	100,000,000	100,243,000	
	第３０９回信金中金債（５年）	100,000,000	100,358,000	
	第３１７回信金中金債（５年）	200,000,000	200,022,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,121,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,168,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,087,000	
	第２１８号商工債（３年）	300,000,000	300,096,000	
	第２２１号商工債（３年）	200,000,000	200,022,000	
	第３８回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,985,000	
	第３３回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,562,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,707,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,323,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,729,000	
	第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,856,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,954,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,000,000	
特殊債券合計		28,518,741,000	30,151,440,493	
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	99,847,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,945,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,837,000	
	第１１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,434,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,520,000	

第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,018,000	
第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,415,000	
第７回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,351,000	
第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,639,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,771,000	
第６回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンＡＢ円貨社債	100,000,000	100,265,000	
第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,357,000	
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	106,200,000	
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	200,000,000	200,454,000	
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	200,200,000	
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	100,276,000	
第２７回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,696,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,619,000	
第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,840,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,307,000	
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	100,417,000	
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	100,346,000	
第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,455,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,842,000	
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,980,000	
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,437,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,569,000	
第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,960,000	
第１１回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
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	99,591,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,135,000	
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,289,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,608,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,322,000	
第８回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,233,000	
	100,000,000	100,224,000	

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			
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,539,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,958,000	
第８回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	99,918,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,298,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,511,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,376,000	
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,755,000	
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	101,104,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,919,000	
第３６回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	202,030,000	
第１２回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,383,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,714,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,416,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,126,000	
第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,786,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,134,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,537,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第６回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,162,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,183,000	
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	199,732,000	
第８回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,459,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,406,000	
第５３回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,812,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,097,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,216,000	
第２回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,760,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,510,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,508,000	
第７６回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,922,000	
第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,151,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	123,916,000	
第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,174,000	

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	103,524,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	117,068,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,832,000	
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	102,389,000	
第６回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,209,000	
第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,017,000	
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	307,608,000	
第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,236,000	
第３回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,010,000	
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,510,000	
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,850,000	
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	100,612,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,258,000	
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,858,000	
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	200,096,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,717,000	
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,102,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,010,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第１９回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,286,000	
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	199,726,000	
第４０回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,305,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,528,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,341,000	
第１１回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,711,000	
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	104,225,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,946,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,280,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,604,000	
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	104,800,000	

第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,218,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,621,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,382,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,404,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,645,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,603,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,354,890	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,954,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,802,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,583,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,429,800	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,582,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,662,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	103,294,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,317,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,141,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,064,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	103,336,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,806,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	103,020,000	
第４５９回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,004,100	
第５２８回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,707,000	
第５５４回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,541,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,468,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,154,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,479,000	
第４９６回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,546,000	
第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,227,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,359,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,533,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,792,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,895,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,495,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,664,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,971,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,713,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,328,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,788,440	

	第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,309,000	
	第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,860,000	
	第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,790,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,663,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,170,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,800,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,321,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,777,000	
	第３２０回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,247,350	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,968,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,479,000	
	第３５１回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,643,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,041,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,659,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,174,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,088,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,558,000	
	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	101,499,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,454,000	
社債券合計		17,376,000,000	17,798,047,580	
合計			430,620,028,429	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,089,248,611
株式	256,062,933,100
派生商品評価勘定	102,122,580

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
未収入金	100,012
未収配当金	379,957,126
差入委託証拠金	111,890,000
流動資産合計	264,746,251,429
資産合計	264,746,251,429
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,702,320
前受金	67,450,500
未払金	5,518,902,880
未払解約金	301,043,971
未払利息	22,585
その他未払費用	99,174
流動負債合計	5,922,221,430
負債合計	5,922,221,430
純資産の部	
元本等	
元本	181,739,336,499
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	77,084,693,500
元本等合計	258,824,029,999
純資産合計	258,824,029,999
負債純資産合計	264,746,251,429

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2019年 1月21日現在

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 1月21日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	181,739,336,499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　1.4241円 (1万口当たり純資産額)　(14,241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 1月21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 1月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2019年 1月21日現在
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	121,805,661,791円
期中追加設定元本額	72,815,143,139円
期中一部解約元本額	12,881,468,431円
期末元本額	181,739,336,499円

区分	2019年 1月21日現在
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	646,813,170円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,903,066,873円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	16,247,494円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,071,792,874円
世界経済インデックスファンド	2,019,783,914円
日本株式インデックス・オープン	5,668,428,687円
ＤＣマイセレクション２５	6,715,926,905円
ＤＣマイセレクション５０	19,452,325,971円
ＤＣマイセレクション７５	17,230,590,362円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,510,846,997円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,665,276,243円
ＤＣマイセレクションＳ５０	7,765,555,830円
ＤＣマイセレクションＳ７５	4,967,015,272円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	6,055,388,378円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	402,680,002円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	634,566,266円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	406,976,199円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,657,199,380円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	602,304,943円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,311,284円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	50,369,402円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	42,572,583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）	328,037,921円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,814,939円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	123,157,692円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	455,100,269円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	71,555,953円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	629,823,147円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,077,075,674円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	796,536,706円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,521,101,557円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	687,689,306円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	53,014,726円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	903,573,678円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	156,277,656円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	517,197,995円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	667,295,222円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	64,605,315円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	920,903,030円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,425,679,684円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,242,361,594円

区分	2019年 1月21日現在
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	922,766,897円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,961,423,314円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,595,765円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	243,430,351円
コア投資戦略ファンド（切替型）	571,766,575円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,186,982円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,419,098円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	77,341,132円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,424,773,918円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	740,838,148円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	8,918,824円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	53,549,601円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	7,088,959円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,500,514円
グローバル経済コア	343,509,606円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	8,152,364円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	38,267,879円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	618,170円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	41,181,007円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	13,814,691円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	49,139,660,213円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	684,192,192円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△24,580,569,730
合計	△24,580,569,730

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	2,688,709,500	－	2,756,160,000	67,450,500
合計		2,688,709,500	－	2,756,160,000	67,450,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	5,100	2,847.00	14,519,700	
日本水産	157,000	664.00	104,248,000	
マルハニチロ	22,700	3,790.00	86,033,000	
カネコ種苗	4,400	1,279.00	5,627,600	
サカタのタネ	19,100	3,605.00	68,855,500	
ホクト	13,200	1,970.00	26,004,000	
ホクリヨウ	2,100	609.00	1,278,900	
住石ホールディングス	33,800	100.00	3,380,000	
日鉄鉱業	3,600	4,690.00	16,884,000	
三井松島ホールディングス	6,600	1,434.00	9,464,400	
国際石油開発帝石	629,900	1,040.00	655,096,000	
石油資源開発	22,600	2,112.00	47,731,200	
K＆Oエナジーグループ	7,600	1,443.00	10,966,800	
ヒノキヤグループ	3,300	2,010.00	6,633,000	
ショーボンドホールディングス	12,200	7,770.00	94,794,000	
ミライト・ホールディングス	44,200	1,571.00	69,438,200	
タマホーム	9,700	1,190.00	11,543,000	
サンヨーホームズ	2,300	833.00	1,915,900	
日本アクア	3,700	428.00	1,583,600	
ファーストコーポレーション	4,300	750.00	3,225,000	
ベステラ	3,000	1,469.00	4,407,000	
ＴＡＴＥＲＵ	14,200	339.00	4,813,800	
スペースバリューホールディングス	19,100	936.00	17,877,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	676.00	2,028,000	
第一カッター興業	1,700	1,790.00	3,043,000	
安藤・間	101,200	726.00	73,471,200	

東急建設	46,600	1,017.00	47,392,200	
コムシスホールディングス	55,700	2,828.00	157,519,600	
ミサワホーム	13,100	763.00	9,995,300	
ビーアールホールディングス	12,800	338.00	4,326,400	
高松コンストラクショングループ	10,000	2,841.00	28,410,000	
東建コーポレーション	4,900	6,730.00	32,977,000	
ソネック	1,600	701.00	1,121,600	
ヤマウラ	6,700	974.00	6,525,800	
大成建設	129,100	5,070.00	654,537,000	
大林組	389,000	1,042.00	405,338,000	
清水建設	396,900	945.00	375,070,500	
飛島建設	11,500	1,467.00	16,870,500	
長谷工コーポレーション	162,400	1,230.00	199,752,000	
松井建設	15,000	778.00	11,670,000	
錢高組	1,600	5,310.00	8,496,000	
鹿島建設	304,000	1,542.00	468,768,000	
不動テトラ	9,600	1,701.00	16,329,600	
大末建設	5,200	944.00	4,908,800	
鉄建建設	8,100	2,600.00	21,060,000	
西松建設	28,200	2,515.00	70,923,000	
三井住友建設	89,700	693.00	62,162,100	
大豊建設	8,900	3,560.00	31,684,000	
前田建設工業	92,900	1,066.00	99,031,400	
佐田建設	9,800	402.00	3,939,600	
ナカノフドー建設	11,100	502.00	5,572,200	
奥村組	21,500	3,430.00	73,745,000	
東鉄工業	15,500	2,982.00	46,221,000	
イチケン	2,600	2,023.00	5,259,800	
富士ピー・エス	4,000	432.00	1,728,000	
淺沼組	4,800	3,040.00	14,592,000	
戸田建設	151,400	702.00	106,282,800	
熊谷組	18,700	3,350.00	62,645,000	
青木あすなろ建設	7,000	991.00	6,937,000	
北野建設	2,900	3,280.00	9,512,000	
植木組	1,900	2,259.00	4,292,100	
矢作建設工業	17,600	701.00	12,337,600	
ピーエス三菱	14,600	575.00	8,395,000	
日本ハウスホールディングス	24,700	426.00	10,522,200	
大東建託	46,200	15,295.00	706,629,000	
新日本建設	16,000	1,085.00	17,360,000	
ＮＩＰＰＯ	34,300	2,082.00	71,412,600	
東亜道路工業	2,400	3,060.00	7,344,000	

前田道路	40,600	2,172.00	88,183,200	
日本道路	3,500	6,170.00	21,595,000	
東亜建設工業	9,700	1,420.00	13,774,000	
若築建設	6,500	1,526.00	9,919,000	
東洋建設	47,400	398.00	18,865,200	
五洋建設	154,000	646.00	99,484,000	
世紀東急工業	18,900	627.00	11,850,300	
福田組	4,300	4,140.00	17,802,000	
住友林業	92,200	1,469.00	135,441,800	
日本基礎技術	13,300	340.00	4,522,000	
巴コーポレーション	17,800	364.00	6,479,200	
大和ハウス工業	358,900	3,639.00	1,306,037,100	
ライト工業	24,900	1,432.00	35,656,800	
積水ハウス	397,000	1,656.00	657,432,000	
日特建設	11,000	653.00	7,183,000	
北陸電気工事	6,300	925.00	5,827,500	
ユアテック	20,700	893.00	18,485,100	
四電工	2,000	2,630.00	5,260,000	
中電工	16,700	2,351.00	39,261,700	
関電工	59,000	1,065.00	62,835,000	
きんでん	86,100	1,814.00	156,185,400	
東京エネシス	13,400	994.00	13,319,600	
トーエネック	3,600	3,105.00	11,178,000	
住友電設	9,000	1,828.00	16,452,000	
日本電設工業	22,100	2,362.00	52,200,200	
協和エクシオ	50,700	2,703.00	137,042,100	
新日本空調	11,200	1,757.00	19,678,400	
九電工	25,500	3,955.00	100,852,500	
三機工業	29,700	1,155.00	34,303,500	
日揮	111,900	1,690.00	189,111,000	
中外炉工業	3,900	2,067.00	8,061,300	
ヤマト	12,800	484.00	6,195,200	
太平電業	8,800	2,449.00	21,551,200	
高砂熱学工業	33,000	1,808.00	59,664,000	
三晃金属工業	1,800	2,852.00	5,133,600	
朝日工業社	2,900	3,160.00	9,164,000	
明星工業	23,400	735.00	17,199,000	
大氣社	17,800	3,020.00	53,756,000	
ダイダン	8,900	2,527.00	22,490,300	
日比谷総合設備	12,400	1,812.00	22,468,800	
東芝プラントシステム	28,300	2,098.00	59,373,400	
ＯＳＪＢホールディングス	57,200	300.00	17,160,000	

東洋エンジニアリング	10,100	711.00	7,181,100	
新興プランテック	23,300	1,199.00	27,936,700	
日本製粉	38,500	1,882.00	72,457,000	
日清製粉グループ本社	131,100	2,239.00	293,532,900	
日東富士製粉	800	5,500.00	4,400,000	
昭和産業	10,700	2,980.00	31,886,000	
鳥越製粉	10,300	807.00	8,312,100	
中部飼料	14,200	1,213.00	17,224,600	
フィード・ワン	77,900	180.00	14,022,000	
東洋精糖	1,800	1,017.00	1,830,600	
日本甜菜製糖	6,600	1,792.00	11,827,200	
三井製糖	9,200	2,971.00	27,333,200	
塩水港精糖	12,600	223.00	2,809,800	
日新製糖	5,500	2,105.00	11,577,500	
森永製菓	29,200	4,675.00	136,510,000	
中村屋	3,000	4,220.00	12,660,000	
江崎グリコ	34,900	5,370.00	187,413,000	
名糖産業	5,600	1,293.00	7,240,800	
井村屋グループ	4,900	2,485.00	12,176,500	
不二家	6,500	2,309.00	15,008,500	
山崎製パン	94,900	2,176.00	206,502,400	
第一屋製パン	2,000	1,046.00	2,092,000	
モロゾフ	2,000	5,080.00	10,160,000	
亀田製菓	7,200	4,935.00	35,532,000	
寿スピリッツ	12,300	4,290.00	52,767,000	
カルビー	52,900	3,500.00	185,150,000	
森永乳業	23,200	3,225.00	74,820,000	
六甲バター	8,500	2,067.00	17,569,500	
ヤクルト本社	86,000	7,570.00	651,020,000	
明治ホールディングス	82,200	8,590.00	706,098,000	
雪印メグミルク	27,900	2,924.00	81,579,600	
プリマハム	16,300	2,078.00	33,871,400	
日本ハム	50,200	4,555.00	228,661,000	
林兼産業	3,800	595.00	2,261,000	
丸大食品	12,400	1,844.00	22,865,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	10,400	3,770.00	39,208,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	74,700	705.00	52,663,500	
サッポロホールディングス	42,400	2,525.00	107,060,000	
アサヒグループホールディングス	243,000	4,442.00	1,079,406,000	
キリンホールディングス	524,900	2,517.50	1,321,435,750	
宝ホールディングス	86,900	1,381.00	120,008,900	
オエノンホールディングス	33,000	351.00	11,583,000	

養命酒製造	3,600	2,082.00	7,495,200	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	88,800	3,350.00	297,480,000	
サントリー食品インターナショナル	77,600	4,880.00	378,688,000	
ダイドーグループホールディングス	6,500	5,450.00	35,425,000	
伊藤園	38,400	4,930.00	189,312,000	
キーコーヒー	11,400	2,023.00	23,062,200	
ユニカフェ	3,500	1,051.00	3,678,500	
ジャパンフーズ	1,600	1,212.00	1,939,200	
日清オイリオグループ	14,900	3,240.00	48,276,000	
不二製油グループ本社	28,300	3,525.00	99,757,500	
かどや製油	1,300	5,460.00	7,098,000	
Ｊ－オイルミルズ	6,000	3,870.00	23,220,000	
キッコーマン	76,600	5,850.00	448,110,000	
味の素	256,300	1,911.00	489,789,300	
キユーピー	64,600	2,521.00	162,856,600	
ハウス食品グループ本社	44,300	4,000.00	177,200,000	
カゴメ	46,500	2,969.00	138,058,500	
焼津水産化学工業	5,600	1,052.00	5,891,200	
アリアケジャパン	10,600	6,930.00	73,458,000	
ピエトロ	1,500	1,640.00	2,460,000	
エバラ食品工業	2,800	2,143.00	6,000,400	
ニチレイ	60,300	2,964.00	178,729,200	
東洋水産	59,700	3,900.00	232,830,000	
イートアンド	4,000	1,590.00	6,360,000	
大冷	1,300	1,707.00	2,219,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,100	482.00	1,494,200	
日清食品ホールディングス	49,300	6,840.00	337,212,000	
永谷園ホールディングス	6,200	2,522.00	15,636,400	
一正蒲鉾	4,500	1,091.00	4,909,500	
フジッコ	12,600	2,393.00	30,151,800	
ロック・フィールド	12,500	1,626.00	20,325,000	
日本たばこ産業	670,100	2,753.00	1,844,785,300	
ケンコーマヨネーズ	6,500	2,028.00	13,182,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,600	1,932.00	14,683,200	
なとり	6,500	1,662.00	10,803,000	
イフジ産業	2,000	654.00	1,308,000	
ピックルスコーポレーション	2,800	2,171.00	6,078,800	
北の達人コーポレーション	45,600	437.00	19,927,200	
ユーグレナ	49,200	620.00	30,504,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,097.00	4,826,800	
理研ビタミン	5,500	3,500.00	19,250,000	
片倉工業	14,000	1,175.00	16,450,000	

グンゼ	7,900	4,735.00	37,406,500	
東洋紡	48,000	1,598.00	76,704,000	
ユニチカ	33,400	511.00	17,067,400	
富士紡ホールディングス	5,900	2,621.00	15,463,900	
倉敷紡績	10,800	2,483.00	26,816,400	
シキボウ	5,900	1,044.00	6,159,600	
日本毛織	37,400	863.00	32,276,200	
トーア紡コーポレーション	4,800	470.00	2,256,000	
ダイドーリミテッド	13,800	350.00	4,830,000	
帝国繊維	12,700	2,290.00	29,083,000	
帝人	92,400	1,865.00	172,326,000	
東レ	878,600	808.10	709,996,660	
サカイオーベックス	2,800	1,907.00	5,339,600	
住江織物	3,000	2,584.00	7,752,000	
日本フエルト	6,600	450.00	2,970,000	
イチカワ	1,700	1,370.00	2,329,000	
日東製網	1,300	1,284.00	1,669,200	
アツギ	9,400	959.00	9,014,600	
ダイニック	4,600	757.00	3,482,200	
セーレン	27,900	1,754.00	48,936,600	
ソトー	4,600	958.00	4,406,800	
東海染工	1,600	982.00	1,571,200	
小松マテーレ	18,700	785.00	14,679,500	
ワコールホールディングス	33,000	2,899.00	95,667,000	
ホギメディカル	14,100	3,645.00	51,394,500	
レナウン	32,700	102.00	3,335,400	
クラウディアホールディングス	2,900	475.00	1,377,500	
ＴＳＩホールディングス	41,900	736.00	30,838,400	
マツオカコーポレーション	3,600	2,789.00	10,040,400	
ワールド	11,200	1,599.00	17,908,800	
三陽商会	6,800	1,779.00	12,097,200	
ナイガイ	4,300	522.00	2,244,600	
オンワードホールディングス	68,100	640.00	43,584,000	
ルックホールディングス	4,200	1,090.00	4,578,000	
ゴールドウイン	10,300	10,600.00	109,180,000	
デサント	27,700	1,904.00	52,740,800	
キング	6,200	480.00	2,976,000	
ヤマトインターナショナル	7,600	417.00	3,169,200	
特種東海製紙	7,200	4,075.00	29,340,000	
王子ホールディングス	509,800	622.00	317,095,600	
日本製紙	54,200	2,158.00	116,963,600	
三菱製紙	18,400	585.00	10,764,000	

北越コーポレーション	75,100	580.00	43,558,000	
中越パルプ工業	4,800	1,360.00	6,528,000	
巴川製紙所	3,700	1,092.00	4,040,400	
大王製紙	55,200	1,360.00	75,072,000	
阿波製紙	2,900	462.00	1,339,800	
レンゴー	116,800	940.00	109,792,000	
トーモク	6,900	1,655.00	11,419,500	
ザ・パック	8,600	3,025.00	26,015,000	
クラレ	191,100	1,723.00	329,265,300	
旭化成	805,600	1,156.00	931,273,600	
共和レザー	7,100	783.00	5,559,300	
昭和電工	75,200	3,630.00	272,976,000	
住友化学	891,300	583.00	519,627,900	
住友精化	5,500	4,460.00	24,530,000	
日産化学	69,500	5,950.00	413,525,000	
ラサ工業	4,000	1,395.00	5,580,000	
クレハ	10,500	6,590.00	69,195,000	
多木化学	3,300	5,060.00	16,698,000	
テイカ	9,200	1,831.00	16,845,200	
石原産業	21,700	1,182.00	25,649,400	
片倉コープアグリ	3,300	1,165.00	3,844,500	
日東エフシー	7,100	733.00	5,204,300	
日本曹達	17,900	2,890.00	51,731,000	
東ソー	175,000	1,507.00	263,725,000	
トクヤマ	32,600	2,580.00	84,108,000	
セントラル硝子	24,700	2,248.00	55,525,600	
東亞合成	71,100	1,255.00	89,230,500	
大阪ソーダ	12,200	2,513.00	30,658,600	
関東電化工業	26,900	851.00	22,891,900	
デンカ	44,500	3,460.00	153,970,000	
信越化学工業	199,500	8,631.00	1,721,884,500	
日本カーバイド工業	3,800	1,705.00	6,479,000	
堺化学工業	7,500	2,212.00	16,590,000	
第一稀元素化学工業	9,200	876.00	8,059,200	
エア・ウォーター	92,700	1,807.00	167,508,900	
大陽日酸	93,300	1,789.00	166,913,700	
日本化学工業	3,800	2,350.00	8,930,000	
東邦アセチレン	1,700	1,389.00	2,361,300	
日本パーカライジング	61,900	1,313.00	81,274,700	
高圧ガス工業	18,000	767.00	13,806,000	
チタン工業	1,400	2,447.00	3,425,800	
四国化成工業	19,000	1,090.00	20,710,000	

戸田工業	2,400	2,288.00	5,491,200	
ステラ　ケミファ	6,600	2,879.00	19,001,400	
保土谷化学工業	3,900	2,114.00	8,244,600	
日本触媒	19,000	7,420.00	140,980,000	
大日精化工業	9,400	2,848.00	26,771,200	
カネカ	30,200	4,305.00	130,011,000	
三菱瓦斯化学	116,500	1,764.00	205,506,000	
三井化学	102,800	2,687.00	276,223,600	
ＪＳＲ	113,600	1,747.00	198,459,200	
東京応化工業	19,400	3,085.00	59,849,000	
大阪有機化学工業	10,500	1,179.00	12,379,500	
三菱ケミカルホールディングス	757,000	917.70	694,698,900	
ＫＨネオケム	17,300	2,541.00	43,959,300	
ダイセル	175,900	1,146.00	201,581,400	
住友ベークライト	19,600	4,000.00	78,400,000	
積水化学工業	247,500	1,589.00	393,277,500	
日本ゼオン	102,100	1,091.00	111,391,100	
アイカ工業	34,000	3,770.00	128,180,000	
宇部興産	57,200	2,407.00	137,680,400	
積水樹脂	18,700	1,949.00	36,446,300	
タキロンシーアイ	24,500	585.00	14,332,500	
旭有機材	7,800	1,561.00	12,175,800	
日立化成	52,400	1,716.00	89,918,400	
ニチバン	6,000	2,072.00	12,432,000	
リケンテクノス	30,900	450.00	13,905,000	
大倉工業	5,800	1,765.00	10,237,000	
積水化成品工業	16,900	966.00	16,325,400	
群栄化学工業	2,900	2,860.00	8,294,000	
タイガースポリマー	6,000	610.00	3,660,000	
ミライアル	3,300	1,034.00	3,412,200	
ダイキアクシス	4,100	947.00	3,882,700	
ダイキョーニシカワ	23,900	1,181.00	28,225,900	
竹本容器	4,100	1,575.00	6,457,500	
森六ホールディングス	6,100	2,579.00	15,731,900	
日本化薬	72,100	1,397.00	100,723,700	
カーリットホールディングス	12,100	754.00	9,123,400	
日本精化	9,100	1,101.00	10,019,100	
扶桑化学工業	11,500	2,104.00	24,196,000	
トリケミカル研究所	2,500	4,435.00	11,087,500	
ＡＤＥＫＡ	55,800	1,777.00	99,156,600	
日油	43,700	3,535.00	154,479,500	
ハリマ化成グループ	9,400	971.00	9,127,400	

花王	280,700	7,634.00	2,142,863,800	
第一工業製薬	4,200	2,625.00	11,025,000	
石原ケミカル	2,900	1,634.00	4,738,600	
日華化学	3,900	962.00	3,751,800	
ニイタカ	1,800	1,448.00	2,606,400	
三洋化成工業	7,600	5,070.00	38,532,000	
有機合成薬品工業	8,900	208.00	1,851,200	
大日本塗料	12,800	1,002.00	12,825,600	
日本ペイントホールディングス	93,400	3,580.00	334,372,000	
関西ペイント	127,200	1,909.00	242,824,800	
神東塗料	9,200	167.00	1,536,400	
中国塗料	37,200	943.00	35,079,600	
日本特殊塗料	8,500	1,341.00	11,398,500	
藤倉化成	15,300	577.00	8,828,100	
太陽ホールディングス	9,300	3,350.00	31,155,000	
ＤＩＣ	51,200	3,510.00	179,712,000	
サカタインクス	24,700	1,230.00	30,381,000	
東洋インキＳＣホールディングス	23,900	2,525.00	60,347,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,800	990.00	8,712,000	
富士フイルムホールディングス	240,200	4,578.00	1,099,635,600	
資生堂	229,700	6,328.00	1,453,541,600	
ライオン	161,100	2,157.00	347,492,700	
高砂香料工業	8,000	3,520.00	28,160,000	
マンダム	26,000	2,949.00	76,674,000	
ミルボン	14,300	4,555.00	65,136,500	
ファンケル	51,500	2,339.00	120,458,500	
コーセー	19,600	15,290.00	299,684,000	
コタ	5,500	1,410.00	7,755,000	
シーボン	1,400	2,700.00	3,780,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	49,400	2,981.00	147,261,400	
ノエビアホールディングス	7,400	4,570.00	33,818,000	
アジュバンコスメジャパン	2,600	927.00	2,410,200	
エステー	8,300	1,852.00	15,371,600	
アグロ　カネショウ	4,700	2,060.00	9,682,000	
コニシ	20,500	1,666.00	34,153,000	
長谷川香料	13,800	1,588.00	21,914,400	
星光ＰＭＣ	7,800	800.00	6,240,000	
小林製薬	32,400	7,040.00	228,096,000	
荒川化学工業	10,400	1,342.00	13,956,800	
メック	8,000	1,103.00	8,824,000	
日本高純度化学	3,200	2,273.00	7,273,600	
タカラバイオ	30,300	2,637.00	79,901,100	

ＪＣＵ	15,000	1,517.00	22,755,000	
新田ゼラチン	7,300	679.00	4,956,700	
ＯＡＴアグリオ	1,600	2,007.00	3,211,200	
デクセリアルズ	29,800	849.00	25,300,200	
アース製薬	8,700	5,170.00	44,979,000	
北興化学工業	11,800	556.00	6,560,800	
大成ラミック	3,800	2,934.00	11,149,200	
クミアイ化学工業	47,800	683.00	32,647,400	
日本農薬	27,700	507.00	14,043,900	
アキレス	8,400	2,046.00	17,186,400	
有沢製作所	18,200	796.00	14,487,200	
日東電工	87,300	5,861.00	511,665,300	
レック	12,400	1,610.00	19,964,000	
三光合成	9,000	350.00	3,150,000	
きもと	19,900	186.00	3,701,400	
藤森工業	10,400	2,937.00	30,544,800	
前澤化成工業	7,900	1,050.00	8,295,000	
ウェーブロックホールディングス	2,500	747.00	1,867,500	
ＪＳＰ	6,800	2,201.00	14,966,800	
エフピコ	9,500	6,330.00	60,135,000	
天馬	8,000	1,758.00	14,064,000	
信越ポリマー	20,800	714.00	14,851,200	
東リ	29,000	257.00	7,453,000	
ニフコ	46,300	2,666.00	123,435,800	
バルカー	9,400	2,316.00	21,770,400	
ユニ・チャーム	245,100	3,404.00	834,320,400	
協和発酵キリン	144,900	2,106.00	305,159,400	
武田薬品工業	456,400	4,437.00	2,025,046,800	
アステラス製薬	1,066,000	1,558.50	1,661,361,000	
大日本住友製薬	85,700	3,820.00	327,374,000	
塩野義製薬	151,300	6,590.00	997,067,000	
田辺三菱製薬	120,900	1,627.00	196,704,300	
わかもと製薬	13,800	291.00	4,015,800	
あすか製薬	14,300	1,160.00	16,588,000	
日本新薬	30,300	6,510.00	197,253,000	
ビオフェルミン製薬	2,000	2,484.00	4,968,000	
中外製薬	120,500	6,620.00	797,710,000	
科研製薬	20,900	5,300.00	110,770,000	
エーザイ	138,400	8,771.00	1,213,906,400	
ロート製薬	59,300	3,010.00	178,493,000	
小野薬品工業	273,000	2,382.00	650,286,000	
久光製薬	34,200	5,570.00	190,494,000	

持田製薬	8,800	9,840.00	86,592,000	
参天製薬	219,200	1,525.00	334,280,000	
扶桑薬品工業	4,100	2,793.00	11,451,300	
日本ケミファ	1,500	3,210.00	4,815,000	
ツムラ	35,800	3,175.00	113,665,000	
日医工	29,700	1,711.00	50,816,700	
キッセイ薬品工業	20,500	2,891.00	59,265,500	
生化学工業	22,400	1,297.00	29,052,800	
栄研化学	20,300	2,433.00	49,389,900	
日水製薬	4,900	1,157.00	5,669,300	
鳥居薬品	6,200	2,486.00	15,413,200	
ＪＣＲファーマ	8,100	5,850.00	47,385,000	
東和薬品	5,500	8,040.00	44,220,000	
富士製薬工業	7,900	1,813.00	14,322,700	
沢井製薬	23,700	5,750.00	136,275,000	
ゼリア新薬工業	22,900	1,954.00	44,746,600	
第一三共	330,900	3,814.00	1,262,052,600	
キョーリン製薬ホールディングス	25,500	2,344.00	59,772,000	
大幸薬品	5,100	1,815.00	9,256,500	
ダイト	6,700	2,960.00	19,832,000	
大塚ホールディングス	220,300	4,500.00	991,350,000	
大正製薬ホールディングス	25,900	11,430.00	296,037,000	
ペプチドリーム	53,200	4,370.00	232,484,000	
日本コークス工業	97,700	96.00	9,379,200	
昭和シェル石油	107,000	1,688.00	180,616,000	
ニチレキ	14,800	996.00	14,740,800	
ユシロ化学工業	6,000	1,197.00	7,182,000	
ビーピー・カストロール	4,100	1,315.00	5,391,500	
富士石油	28,100	317.00	8,907,700	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,200	1,554.00	6,526,800	
出光興産	89,600	3,990.00	357,504,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,944,700	606.50	1,179,460,550	
コスモエネルギーホールディングス	33,500	2,501.00	83,783,500	
横浜ゴム	66,900	2,268.00	151,729,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	59,300	1,481.00	87,823,300	
ブリヂストン	355,400	4,268.00	1,516,847,200	
住友ゴム工業	103,900	1,438.00	149,408,200	
藤倉ゴム工業	10,100	455.00	4,595,500	
オカモト	8,100	5,720.00	46,332,000	
フコク	5,100	899.00	4,584,900	
ニッタ	13,000	3,615.00	46,995,000	
住友理工	22,400	1,039.00	23,273,600	

三ツ星ベルト	15,200	2,088.00	31,737,600	
バンドー化学	22,000	1,108.00	24,376,000	
日東紡績	17,200	1,852.00	31,854,400	
ＡＧＣ	114,300	3,645.00	416,623,500	
日本板硝子	53,000	966.00	51,198,000	
石塚硝子	1,700	1,980.00	3,366,000	
日本山村硝子	4,800	1,567.00	7,521,600	
日本電気硝子	50,000	2,955.00	147,750,000	
オハラ	4,600	1,700.00	7,820,000	
住友大阪セメント	23,400	4,810.00	112,554,000	
太平洋セメント	73,000	3,600.00	262,800,000	
日本ヒューム	11,600	805.00	9,338,000	
日本コンクリート工業	25,000	263.00	6,575,000	
三谷セキサン	5,400	2,690.00	14,526,000	
アジアパイルホールディングス	16,400	601.00	9,856,400	
東海カーボン	105,000	1,474.00	154,770,000	
日本カーボン	5,500	4,360.00	23,980,000	
東洋炭素	6,800	2,254.00	15,327,200	
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,200.00	35,880,000	
ＴＯＴＯ	88,900	4,070.00	361,823,000	
日本碍子	141,100	1,644.00	231,968,400	
日本特殊陶業	97,500	2,166.00	211,185,000	
ＭＡＲＵＷＡ	4,000	6,180.00	24,720,000	
品川リフラクトリーズ	3,100	3,905.00	12,105,500	
黒崎播磨	2,300	6,780.00	15,594,000	
ヨータイ	10,200	638.00	6,507,600	
イソライト工業	6,000	533.00	3,198,000	
東京窯業	14,800	385.00	5,698,000	
ニッカトー	5,300	909.00	4,817,700	
フジミインコーポレーテッド	10,300	2,217.00	22,835,100	
クニミネ工業	3,900	838.00	3,268,200	
エーアンドエーマテリアル	2,200	988.00	2,173,600	
ニチアス	31,700	1,947.00	61,719,900	
ニチハ	16,100	2,686.00	43,244,600	
新日鐵住金	531,200	2,012.00	1,068,774,400	
神戸製鋼所	209,300	861.00	180,207,300	
中山製鋼所	15,800	510.00	8,058,000	
合同製鐵	5,500	1,730.00	9,515,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	308,800	1,911.00	590,116,800	
東京製鐵	61,200	908.00	55,569,600	
共英製鋼	12,900	1,788.00	23,065,200	
大和工業	24,300	2,707.00	65,780,100	

東京鐵鋼	4,700	1,201.00	5,644,700	
大阪製鐵	7,600	1,848.00	14,044,800	
淀川製鋼所	15,400	2,250.00	34,650,000	
丸一鋼管	40,500	3,420.00	138,510,000	
モリ工業	3,400	2,293.00	7,796,200	
大同特殊鋼	18,700	4,660.00	87,142,000	
日本高周波鋼業	4,200	544.00	2,284,800	
日本冶金工業	94,600	256.00	24,217,600	
山陽特殊製鋼	14,400	2,329.00	33,537,600	
愛知製鋼	6,400	3,585.00	22,944,000	
日立金属	123,200	1,244.00	153,260,800	
日本金属	2,600	1,171.00	3,044,600	
大平洋金属	7,700	2,838.00	21,852,600	
新日本電工	68,500	225.00	15,412,500	
栗本鐵工所	5,800	1,405.00	8,149,000	
虹技	1,700	1,351.00	2,296,700	
日本鋳鉄管	1,200	985.00	1,182,000	
三菱製鋼	8,500	1,694.00	14,399,000	
日亜鋼業	16,700	298.00	4,976,600	
日本精線	1,600	3,555.00	5,688,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,400	506.00	1,214,400	
シンニッタン	17,800	330.00	5,874,000	
新家工業	2,600	1,563.00	4,063,800	
大紀アルミニウム工業所	19,000	594.00	11,286,000	
日本軽金属ホールディングス	312,100	229.00	71,470,900	
三井金属鉱業	30,900	2,537.00	78,393,300	
東邦亜鉛	6,400	3,500.00	22,400,000	
三菱マテリアル	75,600	3,140.00	237,384,000	
住友金属鉱山	156,600	3,211.00	502,842,600	
ＤＯＷＡホールディングス	26,700	3,410.00	91,047,000	
古河機械金属	19,000	1,318.00	25,042,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,300	1,654.00	21,998,200	
東邦チタニウム	20,600	992.00	20,435,200	
ＵＡＣＪ	17,400	2,338.00	40,681,200	
ＣＫサンエツ	2,200	2,469.00	5,431,800	
古河電気工業	33,000	3,150.00	103,950,000	
住友電気工業	427,600	1,533.50	655,724,600	
フジクラ	138,300	467.00	64,586,100	
昭和電線ホールディングス	13,300	627.00	8,339,100	
東京特殊電線	1,500	1,951.00	2,926,500	
タツタ電線	22,900	505.00	11,564,500	
カナレ電気	2,000	1,738.00	3,476,000	

平河ヒューテック	4,900	1,104.00	5,409,600	
リョービ	14,100	2,716.00	38,295,600	
アーレスティ	14,200	657.00	9,329,400	
アサヒホールディングス	21,500	2,303.00	49,514,500	
稲葉製作所	6,500	1,280.00	8,320,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,500	1,954.00	6,839,000	
トーカロ	29,500	921.00	27,169,500	
アルファＣｏ	4,000	1,273.00	5,092,000	
ＳＵＭＣＯ	126,400	1,300.00	164,320,000	
川田テクノロジーズ	2,500	7,040.00	17,600,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,300	2,567.00	5,904,100	
東洋製罐グループホールディングス	72,800	2,631.00	191,536,800	
ホッカンホールディングス	5,800	1,740.00	10,092,000	
コロナ	6,300	1,072.00	6,753,600	
横河ブリッジホールディングス	21,300	1,767.00	37,637,100	
駒井ハルテック	2,200	1,888.00	4,153,600	
高田機工	1,100	2,716.00	2,987,600	
三和ホールディングス	118,100	1,194.00	141,011,400	
文化シヤッター	33,700	730.00	24,601,000	
三協立山	15,900	1,392.00	22,132,800	
アルインコ	9,100	958.00	8,717,800	
東洋シヤッター	2,800	623.00	1,744,400	
ＬＩＸＩＬグループ	168,700	1,517.00	255,917,900	
日本フイルコン	8,800	556.00	4,892,800	
ノーリツ	25,500	1,554.00	39,627,000	
長府製作所	11,600	2,125.00	24,650,000	
リンナイ	20,400	7,160.00	146,064,000	
ダイニチ工業	6,200	646.00	4,005,200	
日東精工	15,800	498.00	7,868,400	
三洋工業	1,500	1,914.00	2,871,000	
岡部	23,200	897.00	20,810,400	
ジーテクト	12,600	1,546.00	19,479,600	
東プレ	21,300	2,398.00	51,077,400	
高周波熱錬	22,000	849.00	18,678,000	
東京製綱	7,000	1,011.00	7,077,000	
サンコール	6,500	614.00	3,991,000	
モリテック　スチール	9,000	423.00	3,807,000	
パイオラックス	18,300	2,310.00	42,273,000	
エイチワン	11,200	1,068.00	11,961,600	
日本発條	113,900	1,006.00	114,583,400	
中央発條	1,400	3,180.00	4,452,000	
アドバネクス	1,500	1,608.00	2,412,000	

立川ブラインド工業	5,100	1,046.00	5,334,600	
三益半導体工業	8,900	1,298.00	11,552,200	
日本ドライケミカル	3,100	1,142.00	3,540,200	
日本製鋼所	34,800	1,936.00	67,372,800	
三浦工業	49,600	2,666.00	132,233,600	
タクマ	41,900	1,406.00	58,911,400	
ツガミ	26,100	682.00	17,800,200	
オークマ	14,600	5,540.00	80,884,000	
東芝機械	13,000	2,173.00	28,249,000	
アマダホールディングス	176,700	1,087.00	192,072,900	
アイダエンジニアリング	32,100	772.00	24,781,200	
滝澤鉄工所	3,500	1,477.00	5,169,500	
ＦＵＪＩ	34,200	1,378.00	47,127,600	
牧野フライス製作所	13,500	4,240.00	57,240,000	
オーエスジー	56,400	2,153.00	121,429,200	
ダイジェット工業	1,400	1,814.00	2,539,600	
旭ダイヤモンド工業	30,400	676.00	20,550,400	
DMG森精機	72,500	1,429.00	103,602,500	
ソディック	24,900	805.00	20,044,500	
ディスコ	15,500	14,670.00	227,385,000	
日東工器	6,300	2,163.00	13,626,900	
日進工具	3,400	2,400.00	8,160,000	
パンチ工業	7,900	536.00	4,234,400	
冨士ダイス	5,000	639.00	3,195,000	
豊和工業	6,600	780.00	5,148,000	
ＯＫＫ	5,000	820.00	4,100,000	
東洋機械金属	8,200	588.00	4,821,600	
島精機製作所	15,800	3,615.00	57,117,000	
オプトラン	11,100	1,747.00	19,391,700	
ＮＣホールディングス	3,700	548.00	2,027,600	
フリュー	9,100	1,003.00	9,127,300	
ヤマシンフィルタ	19,900	689.00	13,711,100	
日阪製作所	14,100	826.00	11,646,600	
やまびこ	22,200	1,104.00	24,508,800	
平田機工	5,400	6,000.00	32,400,000	
ペガサスミシン製造	10,700	718.00	7,682,600	
マルマエ	3,100	702.00	2,176,200	
タツモ	3,600	741.00	2,667,600	
ナブテスコ	63,000	2,725.00	171,675,000	
三井海洋開発	12,100	2,562.00	31,000,200	
レオン自動機	11,200	1,370.00	15,344,000	
ＳＭＣ	33,900	35,980.00	1,219,722,000	

新川	5,900	366.00	2,159,400	
ホソカワミクロン	4,000	4,175.00	16,700,000	
ユニオンツール	5,000	3,060.00	15,300,000	
オイレス工業	16,000	1,835.00	29,360,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,300	3,700.00	12,210,000	
サトーホールディングス	13,800	2,715.00	37,467,000	
技研製作所	7,900	3,240.00	25,596,000	
日本エアーテック	3,600	594.00	2,138,400	
カワタ	2,300	1,373.00	3,157,900	
日精樹脂工業	9,900	959.00	9,494,100	
オカダアイヨン	3,900	1,513.00	5,900,700	
ワイエイシイホールディングス	4,600	645.00	2,967,000	
小松製作所	523,600	2,774.50	1,452,728,200	
住友重機械工業	66,200	3,720.00	246,264,000	
日立建機	46,400	2,764.00	128,249,600	
日工	3,300	2,314.00	7,636,200	
巴工業	4,900	2,491.00	12,205,900	
井関農機	11,700	1,645.00	19,246,500	
ＴＯＷＡ	9,900	676.00	6,692,400	
丸山製作所	2,700	1,340.00	3,618,000	
北川鉄工所	5,300	2,262.00	11,988,600	
ローツェ	5,100	1,604.00	8,180,400	
タカキタ	4,000	656.00	2,624,000	
クボタ	620,300	1,725.50	1,070,327,650	
荏原実業	3,500	2,150.00	7,525,000	
三菱化工機	4,200	1,500.00	6,300,000	
月島機械	23,100	1,422.00	32,848,200	
帝国電機製作所	8,100	1,209.00	9,792,900	
新東工業	27,700	951.00	26,342,700	
澁谷工業	10,200	3,695.00	37,689,000	
アイチ　コーポレーション	20,400	597.00	12,178,800	
小森コーポレーション	31,500	1,167.00	36,760,500	
鶴見製作所	9,100	1,952.00	17,763,200	
住友精密工業	1,900	3,180.00	6,042,000	
酒井重工業	2,300	2,366.00	5,441,800	
荏原製作所	51,300	2,880.00	147,744,000	
石井鐵工所	1,900	1,835.00	3,486,500	
酉島製作所	12,100	955.00	11,555,500	
北越工業	11,900	1,078.00	12,828,200	
ダイキン工業	157,800	11,840.00	1,868,352,000	
オルガノ	4,300	2,538.00	10,913,400	
トーヨーカネツ	4,500	2,425.00	10,912,500	

栗田工業	62,700	2,717.00	170,355,900	
椿本チエイン	15,200	4,030.00	61,256,000	
大同工業	5,800	932.00	5,405,600	
木村化工機	10,300	363.00	3,738,900	
アネスト岩田	18,000	959.00	17,262,000	
ダイフク	63,700	5,270.00	335,699,000	
サムコ	3,200	954.00	3,052,800	
加藤製作所	6,000	2,737.00	16,422,000	
油研工業	2,100	1,936.00	4,065,600	
タダノ	56,000	1,220.00	68,320,000	
フジテック	42,000	1,204.00	50,568,000	
ＣＫＤ	32,200	1,039.00	33,455,800	
キトー	8,700	1,612.00	14,024,400	
平和	32,200	2,267.00	72,997,400	
理想科学工業	10,200	1,702.00	17,360,400	
ＳＡＮＫＹＯ	28,900	4,200.00	121,380,000	
日本金銭機械	12,800	991.00	12,684,800	
マースグループホールディングス	7,300	2,250.00	16,425,000	
福島工業	7,100	3,790.00	26,909,000	
オーイズミ	4,800	370.00	1,776,000	
ダイコク電機	5,300	1,550.00	8,215,000	
竹内製作所	19,300	1,970.00	38,021,000	
アマノ	33,000	2,270.00	74,910,000	
ＪＵＫＩ	16,100	1,210.00	19,481,000	
サンデンホールディングス	14,100	849.00	11,970,900	
蛇の目ミシン工業	10,500	503.00	5,281,500	
マックス	17,800	1,419.00	25,258,200	
グローリー	32,000	2,723.00	87,136,000	
新晃工業	10,700	1,467.00	15,696,900	
大和冷機工業	16,700	1,181.00	19,722,700	
セガサミーホールディングス	114,700	1,575.00	180,652,500	
日本ピストンリング	4,200	1,784.00	7,492,800	
リケン	5,400	4,790.00	25,866,000	
ＴＰＲ	15,500	2,336.00	36,208,000	
ツバキ・ナカシマ	17,500	1,749.00	30,607,500	
ホシザキ	33,800	8,290.00	280,202,000	
大豊工業	9,400	998.00	9,381,200	
日本精工	237,500	1,047.00	248,662,500	
ＮＴＮ	248,500	354.00	87,969,000	
ジェイテクト	110,900	1,390.00	154,151,000	
不二越	10,700	4,225.00	45,207,500	
日本トムソン	34,300	531.00	18,213,300	

ＴＨＫ	72,100	2,397.00	172,823,700	
ユーシン精機	9,000	911.00	8,199,000	
前澤給装工業	4,500	1,838.00	8,271,000	
イーグル工業	14,300	1,326.00	18,961,800	
前澤工業	8,500	363.00	3,085,500	
日本ピラー工業	11,700	1,344.00	15,724,800	
キッツ	46,800	914.00	42,775,200	
マキタ	140,700	4,135.00	581,794,500	
日立造船	92,400	370.00	34,188,000	
三菱重工業	193,800	4,236.00	820,936,800	
ＩＨＩ	88,900	3,355.00	298,259,500	
スター精密	19,900	1,583.00	31,501,700	
日清紡ホールディングス	64,600	932.00	60,207,200	
イビデン	71,000	1,543.00	109,553,000	
コニカミノルタ	252,900	1,047.00	264,786,300	
ブラザー工業	150,800	1,817.00	274,003,600	
ミネベアミツミ	214,800	1,657.00	355,923,600	
日立製作所	520,600	3,475.00	1,809,085,000	
三菱電機	1,156,400	1,354.00	1,565,765,600	
富士電機	75,100	3,300.00	247,830,000	
東洋電機製造	4,800	1,331.00	6,388,800	
安川電機	134,100	3,005.00	402,970,500	
シンフォニアテクノロジー	16,300	1,368.00	22,298,400	
明電舎	23,100	1,426.00	32,940,600	
オリジン電気	3,300	1,742.00	5,748,600	
山洋電気	5,700	4,120.00	23,484,000	
デンヨー	10,900	1,414.00	15,412,600	
東芝テック	14,600	2,657.00	38,792,200	
芝浦メカトロニクス	2,100	3,590.00	7,539,000	
マブチモーター	32,100	3,570.00	114,597,000	
日本電産	139,200	12,680.00	1,765,056,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,400	1,770.00	11,328,000	
トレックス・セミコンダクター	4,200	1,209.00	5,077,800	
東光高岳	6,100	1,396.00	8,515,600	
ダブル・スコープ	17,200	1,200.00	20,640,000	
ダイヘン	12,800	2,369.00	30,323,200	
ヤーマン	17,000	1,349.00	22,933,000	
ＪＶＣケンウッド	89,600	251.00	22,489,600	
ミマキエンジニアリング	10,700	800.00	8,560,000	
第一精工	5,100	1,205.00	6,145,500	
日新電機	27,500	879.00	24,172,500	
大崎電気工業	23,400	724.00	16,941,600	

オムロン	123,000	4,310.00	530,130,000	
日東工業	18,700	1,970.00	36,839,000	
ＩＤＥＣ	15,700	2,101.00	32,985,700	
不二電機工業	1,500	1,320.00	1,980,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	41,700	2,350.00	97,995,000	
サクサホールディングス	3,100	1,846.00	5,722,600	
メルコホールディングス	4,900	3,545.00	17,370,500	
テクノメディカ	1,800	2,082.00	3,747,600	
日本電気	149,700	3,610.00	540,417,000	
富士通	111,500	7,067.00	787,970,500	
沖電気工業	50,300	1,394.00	70,118,200	
岩崎通信機	5,400	789.00	4,260,600	
電気興業	6,200	2,396.00	14,855,200	
サンケン電気	13,700	2,232.00	30,578,400	
ナカヨ	2,500	1,399.00	3,497,500	
アイホン	6,700	1,643.00	11,008,100	
ルネサスエレクトロニクス	120,300	601.00	72,300,300	
セイコーエプソン	143,700	1,649.00	236,961,300	
ワコム	84,400	465.00	39,246,000	
アルバック	26,700	3,400.00	90,780,000	
アクセル	5,500	499.00	2,744,500	
ＥＩＺＯ	10,700	4,060.00	43,442,000	
日本信号	29,800	936.00	27,892,800	
京三製作所	25,600	437.00	11,187,200	
能美防災	15,500	1,880.00	29,140,000	
ホーチキ	7,600	1,115.00	8,474,000	
星和電機	5,500	391.00	2,150,500	
エレコム	10,700	2,904.00	31,072,800	
パナソニック	1,321,100	1,093.50	1,444,622,850	
シャープ	114,700	1,270.00	145,669,000	
アンリツ	74,600	1,596.00	119,061,600	
富士通ゼネラル	35,500	1,520.00	53,960,000	
ソニー	775,300	5,436.00	4,214,530,800	
ＴＤＫ	60,500	7,800.00	471,900,000	
帝国通信工業	5,400	1,171.00	6,323,400	
タムラ製作所	45,200	593.00	26,803,600	
アルプスアルパイン	120,500	2,206.00	265,823,000	
池上通信機	3,700	1,207.00	4,465,900	
日本電波工業	7,800	408.00	3,182,400	
鈴木	6,300	618.00	3,893,400	
日本トリム	2,200	5,910.00	13,002,000	
ローランド　ディー．ジー．	6,100	2,125.00	12,962,500	

フォスター電機	13,800	1,393.00	19,223,400	
クラリオン	10,300	2,488.00	25,626,400	
ＳＭＫ	3,400	2,277.00	7,741,800	
ヨコオ	8,500	1,387.00	11,789,500	
ホシデン	34,500	781.00	26,944,500	
ヒロセ電機	16,600	11,520.00	191,232,000	
日本航空電子工業	26,800	1,384.00	37,091,200	
ＴＯＡ	12,700	1,007.00	12,788,900	
マクセルホールディングス	25,100	1,532.00	38,453,200	
古野電気	15,200	927.00	14,090,400	
ユニデンホールディングス	3,600	2,111.00	7,599,600	
スミダコーポレーション	10,100	1,228.00	12,402,800	
アイコム	6,600	2,150.00	14,190,000	
リオン	5,500	1,751.00	9,630,500	
本多通信工業	10,500	499.00	5,239,500	
横河電機	115,900	1,962.00	227,395,800	
新電元工業	4,200	4,020.00	16,884,000	
アズビル	74,800	2,163.00	161,792,400	
東亜ディーケーケー	6,100	763.00	4,654,300	
日本光電工業	51,100	3,445.00	176,039,500	
チノー	4,300	1,229.00	5,284,700	
共和電業	13,000	367.00	4,771,000	
日本電子材料	5,100	642.00	3,274,200	
堀場製作所	23,000	5,080.00	116,840,000	
アドバンテスト	78,900	2,207.00	174,132,300	
小野測器	5,900	591.00	3,486,900	
エスペック	10,400	1,992.00	20,716,800	
キーエンス	56,800	54,660.00	3,104,688,000	
日置電機	6,100	3,580.00	21,838,000	
シスメックス	90,100	6,153.00	554,385,300	
日本マイクロニクス	19,100	726.00	13,866,600	
メガチップス	9,200	2,806.00	25,815,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,600	3,805.00	25,113,000	
澤藤電機	1,600	1,474.00	2,358,400	
原田工業	3,900	835.00	3,256,500	
コーセル	16,400	973.00	15,957,200	
イリソ電子工業	10,700	4,525.00	48,417,500	
オプテックスグループ	20,500	1,893.00	38,806,500	
千代田インテグレ	5,000	1,990.00	9,950,000	
アイ・オー・データ機器	5,100	1,163.00	5,931,300	
レーザーテック	23,800	3,100.00	73,780,000	
スタンレー電気	81,900	3,195.00	261,670,500	

岩崎電気	4,700	1,358.00	6,382,600	
ウシオ電機	70,400	1,236.00	87,014,400	
岡谷電機産業	9,100	381.00	3,467,100	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,100	662.00	7,348,200	
エノモト	2,800	828.00	2,318,400	
日本セラミック	11,900	2,501.00	29,761,900	
遠藤照明	6,300	716.00	4,510,800	
古河電池	8,700	698.00	6,072,600	
双信電機	6,500	372.00	2,418,000	
山一電機	8,700	1,216.00	10,579,200	
図研	7,700	1,520.00	11,704,000	
日本電子	23,000	1,883.00	43,309,000	
カシオ計算機	102,500	1,391.00	142,577,500	
ファナック	109,900	18,575.00	2,041,392,500	
日本シイエムケイ	27,000	651.00	17,577,000	
エンプラス	5,300	3,060.00	16,218,000	
大真空	4,600	953.00	4,383,800	
ローム	55,900	7,050.00	394,095,000	
浜松ホトニクス	83,000	3,695.00	306,685,000	
三井ハイテック	13,100	900.00	11,790,000	
新光電気工業	39,300	722.00	28,374,600	
京セラ	176,300	5,961.00	1,050,924,300	
太陽誘電	51,600	1,637.00	84,469,200	
村田製作所	121,300	14,185.00	1,720,640,500	
ユーシン	15,800	980.00	15,484,000	
双葉電子工業	19,100	1,685.00	32,183,500	
北陸電気工業	4,700	991.00	4,657,700	
ニチコン	36,800	918.00	33,782,400	
日本ケミコン	8,200	2,070.00	16,974,000	
ＫＯＡ	17,700	1,383.00	24,479,100	
市光工業	17,800	612.00	10,893,600	
小糸製作所	69,300	5,950.00	412,335,000	
ミツバ	21,800	688.00	14,998,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	20,100	5,140.00	103,314,000	
キヤノン電子	10,800	1,940.00	20,952,000	
キヤノン	622,500	3,092.00	1,924,770,000	
リコー	347,900	1,119.00	389,300,100	
象印マホービン	21,800	1,101.00	24,001,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,700	1,944.00	3,304,800	
東京エレクトロン	77,100	14,515.00	1,119,106,500	
トヨタ紡織	40,500	1,756.00	71,118,000	
芦森工業	2,400	1,453.00	3,487,200	

ユニプレス	22,400	1,978.00	44,307,200	
豊田自動織機	93,600	5,480.00	512,928,000	
モリタホールディングス	20,200	1,888.00	38,137,600	
三櫻工業	14,800	621.00	9,190,800	
デンソー	254,600	5,067.00	1,290,058,200	
東海理化電機製作所	30,500	1,978.00	60,329,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	36,100	1,209.00	43,644,900	
川崎重工業	90,000	2,630.00	236,700,000	
名村造船所	34,700	456.00	15,823,200	
日本車輌製造	4,200	2,318.00	9,735,600	
三菱ロジスネクスト	13,800	1,089.00	15,028,200	
近畿車輛	1,100	1,952.00	2,147,200	
日産自動車	1,363,500	917.50	1,251,011,250	
いすゞ自動車	365,500	1,610.00	588,455,000	
トヨタ自動車	1,288,400	6,817.00	8,783,022,800	
日野自動車	144,400	1,113.00	160,717,200	
三菱自動車工業	428,000	673.00	288,044,000	
エフテック	8,100	995.00	8,059,500	
レシップホールディングス	4,100	706.00	2,894,600	
ＧＭＢ	2,300	948.00	2,180,400	
ファルテック	2,100	783.00	1,644,300	
武蔵精密工業	28,100	1,615.00	45,381,500	
日産車体	22,600	996.00	22,509,600	
新明和工業	53,800	1,378.00	74,136,400	
極東開発工業	23,000	1,512.00	34,776,000	
日信工業	21,200	1,506.00	31,927,200	
トピー工業	9,500	2,389.00	22,695,500	
ティラド	4,200	2,314.00	9,718,800	
曙ブレーキ工業	63,500	214.00	13,589,000	
タチエス	19,700	1,548.00	30,495,600	
ＮＯＫ	62,200	1,654.00	102,878,800	
フタバ産業	32,300	594.00	19,186,200	
ＫＹＢ	9,700	2,932.00	28,440,400	
大同メタル工業	18,900	807.00	15,252,300	
プレス工業	57,400	571.00	32,775,400	
ミクニ	14,800	545.00	8,066,000	
太平洋工業	24,300	1,546.00	37,567,800	
ケーヒン	26,600	1,964.00	52,242,400	
河西工業	14,300	863.00	12,340,900	
アイシン精機	95,200	4,345.00	413,644,000	
マツダ	362,900	1,211.00	439,471,900	
今仙電機製作所	10,800	1,020.00	11,016,000	

本田技研工業	975,300	3,243.00	3,162,897,900	
スズキ	211,500	5,937.00	1,255,675,500	
ＳＵＢＡＲＵ	358,900	2,566.00	920,937,400	
安永	5,600	1,506.00	8,433,600	
ヤマハ発動機	163,300	2,321.00	379,019,300	
ショーワ	27,300	1,429.00	39,011,700	
ＴＢＫ	13,900	416.00	5,782,400	
エクセディ	15,700	2,710.00	42,547,000	
豊田合成	37,400	2,408.00	90,059,200	
愛三工業	18,200	761.00	13,850,200	
盟和産業	1,800	1,044.00	1,879,200	
日本プラスト	9,100	784.00	7,134,400	
ヨロズ	10,800	1,496.00	16,156,800	
エフ・シー・シー	20,800	2,766.00	57,532,800	
シマノ	46,600	15,450.00	719,970,000	
テイ・エス　テック	26,900	3,205.00	86,214,500	
ジャムコ	5,800	2,542.00	14,743,600	
テルモ	163,600	6,216.00	1,016,937,600	
クリエートメディック	3,800	994.00	3,777,200	
日機装	37,400	1,011.00	37,811,400	
島津製作所	148,800	2,420.00	360,096,000	
ＪＭＳ	10,700	580.00	6,206,000	
長野計器	9,100	798.00	7,261,800	
ブイ・テクノロジー	2,700	14,390.00	38,853,000	
東京計器	7,400	937.00	6,933,800	
愛知時計電機	1,500	3,860.00	5,790,000	
インターアクション	6,100	1,920.00	11,712,000	
オーバル	11,400	234.00	2,667,600	
東京精密	20,900	2,886.00	60,317,400	
マニー	14,100	4,975.00	70,147,500	
ニコン	201,500	1,709.00	344,363,500	
トプコン	62,100	1,545.00	95,944,500	
オリンパス	172,200	4,510.00	776,622,000	
理研計器	10,200	2,050.00	20,910,000	
タムロン	10,300	1,674.00	17,242,200	
ＨＯＹＡ	232,800	6,343.00	1,476,650,400	
シード	4,900	1,350.00	6,615,000	
ノーリツ鋼機	9,100	1,690.00	15,379,000	
エー・アンド・デイ	10,600	677.00	7,176,200	
朝日インテック	41,800	4,805.00	200,849,000	
シチズン時計	126,500	569.00	71,978,500	
リズム時計工業	3,900	1,827.00	7,125,300	

大研医器	9,200	611.00	5,621,200	
メニコン	15,900	2,807.00	44,631,300	
シンシア	1,800	505.00	909,000	
松風	5,700	1,121.00	6,389,700	
セイコーホールディングス	17,800	2,356.00	41,936,800	
ニプロ	80,000	1,440.00	115,200,000	
中本パックス	3,200	1,690.00	5,408,000	
スノーピーク	4,400	1,210.00	5,324,000	
パラマウントベッドホールディングス	13,300	4,660.00	61,978,000	
トランザクション	6,300	734.00	4,624,200	
ＳＨＯ－ＢＩ	3,400	342.00	1,162,800	
ニホンフラッシュ	4,900	1,690.00	8,281,000	
前田工繊	12,700	2,462.00	31,267,400	
永大産業	15,100	425.00	6,417,500	
アートネイチャー	12,300	626.00	7,699,800	
バンダイナムコホールディングス	119,500	4,790.00	572,405,000	
アイフィスジャパン	2,600	595.00	1,547,000	
共立印刷	19,200	203.00	3,897,600	
ＳＨＯＥＩ	5,600	3,760.00	21,056,000	
フランスベッドホールディングス	16,300	894.00	14,572,200	
パイロットコーポレーション	20,200	5,320.00	107,464,000	
萩原工業	6,400	1,572.00	10,060,800	
トッパン・フォームズ	24,800	918.00	22,766,400	
フジシールインターナショナル	25,900	3,865.00	100,103,500	
タカラトミー	48,400	1,110.00	53,724,000	
廣済堂	10,600	579.00	6,137,400	
エステールホールディングス	3,100	651.00	2,018,100	
アーク	44,100	82.00	3,616,200	
タカノ	4,500	823.00	3,703,500	
プロネクサス	9,900	1,019.00	10,088,100	
ホクシン	7,100	151.00	1,072,100	
ウッドワン	3,900	1,157.00	4,512,300	
大建工業	8,700	1,917.00	16,677,900	
凸版印刷	163,200	1,775.00	289,680,000	
大日本印刷	162,900	2,535.00	412,951,500	
図書印刷	10,800	919.00	9,925,200	
共同印刷	3,600	2,393.00	8,614,800	
ＮＩＳＳＨＡ	23,700	1,410.00	33,417,000	
光村印刷	1,000	2,131.00	2,131,000	
宝印刷	6,000	1,585.00	9,510,000	
アシックス	114,800	1,561.00	179,202,800	
ツツミ	3,600	1,904.00	6,854,400	

小松ウオール工業	3,500	1,929.00	6,751,500	
ヤマハ	68,800	4,710.00	324,048,000	
河合楽器製作所	3,600	3,060.00	11,016,000	
クリナップ	10,800	607.00	6,555,600	
ピジョン	69,900	4,275.00	298,822,500	
兼松サステック	700	1,571.00	1,099,700	
キングジム	9,600	822.00	7,891,200	
リンテック	27,500	2,407.00	66,192,500	
イトーキ	21,300	592.00	12,609,600	
任天堂	71,200	33,740.00	2,402,288,000	
三菱鉛筆	19,000	2,272.00	43,168,000	
タカラスタンダード	23,900	1,696.00	40,534,400	
コクヨ	55,500	1,664.00	92,352,000	
ナカバヤシ	11,400	544.00	6,201,600	
グローブライド	5,600	2,661.00	14,901,600	
オカムラ	40,300	1,432.00	57,709,600	
美津濃	11,400	2,526.00	28,796,400	
東京電力ホールディングス	923,000	740.00	683,020,000	
中部電力	353,700	1,772.50	626,933,250	
関西電力	471,700	1,720.50	811,559,850	
中国電力	159,800	1,511.00	241,457,800	
北陸電力	113,300	1,005.00	113,866,500	
東北電力	270,800	1,543.00	417,844,400	
四国電力	104,100	1,418.00	147,613,800	
九州電力	238,300	1,380.00	328,854,000	
北海道電力	108,200	771.00	83,422,200	
沖縄電力	21,400	2,174.00	46,523,600	
電源開発	92,000	2,774.00	255,208,000	
エフオン	7,000	862.00	6,034,000	
イーレックス	20,100	626.00	12,582,600	
レノバ	12,100	1,103.00	13,346,300	
東京瓦斯	226,800	2,936.50	665,998,200	
大阪瓦斯	224,400	2,181.00	489,416,400	
東邦瓦斯	57,300	5,010.00	287,073,000	
北海道瓦斯	6,200	1,517.00	9,405,400	
広島ガス	23,800	341.00	8,115,800	
西部瓦斯	13,000	2,632.00	34,216,000	
静岡ガス	35,600	916.00	32,609,600	
メタウォーター	5,600	3,015.00	16,884,000	
ＳＢＳホールディングス	11,400	1,590.00	18,126,000	
東武鉄道	121,900	3,105.00	378,499,500	
相鉄ホールディングス	39,600	3,385.00	134,046,000	

東京急行電鉄	314,000	1,866.00	585,924,000	
京浜急行電鉄	158,400	1,828.00	289,555,200	
小田急電鉄	185,200	2,490.00	461,148,000	
京王電鉄	64,600	6,340.00	409,564,000	
京成電鉄	86,600	3,480.00	301,368,000	
富士急行	15,800	3,320.00	52,456,000	
新京成電鉄	3,000	2,098.00	6,294,000	
東日本旅客鉄道	205,600	10,025.00	2,061,140,000	
西日本旅客鉄道	103,600	7,969.00	825,588,400	
東海旅客鉄道	103,500	23,195.00	2,400,682,500	
西武ホールディングス	147,400	1,926.00	283,892,400	
鴻池運輸	18,400	1,645.00	30,268,000	
西日本鉄道	32,000	2,827.00	90,464,000	
ハマキョウレックス	8,900	3,645.00	32,440,500	
サカイ引越センター	6,100	5,760.00	35,136,000	
近鉄グループホールディングス	109,500	4,910.00	537,645,000	
阪急阪神ホールディングス	146,000	3,900.00	569,400,000	
南海電気鉄道	48,800	2,979.00	145,375,200	
京阪ホールディングス	48,800	4,540.00	221,552,000	
神戸電鉄	2,800	3,935.00	11,018,000	
名古屋鉄道	87,700	2,880.00	252,576,000	
山陽電気鉄道	8,400	2,114.00	17,757,600	
日本通運	43,000	6,430.00	276,490,000	
ヤマトホールディングス	191,900	2,992.00	574,164,800	
山九	30,400	5,300.00	161,120,000	
丸運	6,200	293.00	1,816,600	
丸全昭和運輸	8,900	2,651.00	23,593,900	
センコーグループホールディングス	60,400	881.00	53,212,400	
トナミホールディングス	2,600	5,890.00	15,314,000	
ニッコンホールディングス	41,600	2,775.00	115,440,000	
日本石油輸送	1,300	2,866.00	3,725,800	
福山通運	14,000	4,475.00	62,650,000	
セイノーホールディングス	82,000	1,523.00	124,886,000	
エスライン	3,300	1,051.00	3,468,300	
神奈川中央交通	2,700	3,720.00	10,044,000	
日立物流	24,100	3,170.00	76,397,000	
丸和運輸機関	5,800	3,495.00	20,271,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11,100	1,238.00	13,741,800	
九州旅客鉄道	91,900	3,705.00	340,489,500	
ＳＧホールディングス	103,400	3,005.00	310,717,000	
日本郵船	91,900	1,834.00	168,544,600	
商船三井	65,200	2,675.00	174,410,000	

川崎汽船	34,200	1,525.00	52,155,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,300	2,980.00	18,774,000	
飯野海運	53,600	397.00	21,279,200	
共栄タンカー	1,400	1,527.00	2,137,800	
乾汽船	9,800	747.00	7,320,600	
日本航空	200,500	3,926.00	787,163,000	
ＡＮＡホールディングス	200,200	3,953.00	791,390,600	
パスコ	2,100	761.00	1,598,100	
トランコム	3,100	5,740.00	17,794,000	
日新	9,500	1,836.00	17,442,000	
三菱倉庫	37,900	2,803.00	106,233,700	
三井倉庫ホールディングス	13,400	1,887.00	25,285,800	
住友倉庫	41,200	1,404.00	57,844,800	
澁澤倉庫	6,000	1,560.00	9,360,000	
東陽倉庫	19,800	283.00	5,603,400	
日本トランスシティ	24,100	452.00	10,893,200	
ケイヒン	2,100	1,264.00	2,654,400	
中央倉庫	6,700	1,012.00	6,780,400	
川西倉庫	2,200	1,251.00	2,752,200	
安田倉庫	9,000	825.00	7,425,000	
東洋埠頭	3,300	1,474.00	4,864,200	
宇徳	9,400	524.00	4,925,600	
上組	67,500	2,339.00	157,882,500	
サンリツ	2,600	658.00	1,710,800	
キムラユニティー	2,900	1,014.00	2,940,600	
キユーソー流通システム	2,700	2,124.00	5,734,800	
近鉄エクスプレス	20,700	1,601.00	33,140,700	
東海運	6,200	299.00	1,853,800	
エーアイテイー	7,100	1,026.00	7,284,600	
内外トランスライン	3,500	1,371.00	4,798,500	
日本コンセプト	3,000	1,003.00	3,009,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	12,600	2,390.00	30,114,000	
システナ	40,600	1,287.00	52,252,200	
デジタルアーツ	6,100	5,990.00	36,539,000	
新日鉄住金ソリューションズ	17,100	2,717.00	46,460,700	
キューブシステム	6,300	631.00	3,975,300	
エイジア	2,400	1,166.00	2,798,400	
コア	5,000	1,180.00	5,900,000	
ソリトンシステムズ	6,600	796.00	5,253,600	
ソフトクリエイトホールディングス	5,100	1,370.00	6,987,000	
ＴＩＳ	37,900	4,910.00	186,089,000	
ネオス	2,600	1,133.00	2,945,800	

電算システム	4,400	2,336.00	10,278,400	
グリー	61,300	485.00	29,730,500	
コーエーテクモホールディングス	23,300	1,876.00	43,710,800	
三菱総合研究所	4,500	3,250.00	14,625,000	
電算	1,300	2,186.00	2,841,800	
ＡＧＳ	6,700	671.00	4,495,700	
ファインデックス	9,900	533.00	5,276,700	
ヒト・コミュニケーションズ	2,700	1,531.00	4,133,700	
ブレインパッド	2,500	6,150.00	15,375,000	
ＫＬａｂ	20,200	969.00	19,573,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,300	918.00	14,045,400	
イーブックイニシアティブジャパン	1,900	1,643.00	3,121,700	
ネクソン	289,000	1,575.00	455,175,000	
アイスタイル	29,200	838.00	24,469,600	
エムアップ	4,000	1,602.00	6,408,000	
エイチーム	7,200	1,631.00	11,743,200	
テクノスジャパン	9,800	793.00	7,771,400	
コロプラ	32,600	772.00	25,167,200	
ブロードリーフ	56,500	589.00	33,278,500	
クロス・マーケティンググループ	3,700	347.00	1,283,900	
デジタルハーツホールディングス	5,300	1,452.00	7,695,600	
メディアドゥホールディングス	3,600	2,444.00	8,798,400	
じげん	12,400	563.00	6,981,200	
サイバーリンクス	1,900	926.00	1,759,400	
フィックスターズ	11,000	1,298.00	14,278,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,200	1,054.00	6,534,800	
オプティム	2,500	4,340.00	10,850,000	
セレス	3,800	1,494.00	5,677,200	
ベリサーブ	1,200	4,695.00	5,634,000	
ティーガイア	11,400	2,117.00	24,133,800	
セック	1,900	3,655.00	6,944,500	
日本アジアグループ	12,000	345.00	4,140,000	
豆蔵ホールディングス	7,900	1,040.00	8,216,000	
テクマトリックス	8,100	1,814.00	14,693,400	
プロシップ	1,700	2,700.00	4,590,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	274,300	235.00	64,460,500	
GMOペイメントゲートウェイ	18,700	5,330.00	99,671,000	
ザッパラス	5,900	359.00	2,118,100	
システムリサーチ	1,600	2,780.00	4,448,000	
インターネットイニシアティブ	18,500	2,545.00	47,082,500	
さくらインターネット	13,900	467.00	6,491,300	
ヴィンクス	4,000	1,298.00	5,192,000	

GMOクラウド	2,600	3,275.00	8,515,000	
ＳＲＡホールディングス	6,100	2,553.00	15,573,300	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	2,300	1,710.00	3,933,000	
朝日ネット	9,600	499.00	4,790,400	
ｅＢＡＳＥ	3,500	1,808.00	6,328,000	
アバント	3,200	1,235.00	3,952,000	
アドソル日進	4,100	1,647.00	6,752,700	
フリービット	7,800	795.00	6,201,000	
コムチュア	6,400	2,802.00	17,932,800	
サイバーコム	2,100	2,192.00	4,603,200	
アステリア	5,900	772.00	4,554,800	
マークラインズ	4,000	1,350.00	5,400,000	
メディカル・データ・ビジョン	10,300	999.00	10,289,700	
ショーケース・ティービー	2,700	688.00	1,857,600	
モバイルファクトリー	3,300	1,268.00	4,184,400	
テラスカイ	700	3,585.00	2,509,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,100	1,370.00	6,987,000	
ＰＣＩホールディングス	2,100	2,322.00	4,876,200	
パイプドＨＤ	1,900	958.00	1,820,200	
アイビーシー	2,000	1,014.00	2,028,000	
ネオジャパン	2,300	856.00	1,968,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	800	2,452.00	1,961,600	
ランドコンピュータ	1,500	1,018.00	1,527,000	
ダブルスタンダード	800	3,735.00	2,988,000	
オープンドア	5,700	3,015.00	17,185,500	
マイネット	3,700	1,727.00	6,389,900	
アカツキ	4,000	6,670.00	26,680,000	
ベネフィットジャパン	900	754.00	678,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,200	1,149.00	2,527,800	
ＬＩＮＥ	34,600	3,880.00	134,248,000	
カナミックネットワーク	1,800	1,807.00	3,252,600	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	753.00	903,600	
チェンジ	1,500	4,125.00	6,187,500	
シンクロ・フード	5,100	599.00	3,054,900	
オークネット	6,200	906.00	5,617,200	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	12,600	803.00	10,117,800	
マクロミル	14,500	1,606.00	23,287,000	
ビーグリー	2,400	818.00	1,963,200	
オロ	1,200	4,330.00	5,196,000	
ソルクシーズ	5,100	636.00	3,243,600	
フェイス	4,700	850.00	3,995,000	
ハイマックス	1,400	1,781.00	2,493,400	

野村総合研究所	72,200	4,710.00	340,062,000	
サイバネットシステム	9,600	573.00	5,500,800	
ＣＥホールディングス	3,200	716.00	2,291,200	
日本システム技術	1,900	1,530.00	2,907,000	
インテージホールディングス	14,700	904.00	13,288,800	
東邦システムサイエンス	3,600	908.00	3,268,800	
ソースネクスト	44,300	603.00	26,712,900	
インフォコム	4,700	4,080.00	19,176,000	
ＦＩＧ	10,600	315.00	3,339,000	
フォーカスシステムズ	7,800	1,028.00	8,018,400	
クレスコ	3,500	3,040.00	10,640,000	
フジ・メディア・ホールディングス	117,800	1,599.00	188,362,200	
オービック	39,300	8,970.00	352,521,000	
ジャストシステム	16,200	2,198.00	35,607,600	
ＴＤＣソフト	10,100	806.00	8,140,600	
ヤフー	740,300	292.00	216,167,600	
トレンドマイクロ	60,500	6,280.00	379,940,000	
インフォメーション・ディベロプメント	3,400	1,362.00	4,630,800	
日本オラクル	18,400	7,760.00	142,784,000	
アルファシステムズ	3,600	2,576.00	9,273,600	
フューチャー	15,500	1,547.00	23,978,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,700	948.00	8,247,600	
ソフトバンク・テクノロジー	4,900	1,824.00	8,937,600	
トーセ	3,300	832.00	2,745,600	
オービックビジネスコンサルタント	11,600	4,345.00	50,402,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	51,800	2,271.00	117,637,800	
アイティフォー	14,000	734.00	10,276,000	
東計電算	1,700	2,985.00	5,074,500	
エックスネット	2,300	833.00	1,915,900	
大塚商会	61,400	3,375.00	207,225,000	
サイボウズ	13,500	667.00	9,004,500	
ソフトブレーン	9,300	446.00	4,147,800	
電通国際情報サービス	7,100	2,961.00	21,023,100	
デジタルガレージ	22,200	2,623.00	58,230,600	
ＥＭシステムズ	9,400	1,114.00	10,471,600	
ウェザーニューズ	3,900	2,971.00	11,586,900	
ＣＩＪ	9,100	749.00	6,815,900	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,200	1,852.00	2,222,400	
日本エンタープライズ	12,700	182.00	2,311,400	
WOWOW	5,500	3,020.00	16,610,000	
スカラ	9,400	712.00	6,692,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,000	516.00	5,160,000	

ネットワンシステムズ	40,200	2,121.00	85,264,200	
システムソフト	28,800	100.00	2,880,000	
アルゴグラフィックス	4,900	3,990.00	19,551,000	
マーベラス	17,500	864.00	15,120,000	
エイベックス	19,600	1,480.00	29,008,000	
日本ユニシス	35,500	2,605.00	92,477,500	
兼松エレクトロニクス	6,200	3,270.00	20,274,000	
東京放送ホールディングス	75,400	1,868.00	140,847,200	
日本テレビホールディングス	104,300	1,718.00	179,187,400	
朝日放送グループホールディングス	11,500	719.00	8,268,500	
テレビ朝日ホールディングス	31,300	2,087.00	65,323,100	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	87,000	481.00	41,847,000	
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,370.00	22,278,000	
日本ＢＳ放送	4,000	1,093.00	4,372,000	
ビジョン	3,600	3,995.00	14,382,000	
ワイヤレスゲート	5,400	464.00	2,505,600	
コネクシオ	8,200	1,418.00	11,627,600	
クロップス	2,400	649.00	1,557,600	
日本電信電話	776,000	4,543.00	3,525,368,000	
ＫＤＤＩ	999,800	2,691.50	2,690,961,700	
光通信	13,400	17,430.00	233,562,000	
ＮＴＴドコモ	814,700	2,583.50	2,104,777,450	
エムティーアイ	13,500	578.00	7,803,000	
GMOインターネット	41,400	1,408.00	58,291,200	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,800	495.00	1,386,000	
カドカワ	33,200	1,170.00	38,844,000	
学研ホールディングス	3,800	4,135.00	15,713,000	
ゼンリン	22,700	2,420.00	54,934,000	
昭文社	5,600	495.00	2,772,000	
インプレスホールディングス	9,400	144.00	1,353,600	
アイネット	6,500	1,385.00	9,002,500	
松竹	7,500	10,860.00	81,450,000	
東宝	74,700	4,125.00	308,137,500	
東映	4,800	13,280.00	63,744,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	302,200	1,275.00	385,305,000	
ピー・シー・エー	1,500	1,918.00	2,877,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	1,866.00	3,732,000	
ＤＴＳ	12,700	3,705.00	47,053,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,800	3,475.00	183,480,000	
シーイーシー	12,200	1,904.00	23,228,800	
カプコン	48,700	2,195.00	106,896,500	
アイ・エス・ビー	2,300	1,781.00	4,096,300	

ジャステック	6,800	947.00	6,439,600	
ＳＣＳＫ	30,000	4,370.00	131,100,000	
日本システムウエア	3,800	1,884.00	7,159,200	
アイネス	14,500	1,174.00	17,023,000	
ＴＫＣ	9,600	3,955.00	37,968,000	
富士ソフト	17,000	4,410.00	74,970,000	
ＮＳＤ	18,700	2,218.00	41,476,600	
コナミホールディングス	46,400	4,955.00	229,912,000	
福井コンピュータホールディングス	3,800	1,593.00	6,053,400	
ＪＢＣＣホールディングス	9,100	1,546.00	14,068,600	
ミロク情報サービス	11,300	2,400.00	27,120,000	
ソフトバンクグループ	474,100	7,868.00	3,730,218,800	
ホウスイ	900	861.00	774,900	
高千穂交易	4,400	961.00	4,228,400	
伊藤忠食品	2,800	4,760.00	13,328,000	
エレマテック	5,300	1,907.00	10,107,100	
ＪＡＬＵＸ	3,200	2,522.00	8,070,400	
あらた	6,300	4,390.00	27,657,000	
トーメンデバイス	1,700	2,333.00	3,966,100	
東京エレクトロン　デバイス	4,100	1,842.00	7,552,200	
フィールズ	10,000	761.00	7,610,000	
双日	628,900	415.00	260,993,500	
アルフレッサ　ホールディングス	126,500	3,105.00	392,782,500	
横浜冷凍	29,800	957.00	28,518,600	
神栄	1,600	945.00	1,512,000	
ラサ商事	6,100	844.00	5,148,400	
ラクーンホールディングス	6,800	659.00	4,481,200	
アルコニックス	12,100	1,115.00	13,491,500	
神戸物産	17,200	3,355.00	57,706,000	
あい　ホールディングス	18,300	1,995.00	36,508,500	
ディーブイエックス	4,500	1,154.00	5,193,000	
ダイワボウホールディングス	10,400	5,270.00	54,808,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	31,600	1,499.00	47,368,400	
ラクト・ジャパン	2,500	7,300.00	18,250,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,400	1,170.00	25,038,000	
八洲電機	8,800	749.00	6,591,200	
メディアスホールディングス	6,300	716.00	4,510,800	
ＵＫＣホールディングス	7,300	1,968.00	14,366,400	
ジューテックホールディングス	2,600	986.00	2,563,600	
大光	2,900	533.00	1,545,700	
ＯＣＨＩホールディングス	3,300	1,145.00	3,778,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	60,200	894.00	53,818,800	

黒谷	2,000	444.00	888,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,000	813.00	1,626,000	
三洋貿易	5,700	1,817.00	10,356,900	
ビューティガレージ	1,600	1,507.00	2,411,200	
ウイン・パートナーズ	7,400	1,043.00	7,718,200	
ミタチ産業	2,900	709.00	2,056,100	
シップヘルスケアホールディングス	23,700	4,220.00	100,014,000	
明治電機工業	3,600	1,693.00	6,094,800	
デリカフーズホールディングス	2,000	1,360.00	2,720,000	
スターティアホールディングス	2,200	597.00	1,313,400	
コメダホールディングス	26,300	2,057.00	54,099,100	
富士興産	4,400	620.00	2,728,000	
協栄産業	1,400	1,517.00	2,123,800	
小野建	10,100	1,625.00	16,412,500	
佐鳥電機	8,400	877.00	7,366,800	
エコートレーディング	2,600	591.00	1,536,600	
伯東	7,800	1,171.00	9,133,800	
コンドーテック	8,800	956.00	8,412,800	
中山福	6,600	533.00	3,517,800	
ナガイレーベン	16,500	2,419.00	39,913,500	
三菱食品	12,500	2,958.00	36,975,000	
松田産業	8,300	1,450.00	12,035,000	
第一興商	17,000	5,380.00	91,460,000	
メディパルホールディングス	122,900	2,491.00	306,143,900	
ＳＰＫ	2,400	2,283.00	5,479,200	
萩原電気ホールディングス	4,200	2,822.00	11,852,400	
アズワン	8,200	7,370.00	60,434,000	
スズデン	4,000	1,365.00	5,460,000	
尾家産業	3,700	1,229.00	4,547,300	
シモジマ	7,000	1,068.00	7,476,000	
ドウシシャ	10,700	1,745.00	18,671,500	
小津産業	2,500	1,895.00	4,737,500	
高速	6,800	1,096.00	7,452,800	
たけびし	4,000	1,403.00	5,612,000	
リックス	2,600	1,482.00	3,853,200	
丸文	10,100	717.00	7,241,700	
ハピネット	9,500	1,579.00	15,000,500	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,451.00	3,047,100	
日本ライフライン	35,700	1,604.00	57,262,800	
タカショー	5,600	433.00	2,424,800	
エクセル	2,900	2,047.00	5,936,300	
マルカキカイ	3,700	2,220.00	8,214,000	

ＩＤＯＭ	38,400	409.00	15,705,600	
日本エム・ディ・エム	6,700	1,043.00	6,988,100	
進和	6,700	2,247.00	15,054,900	
エスケイジャパン	2,800	751.00	2,102,800	
ダイトロン	5,200	1,284.00	6,676,800	
シークス	14,500	1,483.00	21,503,500	
田中商事	3,800	563.00	2,139,400	
オーハシテクニカ	6,400	1,230.00	7,872,000	
白銅	3,700	1,639.00	6,064,300	
伊藤忠商事	796,500	1,996.00	1,589,814,000	
丸紅	1,122,900	830.10	932,119,290	
高島	1,800	1,823.00	3,281,400	
長瀬産業	64,000	1,570.00	100,480,000	
蝶理	7,300	1,666.00	12,161,800	
豊田通商	127,100	3,485.00	442,943,500	
三共生興	19,400	407.00	7,895,800	
兼松	45,500	1,320.00	60,060,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,054.00	2,108,000	
三井物産	938,100	1,799.00	1,687,641,900	
日本紙パルプ商事	6,500	4,075.00	26,487,500	
日立ハイテクノロジーズ	34,600	3,815.00	131,999,000	
カメイ	14,900	1,266.00	18,863,400	
東都水産	1,600	2,245.00	3,592,000	
ＯＵＧホールディングス	1,800	2,455.00	4,419,000	
スターゼン	4,200	3,960.00	16,632,000	
山善	44,500	1,103.00	49,083,500	
椿本興業	2,600	3,255.00	8,463,000	
住友商事	673,500	1,693.00	1,140,235,500	
内田洋行	5,200	2,501.00	13,005,200	
三菱商事	799,100	3,158.00	2,523,557,800	
第一実業	5,200	3,490.00	18,148,000	
キヤノンマーケティングジャパン	32,500	1,993.00	64,772,500	
西華産業	6,500	1,537.00	9,990,500	
佐藤商事	10,200	919.00	9,373,800	
菱洋エレクトロ	11,600	1,561.00	18,107,600	
東京産業	11,400	516.00	5,882,400	
ユアサ商事	11,600	3,225.00	37,410,000	
神鋼商事	2,600	2,525.00	6,565,000	
小林産業	6,900	268.00	1,849,200	
阪和興業	19,800	3,055.00	60,489,000	
正栄食品工業	6,000	2,663.00	15,978,000	
カナデン	10,900	1,218.00	13,276,200	

菱電商事	9,000	1,422.00	12,798,000	
フルサト工業	6,300	1,590.00	10,017,000	
岩谷産業	25,300	3,710.00	93,863,000	
すてきナイスグループ	4,900	896.00	4,390,400	
昭光通商	4,000	628.00	2,512,000	
ニチモウ	1,800	1,743.00	3,137,400	
極東貿易	3,500	1,595.00	5,582,500	
イワキ	13,700	432.00	5,918,400	
三愛石油	30,600	1,028.00	31,456,800	
稲畑産業	27,400	1,497.00	41,017,800	
ＧＳＩクレオス	3,000	1,280.00	3,840,000	
明和産業	10,600	399.00	4,229,400	
ワキタ	24,300	1,136.00	27,604,800	
東邦ホールディングス	33,700	2,771.00	93,382,700	
サンゲツ	34,400	2,093.00	71,999,200	
ミツウロコグループホールディングス	16,500	825.00	13,612,500	
シナネンホールディングス	4,700	2,332.00	10,960,400	
伊藤忠エネクス	25,200	1,001.00	25,225,200	
サンリオ	35,200	2,267.00	79,798,400	
サンワテクノス	6,900	1,012.00	6,982,800	
リョーサン	12,600	3,030.00	38,178,000	
新光商事	10,700	1,740.00	18,618,000	
トーホー	5,100	2,103.00	10,725,300	
三信電気	9,500	1,796.00	17,062,000	
東陽テクニカ	13,100	820.00	10,742,000	
モスフードサービス	14,900	2,835.00	42,241,500	
加賀電子	11,300	2,087.00	23,583,100	
ソーダニッカ	11,800	539.00	6,360,200	
立花エレテック	8,400	1,585.00	13,314,000	
フォーバル	5,000	839.00	4,195,000	
ＰＡＬＴＡＣ	20,500	4,985.00	102,192,500	
三谷産業	13,400	287.00	3,845,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,600	4,460.00	11,596,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,132.00	1,018,800	
国際紙パルプ商事	20,000	288.00	5,760,000	
ヤマタネ	5,700	1,642.00	9,359,400	
丸紅建材リース	1,100	1,839.00	2,022,900	
日鉄住金物産	8,100	4,725.00	38,272,500	
泉州電業	3,800	2,752.00	10,457,600	
トラスコ中山	23,700	2,961.00	70,175,700	
オートバックスセブン	45,300	1,865.00	84,484,500	
モリト	8,300	768.00	6,374,400	

加藤産業	17,800	3,210.00	57,138,000	
北恵	2,200	959.00	2,109,800	
イノテック	7,500	999.00	7,492,500	
イエローハット	10,800	2,636.00	28,468,800	
ＪＫホールディングス	10,300	562.00	5,788,600	
日伝	9,500	1,643.00	15,608,500	
北沢産業	8,600	261.00	2,244,600	
杉本商事	6,200	1,787.00	11,079,400	
因幡電機産業	16,200	4,195.00	67,959,000	
バイテックホールディングス	5,200	1,944.00	10,108,800	
東テク	3,800	1,955.00	7,429,000	
ミスミグループ本社	142,500	2,606.00	371,355,000	
アルテック	8,300	223.00	1,850,900	
タキヒヨー	3,500	1,785.00	6,247,500	
蔵王産業	1,900	1,336.00	2,538,400	
スズケン	51,900	5,810.00	301,539,000	
ジェコス	7,900	1,038.00	8,200,200	
ルネサスイーストン	10,500	421.00	4,420,500	
ローソン	28,800	6,690.00	192,672,000	
サンエー	8,600	4,430.00	38,098,000	
カワチ薬品	8,900	1,944.00	17,301,600	
エービーシー・マート	17,800	6,180.00	110,004,000	
ハードオフコーポレーション	4,600	836.00	3,845,600	
アスクル	9,900	2,335.00	23,116,500	
ゲオホールディングス	17,400	1,617.00	28,135,800	
アダストリア	15,800	2,128.00	33,622,400	
ジーフット	7,000	674.00	4,718,000	
くらコーポレーション	6,700	5,410.00	36,247,000	
キャンドゥ	5,500	1,594.00	8,767,000	
パルグループホールディングス	5,800	3,030.00	17,574,000	
エディオン	48,300	1,093.00	52,791,900	
サーラコーポレーション	23,200	595.00	13,804,000	
ワッツ	3,900	731.00	2,850,900	
ハローズ	4,300	2,124.00	9,133,200	
あみやき亭	2,500	3,540.00	8,850,000	
ひらまつ	22,900	356.00	8,152,400	
大黒天物産	2,700	4,070.00	10,989,000	
ハニーズホールディングス	11,100	914.00	10,145,400	
ファーマライズホールディングス	2,700	584.00	1,576,800	
アルペン	8,800	1,721.00	15,144,800	
ハブ	3,700	923.00	3,415,100	
クオールホールディングス	16,800	1,781.00	29,920,800	

ジンズ	7,800	5,420.00	42,276,000	
ビックカメラ	60,800	1,327.00	80,681,600	
ＤＣＭホールディングス	61,400	1,130.00	69,382,000	
ペッパーフードサービス	9,000	2,897.00	26,073,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	72,000	2,522.00	181,584,000	
東京一番フーズ	3,000	584.00	1,752,000	
ＤＤホールディングス	2,500	2,218.00	5,545,000	
きちりホールディングス	3,100	691.00	2,142,100	
アークランドサービスホールディングス	8,400	2,052.00	17,236,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	145,700	1,258.00	183,290,600	
ドトール・日レスホールディングス	20,000	2,129.00	42,580,000	
マツモトキヨシホールディングス	47,100	3,395.00	159,904,500	
ブロンコビリー	6,000	2,605.00	15,630,000	
ＺＯＺＯ	123,100	2,265.00	278,821,500	
トレジャー・ファクトリー	3,400	797.00	2,709,800	
物語コーポレーション	3,200	9,210.00	29,472,000	
ココカラファイン	12,800	5,390.00	68,992,000	
三越伊勢丹ホールディングス	213,100	1,178.00	251,031,800	
Ｈａｍｅｅ	3,000	917.00	2,751,000	
ウエルシアホールディングス	30,100	4,190.00	126,119,000	
クリエイトＳＤホールディングス	16,800	2,644.00	44,419,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	13,300	330.00	4,389,000	
ティーライフ	1,600	940.00	1,504,000	
エー・ピーカンパニー	2,300	483.00	1,110,900	
チムニー	3,500	2,511.00	8,788,500	
シュッピン	7,800	707.00	5,514,600	
ネクステージ	17,500	1,244.00	21,770,000	
ジョイフル本田	33,400	1,433.00	47,862,200	
鳥貴族	3,800	1,889.00	7,178,200	
キリン堂ホールディングス	4,500	1,401.00	6,304,500	
ホットランド	6,000	1,300.00	7,800,000	
すかいらーくホールディングス	106,200	1,835.00	194,877,000	
綿半ホールディングス	4,300	2,138.00	9,193,400	
ヨシックス	1,900	2,915.00	5,538,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,100	1,224.00	40,514,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	680.00	3,196,000	
ＢＥＥＮＯＳ	2,700	1,372.00	3,704,400	
あさひ	9,500	1,391.00	13,214,500	
日本調剤	4,000	3,550.00	14,200,000	
コスモス薬品	5,700	20,150.00	114,855,000	
トーエル	5,600	741.00	4,149,600	
オンリー	2,000	965.00	1,930,000	

セブン&アイ・ホールディングス	477,300	4,699.00	2,242,832,700	
薬王堂	5,000	2,700.00	13,500,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,700	1,259.00	38,651,300	
ツルハホールディングス	24,700	9,610.00	237,367,000	
サンマルクホールディングス	9,000	2,529.00	22,761,000	
フェリシモ	2,600	1,128.00	2,932,800	
トリドールホールディングス	14,100	1,946.00	27,438,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,300	674.00	6,942,200	
ウイルプラスホールディングス	1,100	800.00	880,000	
ジャパンミート	4,400	1,765.00	7,766,000	
サツドラホールディングス	1,900	1,918.00	3,644,200	
デファクトスタンダード	900	511.00	459,900	
ダイユー・リックホールディングス	6,200	995.00	6,169,000	
バロックジャパンリミテッド	9,300	900.00	8,370,000	
クスリのアオキホールディングス	9,100	6,900.00	62,790,000	
力の源ホールディングス	3,300	814.00	2,686,200	
スシローグローバルホールディングス	12,500	5,620.00	70,250,000	
ＬＩＸＩＬビバ	9,700	1,606.00	15,578,200	
メディカルシステムネットワーク	12,300	442.00	5,436,600	
はるやまホールディングス	5,400	843.00	4,552,200	
ノジマ	20,300	2,215.00	44,964,500	
カッパ・クリエイト	16,000	1,397.00	22,352,000	
ライトオン	9,700	844.00	8,186,800	
良品計画	16,100	24,060.00	387,366,000	
三城ホールディングス	14,300	422.00	6,034,600	
アドヴァン	17,500	927.00	16,222,500	
アルビス	4,300	2,426.00	10,431,800	
コナカ	14,700	450.00	6,615,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,849.00	2,588,600	
Ｇ－７ホールディングス	3,400	2,158.00	7,337,200	
イオン北海道	11,500	797.00	9,165,500	
コジマ	16,900	525.00	8,872,500	
ヒマラヤ	3,600	930.00	3,348,000	
コーナン商事	15,000	2,688.00	40,320,000	
エコス	4,200	1,721.00	7,228,200	
ワタミ	15,000	1,400.00	21,000,000	
マルシェ	3,100	766.00	2,374,600	
ドンキホーテホールディングス	73,800	6,170.00	455,346,000	
西松屋チェーン	25,100	909.00	22,815,900	
ゼンショーホールディングス	53,700	2,539.00	136,344,300	
幸楽苑ホールディングス	7,200	2,502.00	18,014,400	
ハークスレイ	2,400	1,117.00	2,680,800	

サイゼリヤ	18,800	2,041.00	38,370,800	
ＶＴホールディングス	38,700	429.00	16,602,300	
魚力	3,200	1,408.00	4,505,600	
ポプラ	3,000	582.00	1,746,000	
フジ・コーポレーション	2,300	2,103.00	4,836,900	
ユナイテッドアローズ	13,000	3,555.00	46,215,000	
ハイデイ日高	15,000	2,243.00	33,645,000	
京都きもの友禅	7,400	436.00	3,226,400	
コロワイド	37,900	2,382.00	90,277,800	
ピーシーデポコーポレーション	15,300	449.00	6,869,700	
壱番屋	8,000	4,635.00	37,080,000	
ＰＬＡＮＴ	2,700	1,009.00	2,724,300	
スギホールディングス	25,000	4,575.00	114,375,000	
ヴィア・ホールディングス	13,900	675.00	9,382,500	
スクロール	17,700	415.00	7,345,500	
ヨンドシーホールディングス	12,700	2,157.00	27,393,900	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	31,800	12,650.00	402,270,000	
木曽路	14,000	2,510.00	35,140,000	
ＳＲＳホールディングス	13,500	983.00	13,270,500	
タカキュー	9,200	187.00	1,720,400	
ケーヨー	21,200	542.00	11,490,400	
上新電機	13,500	2,444.00	32,994,000	
日本瓦斯	18,500	4,010.00	74,185,000	
ロイヤルホールディングス	19,900	2,663.00	52,993,700	
いなげや	12,700	1,371.00	17,411,700	
島忠	25,800	3,175.00	81,915,000	
チヨダ	12,000	1,866.00	22,392,000	
ライフコーポレーション	8,700	2,422.00	21,071,400	
リンガーハット	14,100	2,351.00	33,149,100	
ＭｒＭａｘＨＤ	15,800	478.00	7,552,400	
テンアライド	10,500	390.00	4,095,000	
ＡＯＫＩホールディングス	22,800	1,314.00	29,959,200	
オークワ	16,300	1,034.00	16,854,200	
コメリ	17,600	2,479.00	43,630,400	
青山商事	19,900	2,734.00	54,406,600	
しまむら	13,300	8,910.00	118,503,000	
はせがわ	6,200	403.00	2,498,600	
高島屋	89,400	1,484.00	132,669,600	
松屋	23,000	1,010.00	23,230,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	58,500	1,580.00	92,430,000	
近鉄百貨店	4,400	3,480.00	15,312,000	
パルコ	11,000	1,051.00	11,561,000	

丸井グループ	96,400	2,189.00	211,019,600	
アクシアル　リテイリング	9,500	3,700.00	35,150,000	
イオン	438,200	2,189.00	959,219,800	
イズミ	23,200	5,550.00	128,760,000	
平和堂	23,100	2,578.00	59,551,800	
フジ	13,800	1,929.00	26,620,200	
ヤオコー	12,900	5,820.00	75,078,000	
ゼビオホールディングス	13,800	1,297.00	17,898,600	
ケーズホールディングス	118,400	1,072.00	126,924,800	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,800	677.00	4,603,600	
日産東京販売ホールディングス	17,000	320.00	5,440,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,500	2,955.00	13,297,500	
総合メディカルホールディングス	9,900	2,040.00	20,196,000	
ブックオフグループホールディングス	5,900	756.00	4,460,400	
アインホールディングス	15,300	8,180.00	125,154,000	
元気寿司	3,200	4,515.00	14,448,000	
ヤマダ電機	347,100	534.00	185,351,400	
アークランドサカモト	19,400	1,373.00	26,636,200	
ニトリホールディングス	49,300	14,095.00	694,883,500	
グルメ杵屋	8,200	1,159.00	9,503,800	
愛眼	9,100	298.00	2,711,800	
ケーユーホールディングス	6,000	808.00	4,848,000	
吉野家ホールディングス	39,800	1,738.00	69,172,400	
松屋フーズホールディングス	5,500	3,655.00	20,102,500	
サガミホールディングス	15,300	1,342.00	20,532,600	
関西スーパーマーケット	8,700	1,024.00	8,908,800	
王将フードサービス	8,400	7,160.00	60,144,000	
プレナス	12,800	1,906.00	24,396,800	
ミニストップ	8,500	2,009.00	17,076,500	
アークス	21,400	2,529.00	54,120,600	
バローホールディングス	24,600	2,657.00	65,362,200	
ベルク	5,600	5,000.00	28,000,000	
大庄	6,100	1,576.00	9,613,600	
ファーストリテイリング	15,200	51,320.00	780,064,000	
サンドラッグ	42,900	3,395.00	145,645,500	
サックスバー　ホールディングス	9,700	1,068.00	10,359,600	
ヤマザワ	2,400	1,777.00	4,264,800	
やまや	2,000	2,133.00	4,266,000	
ベルーナ	28,000	1,030.00	28,840,000	
島根銀行	3,500	707.00	2,474,500	
じもとホールディングス	77,000	129.00	9,933,000	
めぶきフィナンシャルグループ	595,100	312.00	185,671,200	

東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,900	1,684.00	26,775,600	
九州フィナンシャルグループ	189,000	438.00	82,782,000	
ゆうちょ銀行	323,700	1,258.00	407,214,600	
富山第一銀行	29,100	399.00	11,610,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	728,000	453.00	329,784,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	73,800	998.00	73,652,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	54,400	867.00	47,164,800	
三十三フィナンシャルグループ	10,300	1,695.00	17,458,500	
第四北越フィナンシャルグループ	20,000	3,275.00	65,500,000	
新生銀行	83,700	1,453.00	121,616,100	
あおぞら銀行	63,700	3,400.00	216,580,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,941,600	581.40	4,617,246,240	
りそなホールディングス	1,251,400	556.20	696,028,680	
三井住友トラスト・ホールディングス	224,100	4,241.00	950,408,100	
三井住友フィナンシャルグループ	803,700	3,955.00	3,178,633,500	
千葉銀行	405,100	667.00	270,201,700	
群馬銀行	229,700	487.00	111,863,900	
武蔵野銀行	17,300	2,575.00	44,547,500	
千葉興業銀行	33,400	358.00	11,957,200	
筑波銀行	47,400	234.00	11,091,600	
七十七銀行	36,200	2,011.00	72,798,200	
青森銀行	9,100	2,908.00	26,462,800	
秋田銀行	7,700	2,228.00	17,155,600	
山形銀行	13,200	2,141.00	28,261,200	
岩手銀行	8,200	3,535.00	28,987,000	
東邦銀行	102,000	328.00	33,456,000	
東北銀行	5,800	1,116.00	6,472,800	
みちのく銀行	7,300	1,740.00	12,702,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	92,900	2,466.00	229,091,400	
静岡銀行	287,900	903.00	259,973,700	
十六銀行	15,600	2,420.00	37,752,000	
八十二銀行	208,100	478.00	99,471,800	
山梨中央銀行	14,700	1,373.00	20,183,100	
大垣共立銀行	18,400	2,305.00	42,412,000	
福井銀行	10,200	1,675.00	17,085,000	
北國銀行	12,300	3,610.00	44,403,000	
清水銀行	5,200	1,642.00	8,538,400	
富山銀行	2,400	3,280.00	7,872,000	
滋賀銀行	23,200	2,642.00	61,294,400	
南都銀行	13,700	2,285.00	31,304,500	
百五銀行	104,600	409.00	42,781,400	
京都銀行	41,000	4,750.00	194,750,000	

紀陽銀行	40,900	1,614.00	66,012,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	76,500	1,300.00	99,450,000	
広島銀行	169,600	646.00	109,561,600	
山陰合同銀行	68,600	783.00	53,713,800	
中国銀行	74,400	1,001.00	74,474,400	
鳥取銀行	4,400	1,445.00	6,358,000	
伊予銀行	152,400	624.00	95,097,600	
百十四銀行	12,400	2,669.00	33,095,600	
四国銀行	17,000	1,123.00	19,091,000	
阿波銀行	18,500	2,983.00	55,185,500	
大分銀行	7,200	3,520.00	25,344,000	
宮崎銀行	7,900	2,840.00	22,436,000	
佐賀銀行	7,300	1,807.00	13,191,100	
十八銀行	7,300	2,723.00	19,877,900	
沖縄銀行	10,700	3,220.00	34,454,000	
琉球銀行	27,000	1,158.00	31,266,000	
セブン銀行	387,600	325.00	125,970,000	
みずほフィナンシャルグループ	15,495,100	177.50	2,750,380,250	
高知銀行	4,100	792.00	3,247,200	
山口フィナンシャルグループ	143,000	1,118.00	159,874,000	
長野銀行	4,200	1,669.00	7,009,800	
名古屋銀行	9,500	3,405.00	32,347,500	
北洋銀行	174,500	301.00	52,524,500	
愛知銀行	4,300	3,825.00	16,447,500	
中京銀行	5,000	2,135.00	10,675,000	
大光銀行	4,300	1,780.00	7,654,000	
愛媛銀行	16,600	1,072.00	17,795,200	
トマト銀行	5,100	1,128.00	5,752,800	
京葉銀行	51,500	726.00	37,389,000	
栃木銀行	62,100	254.00	15,773,400	
北日本銀行	3,900	2,275.00	8,872,500	
東和銀行	20,000	759.00	15,180,000	
福島銀行	7,300	411.00	3,000,300	
大東銀行	5,500	619.00	3,404,500	
トモニホールディングス	90,000	421.00	37,890,000	
フィデアホールディングス	110,700	135.00	14,944,500	
池田泉州ホールディングス	123,600	310.00	38,316,000	
ＦＰＧ	35,900	1,178.00	42,290,200	
マーキュリアインベストメント	4,600	723.00	3,325,800	
ＳＢＩホールディングス	135,900	2,320.00	315,288,000	
ジャフコ	18,700	3,755.00	70,218,500	
大和証券グループ本社	915,200	591.30	541,157,760	

野村ホールディングス	2,092,900	459.80	962,315,420	
岡三証券グループ	97,400	532.00	51,816,800	
丸三証券	34,000	831.00	28,254,000	
東洋証券	41,500	178.00	7,387,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	136,200	508.00	69,189,600	
光世証券	2,900	771.00	2,235,900	
水戸証券	33,500	274.00	9,179,000	
いちよし証券	24,100	873.00	21,039,300	
松井証券	55,900	1,191.00	66,576,900	
だいこう証券ビジネス	4,900	408.00	1,999,200	
マネックスグループ	106,800	401.00	42,826,800	
カブドットコム証券	85,500	379.00	32,404,500	
極東証券	15,400	1,200.00	18,480,000	
岩井コスモホールディングス	11,800	1,303.00	15,375,400	
藍澤證券	21,500	665.00	14,297,500	
マネーパートナーズグループ	13,800	298.00	4,112,400	
かんぽ生命保険	43,100	2,575.00	110,982,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	201,000	4,074.00	818,874,000	
アニコム　ホールディングス	9,100	3,465.00	31,531,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	298,200	3,296.00	982,867,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	93,700	2,118.00	198,456,600	
第一生命ホールディングス	645,200	1,781.00	1,149,101,200	
東京海上ホールディングス	413,300	5,338.00	2,206,195,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	352,700	1,401.50	494,309,050	
アドバンスクリエイト	2,700	1,767.00	4,770,900	
全国保証	32,100	3,830.00	122,943,000	
ジェイリース	2,400	354.00	849,600	
イントラスト	3,200	374.00	1,196,800	
日本モーゲージサービス	1,500	884.00	1,326,000	
Ｃａｓａ	3,800	1,221.00	4,639,800	
アルヒ	10,400	2,508.00	26,083,200	
クレディセゾン	79,900	1,398.00	111,700,200	
芙蓉総合リース	13,000	5,680.00	73,840,000	
興銀リース	21,400	2,547.00	54,505,800	
東京センチュリー	23,000	5,000.00	115,000,000	
日本証券金融	50,300	614.00	30,884,200	
アイフル	174,000	269.00	46,806,000	
リコーリース	9,000	3,350.00	30,150,000	
イオンフィナンシャルサービス	72,900	2,129.00	155,204,100	
アコム	229,200	383.00	87,783,600	
ジャックス	12,600	1,885.00	23,751,000	
オリエントコーポレーション	308,400	131.00	40,400,400	

日立キャピタル	26,900	2,447.00	65,824,300	
アプラスフィナンシャル	54,700	86.00	4,704,200	
オリックス	760,800	1,711.00	1,301,728,800	
三菱ＵＦＪリース	257,300	562.00	144,602,600	
九州リースサービス	5,600	702.00	3,931,200	
日本取引所グループ	308,000	1,984.00	611,072,000	
イー・ギャランティ	10,600	1,067.00	11,310,200	
アサックス	4,700	551.00	2,589,700	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,600	1,608.00	7,396,800	
いちご	145,400	360.00	52,344,000	
日本駐車場開発	138,500	144.00	19,944,000	
ヒューリック	238,100	987.00	235,004,700	
三栄建築設計	4,600	1,750.00	8,050,000	
スター・マイカ	5,300	1,546.00	8,193,800	
野村不動産ホールディングス	76,000	2,072.00	157,472,000	
三重交通グループホールディングス	23,300	608.00	14,166,400	
サムティ	15,800	1,499.00	23,684,200	
ディア・ライフ	14,900	452.00	6,734,800	
コーセーアールイー	3,500	901.00	3,153,500	
エー・ディー・ワークス	115,000	37.00	4,255,000	
日本商業開発	7,200	1,531.00	11,023,200	
プレサンスコーポレーション	18,100	1,444.00	26,136,400	
ユニゾホールディングス	17,300	2,059.00	35,620,700	
ＴＨＥグローバル社	5,600	557.00	3,119,200	
日本管理センター	7,700	864.00	6,652,800	
サンセイランディック	3,200	806.00	2,579,200	
エストラスト	1,200	748.00	897,600	
フージャースホールディングス	21,200	659.00	13,970,800	
オープンハウス	18,600	4,325.00	80,445,000	
東急不動産ホールディングス	306,900	577.00	177,081,300	
飯田グループホールディングス	95,200	1,963.00	186,877,600	
イーグランド	1,800	679.00	1,222,200	
ムゲンエステート	8,100	560.00	4,536,000	
ファーストブラザーズ	3,200	1,099.00	3,516,800	
ハウスドゥ	4,200	1,257.00	5,279,400	
シーアールイー	3,900	944.00	3,681,600	
ケイアイスター不動産	3,100	1,742.00	5,400,200	
グッドコムアセット	2,100	1,460.00	3,066,000	
ジェイ・エス・ビー	400	3,700.00	1,480,000	
テンポイノベーション	1,000	1,528.00	1,528,000	
パーク２４	66,700	2,677.00	178,555,900	
パラカ	3,000	1,685.00	5,055,000	

三井不動産	605,000	2,649.50	1,602,947,500	
三菱地所	799,000	1,912.50	1,528,087,500	
平和不動産	21,600	1,907.00	41,191,200	
東京建物	124,700	1,283.00	159,990,100	
ダイビル	33,700	1,085.00	36,564,500	
京阪神ビルディング	20,500	937.00	19,208,500	
住友不動産	256,400	4,206.00	1,078,418,400	
テーオーシー	26,300	778.00	20,461,400	
東京楽天地	1,700	4,705.00	7,998,500	
レオパレス２１	140,600	504.00	70,862,400	
スターツコーポレーション	15,600	2,421.00	37,767,600	
フジ住宅	14,700	826.00	12,142,200	
空港施設	13,600	531.00	7,221,600	
明和地所	6,500	592.00	3,848,000	
ゴールドクレスト	9,100	1,620.00	14,742,000	
日本エスリード	4,500	1,504.00	6,768,000	
日神不動産	17,200	444.00	7,636,800	
日本エスコン	20,700	812.00	16,808,400	
タカラレーベン	53,800	331.00	17,807,800	
サンヨーハウジング名古屋	6,600	915.00	6,039,000	
イオンモール	57,200	1,787.00	102,216,400	
毎日コムネット	2,100	750.00	1,575,000	
ファースト住建	4,400	1,177.00	5,178,800	
カチタス	12,800	2,935.00	37,568,000	
トーセイ	15,800	967.00	15,278,600	
穴吹興産	1,300	2,852.00	3,707,600	
サンフロンティア不動産	15,900	1,153.00	18,332,700	
エフ・ジェー・ネクスト	10,100	908.00	9,170,800	
インテリックス	3,400	654.00	2,223,600	
ランドビジネス	5,800	790.00	4,582,000	
グランディハウス	10,300	416.00	4,284,800	
日本空港ビルデング	36,400	3,980.00	144,872,000	
日本工営	7,500	2,585.00	19,387,500	
ＬＩＦＵＬＬ	38,600	754.00	29,104,400	
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	2,067.00	18,603,000	
日本M&Aセンター	82,400	2,601.00	214,322,400	
メンバーズ	3,800	1,112.00	4,225,600	
中広	1,400	605.00	847,000	
タケエイ	11,700	667.00	7,803,900	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,500	1,021.00	1,531,500	
トラスト・テック	5,400	3,260.00	17,604,000	
コシダカホールディングス	29,600	1,395.00	41,292,000	

アルトナー	2,200	695.00	1,529,000	
パソナグループ	10,600	1,300.00	13,780,000	
ＣＤＳ	2,900	1,145.00	3,320,500	
リンクアンドモチベーション	20,500	889.00	18,224,500	
ＧＣＡ	11,400	737.00	8,401,800	
エス・エム・エス	40,700	1,729.00	70,370,300	
パーソルホールディングス	110,500	1,889.00	208,734,500	
リニカル	6,300	1,503.00	9,468,900	
クックパッド	35,200	297.00	10,454,400	
エスクリ	3,300	591.00	1,950,300	
アイ・ケイ・ケイ	5,600	766.00	4,289,600	
学情	4,600	1,243.00	5,717,800	
スタジオアリス	5,600	2,475.00	13,860,000	
シミックホールディングス	6,200	1,612.00	9,994,400	
ＮＪＳ	2,500	1,552.00	3,880,000	
綜合警備保障	44,000	4,990.00	219,560,000	
カカクコム	83,200	1,837.00	152,838,400	
アイロムグループ	4,200	1,515.00	6,363,000	
セントケア・ホールディング	6,300	550.00	3,465,000	
サイネックス	2,100	687.00	1,442,700	
ルネサンス	6,200	2,037.00	12,629,400	
ディップ	17,900	1,816.00	32,506,400	
オプトホールディング	6,900	1,490.00	10,281,000	
ツクイ	26,200	803.00	21,038,600	
キャリアデザインセンター	2,900	1,118.00	3,242,200	
ベネフィット・ワン	15,300	3,460.00	52,938,000	
エムスリー	232,700	1,561.00	363,244,700	
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	602.00	4,394,600	
ブラス	1,100	563.00	619,300	
アウトソーシング	58,300	1,184.00	69,027,200	
ウェルネット	11,300	991.00	11,198,300	
ワールドホールディングス	3,100	2,554.00	7,917,400	
ディー・エヌ・エー	59,600	1,922.00	114,551,200	
博報堂ＤＹホールディングス	153,700	1,616.00	248,379,200	
ぐるなび	15,900	714.00	11,352,600	
エスアールジータカミヤ	11,600	690.00	8,004,000	
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	1,288.00	11,205,600	
ファンコミュニケーションズ	30,600	546.00	16,707,600	
ライク	4,500	1,241.00	5,584,500	
ビジネス・ブレークスルー	5,100	326.00	1,662,600	
ＷＤＢホールディングス	5,100	2,441.00	12,449,100	
ティア	5,800	613.00	3,555,400	

ＣＤＧ	1,100	1,335.00	1,468,500	
バリューコマース	7,500	1,384.00	10,380,000	
インフォマート	60,700	1,107.00	67,194,900	
ＪＰホールディングス	32,100	287.00	9,212,700	
エコナックホールディングス	21,300	109.00	2,321,700	
ＥＰＳホールディングス	16,700	1,681.00	28,072,700	
レッグス	2,900	923.00	2,676,700	
プレステージ・インターナショナル	20,800	1,229.00	25,563,200	
アミューズ	6,700	2,389.00	16,006,300	
ドリームインキュベータ	3,400	1,600.00	5,440,000	
クイック	7,000	1,357.00	9,499,000	
ＴＡＣ	6,600	224.00	1,478,400	
ケネディクス	103,600	534.00	55,322,400	
電通	134,600	5,250.00	706,650,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,850.00	7,955,000	
ぴあ	3,200	3,900.00	12,480,000	
イオンファンタジー	3,600	2,692.00	9,691,200	
シーティーエス	12,700	702.00	8,915,400	
ネクシィーズグループ	3,400	1,936.00	6,582,400	
みらかホールディングス	30,900	2,650.00	81,885,000	
アルプス技研	9,800	1,783.00	17,473,400	
ダイオーズ	2,600	1,291.00	3,356,600	
日本空調サービス	12,700	636.00	8,077,200	
オリエンタルランド	130,600	11,070.00	1,445,742,000	
ダスキン	29,800	2,516.00	74,976,800	
明光ネットワークジャパン	14,100	998.00	14,071,800	
ファルコホールディングス	6,200	1,548.00	9,597,600	
ラウンドワン	34,400	1,123.00	38,631,200	
リゾートトラスト	46,800	1,667.00	78,015,600	
ビー・エム・エル	14,300	3,025.00	43,257,500	
ワタベウェディング	2,000	702.00	1,404,000	
りらいあコミュニケーションズ	20,100	962.00	19,336,200	
リソー教育	56,400	461.00	26,000,400	
早稲田アカデミー	1,600	1,911.00	3,057,600	
ユー・エス・エス	135,000	1,878.00	253,530,000	
東京個別指導学院	4,000	1,338.00	5,352,000	
サイバーエージェント	68,100	4,155.00	282,955,500	
楽天	515,100	843.00	434,229,300	
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,180.00	7,788,000	
テー・オー・ダブリュー	10,700	756.00	8,089,200	
セントラルスポーツ	4,200	3,395.00	14,259,000	
フルキャストホールディングス	11,100	1,813.00	20,124,300	

エン・ジャパン	12,100	3,665.00	44,346,500	
リソルホールディングス	1,200	4,000.00	4,800,000	
テクノプロ・ホールディングス	20,900	5,420.00	113,278,000	
アトラ	2,500	440.00	1,100,000	
インターワークス	2,300	715.00	1,644,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	1,225.00	4,287,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,700	979.00	3,622,300	
ファーストロジック	2,300	661.00	1,520,300	
三機サービス	1,800	1,430.00	2,574,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,800	2,891.00	19,658,800	
デザインワン・ジャパン	2,600	324.00	842,400	
イー・ガーディアン	5,300	2,084.00	11,045,200	
リブセンス	6,600	283.00	1,867,800	
ジャパンマテリアル	30,300	1,139.00	34,511,700	
ベクトル	13,500	1,360.00	18,360,000	
ウチヤマホールディングス	5,800	430.00	2,494,000	
ライクキッズネクスト	2,400	792.00	1,900,800	
キャリアリンク	4,500	333.00	1,498,500	
ＩＢＪ	7,600	873.00	6,634,800	
アサンテ	4,500	2,036.00	9,162,000	
Ｎ・フィールド	7,300	940.00	6,862,000	
バリューＨＲ	2,400	1,820.00	4,368,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2,800	4,210.00	11,788,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,290.00	6,063,000	
ＥＲＩホールディングス	3,300	760.00	2,508,000	
アビスト	1,800	3,430.00	6,174,000	
シグマクシス	5,400	821.00	4,433,400	
ウィルグループ	7,300	914.00	6,672,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,700	260.00	4,082,000	
日本ビューホテル	3,600	1,100.00	3,960,000	
リクルートホールディングス	791,500	2,869.50	2,271,209,250	
エラン	7,700	1,380.00	10,626,000	
土木管理総合試験所	5,100	508.00	2,590,800	
日本郵政	905,600	1,352.00	1,224,371,200	
ベルシステム２４ホールディングス	18,600	1,445.00	26,877,000	
鎌倉新書	8,100	1,258.00	10,189,800	
一蔵	1,400	582.00	814,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,600	1,938.00	5,038,800	
グローバルグループ	1,500	923.00	1,384,500	
エボラブルアジア	3,300	2,028.00	6,692,400	
アトラエ	2,200	2,152.00	4,734,400	
ストライク	2,900	1,811.00	5,251,900	

ソラスト	27,000	1,138.00	30,726,000	
セラク	2,700	575.00	1,552,500	
インソース	3,700	1,828.00	6,763,600	
アイモバイル	2,800	788.00	2,206,400	
キャリアインデックス	3,900	1,247.00	4,863,300	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,600	1,325.00	6,095,000	
船場	1,900	840.00	1,596,000	
グレイステクノロジー	3,000	1,961.00	5,883,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,600	1,609.00	10,619,400	
フルテック	1,300	1,142.00	1,484,600	
グリーンズ	2,500	1,389.00	3,472,500	
ツナグ・ソリューションズ	1,200	639.00	766,800	
日総工産	2,800	1,900.00	5,320,000	
キュービーネットホールディングス	5,700	1,887.00	10,755,900	
スプリックス	3,100	2,132.00	6,609,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,500	922.00	4,149,000	
リログループ	60,400	2,806.00	169,482,400	
東祥	6,900	3,280.00	22,632,000	
エイチ・アイ・エス	19,700	4,075.00	80,277,500	
ラックランド	2,200	2,096.00	4,611,200	
共立メンテナンス	16,900	4,845.00	81,880,500	
イチネンホールディングス	11,600	1,195.00	13,862,000	
建設技術研究所	7,700	1,479.00	11,388,300	
スペース	7,300	1,232.00	8,993,600	
長大	4,600	713.00	3,279,800	
燦ホールディングス	2,500	2,386.00	5,965,000	
スバル興業	800	5,650.00	4,520,000	
東京テアトル	4,400	1,224.00	5,385,600	
タナベ経営	2,200	1,278.00	2,811,600	
ナガワ	3,100	5,660.00	17,546,000	
よみうりランド	2,400	3,880.00	9,312,000	
東京都競馬	7,300	2,903.00	21,191,900	
カナモト	16,600	3,010.00	49,966,000	
東京ドーム	41,400	925.00	38,295,000	
西尾レントオール	11,300	3,435.00	38,815,500	
トランス・コスモス	12,300	2,243.00	27,588,900	
乃村工藝社	25,900	2,699.00	69,904,100	
藤田観光	4,400	2,827.00	12,438,800	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,900	1,375.00	8,112,500	
日本管財	11,900	1,923.00	22,883,700	
トーカイ	10,700	2,792.00	29,874,400	
白洋舎	1,300	2,837.00	3,688,100	

セコム	117,300	9,228.00	1,082,444,400	
セントラル警備保障	5,300	4,745.00	25,148,500	
丹青社	21,000	1,135.00	23,835,000	
メイテック	14,000	4,720.00	66,080,000	
応用地質	12,000	1,161.00	13,932,000	
船井総研ホールディングス	23,000	1,687.00	38,801,000	
進学会ホールディングス	5,300	575.00	3,047,500	
オオバ	8,900	612.00	5,446,800	
いであ	2,400	983.00	2,359,200	
学究社	3,700	1,412.00	5,224,400	
ベネッセホールディングス	40,500	2,854.00	115,587,000	
イオンディライト	13,600	4,000.00	54,400,000	
ナック	7,100	1,041.00	7,391,100	
ニチイ学館	15,900	1,018.00	16,186,200	
ダイセキ	18,600	2,431.00	45,216,600	
ステップ	4,200	1,261.00	5,296,200	
合　計	131,631,000		256,062,933,100	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	110,316,743
コール・ローン	2,380,811,675
国債証券	240,619,013,100
派生商品評価勘定	19,726,580
未収入金	239,055
未収利息	1,959,091,674
前払金	3,395,381

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
前払費用	90,174,431
差入委託証拠金	137,123,534
流動資産合計	245,319,892,173
資産合計	245,319,892,173
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,604,496
未払金	183,330
未払解約金	176,287,128
未払利息	6,647
その他未払費用	19,341
流動負債合計	182,100,942
負債合計	182,100,942
純資産の部	
元本等	
元本	91,483,392,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	153,654,398,539
元本等合計	245,137,791,231
純資産合計	245,137,791,231
負債純資産合計	245,319,892,173

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2019年 1月21日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 1月21日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	91,483,392,692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 2.6796円 (1万口当たり純資産額) (26,796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 1月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2019年 1月21日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 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 1月21日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	94,509,771,464円
期中追加設定元本額	21,455,020,843円
期中一部解約元本額	24,481,399,615円
期末元本額	91,483,392,692円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,899,595,648円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	766,490,074円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	511,607,997円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,065,174,956円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,671,882円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,242,752,145円
世界経済インデックスファンド	6,538,698,751円
ＤＣマイセレクション２５	1,660,445,406円
ＤＣマイセレクション５０	1,374,634,080円
ＤＣマイセレクション７５	864,353,566円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,781,497,911円
ＤＣマイセレクションＳ２５	658,730,410円
ＤＣマイセレクションＳ５０	547,424,469円
ＤＣマイセレクションＳ７５	249,119,074円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	50,592,655円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	59,320,310円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	27,871,774円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,268,652,676円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	614,603,316円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	46,225,350円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,556,105円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,137,167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）	63,060,058円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	139,783,117円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	220,806,512円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	173,406,905円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	508,837,584円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,349,629,618円

区分	2019年 1月21日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	639,045,567円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,265,545,862円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	868,332,764円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	93,707,180円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	669,155,562円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	142,089,648円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	255,231,389円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	329,352,002円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,056,890,243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）	967,370,392円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	889,532,753円
外国債券ファンド・シリーズ１	453,830,753円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,141,142,231円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,562,953,450円
分散投資コア戦略ファンドＡ	917,063,499円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,714,192,297円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	217,594,536円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,367,826,027円
コア投資戦略ファンド（切替型）	495,939,393円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	246,483,838円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,855,937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）	1,052,584,412円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	247,577,514円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	22,248,879,820円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	43,605,392円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	87,079,670円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	109,044,211円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	786,244円
グローバル経済コア	1,119,934,584円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	4,306,350円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	35,263円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	34,174,518円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	7,629,036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）	806,085,118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）	10,262,582,831円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	355,272,890円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	435,097,965
合計	435,097,965

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,666,924,614	－	1,663,529,233	△3,395,381
合計		1,666,924,614	－	1,663,529,233	△3,395,381

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,227,123,435	－	2,244,640,900	17,517,465
	アメリカドル	1,139,049,950	－	1,153,603,000	14,553,050
	カナダドル	97,224,134	－	98,234,500	1,010,366
	ユーロ	831,390,085	－	830,768,400	△621,685
	イギリスポンド	159,459,266	－	162,035,000	2,575,734
合計		2,227,123,435	－	2,244,640,900	17,517,465

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,301,561.76	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	3,924,988.68	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,464,502.19	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,819,616.45	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,694,678.58	
		T 1.25% 01/31/20	9,620,000.00	9,488,425.91	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,350,208.32	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,400,692.40	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,285,105.50	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,639,269.10	
		T 1.375% 01/15/20	5,000,000.00	4,940,602.40	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	4,938,710.65	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,682,061.69	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,933,366.95	
		T 1.375% 03/31/20	8,280,000.00	8,161,646.50	
		T 1.375% 04/30/20	1,000,000.00	984,325.20	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,242,125.54	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,523,814.09	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,483,645.55	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,740,116.50	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,365,511.35	
		T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,916,698.12	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,561,706.24	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,870,194.74	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,357,702.84	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,461,575.94	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,823,464.32	
		T 1.5% 04/15/20	5,750,000.00	5,672,393.97	
		T 1.5% 07/15/20	7,200,000.00	7,081,710.26	
		T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,825,711.80	
		T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,095,237.08	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,534,043.11	

		T 1.625% 03/15/20	4,500,000.00	4,451,103.67	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,360,003.99	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	7,671,230.24	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,796,519.25	
		T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	2,957,421.39	
		T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	4,924,547.70	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,416,575.25	
		T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,372,096.80	
		T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,599,266.09	
		T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	6,894,065.96	
		T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	2,994,756.84	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,300,815.79	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,437,234.42	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,304,241.25	
		T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	10,902,796.24	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,697,458.48	
		T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	16,879,726.15	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,288,566.64	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	6,805,086.12	
		T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	9,843,879.04	
		T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,938,726.08	
		T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,068,783.68	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,446,125.32	
		T 1.875% 06/30/20	3,750,000.00	3,709,665.00	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	8,778,513.42	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	3,899,279.44	
		T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,263,504.57	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,292,958.93	
		T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	2,970,101.13	
		T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	8,878,261.75	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,216,463.05	
		T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	11,606,438.16	
		T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,416,103.35	
		T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,067,196.86	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,670,256.24	
		T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,026,703.98	
		T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,448,069.61	
		T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,975,307.74	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	7,774,423.28	
		T 2.125% 11/30/23	2,000,000.00	1,954,388.46	
		T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,440,566.70	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,629,548.47	

		T 2.25% 03/31/20	11,500,000.00	11,452,416.45	
		T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,026,026.08	
		T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,471,763.89	
		T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	2,973,975.84	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,218,299.15	
		T 2.25% 08/15/46	6,700,000.00	5,637,838.74	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,160,933.98	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,920,522.20	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,274,276.16	
		T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	14,056,714.55	
		T 2.25% 12/31/23	2,000,000.00	1,965,249.72	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,206,829.48	
		T 2.375% 04/30/20	3,960,000.00	3,946,962.80	
		T 2.375% 05/15/27	6,950,000.00	6,758,478.36	
		T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,318,503.62	
		T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,289,374.23	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,951,450.00	
		T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	5,623,999.03	
		T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	14,675,891.50	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,031,344.60	
		T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	2,879,164.39	
		T 2.5% 05/15/46	2,550,000.00	2,266,108.32	
		T 2.5% 05/31/20	13,950,000.00	13,924,210.77	
		T 2.5% 06/30/20	6,500,000.00	6,487,368.48	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,526,100.30	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,400,483.29	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,226,945.29	
		T 2.625% 05/15/21	5,380,000.00	5,380,877.37	
		T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,202,033.04	
		T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,351,111.46	
		T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,498,448.12	
		T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	10,995,885.34	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,016,057.02	
		T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	10,379,509.08	
		T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,640,846.42	
		T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	10,538,534.89	
		T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,033,476.34	
		T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,037,020.28	
		T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	2,834,058.84	
		T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	9,276,754.54	
		T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	6,940,257.77	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	3,962,924.99	
		T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	8,431,957.58	

		T 2.875% 05/15/28	9,760,000.00	9,835,719.34	
		T 2.875% 05/15/43	6,000,000.00	5,779,668.60	
		T 2.875% 08/15/28	5,220,000.00	5,259,845.56	
		T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	10,464,130.47	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,802,644.25	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,456,392.32	
		T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,345,627.46	
		T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,079,599.05	
		T 2% 02/28/21	4,000,000.00	3,948,997.80	
		T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,746,330.09	
		T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,156,332.79	
		T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,150,101.99	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	2,939,090.82	
		T 2% 08/15/25	12,300,000.00	11,783,160.27	
		T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,695,015.68	
		T 2% 09/30/20	5,000,000.00	4,947,986.45	
		T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,559,730.45	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,361,587.06	
		T 2% 11/15/26	5,150,000.00	4,883,707.92	
		T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,437,489.36	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	1,955,145.40	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,163,665.24	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,374,467.77	
		T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,033,096.15	
		T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,361,190.03	
		T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	4,715,832.42	
		T 3.125% 08/15/44	6,000,000.00	6,039,130.50	
		T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,283,867.63	
		T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	5,891,890.66	
		T 3.5% 02/15/39	3,000,000.00	3,242,926.38	
		T 3.5% 05/15/20	5,650,000.00	5,710,699.98	
		T 3.625% 02/15/20	7,000,000.00	7,073,313.24	
		T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,325,368.40	
		T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	5,468,301.60	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,185,408.72	
		T 3.75% 11/15/43	6,000,000.00	6,688,816.74	
		T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,574,062.57	
		T 3% 02/15/48	1,500,000.00	1,468,900.39	
		T 3% 05/15/42	1,950,000.00	1,926,830.41	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,443,479.09	
		T 3% 05/15/47	7,750,000.00	7,603,342.48	
		T 3% 08/15/48	4,050,000.00	3,966,843.33	

		T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,187,989.80	
		T 3% 11/15/44	6,050,000.00	5,954,547.39	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,074,182.99	
		T 4.25% 11/15/40	1,150,000.00	1,373,376.93	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,212,370.42	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,306,335.23	
		T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,222,208.32	
		T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,272,837.69	
		T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,245,086.28	
		T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,231,770.95	
		T 4.5% 08/15/39	250,000.00	307,982.25	
		T 4.625% 02/15/40	1,700,000.00	2,129,997.43	
		T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	3,764,860.12	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,429,854.99	
		T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,516,780.33	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,571,959.28	
		T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,014,318.40	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,471,394.89	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,058,470.43	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,828,109.29	
		T 6.25% 05/15/30	400,000.00	532,204.50	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,904,682.58	
		T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,947,062.49	
	アメリカドル 小計		1,026,490,000.00	1,011,813,294.40 (110,965,563,996)	
	カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	2,965,041.50	
		CAN 0.75% 03/01/21	4,590,000.00	4,477,866.30	
		CAN 0.75% 09/01/20	4,200,000.00	4,122,027.00	
		CAN 0.75% 09/01/21	1,630,000.00	1,581,026.65	
		CAN 1.25% 02/01/20	1,770,000.00	1,758,202.95	
		CAN 1.5% 03/01/20	6,100,000.00	6,072,672.00	
		CAN 1.5% 06/01/23	2,400,000.00	2,353,620.00	
		CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,222,099.00	
		CAN 1.75% 03/01/23	1,900,000.00	1,883,802.50	
		CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,816,881.75	
		CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,450,080.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	2,050,000.00	2,082,287.50	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,430,000.00	1,468,188.15	
		CAN 2.75% 06/01/22	2,210,000.00	2,267,150.60	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,750,000.00	1,937,057.50	
		CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	713,837.00	
		CAN 2% 06/01/28	1,300,000.00	1,296,243.00	
		CAN 2% 12/01/51	400,000.00	376,498.00	

	CAN 3.25% 06/01/21	2,130,000.00	2,193,953.25	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,837,800.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,490,000.00	3,105,005.10	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,000,000.00	2,605,390.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	2,910,360.60	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,305,168.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,710,000.00	2,423,129.85	
	CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	525,112.20	
カナダドル 小計		55,480,000.00	58,750,500.40 (4,857,491,373)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	18,599,828.25	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	41,558,605.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,070,000.00	21,352,871.10	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	44,074,759.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	35,950,000.00	34,508,584.75	
	MBONO 7.25% 12/09/21	16,950,000.00	16,459,806.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	33,010,000.00	30,789,087.20	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,100,000.00	15,752,776.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,450,000.00	21,560,988.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,950,000.00	5,378,948.75	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	15,401,022.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	15,850,000.00	15,187,549.25	
	MBONO 8% 06/11/20	30,750,000.00	30,605,628.75	
	MBONO 8% 11/07/47	9,250,000.00	8,314,038.75	
	MBONO 8% 12/07/23	8,800,000.00	8,644,020.00	
メキシコペソ 小計		341,220,000.00	328,188,514.60 (1,883,802,073)	
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	550,000.00	556,921.75	
	BGB 0.5% 10/22/24	880,000.00	898,845.20	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,100,000.00	2,178,130.50	
	BGB 0.8% 06/22/27	2,110,000.00	2,152,083.95	
	BGB 0.8% 06/22/28	2,060,000.00	2,078,570.90	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	861,050.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	803,096.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,350,000.00	1,312,854.75	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,100,000.00	1,182,021.50	
	BGB 1% 06/22/26	1,730,000.00	1,807,313.70	
	BGB 1% 06/22/31	1,300,000.00	1,299,174.50	
	BGB 2.15% 06/22/66	570,000.00	589,684.95	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,760,000.00	1,950,053.60	
	BGB 2.25% 06/22/57	540,000.00	582,533.10	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,435,191.60	

		BGB 3.75% 06/22/45	1,280,000.00	1,856,556.80	
		BGB 3.75% 09/28/20	2,750,000.00	2,949,911.25	
		BGB 3% 06/22/34	1,450,000.00	1,812,282.50	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,230,000.00	3,364,869.30	
		BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,647,745.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	1,580,000.00	1,846,790.90	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,420,000.00	1,839,524.80	
		BGB 4% 03/28/22	2,250,000.00	2,566,237.50	
		BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,407,175.70	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,260,000.00	3,239,484.00	
		BGB 5% 03/28/35	1,760,000.00	2,723,160.00	
		BTPS 0.05% 04/15/21	1,550,000.00	1,532,399.75	
		BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,387,164.40	
		BTPS 0.35% 06/15/20	1,480,000.00	1,483,256.00	
		BTPS 0.35% 11/01/21	3,800,000.00	3,757,782.00	
		BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,396,129.00	
		BTPS 0.65% 10/15/23	1,300,000.00	1,251,763.50	
		BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,558,734.25	
		BTPS 0.7% 05/01/20	2,000,000.00	2,013,160.00	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,151,713.90	
		BTPS 0.95% 03/01/23	1,300,000.00	1,278,205.50	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,000,000.00	1,967,570.00	
		BTPS 1.2% 04/01/22	400,000.00	402,274.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,400,000.00	1,300,523.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,928,449.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	700,000.00	676,004.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,059,581.25	
		BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,269,268.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	2,820,648.45	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,537,088.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,100,000.00	2,678,973.50	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,009,750.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	3,200,000.00	3,094,352.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,591,200.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,950,000.00	2,893,994.25	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,750,000.00	1,539,868.75	
		BTPS 2.45% 09/01/33	1,690,000.00	1,571,252.15	
		BTPS 2.5% 11/15/25	350,000.00	357,792.75	
		BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,619,168.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,000,000.00	1,748,220.00	
		BTPS 2.8% 03/01/67	920,000.00	773,278.40	
		BTPS 2.8% 12/01/28	950,000.00	957,376.75	
		BTPS 2.95% 09/01/38	1,760,000.00	1,657,022.40	

		BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,582,102.50	
		BTPS 2% 12/01/25	1,300,000.00	1,291,114.50	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,870,000.00	1,795,200.00	
		BTPS 3.45% 03/01/48	1,880,000.00	1,840,529.40	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,160,000.00	3,349,410.40	
		BTPS 3.75% 03/01/21	1,130,000.00	1,205,964.25	
		BTPS 3.75% 05/01/21	3,100,000.00	3,316,364.50	
		BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,295,760.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,362,398.50	
		BTPS 4.25% 03/01/20	4,030,000.00	4,213,143.35	
		BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,724,373.75	
		BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	3,913,473.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	5,300,000.00	6,098,922.00	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,395,495.00	
		BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,800,201.00	
		BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,348,377.25	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,119,351.70	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,400,000.00	2,860,032.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,700,000.00	4,059,677.00	
		BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,661,404.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	2,920,000.00	3,559,888.80	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,650,000.00	4,469,936.00	
		BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,915,559.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,981,093.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,620,000.00	3,395,572.40	
		BTPS 5% 03/01/22	3,000,000.00	3,362,355.00	
		BTPS 5% 03/01/25	2,650,000.00	3,105,906.00	
		BTPS 5% 08/01/34	3,250,000.00	3,973,482.50	
		BTPS 5% 09/01/40	2,900,000.00	3,523,369.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,060,000.00	4,012,409.70	
		BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,104,339.50	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,888,320.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,073,520.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	4,810,000.00	4,895,112.95	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,590,000.00	2,599,984.45	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,200,000.00	3,334,864.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,400,000.00	3,539,842.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	3,270,000.00	3,374,116.80	
		DBR 0.5% 08/15/27	3,050,000.00	3,158,198.75	
		DBR 0% 08/15/26	3,160,000.00	3,165,419.40	
		DBR 1.25% 08/15/48	1,540,000.00	1,692,429.20	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,550,000.00	2,751,858.00	

		DBR 1.5% 05/15/23	850,000.00	920,409.75	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,507,893.50	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,002,468.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,823,481.00	
		DBR 1.75% 07/04/22	3,650,000.00	3,934,955.50	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,139,910.00	
		DBR 1% 08/15/25	3,050,000.00	3,279,512.50	
		DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,616,625.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	2,950,000.00	3,169,568.50	
		DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,078,857.50	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,350,000.00	4,653,351.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,190,000.00	4,494,470.75	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,550,123.50	
		DBR 2% 08/15/23	2,100,000.00	2,329,467.00	
		DBR 3.25% 01/04/20	2,450,000.00	2,541,850.50	
		DBR 3.25% 07/04/21	3,400,000.00	3,721,402.00	
		DBR 3.25% 07/04/42	1,850,000.00	2,848,713.25	
		DBR 3% 07/04/20	5,940,000.00	6,253,869.60	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,860,000.00	4,512,164.80	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,850,000.00	3,113,661.00	
		DBR 4.75% 07/04/28	940,000.00	1,345,337.40	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,570,000.00	4,192,222.55	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,950,000.00	3,533,897.25	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,030,000.00	3,265,711.75	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,000,000.00	2,988,380.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,655,230.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,060,893.75	
		DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,004,906.50	
		FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,071,375.00	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,850,000.00	4,805,137.50	
		FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,042,165.65	
		FRTR 0.5% 05/25/26	6,280,000.00	6,374,702.40	
		FRTR 0.75% 05/25/28	5,000,000.00	5,073,000.00	
		FRTR 0.75% 11/25/28	2,590,000.00	2,612,623.65	
		FRTR 0% 03/25/23	3,900,000.00	3,930,732.00	
		FRTR 0% 03/25/24	3,500,000.00	3,502,275.00	
		FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,144,341.50	
		FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,612,437.50	
		FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,378,437.75	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,200,000.00	4,213,965.00	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,970,000.00	6,388,974.60	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,978,359.90	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,250,000.00	1,218,600.00	

		FRTR 1.75% 06/25/39	1,920,000.00	2,060,313.60	
		FRTR 1.75% 11/25/24	5,750,000.00	6,317,956.25	
		FRTR 1% 05/25/27	3,650,000.00	3,814,797.50	
		FRTR 1% 11/25/25	4,050,000.00	4,266,371.25	
		FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,476,882.50	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,100,000.00	5,586,922.50	
		FRTR 2.5% 05/25/30	4,760,000.00	5,638,791.20	
		FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,741,874.75	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	5,981,475.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,060,000.00	3,335,813.10	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	4,617,087.25	
		FRTR 3.25% 10/25/21	6,850,000.00	7,549,350.75	
		FRTR 3.5% 04/25/20	10,180,000.00	10,699,434.50	
		FRTR 3.5% 04/25/26	2,130,000.00	2,630,422.20	
		FRTR 3.75% 04/25/21	5,070,000.00	5,556,517.20	
		FRTR 3% 04/25/22	2,800,000.00	3,108,910.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,561,375.00	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,580,000.00	7,342,907.90	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	4,642,365.00	
		FRTR 4% 04/25/55	1,900,000.00	3,074,665.50	
		FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,735,922.75	
		FRTR 4% 10/25/38	3,300,000.00	4,883,752.50	
		FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,001,168.50	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,100,000.00	6,647,863.00	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,642,368.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,373,130.00	
		IRISH 0.8% 03/15/22	970,000.00	1,001,374.65	
		IRISH 0.9% 05/15/28	600,000.00	603,510.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	520,000.00	515,652.80	
		IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	345,995.90	
		IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	768,446.25	
		IRISH 1% 05/15/26	1,880,000.00	1,944,437.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,230,000.00	1,403,620.65	
		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,218,425.00	
		IRISH 3.4% 03/18/24	800,000.00	934,404.00	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,310,000.00	1,526,346.50	
		IRISH 4.5% 04/18/20	2,080,000.00	2,208,377.60	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,550,000.00	2,027,338.00	
		IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	251,897.15	
		NETHER 0.25% 01/15/20	1,320,000.00	1,332,018.60	
		NETHER 0.25% 07/15/25	1,880,000.00	1,911,828.40	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,696,517.10	

		NETHER 0.75% 07/15/27	2,050,000.00	2,135,854.00	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,490,000.00	1,544,049.75	
		NETHER 0% 01/15/22	1,800,000.00	1,826,136.00	
		NETHER 0% 01/15/24	1,260,000.00	1,272,436.20	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,950,000.00	2,131,116.00	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,817,036.00	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,670,000.00	2,087,625.25	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,790,000.00	2,602,624.20	
		NETHER 2% 07/15/24	2,750,000.00	3,075,421.25	
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,245,252.25	
		NETHER 3.5% 07/15/20	2,660,000.00	2,823,310.70	
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,930,000.00	2,251,924.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,030,000.00	3,279,688.30	
		NETHER 4% 01/15/37	2,090,000.00	3,243,439.65	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,673,599.80	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	263,261.00	
		OBL 0.25% 10/16/20	2,250,000.00	2,283,840.00	
		OBL 0% 04/14/23	1,790,000.00	1,820,358.40	
		OBL 0% 04/17/20	3,800,000.00	3,828,861.00	
		OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,550,464.25	
		OBL 0% 10/08/21	3,800,000.00	3,858,995.00	
		OBL 0% 10/13/23	3,530,000.00	3,586,480.00	
		RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,124,570.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	540,000.00	553,942.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,430,318.50	
		RAGB 0% 07/15/23	630,000.00	635,358.15	
		RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,112,177.00	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,834,240.05	
		RAGB 1.5% 02/20/47	640,000.00	666,390.40	
		RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	379,036.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	1,090,000.00	1,195,642.80	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,400,000.00	1,529,619.00	
		RAGB 2.1% 09/20/17	500,000.00	582,470.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	940,000.00	1,134,674.00	
		RAGB 3.15% 06/20/44	900,000.00	1,276,942.50	
		RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,714,927.50	
		RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,400,681.85	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,244,226.50	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	823,632.70	
		RAGB 3.9% 07/15/20	1,750,000.00	1,865,281.25	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,731,878.00	
		RAGB 4.85% 03/15/26	500,000.00	666,510.00	
		RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	194,374.70	

		RFGB 0.375% 09/15/20	790,000.00	801,648.55	
		RFGB 0.5% 04/15/26	650,000.00	664,267.50	
		RFGB 0.5% 09/15/27	350,000.00	353,633.00	
		RFGB 0.5% 09/15/28	350,000.00	349,914.25	
		RFGB 0.75% 04/15/31	630,000.00	632,705.85	
		RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	315,246.00	
		RFGB 0% 04/15/22	430,000.00	435,020.25	
		RFGB 0% 09/15/23	760,000.00	766,156.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	570,000.00	588,601.95	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	698,028.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	770,000.00	825,128.15	
		RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,224,133.60	
		RFGB 2.75% 07/04/28	720,000.00	873,914.40	
		RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	665,898.00	
		RFGB 3.375% 04/15/20	700,000.00	734,111.00	
		RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	871,396.00	
		RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,417,477.65	
		SPGB 0.05% 01/31/21	1,100,000.00	1,105,115.00	
		SPGB 0.05% 10/31/21	1,700,000.00	1,704,675.00	
		SPGB 0.35% 07/30/23	2,280,000.00	2,287,638.00	
		SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,324,558.80	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,350,000.00	2,383,499.25	
		SPGB 0.75% 07/30/21	3,400,000.00	3,478,404.00	
		SPGB 1.15% 07/30/20	3,000,000.00	3,065,880.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,900,000.00	1,940,375.00	
		SPGB 1.4% 01/31/20	2,360,000.00	2,402,291.20	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,430,000.00	2,455,174.80	
		SPGB 1.4% 07/30/28	2,090,000.00	2,100,115.60	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,652,455.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,135,949.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	2,900,000.00	3,063,632.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,950,000.00	3,160,084.25	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,970,000.00	3,083,602.50	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,057,982.50	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,200,000.00	2,328,128.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,110,000.00	1,141,213.20	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,200,000.00	3,593,056.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,300,000.00	2,485,989.50	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,210,000.00	1,397,005.50	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,700,000.00	1,991,524.50	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,540,000.00	3,363,861.70	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,750,000.00	2,084,880.00	

		SPGB 4.65% 07/30/25	2,550,000.00	3,182,502.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,620,000.00	3,725,535.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,711,377.25	
		SPGB 4.85% 10/31/20	2,100,000.00	2,290,606.50	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,266,628.75	
		SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,165,165.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,364,085.60	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,800,000.00	2,737,980.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	3,400,000.00	4,114,459.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,480,000.00	3,929,094.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	4,100,000.00	6,093,686.50	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,950,000.00	3,475,527.75	
		SPGB 5.9% 07/30/26	2,380,000.00	3,228,684.20	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,504,350.75	
	ユーロ 小計		664,910,000.00	753,273,907.00 (93,963,387,159)	
	イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	3,300,000.00	3,257,727.00	
		UKT 0.75% 07/22/23	3,230,000.00	3,198,523.65	
		UKT 1.25% 07/22/27	4,200,000.00	4,199,769.00	
		UKT 1.5% 01/22/21	2,700,000.00	2,736,490.50	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,600,000.00	2,664,324.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,670,000.00	2,456,974.05	
		UKT 1.625% 10/22/28	2,360,000.00	2,419,802.40	
		UKT 1.625% 10/22/71	550,000.00	529,138.50	
		UKT 1.75% 01/22/49	390,000.00	380,214.90	
		UKT 1.75% 07/22/57	1,980,000.00	1,967,417.10	
		UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,503,904.00	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,240,000.00	2,227,276.80	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,645,050.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	2,300,000.00	2,847,906.00	
		UKT 2.75% 09/07/24	2,200,000.00	2,405,799.00	
		UKT 2% 07/22/20	4,360,000.00	4,437,695.20	
		UKT 2% 09/07/25	2,250,000.00	2,381,535.00	
		UKT 3.25% 01/22/44	3,650,000.00	4,655,958.25	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,910,000.00	3,884,762.70	
		UKT 3.5% 07/22/68	2,610,000.00	4,108,570.65	
		UKT 3.75% 07/22/52	2,050,000.00	3,049,990.00	
		UKT 3.75% 09/07/20	1,070,000.00	1,120,616.35	
		UKT 3.75% 09/07/21	2,770,000.00	2,980,603.10	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,852,184.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,000,000.00	2,649,420.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,790,000.00	2,548,324.55	
		UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	839,265.45	

	UKT 4.25% 12/07/40	2,240,000.00	3,225,992.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,250,000.00	3,414,555.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,770,000.00	2,771,359.80	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,660,000.00	4,435,589.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,430,000.00	3,379,704.75	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,450,000.00	3,712,203.25	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,650,000.00	2,766,427.75	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,610,000.00	2,187,732.40	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,851,539.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,950,000.00	3,225,748.50	
	UKT 4% 03/07/22	1,450,000.00	1,591,063.25	
	UKT 5% 03/07/25	2,100,000.00	2,588,575.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,789,993.75	
	UKT 8% 06/07/21	1,550,000.00	1,812,957.50	
イギリスポンド 小計		93,810,000.00	113,702,684.50 (16,032,078,514)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,700,000.00	6,879,258.50	
	SGB 0.75% 11/12/29	4,010,000.00	4,057,498.45	
	SGB 1.5% 11/13/23	10,250,000.00	11,003,580.00	
	SGB 1% 11/12/26	8,660,000.00	9,124,046.10	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,810,000.00	8,968,535.40	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,850,000.00	8,321,157.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,070,000.00	15,828,961.05	
	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	13,210,020.00	
スウェーデンクローナ 小計		69,350,000.00	77,393,056.50 (941,099,567)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	5,260,000.00	5,219,761.00	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,650,000.00	4,666,995.75	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,873,341.00	
	NGB 2% 04/26/28	3,170,000.00	3,229,374.10	
	NGB 2% 05/24/23	8,650,000.00	8,886,620.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	10,350,000.00	10,964,945.25	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	5,979,792.00	
ノルウェークローネ 小計		43,430,000.00	44,820,829.85 (574,154,830)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	4,440,000.00	4,508,176.20	
	DGB 0.5% 11/15/27	7,700,000.00	7,916,447.00	
	DGB 1.5% 11/15/23	9,700,000.00	10,536,382.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	12,720,000.00	14,288,757.60	
	DGB 3% 11/15/21	10,700,000.00	11,770,160.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,890,000.00	29,435,047.50	
デンマーククローネ 小計		62,150,000.00	78,454,971.30	

			(1,310,982,570)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,200,000.00	2,204,345.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	5,100,000.00	5,122,134.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,160,000.00	2,190,056.40	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,680,000.00	5,789,198.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,597,710.75	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,100,000.00	4,022,653.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,080,000.00	3,057,315.80	
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,630,257.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,508,854.80	
	POLGB 4% 10/25/23	2,110,000.00	2,287,735.85	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,150,000.00	3,360,939.75	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	753,693.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,087,872.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,150,000.00	1,277,132.50	
ポーランドズロチ 小計		50,370,000.00	51,889,898.95 (1,508,958,261)	
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,850,000.00	2,842,219.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,800,000.00	3,775,490.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	400,000.00	405,722.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,480,000.00	1,498,677.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	3,510,000.00	3,642,449.85	
	ACGB 2.75% 05/21/41	440,000.00	436,306.20	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,030,000.00	1,050,651.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,550,000.00	3,677,551.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,050,000.00	3,160,150.75	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,360,000.00	2,448,488.20	
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,733,137.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,570,000.00	3,810,421.65	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,590,000.00	2,803,208.80	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,010,000.00	1,090,820.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,500,000.00	1,734,217.50	
	ACGB 3% 03/21/47	1,600,000.00	1,641,448.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	4,230,000.00	4,813,126.65	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,170,000.00	3,269,347.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,100,000.00	2,606,709.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,850,000.00	4,570,643.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,587,060.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,170,000.00	4,534,833.30	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,070,000.00	3,474,150.15	
オーストラリアドル 小計		60,050,000.00	64,606,830.75 (5,076,158,692)	
	SIGB 1.25% 10/01/21	250,000.00	245,255.00	

シンガポールドル	SIGB 1.75% 04/01/22	510,000.00	506,475.90	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	850,119.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	870,000.00	875,585.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	240,000.00	232,054.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	640,158.75	
	SIGB 2.625% 05/01/28	170,000.00	176,158.25	
	SIGB 2.75% 03/01/46	700,000.00	721,812.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	620,000.00	639,052.60	
	SIGB 2.75% 07/01/23	810,000.00	834,733.35	
	SIGB 2.875% 07/01/29	280,000.00	296,641.80	
	SIGB 2.875% 09/01/30	470,000.00	497,079.05	
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,267.20	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,143,560.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,091,656.80	
	SIGB 3.375% 09/01/33	730,000.00	813,479.15	
	SIGB 3.5% 03/01/27	780,000.00	858,592.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,100,620.50	
シンガポールドル 小計		11,450,000.00	11,843,302.35 (956,109,798)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,477,525.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,672,149.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,480,000.00	1,480,873.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,296,740.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	1,150,000.00	1,153,202.75	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,268,982.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,100,000.00	1,103,652.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	400,000.00	399,814.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,560,000.00	1,466,275.20	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	757,402.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,509,045.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,112,242.05	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,080,000.00	1,070,658.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,698,407.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,074,456.50	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,917,470.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,000,000.00	973,585.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,673,702.25	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,576,396.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	1,987,360.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,363,698.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,180,000.00	2,231,437.10	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,650,000.00	1,684,336.50	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,050,000.00	1,038,250.50	

		MGS 4.762% 04/07/37	1,860,000.00	1,912,721.70	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,477,648.80	
		MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	649,608.00	
	マレーシアリンギット 小計		42,080,000.00	42,027,639.55 (1,120,877,146)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	27,500,000.00	29,995,487.50	
		SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,869,326.90	
		SAGB 6.5% 02/28/41	8,200,000.00	5,724,010.00	
		SAGB 6.75% 03/31/21	7,300,000.00	7,241,344.50	
		SAGB 7.25% 01/15/20	4,170,000.00	4,206,696.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	7,750,000.00	7,668,470.00	
		SAGB 7% 02/28/31	13,100,000.00	10,788,898.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	14,160,000.00	12,745,628.40	
		SAGB 8.5% 01/31/37	17,700,000.00	15,728,043.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,210,508.40	
		SAGB 8.75% 02/28/48	16,450,000.00	14,651,357.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	10,550,000.00	9,796,519.00	
		SAGB 8% 01/31/30	17,400,000.00	15,779,538.00	
		SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,487,009.75	
	南アフリカランド 小計		197,090,000.00	179,892,836.45 (1,428,349,121)	
合計				240,619,013,100 (240,619,013,100)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　182銘柄	100.0%	46.1%
カナダドル	国債証券　26銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　284銘柄	100.0%	39.1%
イギリスポンド	国債証券　41銘柄	100.0%	6.7%
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　7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　14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　23銘柄	100.0%	2.1%

シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　27銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　14銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,181,496,102
コール・ローン	645,826,138
株式	316,278,946,476
投資信託受益証券	220,470,635
投資証券	8,048,999,055
派生商品評価勘定	543,258,227
未収配当金	327,442,238
差入委託証拠金	2,695,194,313
流動資産合計	335,941,633,184
資産合計	335,941,633,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,500
前受金	540,660,812
未払金	222,111,527
未払解約金	188,129,289
未払利息	1,803
その他未払費用	23,677
流動負債合計	950,931,608
負債合計	950,931,608
純資産の部	
元本等	
元本	141,058,766,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	193,931,934,721
元本等合計	334,990,701,576
純資産合計	334,990,701,576
負債純資産合計	335,941,633,184

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2019年 1月21日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 1月21日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		141,058,766,855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	2.3748円
	(1万口当たり純資産額)	(23,748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 1月21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。

	2019年 1月21日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 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 1月21日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	133,409,705,614円
期中追加設定元本額	21,307,743,454円
期中一部解約元本額	13,658,682,213円
期末元本額	141,058,766,855円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,415,112,269円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	10,115,691円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,517,570,822円
世界経済インデックスファンド	7,548,044,626円
外国株式インデックス・オープン	1,059,048,426円
ＤＣマイセレクション２５	1,008,510,033円
ＤＣマイセレクション５０	4,977,294,763円
ＤＣマイセレクション７５	5,234,445,461円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	8,080,785,954円
ＤＣマイセレクションＳ２５	400,461,475円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,982,119,244円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,508,919,397円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	124,238,188円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	196,014,460円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	125,500,798円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	6,145,071,526円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,804,195,614円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,878,995円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,927,715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）	57,968,503円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,167,672円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	276,248,851円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	43,889,791円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	386,455,720円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	832,545,989円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	419,355,066円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,725,527,612円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,170,116,526円

区分	2019年 1月21日現在
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	100,323,258円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	407,776,262円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	38,892,841円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	133,125,355円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,163,296,205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）	2,307,981,842円
外国株式ファンド・シリーズ１	907,887,849円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,841,706,471円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,314,724,224円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,206,637,749円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,603,320,148円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	771,607,364円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	933,055,582円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,258,393,490円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	874,239,353円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	44,284,640円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	291,373,699円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,876,372,616円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	30,825,424,417円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	51,900,361円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	308,162,363円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	42,635,601円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	926,737円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	35,693,600円
グローバル経済コア	1,299,170,883円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	5,015,701円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	190,413円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	91,471,625円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,914,142円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,562,430,198円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,373,263,663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）	1,202,037,016円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△12,164,347,812
投資信託受益証券	△15,974,558
投資証券	322,799,060
合計	△11,857,523,310

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,784,340,432	－	10,325,001,244	540,660,812
合計		9,784,340,432	－	10,325,001,244	540,660,812

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	438,467,345	－	441,064,760	2,597,415
	アメリカドル	347,890,480	－	350,254,040	2,363,560
	ユーロ	90,576,865	－	90,810,720	233,855
	売建	90,563,350	－	90,567,850	△4,500
	アメリカドル	49,232,850	－	49,232,850	－
	カナダドル	41,330,500	－	41,335,000	△4,500
合計		529,030,695	－	531,632,610	2,592,915

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	44,380	48.67	2,159,974.60	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	10.82	201,641.52	
	APACHE CORP	34,273	32.09	1,099,820.57	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	24.12	1,070,928.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	25.62	919,219.98	
	CHENIERE ENERGY INC	18,402	64.80	1,192,449.60	
	CHEVRON CORP	163,581	114.37	18,708,758.97	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	74.74	567,949.26	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	124.87	2,182,852.47	
	CONOCOPHILLIPS	99,705	67.90	6,769,969.50	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	47.59	363,920.73	
	DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	27.14	1,178,418.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	106.89	1,441,625.43	
	EOG RESOURCES INC	49,840	101.05	5,036,332.00	
	EXXON MOBIL	361,142	72.99	26,359,754.58	
	HALLIBURTON CO	76,620	32.25	2,470,995.00	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	54.14	450,174.10	
	HESS CORP	22,081	52.81	1,166,097.61	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	55.97	789,736.70	
	KINDER MORGAN INC	167,254	18.01	3,012,244.54	
	MARATHON OIL CORP	74,537	16.10	1,200,045.70	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,562	66.09	3,804,272.58	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	30.45	922,969.95	
	NOBLE ENERGY INC	38,291	23.39	895,626.49	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,462	67.03	4,320,887.86	
	ONEOK INC	33,743	63.19	2,132,220.17	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	19.25	394,143.75	
	PHILLIPS 66	38,115	95.30	3,632,359.50	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	144.90	2,094,529.50	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	24.00	237,360.00	
	SCHLUMBERGER	119,098	44.73	5,327,253.54	
	TARGA RESOURCES CORP	20,002	43.50	870,087.00	
	TECHNIPFMC PLC	36,005	24.08	867,000.40	
	VALERO ENERGY CORP	35,381	82.59	2,922,116.79	
	WILLIAMS COS	105,155	26.40	2,776,092.00	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,003	158.62	3,014,255.86	
	ALBEMARLE CORP	8,647	76.63	662,619.61	

AVERY DENNISON CORP	7,457	96.57	720,122.49	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	25.57	450,185.42	
BALL CORP	27,142	50.26	1,364,156.92	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	97.81	1,081,093.93	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,052	44.18	930,077.36	
CHEMOURS CO/THE	15,493	34.95	541,480.35	
CROWN HOLDINGS INC	10,321	48.27	498,194.67	
DOWDUPONT INC	197,370	58.06	11,459,302.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	81.20	962,869.60	
ECOLAB INC	21,802	154.50	3,368,409.00	
FMC CORP	12,118	80.65	977,316.70	
FREEPORT-MCMORAN INC	111,396	12.56	1,399,133.76	
INT'L PAPER CO	33,803	45.68	1,544,121.04	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,824	138.06	942,121.44	
LINDE PLC	47,208	160.79	7,590,574.32	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28,777	87.86	2,528,347.22	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	180.47	900,364.83	
MOSAIC CO/THE	31,911	32.20	1,027,534.20	
NEWMONT MINING CORP	46,929	31.77	1,490,934.33	
NUCOR CORP	27,868	58.73	1,636,687.64	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	91.90	662,139.50	
PPG INDUSTRIES INC	19,958	105.43	2,104,171.94	
SEALED AIR CORP	14,689	37.74	554,362.86	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,287	398.53	2,904,088.11	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	34.30	626,763.90	
VULCAN MATERIALS CO	10,740	103.61	1,112,771.40	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	77.83	268,902.65	
WESTROCK CO	21,244	41.42	879,926.48	
3 M COMPANY	50,210	195.86	9,834,130.60	
ACUITY BRANDS INC	3,505	120.57	422,597.85	
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	46.64	528,431.20	
ALLEGION PLC	7,168	83.51	598,599.68	
AMETEK INC	18,866	72.36	1,365,143.76	
ARCONIC INC	36,550	20.34	743,427.00	
BOEING CO	46,611	364.73	17,000,430.03	
CATERPILLAR	50,991	136.60	6,965,370.60	
CUMMINS INC	13,588	150.56	2,045,809.28	
DEERE&CO	26,347	164.61	4,336,979.67	
DOVER CORP	12,008	80.69	968,925.52	
EATON CORP	37,641	71.87	2,705,258.67	
EMERSON ELECTRIC CO	53,427	63.68	3,402,231.36	
FASTENAL CO	23,228	59.35	1,378,581.80	

FLOWSERVE CORP	10,826	43.10	466,600.60	
FLUOR CORP	11,267	38.53	434,117.51	
FORTIVE CORP	25,813	73.03	1,885,123.39	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	43.06	551,598.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,158	168.58	3,566,815.64	
GENERAL ELECTRIC CO	745,767	9.06	6,756,649.02	
GRAINGER (WW) INC	3,976	305.39	1,214,230.64	
HARRIS CORP	9,793	142.78	1,398,244.54	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.03	609,496.78	
HONEYWELL INTL INC	63,600	141.85	9,021,660.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	200.29	705,421.38	
IDEX CORP	6,916	140.77	973,565.32	
ILLINOIS TOOL WORKS	25,828	136.67	3,529,912.76	
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	96.11	1,946,131.39	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	62.51	605,909.43	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	66.85	1,343,685.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	36.61	750,505.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	80,399	32.73	2,631,459.27	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,974	183.29	1,278,264.46	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	225.37	650,192.45	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,009	282.87	6,225,685.83	
MASCO CORP	24,547	32.22	790,904.34	
MIDDLEBY CORP	4,364	117.09	510,980.76	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,287	267.75	3,825,344.25	
OWENS CORNING	7,979	48.87	389,933.73	
PACCAR INC	30,075	62.98	1,894,123.50	
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	162.49	1,842,636.60	
PENTAIR PLC	13,583	41.17	559,212.11	
RAYTHEON COMPANY	24,615	165.41	4,071,567.15	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	164.75	1,731,687.25	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	282.04	2,459,388.80	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	47.44	656,000.32	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	48.01	583,129.46	
SNAP-ON INC	4,900	167.76	822,024.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	79.47	673,985.07	
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	136.88	1,811,469.92	
TEXTRON	21,877	49.40	1,080,723.80	
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	355.89	1,449,184.08	
UNITED RENTALS INC	6,446	123.32	794,920.72	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,171	113.90	7,992,476.90	
WABCO HOLDINGS INC	3,841	114.36	439,256.76	
WABTEC CORP	7,158	75.65	541,502.70	

XYLEM INC	16,060	71.21	1,143,632.60	
CINTAS CORP	7,934	184.91	1,467,075.94	
COPART INC	17,540	50.06	878,052.40	
COSTAR GROUP INC	3,008	380.10	1,143,340.80	
EQUIFAX INC	10,799	104.24	1,125,687.76	
IHS MARKIT LTD	32,775	51.61	1,691,517.75	
MANPOWER GROUP	5,123	74.44	381,356.12	
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	26.14	718,954.56	
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	76.26	1,407,835.86	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	60.87	582,282.42	
ROLLINS INC	10,546	38.68	407,919.28	
TRANSUNION	15,344	60.58	929,539.52	
VERISK ANALYTICS INC	13,480	115.70	1,559,636.00	
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	80.43	1,850,533.44	
WASTE MANAGEMENT INC	36,731	94.47	3,469,977.57	
AMERCO	602	356.78	214,781.56	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	33.97	336,982.40	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	88.67	1,015,094.16	
CSX CORP	68,519	67.36	4,615,439.84	
DELTA AIR LINES INC	15,095	48.11	726,220.45	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	69.29	956,409.87	
FEDEX CORP	21,697	176.91	3,838,416.27	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	106.11	756,988.74	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	110.52	966,276.36	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	32.64	349,248.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,799	169.05	4,023,220.95	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	136.63	716,624.35	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	51.57	591,250.05	
UNION PACIFIC CORP	63,293	158.34	10,021,813.62	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	85.59	513,796.77	
UNITED PARCEL SERVICE B	59,561	101.60	6,051,397.60	
XPO LOGISTICS INC	10,037	63.89	641,263.93	
APTIV PLC	23,291	72.93	1,698,612.63	
AUTOLIV INC	6,639	79.51	527,866.89	
BORGWARNER INC	15,953	40.62	648,010.86	
FORD MOTOR COMPANY	315,578	8.58	2,707,659.24	
GENERAL MOTORS CO	106,320	38.61	4,105,015.20	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	20.58	445,083.66	
HARLEY-DAVIDSON	14,677	37.43	549,360.11	
LEAR CORP	5,287	151.56	801,297.72	
TESLA INC	10,812	302.26	3,268,035.12	
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	42.42	489,823.74	

DR HORTON INC	28,586	37.18	1,062,827.48	
GARMIN LTD	9,564	67.90	649,395.60	
HANESBRANDS INC	31,136	14.84	462,058.24	
HASBRO INC	10,617	88.85	943,320.45	
LEGGETT & PLATT INC	10,594	39.61	419,628.34	
LENNAR CORP-CL A	23,545	44.10	1,038,334.50	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	152.07	1,288,337.04	
MATTEL INC	27,399	12.44	340,843.56	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	126.62	640,950.44	
NEWELL BRANDS INC	37,563	21.09	792,203.67	
NIKE B	109,697	80.45	8,825,123.65	
NVR INC	264	2,490.45	657,478.80	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	88.32	414,309.12	
PULTE GROUP INC	21,959	26.59	583,889.81	
PVH CORP	5,820	110.18	641,247.60	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	111.57	510,767.46	
TAPESTRY INC	25,989	37.08	963,672.12	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	20.49	326,815.50	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	18.55	302,049.65	
VF CORP	28,754	82.34	2,367,604.36	
WHIRLPOOL CORP	5,324	127.06	676,467.44	
ARAMARK	19,980	31.89	637,162.20	
BLOCK H & R INC	16,984	25.63	435,299.92	
CARNIVAL CORPORATION	35,126	54.88	1,927,714.88	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	513.24	1,013,649.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	109.02	1,093,579.62	
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	267.46	923,539.38	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	73.08	1,719,060.84	
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	57.70	1,866,075.70	
MARRIOTT INTL A	25,016	109.05	2,727,994.80	
MCDONALD'S CORP	66,333	182.57	12,110,415.81	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	21.20	374,434.40	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	28.56	1,275,375.36	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	47.53	847,840.14	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	109.35	1,518,324.75	
STARBUCKS CORP	115,669	64.70	7,483,784.30	
VAIL RESORTS INC	3,574	186.73	667,373.02	
WYNN RESORTS LTD	8,052	115.18	927,429.36	
YUM BRANDS INC	27,323	92.36	2,523,552.28	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,388	48.65	2,986,526.20	
ALPHABET INC-CL A	25,494	1,107.30	28,229,506.20	
ALPHABET INC-CL C	26,855	1,098.26	29,493,772.30	

CBS CORP-CL B	28,628	49.24	1,409,642.72	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	291.40	3,972,364.80	
COMCAST CORP-CL A	390,717	36.21	14,147,862.57	
DISCOVERY INC - A	12,804	27.71	354,798.84	
DISCOVERY INC-C	23,672	25.92	613,578.24	
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	29.80	542,896.40	
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	92.52	2,319,476.40	
FACEBOOK INC-A	205,664	150.04	30,857,826.56	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	200.01	1,272,863.64	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.25	752,806.50	
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	75.60	654,922.80	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	22.16	343,834.56	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	21.57	998,065.47	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	32.04	598,923.72	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	39.36	599,570.88	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.13	249,805.92	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	54.04	682,903.48	
NETFLIX INC	37,232	339.10	12,625,371.20	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	12.52	419,157.08	
OMNICOM GROUP	19,030	76.00	1,446,280.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.05	783,505.25	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,552	108.26	1,034,099.52	
THE WALT DISNEY CO	127,073	111.04	14,110,185.92	
TRIPADVISOR INC	10,393	59.04	613,602.72	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	90,813	48.74	4,426,225.62	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	48.35	1,762,792.65	
TWITTER INC	55,701	33.27	1,853,172.27	
VIACOM INC-CLASS B	31,895	30.08	959,401.60	
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	34.00	338,708.00	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	167.61	1,036,835.46	
AMAZON.COM	35,323	1,696.20	59,914,872.60	
AUTOZONE INC	2,315	844.32	1,954,600.80	
BEST BUY COMPANY INC	21,836	58.71	1,281,991.56	
BOOKING HOLDINGS INC	4,004	1,760.26	7,048,081.04	
BURLINGTON STORES INC	6,004	169.47	1,017,497.88	
CARMAX INC	14,253	61.92	882,545.76	
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	113.53	2,535,124.90	
DOLLAR TREE INC	19,550	94.66	1,850,603.00	
EBAY	78,686	31.00	2,439,266.00	
EXPEDIA GROUP INC	9,800	118.48	1,161,104.00	
GAP	21,891	26.01	569,384.91	
GENUINE PARTS CO	12,722	97.93	1,245,865.46	

GRUBHUB INC	8,261	80.97	668,893.17	
HOME DEPOT	97,692	179.58	17,543,529.36	
KOHLS CORP	14,645	69.95	1,024,417.75	
L BRANDS INC	19,499	27.33	532,907.67	
LKQ CORP	24,693	26.25	648,191.25	
LOWES COMPANIES	68,413	94.98	6,497,866.74	
MACY'S INC	25,926	25.79	668,631.54	
MERCADOLIBRE INC	3,727	350.66	1,306,909.82	
NORDSTROM INC	10,094	47.52	479,666.88	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,012	351.50	2,464,718.00	
QURATE RETAIL INC	35,071	21.57	756,481.47	
ROSS STORES INC	31,827	93.01	2,960,229.27	
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	70.68	2,956,968.48	
TIFFANY & CO	9,326	89.82	837,661.32	
TJX COMPANIES INC	106,813	49.16	5,250,927.08	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	89.48	846,122.88	
ULTA BEAUTY INC	4,911	291.50	1,431,556.50	
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	102.14	544,099.78	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,583	213.59	8,027,352.97	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	9.48	321,372.00	
KROGER CO	68,147	29.43	2,005,566.21	
SYSCO CORP	42,872	62.68	2,687,216.96	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,540	72.43	5,254,072.20	
WALMART INC	126,155	97.73	12,329,128.15	
ALTRIA GROUP INC	161,562	48.31	7,805,060.22	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	44.26	2,115,539.48	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	45.91	1,011,856.40	
BUNGE LIMITED	11,767	53.03	624,004.01	
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	35.49	499,415.28	
COCA-COLA CO	345,058	47.61	16,428,211.38	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	46.20	788,911.20	
CONAGRA BRANDS INC	39,943	21.57	861,570.51	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	164.15	2,301,054.70	
GENERAL MILLS INC	50,246	43.47	2,184,193.62	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	108.14	1,354,020.94	
HORMEL FOODS CORP	23,465	43.84	1,028,705.60	
INGREDION INC	5,835	98.70	575,914.50	
JM SMUCKER CO	9,442	104.79	989,427.18	
KELLOGG CO	21,051	59.43	1,251,060.93	
KRAFT HEINZ CO/THE	53,058	47.53	2,521,846.74	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	70.88	916,053.12	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	139.44	1,391,053.44	

MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	63.62	960,662.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	126,095	43.36	5,467,479.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	55.58	1,941,520.56	
PEPSICO INC	120,885	110.07	13,305,811.95	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,107	73.79	9,821,965.53	
TYSON FOODS INC	24,363	60.96	1,485,168.48	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	68.36	1,453,607.04	
CLOROX COMPANY	10,995	154.37	1,697,298.15	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,032	62.63	4,448,734.16	
COTY INC-CL A	39,000	7.53	293,670.00	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,908	127.54	2,411,526.32	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	116.87	3,438,666.01	
PROCTER & GAMBLE CO	212,473	91.42	19,424,281.66	
ABBOTT LABORATORIES	150,415	71.42	10,742,639.30	
ABIOMED INC	3,502	333.74	1,168,757.48	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	220.09	1,378,643.76	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	79.86	1,025,961.42	
ANTHEM INC	21,882	266.12	5,823,237.84	
BAXTER INTERNATIONAL	44,084	70.63	3,113,652.92	
BECTON DICKINSON & CO	22,547	242.08	5,458,177.76	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,930	37.69	4,407,091.70	
CARDINAL HEALTH	25,252	49.05	1,238,610.60	
CENTENE CORP	17,957	126.62	2,273,715.34	
CERNER CORP	25,778	54.06	1,393,558.68	
CIGNA CORP	32,709	194.83	6,372,694.47	
CVS HEALTH CORP	111,050	65.52	7,275,996.00	
DANAHER CORP	54,225	107.45	5,826,476.25	
DAVITA INC	11,875	57.37	681,268.75	
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	40.83	728,162.22	
DEXCOM INC	7,827	149.52	1,170,293.04	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	168.41	3,004,265.99	
HCA HEALTHCARE INC	23,027	134.54	3,098,052.58	
HENRY SCHEIN INC	12,492	79.30	990,615.60	
HOLOGIC INC	24,459	44.12	1,079,131.08	
HUMANA INC	11,944	295.56	3,530,168.64	
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	200.87	1,447,268.35	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,805	542.55	5,319,702.75	
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	137.70	1,215,477.90	
MCKESSON CORP	16,655	126.67	2,109,688.85	
MEDTRONIC PLC	115,827	87.30	10,111,697.10	
QUEST DIAGNOSTICS	12,284	87.04	1,069,199.36	
RESMED INC	12,398	117.84	1,460,980.32	

STRYKER CORP	29,041	167.55	4,865,819.55	
TELEFLEX INC	3,697	257.92	953,530.24	
THE COOPER COS INC	4,135	269.63	1,114,920.05	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,318	265.50	21,855,429.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	131.97	956,518.56	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	127.84	1,053,018.08	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	106.03	1,034,958.83	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	264.36	1,163,977.08	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	105.34	1,826,806.28	
ABBVIE INC	129,772	89.50	11,614,594.00	
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	71.93	1,969,946.91	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	117.05	2,229,568.40	
ALKERMES PLC	12,547	34.14	428,354.58	
ALLERGAN PLC	29,318	160.22	4,697,329.96	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	83.12	615,004.88	
AMGEN	55,476	203.88	11,310,446.88	
BEIGENE LTD-ADR	3,967	143.28	568,391.76	
BIOGEN INC	17,262	337.42	5,824,544.04	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	97.69	1,400,972.29	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140,314	50.12	7,032,537.68	
CELGENE CORP	59,466	86.27	5,130,131.82	
GILEAD SCIENCES INC	111,360	69.18	7,703,884.80	
ILLUMINA INC	12,711	312.75	3,975,365.25	
INCYTE CORP	16,120	78.42	1,264,130.40	
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	127.19	1,813,093.45	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	129.07	641,606.97	
JOHNSON & JOHNSON	229,254	130.69	29,961,205.26	
LILLY (ELI) & CO	82,910	116.59	9,666,476.90	
MERCK & CO	227,576	75.87	17,266,191.12	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,243	602.10	1,350,510.30	
MYLAN NV	42,644	29.59	1,261,835.96	
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	46.20	624,023.40	
PERRIGO CO PLC	11,333	45.97	520,978.01	
PFIZER	501,305	42.53	21,320,501.65	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	418.84	2,898,791.64	
SEATTLE GENETICS INC	9,601	73.61	706,729.61	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	18.82	1,518,585.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,582	240.66	8,322,504.12	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	115.75	375,840.25	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	194.70	4,212,139.80	
WATERS CORP	6,513	206.94	1,347,800.22	
ZOETIS INC	41,718	84.59	3,528,925.62	

BANK OF AMERICA CORP	809,805	29.30	23,727,286.50	
BB&T CORP	64,293	49.29	3,169,001.97	
CIT GROUP INC	10,713	44.39	475,550.07	
CITIGROUP	215,167	63.12	13,581,341.04	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	35.43	1,417,554.30	
COMERICA INC	14,360	81.19	1,165,888.40	
EAST WEST BANCORP INC	10,794	50.25	542,398.50	
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	27.00	1,571,859.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	96.02	1,356,378.52	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	98,222	13.59	1,334,836.98	
JPMORGAN CHASE & CO	286,626	104.59	29,978,213.34	
KEY CORP	87,033	16.85	1,466,506.05	
M & T BANK CORP	11,745	165.59	1,944,854.55	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	16.37	448,276.08	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,173	125.25	4,906,418.25	
REGIONS FINL CORP	96,209	15.70	1,510,481.30	
SIGNATURE BANK	4,354	124.40	541,637.60	
SUNTRUST BANKS	38,353	60.72	2,328,794.16	
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	230.99	1,014,046.10	
US BANCORP	132,861	50.22	6,672,279.42	
WELLS FARGO & CO	390,589	50.01	19,533,355.89	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	47.05	714,501.30	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	108.57	481,290.81	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	26.14	941,771.92	
AMERICAN EXPRESS	62,843	100.48	6,314,464.64	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	121.11	1,435,153.50	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	18.88	428,462.72	
BANK NEW YORK CO	84,617	52.66	4,455,931.22	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110,724	204.48	22,640,843.52	
BLACKROCK INC	10,321	419.45	4,329,143.45	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,390	84.97	3,516,908.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	95.09	900,502.30	
CME GROUP INC	30,723	183.43	5,635,519.89	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	66.37	1,962,229.05	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	50.66	1,069,331.28	
EATON VANCE CORP	10,061	39.70	399,421.70	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	31.54	822,247.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,147	202.54	6,105,973.38	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,543	75.63	3,746,937.09	
INVESCO LTD	30,943	18.84	582,966.12	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	20.38	523,888.28	
MOODY'S CORP	15,058	159.40	2,400,245.20	

MORGAN STANLEY	112,668	43.69	4,922,464.92	
MSCI INC	7,907	165.97	1,312,324.79	
NASDAQ INC	9,070	83.14	754,079.80	
NORTHERN TRUST CORP	17,320	91.16	1,578,891.20	
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	96.61	1,938,576.26	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,870	81.26	964,556.20	
S&P GLOBAL INC	21,709	188.64	4,095,185.76	
SCHWAB (CHARLES) CORP	102,452	47.98	4,915,646.96	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	49.33	532,862.66	
STATE STREET CORP	32,349	71.30	2,306,483.70	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	26.28	1,585,919.16	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	55.37	1,295,879.48	
VOYA FINANCIAL INC	14,081	45.35	638,573.35	
AFLAC	65,227	47.70	3,111,327.90	
ALLEGHANY CORP	1,276	619.59	790,596.84	
ALLSTATE CORP	30,108	85.70	2,580,255.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	95.96	672,967.48	
AMERICAN INT'L GROUP	76,910	44.16	3,396,345.60	
AON PLC	20,163	154.41	3,113,368.83	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	28.48	984,012.48	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	74.41	1,114,066.52	
ASSURANT INC	4,769	96.38	459,636.22	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	43.49	580,461.03	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	36.43	379,454.88	
CHUBB LTD	38,983	133.59	5,207,738.97	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	80.35	997,384.55	
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	216.69	726,561.57	
FNF GROUP	24,961	34.43	859,407.23	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	46.68	1,480,222.80	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	59.16	1,052,456.40	
LOEWS CORP	22,051	47.53	1,048,084.03	
MARKEL CORP	1,132	1,068.20	1,209,202.40	
MARSH & MCLENNAN COS	42,543	84.06	3,576,164.58	
METLIFE INC	71,520	45.31	3,240,571.20	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	50.10	1,160,065.50	
PROGRESSIVE CORP	48,878	64.42	3,148,720.76	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,290	92.26	3,255,855.40	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	149.13	809,925.03	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	132.95	431,954.55	
TORCHMARK CORP	8,473	81.98	694,616.54	
TRAVELERS COS INC/THE	23,228	124.01	2,880,504.28	
UNUM GROUP	18,574	34.45	639,874.30	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	158.66	1,734,153.80	
WR BERKLEY CORP	7,296	75.68	552,161.28	
CBRE GROUP INC-A	26,855	44.55	1,196,390.25	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.90	681,030.00	
JONES LANG LASALLE INC	3,673	142.83	524,614.59	
WEYERHAEUSER CO	62,107	25.08	1,557,643.56	
ACCENTURE PLC-CL A	54,905	150.45	8,260,457.25	
ADOBE INC	41,906	247.51	10,372,154.06	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	14,178	65.79	932,770.62	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	172.52	692,840.32	
ANSYS INC	6,865	161.71	1,110,139.15	
AUTODESK INC	18,086	141.73	2,563,328.78	
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,852	135.18	4,981,653.36	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	101.31	977,641.50	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	25,271	46.62	1,178,134.02	
CDK GLOBAL INC	10,687	50.24	536,914.88	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	106.84	1,153,978.84	
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	108.74	1,234,416.48	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	67.82	3,256,716.40	
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	62.62	1,471,444.76	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	105.84	2,870,910.00	
FIRST DATA CORP- CLASS A	47,683	22.95	1,094,324.85	
FISERV INC	33,784	77.82	2,629,070.88	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	198.32	1,420,566.16	
FORTINET INC	12,963	70.50	913,891.50	
GARTNER INC	8,145	129.74	1,056,732.30	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,947	114.59	1,598,186.73	
GODADDY INC - CLASS A	14,919	65.31	974,359.89	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,135	123.82	9,674,675.70	
INTUIT INC	20,572	213.87	4,399,733.64	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	130.87	782,471.73	
LEIDOS HOLDINGS	10,999	56.88	625,623.12	
MASTERCARD INC-CLASS A	78,802	202.00	15,918,004.00	
MICROSOFT CORP	620,635	107.71	66,848,595.85	
ORACLE CORP	255,283	49.27	12,577,793.41	
PAYCHEX INC	27,697	69.90	1,936,020.30	
PAYPAL HOLDINGS INC	96,308	91.12	8,775,584.96	
PTC INC	9,984	87.68	875,397.12	
RED HAT INC	15,009	175.51	2,634,229.59	
SABRE CORP	24,114	22.85	551,004.90	
SALESFORCE.COM INC	61,555	152.51	9,387,753.05	
SERVICENOW INC	14,927	190.09	2,837,473.43	

SPLUNK INC	11,773	120.72	1,421,236.56	
SQUARE INC - A	24,800	72.24	1,791,552.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	48.84	863,540.04	
SYMANTEC CORP	48,508	20.11	975,495.88	
SYNOPSYS INC	12,264	91.49	1,122,033.36	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	87.94	1,250,330.92	
VERISIGN INC	9,541	164.44	1,568,922.04	
VISA INC-CLASS A SHARES	151,622	138.50	20,999,647.00	
VMWARE INC-CLASS A	6,787	147.66	1,002,168.42	
WESTERN UNION CO	38,757	18.26	707,702.82	
WIX.COM LTD	5,661	104.29	590,385.69	
WORKDAY INC-CLASS A	12,522	172.08	2,154,785.76	
WORLDPAY INC-CLASS A	25,793	83.88	2,163,516.84	
AMPHENOL CORPORATION	26,216	82.49	2,162,557.84	
APPLE INC	411,495	156.82	64,530,645.90	
ARISTA NETWORKS INC	4,324	232.08	1,003,513.92	
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	75.31	502,016.46	
CDW CORP/DE	12,482	81.69	1,019,654.58	
CISCO SYSTEMS	401,562	45.03	18,082,336.86	
COGNEX CORP	12,660	42.94	543,620.40	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	19.05	284,473.65	
CORNING	71,752	30.63	2,197,763.76	
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	43.35	602,131.50	
F5 NETWORKS INC	5,350	158.64	848,724.00	
FLEX LTD	40,465	8.14	329,385.10	
FLIR SYSTEMS INC	11,686	45.39	530,427.54	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	14.68	1,904,524.48	
HP INC	134,066	21.75	2,915,935.50	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	132.51	424,959.57	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	28.32	886,529.28	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	69.58	1,103,051.74	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	115.60	1,611,001.60	
NETAPP INC	22,881	62.98	1,441,045.38	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	203.30	1,639,411.20	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	40.23	918,692.28	
TE CONNECTIVITY LTD	30,342	81.25	2,465,287.50	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	36.59	754,558.98	
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	39.20	924,218.40	
XEROX CORP	16,718	23.43	391,702.74	
AT&T INC	619,927	30.96	19,192,939.92	
CENTURYLINK INC	83,301	15.83	1,318,654.83	
SPRINT CORP	64,825	6.07	393,487.75	

T-MOBILE US INC	28,273	66.96	1,893,160.08	
VERIZON COMMUNICATIONS	352,654	57.09	20,133,016.86	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	27.65	422,740.85	
AES CORP	52,646	15.55	818,645.30	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	42.95	827,045.20	
AMEREN CORPORATION	21,002	67.24	1,412,174.48	
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	76.09	3,151,799.98	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,134	92.61	1,494,169.74	
ATMOS ENERGY CORP	9,385	95.43	895,610.55	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	29.44	1,259,796.48	
CMS ENERGY CORP	24,527	50.88	1,247,933.76	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	76.51	2,103,565.94	
DOMINION ENERGY INC	65,279	68.77	4,489,236.83	
DTE ENERGY COMPANY	15,603	112.98	1,762,826.94	
DUKE ENERGY CORP	61,991	85.60	5,306,429.60	
EDISON INTL	28,962	54.88	1,589,434.56	
ENTERGY CORP	15,636	86.29	1,349,230.44	
EVERGY INC	24,339	56.66	1,379,047.74	
EVERSOURCE ENERGY	28,103	67.67	1,901,730.01	
EXELON CORP	84,371	46.08	3,887,815.68	
FIRSTENERGY CORP	43,246	38.87	1,680,972.02	
NEXTERA ENERGY INC	40,931	176.09	7,207,539.79	
NISOURCE INC	32,308	26.65	861,008.20	
NRG ENERGY INC	26,737	40.34	1,078,570.58	
OGE ENERGY CORP	15,686	40.28	631,832.08	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	85.67	806,668.72	
PPL CORPORATION	59,613	30.07	1,792,562.91	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	44,554	51.94	2,314,134.76	
SEMPRA ENERGY	23,257	112.67	2,620,366.19	
SOUTHERN CO	88,512	47.22	4,179,536.64	
UGI CORP	13,950	55.23	770,458.50	
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.20	715,376.20	
WEC ENERGY GROUP INC	27,947	70.86	1,980,324.42	
XCEL ENERGY INC	44,934	50.70	2,278,153.80	
ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	20.77	1,602,779.36	
ANALOG DEVICES	32,237	91.36	2,945,172.32	
APPLIED MATERIALS	84,218	35.71	3,007,424.78	
BROADCOM INC	36,960	260.82	9,639,907.20	
INTEL CORP	393,606	49.19	19,361,479.14	
KLA-TENCOR CORP	13,856	95.73	1,326,434.88	
LAM RESEARCH CORP	13,961	147.55	2,059,945.55	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	16.88	923,960.56	

	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,692	53.61	1,323,738.12	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	77.64	1,610,564.16	
	MICRON TECHNOLOGY	97,275	35.76	3,478,554.00	
	NVIDIA CORP	49,534	156.93	7,773,370.62	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	29,778	80.79	2,405,764.62	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	18.41	662,686.36	
	QORVO INC	10,609	63.28	671,337.52	
	QUALCOMM	120,656	55.27	6,668,657.12	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	70.07	1,016,715.70	
	TEXAS INSTRUMENTS	83,302	99.42	8,281,884.84	
	XILINX INC	22,116	93.52	2,068,288.32	
アメリカドル 小計		25,894,489		1,957,990,945.68 (214,732,867,012)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	27,117	9.90	268,458.30	
	CAMECO CORP	28,709	15.73	451,592.57	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,328	36.51	3,882,035.28	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.79	1,043,026.14	
	ENBRIDGE	173,856	47.91	8,329,440.96	
	ENCANA CORP	76,271	9.34	712,371.14	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	16.70	525,031.30	
	IMPERIAL OIL	24,763	37.21	921,431.23	
	INTER PIPELINE LTD	30,317	21.58	654,240.86	
	KEYERA CORP	14,929	28.21	421,147.09	
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	45.33	1,916,371.08	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	19.62	360,027.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	10.58	211,705.80	
	SUNCOR ENERGY	140,326	42.49	5,962,451.74	
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	19.18	382,928.70	
	TRANSCANADA CORP	76,556	55.29	4,232,781.24	
	VERMILION ENERGY INC	10,067	32.67	328,888.89	
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	51.74	1,110,288.66	
	BARRICK GOLD CORP	149,092	15.64	2,331,798.88	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	54.92	721,593.88	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	12.70	722,630.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	91.48	1,533,021.84	
	GOLDCORP INC	68,688	13.78	946,520.64	
	KINROSS GOLD CORP	107,615	4.12	443,373.80	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	5.96	370,968.28	
	METHANEX CORP	7,099	78.27	555,638.73	
	NUTRIEN LTD	51,428	68.09	3,501,732.52	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	30.63	1,399,086.51	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	2.16	153,360.00	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	70.90	306,784.30	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	25.25	930,159.50	
BOMBARDIER B	157,835	2.10	331,453.50	
CAE INC	25,999	26.92	699,893.08	
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	25.63	301,511.32	
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	48.20	709,166.60	
WSP GLOBAL INC	9,471	64.25	608,511.75	
THOMSON REUTERS CORP	20,231	67.52	1,365,997.12	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,162	109.25	6,900,448.50	
CP RAILWAY LIMITED	11,959	261.72	3,129,909.48	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	67.56	1,890,193.68	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	43.48	767,813.32	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	76.21	1,628,226.65	
STARS GROUP INC/THE	24,249	23.79	576,883.71	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	26.93	968,052.71	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	147.80	799,450.20	
DOLLARAMA INC	26,700	35.16	938,772.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	40,089	71.63	2,871,575.07	
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	30.08	345,889.92	
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	63.63	993,773.34	
METRO INC	19,179	49.29	945,332.91	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	94.01	647,070.83	
SAPUTO INC	20,412	39.39	804,028.68	
AURORA CANNABIS INC	53,000	8.53	452,090.00	
CANOPY GROWTH CORP	16,400	57.80	947,920.00	
BANK MONTREAL	55,382	96.73	5,357,100.86	
BANK NOVA SCOTIA	106,056	73.34	7,778,147.04	
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	109.69	4,167,123.10	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	60.74	1,714,568.72	
ROYAL BANK OF CANADA	123,447	98.64	12,176,812.08	
TORONTO-DOMINION BANK	154,229	72.34	11,156,925.86	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	73,316	55.98	4,104,229.68	
CI FINANCIAL CORP	18,671	18.16	339,065.36	
IGM FINANCIAL INC	7,685	33.12	254,527.20	
ONEX CORP	6,603	78.72	519,788.16	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	623.34	1,436,798.70	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	29.54	702,697.52	
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	48.14	396,192.20	
INTACT FINANCIAL CORP	13,951	103.07	1,437,929.57	
MANULIFE FINANCIAL CORP	172,987	21.38	3,698,462.06	
POWER CORP OF CANADA	29,774	25.87	770,253.38	
POWER FINANCIAL CORP	20,740	27.34	567,031.60	

	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	48.86	2,420,328.96	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	20.19	251,668.35	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	10.41	410,154.00	
	CGI GROUP INC - CL A	21,192	86.85	1,840,525.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	940.98	1,600,606.98	
	OPEN TEXT CORP	24,643	46.87	1,155,017.41	
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	210.55	1,545,858.10	
	BCE INC	12,539	55.83	700,052.37	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	72.61	2,330,417.95	
	TELUS CORP	16,454	46.20	760,174.80	
	ALTAGAS INCOME LTD	31,487	14.02	441,447.74	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	40.00	209,640.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.34	344,202.16	
	EMERA INC	4,086	44.93	183,583.98	
	FORTIS INC	38,447	46.37	1,782,787.39	
	HYDRO ONE LTD	32,299	20.44	660,191.56	
カナダドル 小計		3,530,362		148,469,161.27 (12,275,430,253)	
ユーロ	ENAGAS	18,299	25.02	457,840.98	
	ENI	216,297	14.60	3,159,666.57	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	14.36	572,490.12	
	NESTE OIL OYJ	11,086	78.86	874,241.96	
	OMV AG	12,139	42.65	517,728.35	
	REPSOL SA	113,179	15.00	1,697,685.00	
	SNAM SPA	205,372	4.13	849,418.59	
	TENARIS SA	40,648	10.65	433,104.44	
	TOTAL SA	205,309	47.78	9,810,690.56	
	VOPAK	6,360	43.72	278,059.20	
	AIR LIQUIDE	36,297	105.55	3,831,148.35	
	AKZO NOBEL	22,210	73.68	1,636,432.80	
	ARCELORMITTAL	53,985	20.01	1,080,239.85	
	ARKEMA	5,335	84.00	448,140.00	
	BASF SE	77,217	65.60	5,065,435.20	
	COVESTRO AG	16,178	48.48	784,309.44	
	CRH PLC	71,124	25.29	1,798,725.96	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	23.79	320,070.66	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	40.94	235,896.28	
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	60.14	686,016.98	
	IMERYS SA	3,000	45.50	136,500.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	80.00	1,218,720.00	
	LANXESS	7,293	48.72	355,314.96	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	25.18	492,646.70	

SOLVAY SA	6,906	95.76	661,318.56	
STORA ENSO OYJ R	47,237	11.79	556,924.23	
SYMRISE AG	11,581	72.88	844,023.28	
THYSSEN KRUPP	33,044	15.98	528,043.12	
UMICORE	17,605	35.87	631,491.35	
UPM KYMMENE OYJ	43,990	25.63	1,127,463.70	
VOESTALPINE AG	8,140	27.19	221,326.60	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	35.32	727,274.12	
AIRBUS SE	49,075	93.66	4,596,364.50	
ALSTOM	13,816	34.45	475,961.20	
ANDRITZ AG	5,242	43.22	226,559.24	
BOUYGUES ORD	16,815	30.12	506,467.80	
BRENNTAG AG	11,626	41.35	480,735.10	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	9.04	841,327.14	
DASSAULT AVIATION SA	213	1,268.00	270,084.00	
EIFFAGE	6,079	78.42	476,715.18	
FERROVIAL SA	38,509	19.36	745,534.24	
GEA GROUP AG	13,382	24.19	323,710.58	
HOCHTIEF AG	1,354	123.70	167,489.80	
KINGSPAN GROUP PLC	16,906	37.96	641,751.76	
KION GROUP AG	5,887	47.19	277,807.53	
KONE OYJ-B	30,120	43.98	1,324,677.60	
LEGRAND SA	21,312	51.08	1,088,616.96	
LEONARDO SPA	35,425	7.89	279,644.95	
METSO OYJ	9,561	25.92	247,821.12	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	181.50	862,669.50	
OSRAM LICHT AG	7,440	37.78	281,083.20	
PRYSMIAN SPA	25,673	18.61	477,902.89	
REXEL SA	24,339	10.03	244,120.17	
SAFRAN SA	28,935	110.05	3,184,296.75	
SAINT-GOBAIN	46,266	29.91	1,383,816.06	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,763	60.26	2,878,198.38	
SIEMENS	65,680	100.56	6,604,780.80	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	11.52	201,496.32	
THALES SA	9,665	99.82	964,760.30	
VINCI S.A.	43,091	75.42	3,249,923.22	
WARTSILA OYJ	34,386	14.45	497,049.63	
BUREAU VERITAS SA	19,558	19.26	376,687.08	
EDENRED	18,941	36.63	693,808.83	
RANDSTAD NV	9,588	41.71	399,915.48	
SOCIETE BIC SA	2,424	91.60	222,038.40	
TELEPERFORMANCE	4,523	147.00	664,881.00	

WOLTERS KLUWER	25,763	53.36	1,374,713.68	
ADP	2,382	163.00	388,266.00	
AENA SME SA	5,610	142.90	801,669.00	
ATLANTIA SPA	42,039	19.63	825,435.76	
BOLLORE	61,805	3.63	224,352.15	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	20.85	352,969.65	
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	25.77	2,190,089.22	
FRAPORT AG	3,561	64.36	229,185.96	
GETLINK	36,478	12.52	456,704.56	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.02	325,320.84	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	73.34	2,122,899.64	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	63.90	318,924.90	
CONTINENTAL AG	8,828	134.50	1,187,366.00	
DAIMLER AG	78,530	50.89	3,996,391.70	
FAURECIA	5,945	37.41	222,402.45	
FERRARI NV	9,947	99.50	989,726.50	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	14.75	1,421,590.25	
MICHELIN	13,802	93.00	1,283,586.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	29.30	301,555.60	
PEUGEOT SA	52,883	21.33	1,127,994.39	
PIRELLI & C SPA	39,097	6.05	236,615.04	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	56.02	785,848.56	
RENAULT SA	17,362	57.10	991,370.20	
VALEO SA	19,350	26.64	515,484.00	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	145.66	2,330,414.34	
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	147.00	381,318.00	
ADIDAS AG	16,028	204.00	3,269,712.00	
ESSILORLUXOTTICA	25,039	112.05	2,805,619.95	
HERMES INTERNATIONAL	2,861	500.40	1,431,644.40	
HUGO BOSS AG	4,852	58.36	283,162.72	
KERING	6,725	410.00	2,757,250.00	
LVMH	23,916	253.40	6,060,314.40	
MONCLER SPA	15,736	30.34	477,430.24	
PUMA AG	772	472.00	364,384.00	
SEB SA	2,075	127.60	264,770.00	
ACCOR	17,931	39.02	699,667.62	
PADDY POWER PLC	7,143	71.00	507,153.00	
SODEXO	8,135	94.16	765,991.60	
AXEL SPRINGER SE	3,827	50.70	194,028.90	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	18.17	217,603.92	
JC DECAUX SA	4,674	25.74	120,308.76	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	14.92	286,171.95	

PUBLICIS GROUPE	17,601	53.04	933,557.04	
RTL GROUP	3,513	46.52	163,424.76	
SES	31,369	17.26	541,585.78	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	39.72	198,520.56	
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	78.22	534,242.60	
VIVENDI	94,307	21.97	2,071,924.79	
DELIVERY HERO SE	8,671	32.94	285,622.74	
INDITEX	93,820	23.83	2,235,730.60	
ZALANDO SE	9,155	26.61	243,614.55	
CARREFOUR	53,759	16.61	893,205.78	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	39.19	144,493.53	
COLRUYT SA	4,160	62.34	259,334.40	
JERONIMO MARTINS	20,234	12.10	244,831.40	
KONINKLIJKE AHOLD NV	108,577	22.55	2,448,954.23	
METRO AG	13,712	14.93	204,788.72	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	64,381	64.75	4,168,669.75	
DANONE (GROUPE)	52,307	62.35	3,261,341.45	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.98	339,570.11	
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	73.65	661,377.00	
HEINEKEN NV	22,649	75.80	1,716,794.20	
KERRY GROUP PLC-A	13,146	92.25	1,212,718.50	
PERNOD-RICARD	18,484	139.60	2,580,366.40	
REMY COINTREAU	1,575	101.80	160,335.00	
BEIERSDORF AG	9,190	88.34	811,844.60	
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	87.55	754,505.90	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	97.02	1,526,706.72	
LOREAL	21,337	199.80	4,263,132.60	
UNILEVER NV-CVA	131,771	46.85	6,173,471.35	
BIOMERIEUX	3,246	61.40	199,304.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	62.02	1,116,111.92	
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	44.03	1,617,970.41	
KONINKLIJKE PHILIPS	80,612	31.40	2,531,216.80	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	113.80	369,394.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.25	440,625.00	
BAYER	78,360	66.50	5,210,940.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	971	359.80	349,365.80	
GRIFOLS SA	27,685	24.44	676,621.40	
IPSEN	2,722	120.60	328,273.20	
MERCK KGAA	10,480	90.50	948,440.00	
ORION OYJ-CLASS B	7,975	31.24	249,139.00	
QIAGEN N.V.	17,548	32.45	569,432.60	
RECORDATI SPA	7,493	30.91	231,608.63	

SANOFI	96,647	72.92	7,047,499.24	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,042	88.30	356,908.60	
UCB (GROUPE)	10,465	75.84	793,665.60	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	22.82	757,372.98	
BANCO BILBAO VIZCAYA	591,442	5.20	3,075,498.40	
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.06	470,867.54	
BANCO SANTANDER SA	1,401,372	4.35	6,103,675.74	
BANKIA SA	110,053	2.59	285,807.64	
BANKINTER SA	58,881	7.11	418,879.43	
BNP PARIBAS	95,497	42.47	4,055,757.59	
CAIXABANK	343,011	3.30	1,133,651.35	
COMMERZBANK AG	80,494	6.68	537,699.92	
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.32	958,418.21	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	30.61	843,611.60	
ING GROEP NV-CVA	332,029	10.45	3,471,031.16	
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.03	2,623,131.60	
KBC GROEP NV	20,232	60.66	1,227,273.12	
MEDIOBANCA	53,990	7.87	425,333.22	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	24.29	303,382.10	
SOCIETE GENERALE	63,719	28.60	1,822,681.99	
UNICREDIT SPA	177,131	10.66	1,889,633.50	
AMUNDI SA	4,764	49.48	235,722.72	
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	7.99	1,288,925.68	
DEUTSCHE BOERSE	17,038	114.45	1,949,999.10	
EURAZEO SA	3,198	64.90	207,550.20	
EXOR NV	10,345	55.06	569,595.70	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	81.94	511,879.18	
NATIXIS	69,996	4.59	321,351.63	
WENDEL	2,023	108.40	219,293.20	
AEGON	166,267	4.54	755,849.78	
AGEAS	16,065	41.09	660,110.85	
ALLIANZ SE-REG	37,062	184.00	6,819,408.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	15.37	1,562,345.13	
AXA	165,661	20.56	3,405,990.16	
CNP ASSURANCES	11,830	19.80	234,234.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	125.10	588,720.60	
MAPFRE SA	90,939	2.46	224,073.69	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	195.15	2,471,574.75	
NN GROUP NV	27,631	37.53	1,036,991.43	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.58	349,221.51	
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	40.81	1,477,852.53	
SCOR SE	13,354	41.66	556,327.64	

AROUNDTOWN SA	86,595	7.52	651,194.40	
DEUTSCHE WOHNEN SE	33,559	41.56	1,394,712.04	
VONOVIA SE	40,469	42.01	1,700,102.69	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	65.00	2,352,090.00	
ATOS SE	7,634	73.66	562,320.44	
CAPGEMINI SA	13,238	96.38	1,275,878.44	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	111.70	1,169,387.30	
SAP SE	84,279	93.10	7,846,374.90	
WIRECARD AG	9,864	149.85	1,478,120.40	
INGENICO GROUP	4,681	52.76	246,969.56	
NOKIA OYJ	489,813	5.30	2,597,968.15	
1&1 DRILLISCH AG	3,773	38.82	146,467.86	
DEUTSCHE TELEKOM	281,702	14.89	4,194,542.78	
ELISA A	11,722	38.66	453,172.52	
ILIAD SA	2,053	105.85	217,310.05	
KPN (KON.)	261,596	2.52	660,529.90	
ORANGE	164,543	13.57	2,232,848.51	
PROXIMUS	13,141	22.78	299,351.98	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.48	416,471.65	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	198,402.03	
TELEFONICA	410,000	7.68	3,151,670.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.10	207,664.66	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.46	346,843.98	
E.ON SE	183,255	9.13	1,673,667.91	
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	14.30	711,473.48	
ENDESA	24,774	21.14	523,722.36	
ENEL	711,008	5.30	3,774,030.46	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.07	725,432.47	
ENGIE	151,158	13.83	2,091,270.93	
FORTUM OYJ	38,328	19.34	741,455.16	
IBERDROLA SA	506,837	7.06	3,580,296.56	
IBERDROLA SA-RTS	506,837	0.15	79,370.67	
INNOGY SE	11,000	40.61	446,710.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	32,230	23.40	754,182.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	19.66	779,165.12	
RWE STAMM	42,828	20.25	867,267.00	
SUEZ	28,043	11.63	326,140.09	
TERNA SPA	130,230	5.33	694,907.28	
UNIPER SE	14,751	24.76	365,234.76	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	18.33	838,679.57	
VERBUND AG	10,227	43.92	449,169.84	
ASML HOLDING NV	35,211	142.88	5,030,947.68	

	INFINEON TECHNOLOGIES	99,840	18.47	1,844,044.80	
	STMICROELECTRONICS	57,598	12.86	740,710.28	
ユーロ 小計		16,962,333		302,844,672.16 (37,776,844,405)	
イギリスポンド	BP PLC	1,710,065	5.23	8,948,770.14	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	393,260	23.62	9,288,801.20	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,895	23.89	7,666,181.55	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	5.48	296,028.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	18.21	1,592,202.31	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.54	306,497.08	
	BHP GROUP PLC	179,682	16.28	2,926,301.05	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	48.83	500,165.69	
	FRESNILLO PLC	17,743	8.87	157,486.86	
	GLENCORE PLC	988,180	2.97	2,942,305.95	
	JOHNSON MATTHEY PLC	18,160	30.51	554,061.60	
	MONDI PLC	34,071	18.13	617,877.58	
	RIO TINTO PLC REG	100,197	39.25	3,932,732.25	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	19.53	820,670.13	
	BAE SYSTEMS PLC	282,016	5.10	1,438,281.60	
	BUNZL PLC	27,712	24.21	670,907.52	
	DCC PLC	9,127	64.40	587,778.80	
	FERGUSON PLC	19,208	53.21	1,022,057.68	
	MEGGITT PLC	66,268	5.01	332,532.82	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.69	692,588.01	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	8.95	1,334,071.80	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	14.60	542,331.60	
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	14.15	262,991.90	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	5.53	108,902.29	
	EXPERIAN PLC	75,041	19.43	1,458,421.83	
	G4S PLC	132,555	2.09	277,172.50	
	INTERTEK GROUP PLC	14,722	50.70	746,405.40	
	RELX PLC	171,324	16.67	2,855,971.08	
	EASYJET PLC	11,633	11.72	136,338.76	
	ROYAL MAIL PLC	75,133	2.98	224,347.13	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.35	516,109.15	
	BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.87	631,488.00	
	PERSIMMON PLC	26,389	23.95	632,016.55	
	TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.67	452,436.51	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	38.41	407,107.59	
	CARNIVAL PLC	13,721	41.68	571,891.28	
	COMPASS GROUP PLC	136,301	16.19	2,206,713.19	
	GVC HOLDINGS PLC	42,500	7.14	303,662.50	

INTERCONTINENTAL HOTELS	13,265	44.15	585,716.07	
MERLIN ENTERTAINME	65,098	3.42	222,635.16	
TUI AG-DI	37,945	11.87	450,407.15	
WHITBREAD PLC	14,664	48.20	706,804.80	
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.53	362,445.30	
INFORMA PLC	100,899	6.76	682,279.03	
ITV PLC	295,435	1.32	391,894.52	
PEARSON	66,305	9.25	613,586.47	
WPP PLC	113,065	8.75	990,223.27	
KINGFISHER PLC	170,994	2.26	387,814.39	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.89	391,586.38	
NEXT PLC	11,202	47.46	531,646.92	
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.30	387,780.31	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.77	412,222.96	
TESCO	856,393	2.24	1,922,602.28	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	23.51	678,145.95	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	197,242	25.41	5,012,905.43	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.46	457,261.60	
DIAGEO	211,349	27.53	5,819,494.71	
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	24.82	2,066,557.12	
RECKITT BENCKISER PLC	56,603	59.78	3,383,727.34	
UNILEVER PLC	97,505	40.58	3,956,752.90	
CONVATEC GROUP PLC	112,565	1.40	157,816.13	
NMC HEALTH PLC	9,509	27.58	262,258.22	
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	14.55	1,033,442.85	
ASTRAZENECA	108,675	55.70	6,053,197.50	
GLAXOSMITHKLINE	425,464	14.98	6,376,003.50	
BARCLAYS	1,471,691	1.65	2,440,946.69	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,712,303	6.51	11,160,790.95	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,182,117	0.58	3,585,627.86	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.45	971,011.42	
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.23	1,456,458.00	
3I GROUP PLC	79,251	8.38	664,757.38	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	18.34	495,700.24	
INVESTEC PLC	54,280	4.89	265,483.48	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	44.54	1,171,223.84	
SCHRODERS PLC	8,614	26.42	227,581.88	
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.83	439,982.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.69	521,845.22	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.00	341,355.00	
AVIVA PIC	348,023	4.17	1,452,648.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.26	370,938.33	

	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.57	1,247,526.83	
	PRUDENTIAL	225,383	15.03	3,387,506.49	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.29	457,959.09	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	15.00	525,540.00	
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.32	565,044.64	
	BT GROUP PLC	730,298	2.38	1,744,681.92	
	VODAFONE GROUP PLC	2,309,362	1.49	3,448,801.21	
	CENTRICA PLC	440,558	1.37	604,225.29	
	NATIONAL GRID PLC	299,953	8.04	2,413,721.79	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	19.55	354,089.60	
	SSE PLC	80,824	11.33	916,140.04	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.30	489,258.12	
イギリスポンド 小計		25,604,908		144,980,660.45 (20,442,273,123)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.88	345,872.24	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	508.50	341,712.00	
	GIVAUDAN-REG	813	2,442.00	1,985,346.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	47.50	1,915,865.00	
	SIKA AG-BR	10,500	135.50	1,422,750.00	
	ABB LTD	162,508	19.25	3,129,091.54	
	GEBERIT AG-REG	3,021	386.10	1,166,408.10	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	202.80	299,941.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	207.40	781,483.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	50.70	670,456.80	
	SGS SA	437	2,368.00	1,034,816.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	135.25	685,311.75	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	68.80	3,078,387.20	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	307.10	762,529.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	60.40	237,855.20	
	DUFRY AG-REG	2,548	95.32	242,875.36	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,564.00	250,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	73,100.00	584,800.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	6,205.00	645,320.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	261,490	84.40	22,069,756.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	179.70	917,188.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	713.50	555,816.50	
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	277.50	1,805,692.50	
	NOVARTIS	185,277	88.80	16,452,597.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,050	258.40	15,516,920.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	124.00	446,524.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	224,271	12.24	2,745,077.04	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	40.79	703,790.66	

	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	78.30	265,985.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	684.00	1,019,844.00	
	UBS GROUP AG	334,926	13.50	4,523,175.63	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	153.60	595,507.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	417.10	1,230,027.90	
	SWISS RE LTD	26,239	94.90	2,490,081.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,265	314.20	4,167,863.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	84.15	528,209.55	
	TEMENOS AG - REG	5,252	132.10	693,789.20	
	SWISSCOM	2,064	488.70	1,008,676.80	
スイスフラン 小計		1,477,276		97,317,583.47 (10,723,424,522)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	270.00	3,831,570.00	
	BOLIDEN AB	20,141	217.65	4,383,688.65	
	ALFA LAVAL AB	25,639	201.40	5,163,694.60	
	ASSA ABLOY AB-B	88,864	167.75	14,906,936.00	
	ATLAS COPCO A	59,675	228.95	13,662,591.25	
	ATLAS COPCO B	29,972	213.10	6,387,033.20	
	EPIROC AB-A	53,833	88.21	4,748,608.93	
	EPIROC AB-B	29,972	82.57	2,474,788.04	
	SANDVIK AB	100,730	139.25	14,026,652.50	
	SKANSKA B	28,530	158.20	4,513,446.00	
	SKF AB-B	28,335	148.40	4,204,914.00	
	VOLVO B	136,906	125.15	17,133,785.90	
	SECURITAS B	22,844	145.15	3,315,806.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	208.50	3,788,445.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	70.98	2,747,777.76	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	136.74	10,113,563.88	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	325.40	1,864,542.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	398.70	6,039,906.30	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	227.50	11,049,902.50	
	NORDEA BANK ABP	274,557	82.00	22,513,674.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	91.94	12,752,997.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	100.85	13,754,528.10	
	SWEDBANK AB-A	80,216	214.40	17,198,310.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	187.70	2,401,058.40	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	401.00	16,215,638.00	
	KINNEVIK AB - B	18,104	225.70	4,086,072.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	283.60	2,064,608.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	77.08	20,715,635.40	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	447.10	9,614,438.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	628.00	3,889,832.00	

	TELE2 AB-B SHS	51,594	114.70	5,917,831.80	
	TELIA CO AB	235,437	42.15	9,923,669.55	
スウェーデンクローナ 小計		2,131,893		275,405,947.36 (3,348,936,319)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	286.20	2,951,008.20	
	EQUINOR ASA	100,907	193.55	19,530,549.85	
	NORSK HYDRO	106,150	40.65	4,314,997.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	358.00	4,822,260.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	292.00	2,035,532.00	
	MOWI ASA	32,238	190.00	6,125,220.00	
	ORKLA	69,804	70.74	4,937,934.96	
	DNB ASA	80,217	155.40	12,465,721.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	137.60	2,555,782.40	
	TELENOR ASA	60,821	166.00	10,096,286.00	
ノルウェークローネ 小計		499,463		69,835,292.71 (894,590,099)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	614.40	5,578,137.60	
	NOVOZYMES A/S	17,687	299.70	5,300,793.90	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	518.60	9,189,592.00	
	ISS A/S	14,253	194.60	2,773,633.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,345.00	2,495,155.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	8,920.00	4,531,360.00	
	DSV A/S	16,873	510.60	8,615,353.80	
	PANDORA A/S	8,431	275.10	2,319,368.10	
	CARLSBERG AS-B	9,692	738.40	7,156,572.80	
	COLOPLAST-B	9,476	616.00	5,837,216.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	204.00	1,513,680.00	
	GENMAB A/S	6,342	1,018.50	6,459,327.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	287.00	1,397,977.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	155,978	315.10	49,148,667.80	
	DANSKE BANK A/S	59,378	126.50	7,511,317.00	
	TRYG A/S	9,828	166.60	1,637,344.80	
	ORSTED A/S	15,908	445.00	7,079,060.00	
デンマーククローネ 小計		363,743		128,544,556.60 (2,147,979,540)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	26.28	542,130.12	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.72	916,989.32	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	7.20	966,254.40	
	SANTOS	156,437	6.06	948,008.22	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	18,060	26.17	472,630.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	33.89	2,606,683.24	
	WORLEYPARSONS LTD	46,003	13.59	625,180.77	

ALUMINA LIMITED	170,458	2.42	412,508.36	
AMCOR	105,214	13.39	1,408,815.46	
BHP GROUP LTD	253,437	33.11	8,391,299.07	
BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.47	615,120.16	
BORAL LIMITED	81,732	5.19	424,189.08	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	4.63	623,549.88	
INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.53	531,614.47	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	15.15	566,049.45	
NEWCREST MINING LIMITED	61,159	23.61	1,443,963.99	
ORICA LTD	29,211	17.51	511,484.61	
RIO TINTO LTD	32,522	80.65	2,622,899.30	
SOUTH32 LTD	408,172	3.41	1,391,866.52	
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	44.77	412,779.40	
BRAMBLES LTD	129,297	10.60	1,370,548.20	
SEEK LTD	26,358	17.43	459,419.94	
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.42	704,932.54	
TRANSURBAN GROUP	214,921	11.86	2,548,963.06	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	23.56	1,242,837.12	
CROWN RESORTS LTD	30,328	11.88	360,296.64	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	43.77	241,741.71	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	44.10	143,898.30	
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.63	772,496.98	
REA GROUP LTD	3,593	77.30	277,738.90	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.25	146,779.75	
WESFARMERS LTD	100,277	32.50	3,259,002.50	
COLES GROUP LTD	93,277	12.32	1,149,172.64	
WOOLWORTHS GROUP LTD	113,612	29.96	3,403,815.52	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	8.25	380,572.50	
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	15.34	895,472.50	
COCHLEAR LIMITED	4,811	189.19	910,193.09	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	57.81	708,056.88	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	22.69	721,020.13	
CSL LIMITED	38,119	196.19	7,478,566.61	
AUST AND NZ BANKING GROUP	248,111	26.07	6,468,253.77	
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	10.33	367,748.00	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.06	469,320.04	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,029	73.23	11,059,853.67	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	24.89	5,917,871.29	
WESTPAC BANKING	287,943	26.15	7,529,709.45	
AMP LTD	244,230	2.66	649,651.80	
ASX LTD	15,814	63.90	1,010,514.60	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	9.23	406,747.64	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	118.20	3,165,159.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.19	1,505,262.45	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.64	566,311.68	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	10.96	1,239,499.28	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	12.90	1,327,680.90	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	18.21	808,086.96	
	TELSTRA CORP	342,339	2.92	999,629.88	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.87	216,233.25	
	AGL ENERGY LTD	51,344	20.90	1,073,089.60	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.63	196,576.05	
オーストラリアドル 小計		5,993,689		98,586,741.44 (7,745,960,274)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.02	384,752.88	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.35	624,382.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	12.65	845,703.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	13.85	630,285.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	11.10	403,118.70	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.04	587,613.96	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.59	396,852.96	
ニュージーランドドル 小計		566,266		3,872,709.90 (286,115,807)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	79.20	18,532,483.20	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	17.20	1,702,800.00	
	MTR CORP	142,000	42.30	6,006,600.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	26.80	1,232,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	46.45	5,527,550.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	25.10	1,719,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	49.15	9,731,700.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	13.78	926,016.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	36.45	7,392,060.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	10.14	993,720.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.17	946,440.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	17.68	2,489,344.00	
	WH GROUP LTD	699,000	6.68	4,669,320.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	25.80	2,816,328.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	29.50	9,145,000.00	
	HANG SENG BANK	68,000	174.30	11,852,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	103,000	239.40	24,658,200.00	
	AIA GROUP LTD	1,035,400	69.90	72,374,460.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	63.45	13,704,946.20	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	21.00	1,701,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.82	2,736,860.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	43.15	4,912,368.60	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	38.20	2,253,800.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	28.40	1,831,800.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.70	5,750,550.00	
	SINO LAND CO	315,400	14.22	4,484,988.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	124.00	16,368,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	90.70	3,673,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	28.40	2,732,080.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	22.40	2,038,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	49.90	4,540,900.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	47.65	3,097,250.00	
	PCCW LTD	357,000	4.75	1,695,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	61.35	3,067,500.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	90.55	12,088,425.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	815,913	16.70	13,625,747.10	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	54.30	6,027,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	78.75	1,866,375.00	
香港ドル 小計		7,392,909		290,913,961.10 (4,066,977,176)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.29	706,367.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.70	288,900.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.69	402,210.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.35	269,865.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.14	356,310.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.59	415,563.47	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.82	246,784.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.08	459,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.52	320,292.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	37.06	366,894.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.26	111,035.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.25	580,450.00	
	DBS GROUP	156,300	25.14	3,929,382.00	
	OCBC BANK	260,000	11.75	3,055,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	26.54	2,937,978.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.42	462,266.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.30	617,430.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	8.98	280,176.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.69	317,775.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.15	389,355.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	760,443	3.07	2,334,560.01	
シンガポールドル 小計		3,590,076		18,847,592.48 (1,521,566,140)	

イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	21.45	1,453,366.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	454.20	663,132.00	
	BANK HAPOALIM BM	84,067	23.83	2,003,316.61	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	23.43	2,713,053.42	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	65.79	539,478.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	189.00	817,047.00	
	NICE LTD	4,894	392.10	1,918,937.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	3.41	527,206.46	
イスラエルシェケル 小計		441,100		10,635,537.09 (315,981,806)	
合　計		94,448,507		316,278,946,476 (316,278,946,476)	

(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	801,660.45	
		LENDLEASE GROUP	44,009	539,990.43	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	576,002.60	
	オーストラリアドル 小計		223,440	1,917,653.48 (150,670,033)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,803,690.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	3,189,200.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,992,890.00 (69,800,602)	
投資信託受益証券合計			711,940	220,470,635 (220,470,635)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	833,142.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,053,600.54	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,042	6,099,706.14	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	112,760	1,153,534.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,159,927.97	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,651,456.80	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,000	331,550.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	651,967.56	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,766	3,741,169.26	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,804,374.00	
		DUKE REALTY CORP	29,929	850,582.18	
		EQUINIX INC	6,911	2,589,344.37	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,192,932.88	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,479,261.63	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	931,794.36	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	759,111.39	
	HCP INC	41,014	1,225,498.32	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,040,477.76	
	INVITATION HOMES INC	24,000	510,000.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,669	879,203.16	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	585,985.85	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	527,615.86	
	MACERICH CO/THE	10,128	468,723.84	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,025,133.18	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	708,816.36	
	PROLOGIS INC	53,238	3,444,498.60	
	PUBLIC STORAGE	13,613	2,765,208.69	
	REALTY INCOME CORP	24,440	1,580,046.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	722,821.73	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,620,786.30	
	SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,543,661.24	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	719,899.08	
	UDR INC	20,960	873,612.80	
	VENTAS INC	30,413	1,856,409.52	
	VEREIT INC	77,798	604,490.46	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	1,021,742.10	
	WELLTOWER INC	31,753	2,319,239.12	
	WP CAREY INC	13,017	909,237.45	
アメリカドル 小計		964,210	58,236,563.90 (6,386,803,962)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	206,119.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	380,899.10	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	182,050.23	
カナダドル 小計		30,576	769,068.33 (63,586,569)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	312,717.20	
	GECINA SA	4,459	540,430.80	
	ICADE	2,845	204,413.25	
	KLEPIERRE	17,225	489,879.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,040	1,808,889.60	
ユーロ 小計		40,147	3,356,329.85 (418,668,585)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	453,612.76	
	HAMMERSON PLC	61,184	218,977.53	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	502,593.20	
	SEGRO PLC	81,695	515,168.67	

	イギリスポンド 小計		280,843	1,690,352.16 (238,339,654)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,046,280.80	
		GOODMAN GROUP	140,271	1,641,170.70	
		GPT GROUP	136,015	748,082.50	
		MIRVAC GROUP	306,089	691,761.14	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,975,851.78	
		STOCKLAND	207,412	767,424.40	
		VICINITY CENTERS	291,115	762,721.30	
	オーストラリアドル 小計		1,661,655	7,633,292.62 (599,747,801)	
	香港ドル	LINK REIT	179,500	14,243,325.00	
	香港ドル 小計		179,500	14,243,325.00 (199,121,683)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	535,225.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	447,120.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	458,687.00	
		SUNTEC REIT	173,000	326,970.00	
	シンガポールドル 小計		813,800	1,768,002.00 (142,730,801)	
投資証券合計			3,970,731	8,048,999,055 (8,048,999,055)	
合計				8,269,469,690 (8,269,469,690)	

(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　594銘柄	97.1%	—	—	66.2%
	投資証券　38銘柄	—	—	2.9%	2.0%
カナダドル	株式　87銘柄	99.5%	—	—	3.8%
	投資証券　3銘柄	—	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　236銘柄	98.9%	—	—	11.6%
	投資証券　5銘柄	—	—	1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式　92銘柄	98.8%	—	—	6.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	1.2%	0.1%

スイスフラン	株式　38銘柄	100.0%	—	—	3.3%
スウェーデンクローナ	株式　32銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.7%
オーストラリアドル	株式　59銘柄	91.2%	—	—	2.4%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	7.1%	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　38銘柄	93.8%	—	—	1.3%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式　21銘柄	91.4%	—	—	0.5%
	投資証券　4銘柄	—	—	8.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	505,072,586
コール・ローン	562,804,742
国債証券	44,839,004,491
未収利息	738,739,353
前払費用	53,974,922
流動資産合計	46,699,596,094
資産合計	46,699,596,094
負債の部	
流動負債	
未払金	24,399,510
未払解約金	26,493,198
未払利息	1,571

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	1,581
流動負債合計	50,895,860
負債合計	50,895,860
純資産の部	
元本等	
元本	28,341,111,188
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,307,589,046
元本等合計	46,648,700,234
純資産合計	46,648,700,234
負債純資産合計	46,699,596,094

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 1月21日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	28,341,111,188口
2.	1口当たり純資産額	1.6460円

	2019年 1月21日現在
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (16,460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 1月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 1月21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。

	2019年 1月21日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	19,505,694,501円
期中追加設定元本額	11,014,724,643円
期中一部解約元本額	2,179,307,956円
期末元本額	28,341,111,188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	4,201,029,760円
世界経済インデックスファンド	5,421,050,984円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	3,910,786,558円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,398,097,631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）	1,871,312,197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）	99,286,194円
分散投資コア戦略ファンドＡ	132,210,545円
分散投資コア戦略ファンドＳ	417,066,427円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	182,784,643円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,990,960,675円

区分	2019年 1月21日現在
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）	209,886,987円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,804,406円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	213,041,592円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,146,925,450円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	53,231,682円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	104,456,705円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	129,187,555円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,337,534円
グローバル経済コア	930,203,418円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	4,849,816円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	1,109,392円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	118,081,851円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	596,115,381
合計	596,115,381

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,200,000.00	34,236,852.00	
		MBONO 10% 12/05/24	77,350,000.00	82,764,113.25	

	MBONO 5.75% 03/05/26	47,200,000.00	40,201,656.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	91,600,000.00	86,450,706.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	88,023,288.50	
	MBONO 7.25% 12/09/21	45,600,000.00	44,281,248.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	92,700,000.00	86,463,144.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	45,876,507.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	74,100,000.00	65,344,344.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	21,696,600.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	28,400,000.00	28,037,758.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	31,450,000.00	30,135,547.25	
	MBONO 8% 06/11/20	85,000,000.00	84,600,925.00	
	MBONO 8% 11/07/47	28,500,000.00	25,616,227.50	
	MBONO 8% 12/07/23	63,700,000.00	62,570,917.50	
メキシコペソ 小計		862,300,000.00	826,299,834.00 (4,742,961,047)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/22	17,850,000.00	14,215,306.24	
	BLTN 0% 04/01/20	21,600,000.00	19,983,015.36	
	BLTN 0% 07/01/20	37,550,000.00	34,123,055.57	
	BLTN 0% 07/01/21	16,500,000.00	13,760,455.50	
	BLTN 0% 07/01/22	1,900,000.00	1,444,645.24	
	BNTNF 10% 01/01/21	13,800,000.00	14,425,655.30	
	BNTNF 10% 01/01/23	25,850,000.00	27,174,511.11	
	BNTNF 10% 01/01/25	15,550,000.00	16,373,548.85	
	BNTNF 10% 01/01/27	15,700,000.00	16,570,523.25	
	BNTNF 10% 01/01/29	1,850,000.00	1,959,063.86	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,565,375.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	507,093.75	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,938,000.00	
ブラジルレアル 小計		171,900,000.00	164,040,249.03 (4,791,615,674)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	8,870,000,000.00	9,112,372,750.00	
チリペソ 小計		8,870,000,000.00	9,112,372,750.00 (1,492,606,656)	
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	22,425,284,750.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	11,600,000,000.00	12,076,644,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	48,100,000,000.00	58,845,299,500.00	
コロンビアペソ 小計		83,350,000,000.00	93,347,228,250.00 (3,276,487,711)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,550,000.00	5,767,060.50	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	4,700,000.00	4,826,665.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,100,000.00	6,215,656.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,100,000.00	7,503,564.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	5,100,000.00	5,502,594.00	

	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,750,000.00	7,381,563.75	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	7,672,892.50	
ペルーヌエボソル 小計		41,800,000.00	44,869,995.75 (1,482,055,959)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	16,900,000.00	14,809,216.50	
	URUGUA 9.875% 06/20/22	18,450,000.00	18,540,681.75	
ウルグアイペソ 小計		35,350,000.00	33,349,898.25 (112,055,658)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	19,776,678.00	
ドミニカペソ 小計		20,400,000.00	19,776,678.00 (42,915,391)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,749,063.50	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	10,050,000.00	7,646,542.50	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	7,651,361.25	
	TURKGB 10.7% 02/17/21	7,300,000.00	6,409,619.00	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	8,876,651.25	
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	7,293,618.00	
	TURKGB 11% 03/02/22	9,600,000.00	8,144,256.00	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,750,000.00	8,434,091.25	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,435,886.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	8,400,000.00	6,065,136.00	
	TURKGB 7.4% 02/05/20	5,750,000.00	5,139,033.75	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,900,000.00	3,843,854.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	6,050,000.00	4,583,268.25	
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,254,780.50	
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	8,972,244.75	
	TURKGB 9.4% 07/08/20	7,750,000.00	6,871,188.75	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,445,450.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	5,418,178.75	
トルコリラ 小計		135,200,000.00	109,234,223.50 (2,253,502,030)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	26,700,000.00	23,570,226.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	20,400,000.00	19,216,800.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	30,500,000.00	27,001,040.00	
	CZGB 0% 02/10/20	15,200,000.00	14,925,944.00	
	CZGB 1% 06/26/26	29,000,000.00	27,291,755.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	47,200,000.00	49,088,708.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	46,500,000.00	49,221,877.50	
	CZGB 3.75% 09/12/20	40,700,000.00	42,047,984.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	40,037,560.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	38,000,000.00	41,935,850.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	38,800,000.00	47,013,572.00	

チェココルナ 小計		370,900,000.00	381,351,316.50 (1,860,994,424)	
ハンガリーフォリント	HGB 0.5% 04/21/21	297,000,000.00	292,256,910.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	596,000,000.00	599,266,080.00	
	HGB 1% 09/23/20	230,000,000.00	231,400,700.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	352,825,880.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	340,000,000.00	339,398,200.00	
	HGB 3.5% 06/24/20	442,000,000.00	460,453,500.00	
	HGB 3% 06/26/24	466,000,000.00	486,114,890.00	
	HGB 3% 10/27/27	531,000,000.00	537,302,970.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	556,000,000.00	656,235,680.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	453,000,000.00	541,278,375.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	195,000,000.00	257,613,525.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	265,961,400.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	560,949,727.50	
ハンガリーフォリント 小計		5,159,500,000.00	5,581,057,837.50 (2,188,332,778)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	13,350,000.00	13,376,366.25	
	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,700,561.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	14,000,000.00	14,194,810.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	11,300,000.00	11,517,242.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,400,000.00	1,419,180.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	14,550,000.00	14,386,385.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	13,150,000.00	12,901,925.25	
	POLGB 2.75% 04/25/28	7,700,000.00	7,643,289.50	
	POLGB 2% 04/25/21	9,750,000.00	9,854,422.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,268,452.00	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,733,926.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,682,148.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,573,176.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,940,432.50	
ポーランドズロチ 小計		141,350,000.00	145,192,317.25 (4,222,192,585)	
ロシアルーブル	RFLB 6.4% 05/27/20	98,800,000.00	97,358,014.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	121,000,000.00	113,709,145.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	39,000,000.00	35,652,825.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	165,277,290.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	157,718,971.50	
	RFLB 7.25% 05/10/34	55,000,000.00	50,413,550.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	170,550,289.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	159,200,000.00	158,263,108.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	79,350,000.00	79,352,380.50	
	RFLB 7.6% 07/20/22	62,500,000.00	62,246,562.50	

	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	167,370,489.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	159,856,125.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	94,363,218.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	103,360,632.00	
	RFLB 7% 12/15/21	144,000,000.00	141,333,120.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	176,940,720.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	126,157,323.00	
ロシアルーブル 小計		2,113,100,000.00	2,059,923,762.50 (3,419,473,445)	
マレーシアリンギット	MGS 3.492% 03/31/20	8,400,000.00	8,404,956.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	6,900,000.00	6,915,801.00	
	MGS 3.659% 10/15/20	6,150,000.00	6,167,127.75	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,005,435.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	10,050,000.00	10,067,034.75	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,200,000.00	7,196,652.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	10,950,000.00	10,814,055.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	7,980,367.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	5,950,000.00	5,946,489.50	
	MGS 4.059% 09/30/24	6,550,000.00	6,610,227.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,136,908.25	
	MGS 4.181% 07/15/24	6,000,000.00	6,102,180.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,200,000.00	6,375,739.00	
マレーシアリンギット 小計		98,700,000.00	98,722,973.75 (2,632,941,709)	
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	99,502,095.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000.00	96,200,230.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	12,000,000.00	12,154,200.00	
	THAIGB 2.55% 06/26/20	44,350,000.00	44,846,720.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	27,000,000.00	27,966,465.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	97,500,000.00	97,461,487.50	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	167,500,000.00	173,857,462.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,516,700.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	148,758,962.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	102,100,000.00	107,400,011.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	20,900,000.00	22,922,911.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	89,000,000.00	97,595,620.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	114,175,750.00	
タイバーツ 小計		1,073,950,000.00	1,132,358,615.00 (3,906,637,221)	
フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	23,905,875.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	19,912,900.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	20,520,500.00	

	フィリピンペソ 小計		65,000,000.00	64,339,275.00 (134,469,084)	
	インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,467,379,500.00	
		INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,251,339,500.00	
		INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,681,872,500.00	
		INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,581,014,000.00	
		INDOGB 5.625% 05/15/23	44,900,000,000.00	41,255,467,000.00	
		INDOGB 6.125% 05/15/28	29,700,000,000.00	25,735,198,500.00	
		INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	24,638,835,000.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	21,238,191,000.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	18,800,000,000.00	17,225,500,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/22	39,200,000,000.00	38,380,132,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	47,800,000,000.00	44,272,599,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	32,787,822,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	18,495,823,500.00	
		INDOGB 8.25% 07/15/21	35,000,000,000.00	35,494,375,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000.00	48,946,618,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	32,260,150,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	45,409,275,000.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	33,335,034,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,268,452,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	34,281,975,000.00	
	インドネシアルピア 小計		565,500,000,000.00	554,007,052,500.00 (4,321,255,009)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	76,750,000.00	83,714,678.75	
		SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,779,096.50	
		SAGB 6.5% 02/28/41	29,300,000.00	20,452,865.00	
		SAGB 6.75% 03/31/21	16,600,000.00	16,466,619.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	34,100,000.00	33,741,268.00	
		SAGB 7% 02/28/31	40,800,000.00	33,602,064.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	36,900,000.00	33,214,243.50	
		SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	41,586,012.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	56,800,000.00	50,669,008.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	68,850,000.00	61,321,941.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	26,800,000.00	24,885,944.00	
		SAGB 8% 01/31/30	46,200,000.00	41,897,394.00	
		SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	32,221,525.00	
	南アフリカランド 小計		549,600,000.00	498,552,658.75 (3,958,508,110)	
合計				44,839,004,491 (44,839,004,491)	

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%	10.6%
ブラジルレアル	国債証券　13銘柄	100.0%	10.7%
チリペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	3.3%
コロンビアペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	7.3%
ペルーヌエボソル	国債証券　7銘柄	100.0%	3.3%
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　18銘柄	100.0%	5.0%
チェココルナ	国債証券　11銘柄	100.0%	4.2%
ハンガリーフォリント	国債証券　13銘柄	100.0%	4.9%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	9.4%
ロシアルーブル	国債証券　17銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券　13銘柄	100.0%	5.9%
タイバーツ	国債証券　13銘柄	100.0%	8.7%
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　20銘柄	100.0%	9.6%
南アフリカランド	国債証券　13銘柄	100.0%	8.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,174,372,161

	2019年 1月21日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	25,319,673
株式	49,954,153,688
投資信託受益証券	100,443,311
投資証券	187,924,405
派生商品評価勘定	65,116,562
未収入金	33,126,879
未収配当金	40,055,844
差入委託証拠金	223,847,881
流動資産合計	51,804,360,404
資産合計	51,804,360,404
負債の部	
流動負債	
前受金	65,116,562
未払金	5,212
未払解約金	16,426,931
未払利息	70
その他未払費用	133
流動負債合計	81,548,908
負債合計	81,548,908
純資産の部	
元本等	
元本	19,183,829,395
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	32,538,982,101
元本等合計	51,722,811,496
純資産合計	51,722,811,496
負債純資産合計	51,804,360,404

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 1月21日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 (3)投資証券

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

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 1月21日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	19,183,829,395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 2.6962円 (1万口当たり純資産額) (26,962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 1月21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 1月21日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（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 1月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	16,271,676,908円
期中追加設定元本額	3,790,512,657円
期中一部解約元本額	878,360,170円
期末元本額	19,183,829,395円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,210,616,818円
世界経済インデックスファンド	3,220,013,398円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	3,872,098,715円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,635,967,059円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	175,446,907円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	336,691,932円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	397,933,939円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	381,553,385円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,083,415円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	125,754,003円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	31,520,184円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	191,113,350円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	25,247,586円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	806,448円
グローバル経済コア	551,416,419円

ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	8,565,837円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,631,922,393
投資信託受益証券	9,407,393
投資証券	△1,085,425
合計	1,640,244,361

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,450,951,647	－	1,516,068,209	65,116,562
合計		1,450,951,647	－	1,516,068,209	65,116,562

(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 1月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	54,825,000	－	54,825,000	－
	アメリカドル	54,825,000	－	54,825,000	－
合計		54,825,000	－	54,825,000	－

(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。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	487,161	4.74	2,312,066.10	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	1.21	126,048.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	45,453	78.60	3,572,605.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	180.00	1,551,060.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	108,104	6.28	678,893.12	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	4.19	673,367.59	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	24,530	67.00	1,643,510.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.17	256,828.10	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	20.22	1,344,569.34	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	22.83	354,070.47	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	13.53	251,928.60	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	40.45	288,165.80	

	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	14.35	363,772.50	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	32.29	174,430.58	
	51JOB INC-ADR	1,655	67.85	112,291.75	
	DP WORLD LTD	21,152	16.65	352,180.80	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	34.93	381,924.62	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	12,213	65.90	804,836.70	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	34,236	30.19	1,033,584.84	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	36.16	1,204,344.96	
	58.COM INC-ADR	9,450	60.26	569,457.00	
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	72.64	384,846.72	
	BAIDU INC - SPON ADR	25,114	171.36	4,303,535.04	
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	30.26	393,289.22	
	NETEASE INC-ADR	6,861	252.68	1,733,637.48	
	SINA CORP	5,725	61.72	353,347.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	60.80	319,139.20	
	YY INC-ADR	4,344	73.97	321,325.68	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	117,435	157.02	18,439,643.70	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	33.29	116,781.32	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	32.40	1,233,500.40	
	JD.COM INC-ADR	68,369	23.26	1,590,262.94	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	6.87	248,961.93	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	30,969	15.50	480,174.34	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	22.15	80,692.45	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	129,064	4.54	586,595.88	
	CREDICORP LTD	6,431	232.05	1,492,313.55	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	252,453	12.89	3,255,381.43	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.24	257,189.08	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	48.83	98,685.43	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	45,360	1.34	60,827.76	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	28.83	126,996.15	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.14	324,411.56	
アメリカドル 小計		2,265,971		54,251,474.93 (5,949,759,255)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,571,661	10.68	16,785,339.48	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	300,792	45.12	13,571,735.04	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	246.50	3,574,250.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	47.27	4,578,194.04	
	ALFA S.A.B.-A	242,900	24.82	6,028,778.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	77.25	2,896,875.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	15,485	336.17	5,205,592.45	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	179.86	5,590,048.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	192.37	3,266,442.60	

	ALSEA SAB DE CV	34,300	51.85	1,778,455.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	209,790	47.70	10,006,983.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	86.99	2,731,486.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	127.54	1,390,186.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	49.37	23,133,794.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	106.75	3,594,806.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	43,300	123.65	5,354,045.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	178.58	31,990,821.20	
	GRUMA S.A.B.-B	14,210	230.15	3,270,431.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	38.30	5,070,920.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	30.71	5,583,078.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	26.81	4,549,657.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	248,500	109.09	27,108,865.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	29.83	7,532,075.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	15.18	46,114,411.20	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	79.95	3,014,115.00	
メキシコペソ 小計		7,413,485		243,721,385.16 (1,398,960,750)	
ブラジルレアル	COSAN SA	18,400	42.18	776,112.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,100	29.15	8,106,615.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	346,340	25.40	8,797,036.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	28,700	56.02	1,607,774.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	46.29	685,092.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	71,700	9.84	705,528.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	15.49	1,347,630.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	50,679	44.37	2,248,627.23	
	VALE SA	288,278	54.76	15,786,103.28	
	EMBRAER SA	69,700	19.85	1,383,545.00	
	WEG SA	66,872	18.70	1,250,506.40	
	CCR SA	101,100	13.50	1,364,850.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	31.18	1,839,682.36	
	RUMO SA	97,700	18.57	1,814,289.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.18	1,406,713.12	
	B2W CIA DIGITAL	23,600	46.00	1,085,600.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	20.43	1,301,717.88	
	LOJAS RENNER S.A.	60,370	43.85	2,647,224.50	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,100	174.20	1,236,820.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	27,700	26.43	732,111.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	19.80	821,700.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	89.65	1,326,820.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	63.37	1,337,107.00	
	AMBEV SA	438,500	18.00	7,893,000.00	

	BRF SA	52,500	24.05	1,262,625.00	
	JBS SA	111,900	13.53	1,514,007.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	45.62	287,406.00	
	NATURA COSMETICOS SA	20,700	46.05	953,235.00	
	HYPERA SA	35,300	33.02	1,165,606.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	96,969	38.10	3,694,518.90	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	292,161	42.68	12,469,431.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	48.55	3,937,405.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	426,781	37.66	16,072,572.46	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	370,067	12.93	4,784,966.31	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	30.40	5,791,291.20	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	29.64	1,668,732.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,200	86.21	620,712.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	54.40	397,120.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	13.59	775,486.17	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	24.28	1,102,312.00	
	CIELO SA	99,269	10.42	1,034,382.98	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	47.09	2,279,156.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.35	900,315.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	35.69	631,713.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	32.36	779,876.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	13.88	915,968.96	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	40.67	1,061,487.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	38.49	644,707.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,000	82.80	1,821,600.00	
ブラジルレアル 小計		4,665,696		134,068,836.73 (3,916,150,720)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	9,080.00	406,148,400.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	2,394.00	325,500,210.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	29,000.00	285,853,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	40,858	8,025.00	327,885,450.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	5,274.00	373,594,338.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,410.00	194,563,080.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	9,249.00	86,228,427.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,710.00	41,224,520.00	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	103.51	241,724,832.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,724	46,600.00	126,938,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	52.89	332,139,732.69	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	6.56	109,874,463.36	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,175.00	114,558,600.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	394.60	64,417,660.80	
	COLBUN SA	475,888	154.23	73,396,206.24	

	ENEL AMERICAS SA	2,162,581	138.40	299,301,210.40	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	72.14	184,770,594.92	
チリペソ 小計		31,213,298		3,588,119,126.21 (587,733,912)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,895.00	1,415,594,205.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	7,080.00	226,637,880.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	17,400.00	308,380,200.00	
	BANCOLOMBIA SA	20,302	34,020.00	690,674,040.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	34,400.00	1,316,763,200.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,055.00	320,411,940.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	32,580.00	678,315,600.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	31,060.00	390,144,660.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	13,980.00	706,143,780.00	
コロンビアペソ 小計		984,893		6,053,065,505.00 (212,462,599)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	21.15	190,350.00	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,358	20.35	88,685.30	
	OPAP SA	17,668	8.35	147,527.80	
	JUMBO SA	8,599	14.10	121,245.90	
	ALPHA BANK AE	129,138	0.95	122,681.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	10.70	217,135.10	
ユーロ 小計		189,056		887,625.20 (110,722,367)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	130.00	1,508,390.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	7.89	921,196.95	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	52,814	5.32	280,970.48	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	24.16	575,273.76	
	KOC HOLDING AS	62,460	16.22	1,013,101.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	5.75	248,216.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	24.84	244,326.24	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	14.44	898,038.04	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	57.15	186,194.70	
	ARCELIK AS	15,358	18.02	276,751.16	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,412	93.40	1,999,880.80	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	20.66	232,011.80	
	AKBANK T.A.S.	228,927	6.55	1,499,471.85	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	9.15	2,195,926.80	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	7.88	413,156.28	
	TURKIYE IS BANKASI-C	219,434	5.10	1,119,113.40	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	8.45	519,218.70	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	14.24	1,354,167.04	
		1,331,222		15,485,405.20	

トルコリラ 小計				(319,463,909)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	890.00	6,642,070.00	
	MONETA MONEY BANK AS	26,717	74.45	1,989,080.65	
	CEZ AS	13,737	539.50	7,411,111.50	
チェココルナ 小計		47,917		16,042,262.15 (78,286,239)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,242.00	106,571,024.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,020.00	91,371,560.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	11,850.00	231,655,650.00	
ハンガリーフォリント 小計		67,599		429,598,234.00 (168,445,467)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	5,516	97.30	536,706.80	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	111.65	2,949,123.10	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	7.41	1,085,542.77	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	67.50	281,542.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	92.48	1,214,447.36	
	CCC SA	3,138	185.90	583,354.20	
	LPP SA	124	8,135.00	1,008,740.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	173.90	1,165,825.60	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	23.06	541,956.12	
	DINO POLSKA SA	4,430	102.60	454,518.00	
	ALIOR BANK SA	8,830	54.20	478,586.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	70.60	141,906.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	9.35	308,708.95	
	BANK PEKAO SA	15,510	115.70	1,794,507.00	
	M BANK SA	2,316	456.00	1,056,096.00	
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	40.58	3,104,572.90	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	4,247	372.60	1,582,432.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	44.10	2,246,939.10	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.45	303,336.10	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.31	654,643.76	
ポーランドズロチ 小計		546,168		21,493,484.46 (625,030,528)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.29	322,420.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.30	1,401,600.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,377,400	6.16	14,644,784.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	287,000	18.66	5,355,420.00	
	CNOOC LTD-R	1,626,000	12.92	21,007,920.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	8.50	2,193,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	5.05	9,978,800.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	7.11	1,009,620.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.84	965,600.00	

ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	5.75	333,500.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	39.55	4,350,500.00	
BBMG CORPORATION - H	131,000	2.54	332,740.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.07	514,605.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	3.04	1,021,440.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	5.80	1,914,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	7.28	1,528,800.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.67	292,132.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.46	785,180.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.75	1,120,500.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	3.67	1,071,640.00	
MMG LIMITED	168,000	3.56	598,080.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.68	990,720.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.58	712,420.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	7.52	680,560.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.74	1,997,460.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.86	602,640.00	
BOC AVIATION LTD	32,500	62.50	2,031,250.00	
CHINA COMMUICATIONS CONST-H	577,000	7.84	4,523,680.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	24.60	3,923,700.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	11.26	2,156,290.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	7.36	2,208,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.99	1,188,300.00	
CITIC LTD	502,000	11.88	5,963,760.00	
CRRC CORP LTD-H	511,050	7.67	3,919,753.50	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.00	3,168,000.00	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	1.61	897,575.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	17.16	600,600.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.96	280,280.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.66	446,880.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	16.00	608,000.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	7.33	524,095.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	12.00	510,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	143,800	9.45	1,358,910.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	26,400	7.05	186,120.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	45.50	2,834,650.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	7.63	2,938,114.62	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	11.54	1,569,440.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.80	1,224,000.00	
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.57	893,260.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	7.30	788,400.00	
CAR INC	42,000	5.38	225,960.00	

CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	4.78	315,480.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	15.36	1,498,321.92	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.47	962,720.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	4.07	350,020.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	3.17	464,405.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	8.21	856,664.24	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.48	780,640.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	118,500	15.24	1,805,940.00	
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	3.37	370,700.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.72	679,360.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.88	570,960.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	6.93	1,732,500.00	
BYD CO LTD-H	74,500	44.05	3,281,725.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	3.92	980,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.86	2,090,760.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	26.40	718,080.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	421,000	12.26	5,161,460.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	5.20	1,059,500.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	8.29	2,091,931.76	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	11.30	1,039,600.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	37.05	4,112,550.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	21.30	2,470,800.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.26	430,560.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	92.55	6,478,500.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	2.09	246,620.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.28	1,856,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	11,800	38.45	453,710.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	517,800	337.00	174,498,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.67	397,951.86	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	14.06	590,520.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	7.83	1,526,850.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.91	299,730.00	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	25.45	6,540,650.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	27.15	3,855,300.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.64	679,620.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	10.50	1,554,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	34.60	968,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.84	547,200.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	379,000	6.13	2,323,270.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	22.45	763,300.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	58.20	3,870,300.00	

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	6.93	1,981,980.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	292,000	6.46	1,886,320.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	17.02	2,185,368.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	34.30	3,416,280.00	
3SBIO INC	119,000	12.58	1,497,020.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	7.66	766,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	13.10	5,921,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	10.96	1,726,200.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	4.94	820,040.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	64,000	11.72	750,080.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	5.73	466,995.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	23.95	1,329,225.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.60	513,600.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	6.46	3,740,340.00	
SSY GROUP LTD	114,000	6.30	718,200.00	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	10.06	372,220.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	39,000	61.45	2,396,550.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.58	8,656,440.00	
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	3.47	25,706,454.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	6.39	6,054,365.25	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.87	4,632,344.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,631,620	6.63	57,227,640.60	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.61	805,030.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	357,423	31.00	11,080,113.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.73	3,159,522.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	463,000	4.39	2,032,570.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,239,515	5.76	35,939,606.40	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	202,000	4.19	846,380.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	2.09	1,738,880.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	24.65	1,972,000.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	14.18	879,160.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.04	1,327,140.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.53	1,418,310.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	15.04	1,985,280.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	15.44	3,072,560.00	
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.69	1,084,290.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	225,600	11.60	2,616,960.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	16.32	966,144.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	8.57	2,372,176.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	13.76	2,185,088.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	667,000	19.10	12,739,700.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	27.20	7,365,760.00	

CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	1,140,000	1.61	1,835,400.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	21.60	3,063,398.40	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	30.25	2,026,750.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.17	2,193,640.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.30	5,090,290.40	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	464,000	71.85	33,338,400.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	28.20	301,740.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.30	1,320,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	238,000	22.85	5,438,300.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	3.71	2,144,380.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	27.80	10,592,912.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	31.15	7,572,907.65	
CHINA VANKE CO LTD-H	120,800	28.60	3,454,880.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.40	1,214,400.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	657,285	9.71	6,382,237.35	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	6.19	792,320.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	6.34	355,040.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	14.14	972,832.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	4.40	308,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.41	375,960.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	7.57	673,730.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	10.56	992,640.00	
LONGFOR PROPERTIES	123,500	22.80	2,815,800.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.61	876,960.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	21.70	2,875,250.00	
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.83	383,385.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	599,091	3.61	2,162,718.51	
SOHO CHINA LTD	113,000	2.98	336,740.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	26.35	5,559,850.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	1,360,000	1.51	2,053,600.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.59	373,668.74	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	7.37	1,783,540.00	
KINGSOFT CORP LTD	66,000	15.02	991,320.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	20.50	1,619,500.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	60,000	48.20	2,892,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	9.30	790,500.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	57,000	6.01	342,570.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	25.40	1,701,800.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.73	533,370.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	21.00	443,100.00	
LENOVO GROUP LTD	578,000	5.61	3,242,580.00	
MEITU INC	143,000	2.69	384,670.00	

	SUNNY OPTICAL TECH	61,100	71.65	4,377,815.00	
	ZTE CORP-H	48,508	15.46	749,933.68	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	350,000	6.88	2,408,000.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	545,000	80.85	44,063,250.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,100,000	4.09	4,499,000.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	3,672,000	1.53	5,618,160.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	8.67	4,404,360.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	44.40	1,731,600.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.29	1,750,320.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	1.99	2,670,580.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	26.00	4,477,200.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.69	1,439,570.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.88	310,200.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	32.45	2,790,700.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	15.40	2,701,160.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.98	273,240.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	74.50	5,594,950.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	15.60	3,463,200.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.60	662,400.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.93	1,824,100.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.22	679,320.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	6.23	286,580.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	0.17	115,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	15.80	711,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	6.79	1,799,350.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	151,725	3.17	480,968.25	
香港ドル 小計		83,615,558		812,808,567.17 (11,363,063,769)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	222,968	3.12	695,660.16	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	25.00	627,500.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	8.60	1,806,860.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.45	642,135.00	
	GAMUDA BHD	139,200	2.80	389,760.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.88	377,416.00	
	IJM CORP BHD	198,100	1.80	356,580.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.30	384,665.80	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	3.04	196,992.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.10	434,111.40	
	MISC BHD	125,040	6.63	829,015.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.93	275,100.00	
	GENTING BHD	205,300	6.79	1,393,987.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.30	739,530.00	

	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	37.94	413,546.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	33.64	285,940.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.98	139,720.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.64	833,529.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	24.30	1,331,640.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	147.40	1,017,060.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	17.58	926,114.40	
	QL RESOURCES BHD	83,200	6.87	571,584.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	167,246	5.11	854,627.06	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	5.30	840,580.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.70	1,307,010.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.86	478,224.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	4.23	298,638.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.50	585,900.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.67	2,447,001.90	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.72	1,269,970.24	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	19.42	289,998.86	
	MALAYAN BANKING BHD	352,318	9.55	3,364,636.90	
	PUBLIC BANK BERHAD	256,420	24.80	6,359,216.00	
	RHB BANK BHD	53,119	5.43	288,436.17	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	153,825	1.57	241,505.25	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	1.10	183,970.60	
	SP SETIA BHD	180,947	2.48	448,748.56	
	AXIATA GROUP BERHAD	278,374	4.06	1,130,198.44	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.50	1,402,650.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.71	1,529,709.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	2.78	196,134.56	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.78	1,342,390.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	13.68	4,028,418.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.14	287,696.10	
マレーシアリンギット 小計		6,375,550		43,844,106.20 (1,169,322,312)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	118,500	16.50	1,955,250.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	45.00	8,347,500.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	5.85	3,350,880.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	125.00	15,587,500.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	48.25	46,377,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	69.50	8,346,950.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	47.75	9,855,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	69.00	15,520,446.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	27,200	442.00	12,022,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	68.50	29,324,850.00	

	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	391,200	10.00	3,912,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.55	3,509,625.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	161,810	36.50	5,906,065.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	15.00	3,474,525.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	68.50	2,383,800.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	67,800	45.75	3,101,850.00	
	CP ALL PCL-NVDR	491,700	74.75	36,754,575.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	26.50	9,028,550.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	17.40	4,176,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,700	23.60	10,754,520.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	181.00	4,633,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	202.00	3,272,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	186.50	23,573,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	183.00	9,442,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	19.60	4,846,100.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	148,000	128.50	19,018,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.18	2,913,570.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	43.00	3,861,400.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	132,100	77.00	10,171,700.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	132,300	10.10	1,336,230.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	69.25	2,236,775.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	172.00	18,214,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	4.70	2,856,232.30	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	253.00	5,869,600.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	90.75	2,686,200.00	
タイバーツ 小計		8,856,738		348,623,793.30 (1,202,752,086)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	67.90	16,156,126.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	14.28	8,433,768.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	12.12	4,186,854.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	66.25	15,261,350.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	976.00	22,257,680.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	108.00	6,829,920.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	324.80	19,816,048.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	142.90	9,057,002.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	93.10	5,571,569.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	132.00	22,931,172.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	142,732	82.50	11,775,390.00	
	SECURITY BANK CORP	30,810	179.70	5,536,557.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	939.00	21,005,430.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,350	1,050.00	6,667,500.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.01	3,685,857.00	

	AYALA LAND INC	637,000	45.00	28,665,000.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.38	3,432,440.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	23.20	2,157,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	39.40	34,969,470.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	2,092.00	3,744,680.00	
	PLDT INC	6,225	1,247.00	7,762,575.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	37.95	3,396,525.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	369.20	10,747,412.00	
フィリピンペソ 小計		5,168,488		274,047,925.50 (572,760,164)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,485.00	2,137,360,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	4,470.00	1,999,431,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	26,925.00	3,470,632,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	12,300.00	3,003,660,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	18,800.00	3,572,000,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	12,875.00	1,116,262,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	12,700.00	2,979,420,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	4,900.00	605,150,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	8,475.00	14,587,170,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,945.00	1,036,685,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	979,900	8,250.00	8,084,175,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	83,900.00	2,584,120,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,730.00	3,423,767,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	10,150.00	1,634,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,500.00	3,218,250,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	48,925.00	5,802,505,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	3,154,000	1,615.00	5,093,710,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	831,200	27,125.00	22,546,300,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	8,350.00	1,640,775,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,875.00	14,317,506,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	9,400.00	7,615,880,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	894,600	2,760.00	2,469,096,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	3,820.00	18,664,902,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,400.00	956,760,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	660.00	1,062,864,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	4,020.00	18,263,262,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	4,720.00	629,648,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,430.00	1,923,345,000.00	
インドネシアルピア 小計		28,138,496		154,438,786,500.00 (1,204,622,534)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	52,000.00	219,804,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	98,200.00	333,978,200.00	

SK INNOVATION CO LTD	6,130	183,500.00	1,124,855,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	21,450.00	229,643,700.00	
HYUNDAI STEEL CO	7,242	50,400.00	364,996,800.00	
KOREA ZINC CO LTD	783	424,000.00	331,992,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	88,200.00	92,698,200.00	
LG CHEM LTD	4,436	368,500.00	1,634,666,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	208,000.00	99,632,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	281,500.00	394,100,000.00	
OCI COMPANY LTD	1,127	98,800.00	111,347,600.00	
POSCO	7,270	262,500.00	1,908,375,000.00	
POSCO CHEMTECH CO LTD	1,159	57,800.00	66,990,200.00	
CJ CORP	1,230	118,000.00	145,140,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,964	101,000.00	400,364,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,650.00	46,725,500.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	33,750.00	145,395,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	45,450.00	307,242,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,825	33,600.00	94,920,000.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	44,050.00	96,954,050.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	60,800.00	387,904,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,318	139,500.00	462,861,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	365,500.00	296,055,000.00	
KCC CORP	870	305,500.00	265,785,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	34,250.00	177,278,000.00	
LG CORP	8,323	75,500.00	628,386,500.00	
LOTTE CORP	2,370	50,700.00	120,159,000.00	
POSCO DAEWOO CORP	5,988	20,050.00	120,059,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,354	116,500.00	740,241,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	16,900.00	312,920,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,610.00	282,719,110.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,769	266,500.00	737,938,500.00	
S-1 CORPORATION	960	104,500.00	100,320,000.00	
CJ LOGISTICS	862	173,500.00	149,557,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	142,000.00	206,610,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	36,550.00	201,171,200.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,665.00	138,718,440.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	7,066	41,300.00	291,825,800.00	
HANON SYSTEMS	19,000	12,700.00	241,300,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,621	210,000.00	1,390,410,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	131,000.00	1,726,056,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	83,600.00	241,771,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	76,600.00	230,029,800.00	
KIA MOTORS CORPORATION	26,869	35,800.00	961,910,200.00	

COWAY CO.,LTD.	3,982	79,000.00	314,578,000.00	
FILA KOREA LTD	2,995	48,200.00	144,359,000.00	
HLB INC	2,398	69,500.00	166,661,000.00	
LG ELECTRONICS INC	9,197	67,000.00	616,199,000.00	
KANGWON LAND INC	13,208	32,150.00	424,637,200.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	22,650.00	114,835,500.00	
KAKAO CORP	4,122	99,600.00	410,551,200.00	
NAVER CORP	13,644	137,500.00	1,876,050,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,650	498,000.00	821,700,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	106,000.00	261,290,000.00	
PEARL ABYSS CORP	338	187,200.00	63,273,600.00	
CJ ENM CO LTD	830	206,500.00	171,395,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	73,200.00	223,333,200.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	91,800.00	112,179,600.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	194,500.00	201,113,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	530	250,500.00	132,765,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	183,000.00	100,467,000.00	
EMART	1,661	192,500.00	319,742,500.00	
GS RETAIL CO LTD	1,311	35,600.00	46,671,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	341,500.00	264,662,500.00	
KT&G CORP	10,696	102,000.00	1,090,992,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	122,000.00	243,146,000.00	
OTTOGI CORPORATION	68	768,000.00	52,224,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,873	172,500.00	495,592,500.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	97,000.00	68,870,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,140,000.00	1,055,640,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	720,000.00	97,200,000.00	
PACIFIC CORP	2,115	63,900.00	135,148,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,731	66,500.00	248,111,500.00	
CELLTRION INC	7,739	201,000.00	1,555,539,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,112	59,800.00	66,497,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	481	446,000.00	214,526,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	628	75,600.00	47,476,800.00	
MEDY-TOX INC	326	594,400.00	193,774,400.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	400,000.00	625,200,000.00	
SILLAJEN INC	5,667	69,500.00	393,856,500.00	
VIROMED CO LTD	1,015	261,000.00	264,915,000.00	
YUHAN CORPORATION	630	233,500.00	147,105,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	6,980.00	162,047,680.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	8,330.00	102,259,080.00	
HANA FINANCIAL GROUP	26,441	38,050.00	1,006,080,050.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,750.00	389,537,500.00	

	KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	46,700.00	1,782,025,300.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37,696	40,750.00	1,536,112,000.00	
	WOORI BANK	45,214	14,800.00	669,167,200.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	64,100.00	294,988,200.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,280.00	226,349,760.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	13,700.00	154,782,600.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	34,950.00	66,370,050.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	33,550.00	193,784,800.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	68,500.00	288,316,500.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	4,245.00	126,912,765.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	38,200.00	164,947,600.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	28,900.00	114,877,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,526	270,500.00	683,283,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	85,600.00	634,895,200.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	215,500.00	672,575,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	18,774	20,000.00	375,480,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	92,400.00	130,746,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,566	94,600.00	431,943,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	437,637	42,300.00	18,512,045,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	76,736	35,150.00	2,697,270,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,724	232,500.00	1,098,330,000.00	
	KT CORP	3,800	29,300.00	111,340,000.00	
	LG UPLUS CORP	17,329	17,350.00	300,658,150.00	
	SK TELECOM	1,647	269,500.00	443,866,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	33,850.00	828,207,950.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	53,900.00	77,184,800.00	
	SK HYNIX INC	53,572	64,600.00	3,460,751,200.00	
韓国ウォン 小計		1,374,139		70,081,220,485.00 (6,839,927,119)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	110.50	12,071,020.00	
	ASIA CEMENT CORP	261,176	36.15	9,441,512.40	
	CHINA STEEL	1,120,261	25.00	28,006,525.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	106.50	33,447,496.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	102.50	39,854,460.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	75.60	35,362,051.20	
	TAIWAN CEMENT	465,721	36.00	16,765,956.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	362.00	4,344,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	385,028	28.80	11,088,806.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,619	238.50	4,917,631.50	
	CHINA AIRLINES LTD	130,203	11.00	1,432,233.00	
	EVA AIRWAYS CORP	159,403	15.25	2,430,895.75	
	EVERGREEN MARINE	132,968	12.05	1,602,264.40	

TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	30.95	5,478,150.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	43.00	7,613,623.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	359.00	4,285,383.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,916	192.50	6,336,330.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.90	1,396,000.00	
GIANT MANUFACTURING	25,464	159.50	4,061,508.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	267.00	4,272,000.00	
POU CHEN	153,780	35.60	5,474,568.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	81.30	1,797,380.40	
TATUNG CO LTD	210,000	26.10	5,481,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	266.50	6,929,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	320.00	14,574,080.00	
STANDARD FOODS CORP	35,756	50.50	1,805,678.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	72.10	32,185,079.50	
TAIMED BIOLOGICS INC	13,000	171.50	2,229,500.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	412,224	17.85	7,358,198.40	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.91	12,454,689.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,628,237	19.95	32,483,328.15	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	913,614	21.20	19,368,616.80	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	724,153	20.20	14,627,890.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	852,972	18.25	15,566,739.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	26.10	23,551,047.90	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	10.45	12,089,490.05	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	945,114	13.40	12,664,527.60	
TAIWAN BUSINESS BANK	199,639	10.85	2,166,083.15	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	747,205	18.30	13,673,851.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	128,177	108.50	13,907,204.50	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	551,082	44.15	24,330,270.30	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	16.30	12,586,093.90	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	43.50	31,839,868.50	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163,157	26.65	4,348,134.05	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,142,638	8.45	9,655,291.10	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	46.60	1,962,792.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	46.30	1,548,272.00	
ACER INC	255,803	19.20	4,911,417.60	
ADVANTECH CO LTD	51,402	229.00	11,771,058.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	232.50	14,668,890.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	12.45	11,766,370.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	224.50	12,953,650.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	67.70	1,949,218.40	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	10.45	8,098,750.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	17.55	7,577,388.00	

	DELTA ELECTRONICS INC	186,903	150.50	28,128,901.50	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	58.60	5,441,010.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,185,248	70.80	83,915,558.40	
	INVENTEC CO LTD	349,511	22.85	7,986,326.35	
	LARGAN PRECISION CO LTD	10,040	3,785.00	38,001,400.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	251,452	43.00	10,812,436.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	75,000	78.70	5,902,500.00	
	PEGATRON CORP	159,474	48.95	7,806,252.30	
	QUANTA COMPUTER INC	242,270	55.50	13,445,985.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	38.00	4,867,800.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	166.00	4,482,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	20.10	4,878,169.50	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	38.15	5,481,849.80	
	YAGEO CORPORATION	22,764	318.50	7,250,334.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	76.70	1,681,417.40	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,315	107.00	38,232,705.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	72.70	11,413,900.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	109.00	16,589,800.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	58.80	17,246,922.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	263.00	4,734,000.00	
	MEDIATEK INC	129,804	244.00	31,672,176.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	56.40	5,809,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	150.50	7,983,272.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	243.00	2,818,557.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	68.30	3,262,691.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	62,944	152.50	9,598,960.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,232,389	218.50	487,776,996.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	11.40	11,137,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	60.00	5,340,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	126.00	4,032,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	13.95	2,845,800.00	
新台湾ドル 小計		29,372,042		1,535,139,984.10 (5,465,098,343)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	354.20	23,419,704.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	230.00	9,642,520.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	239.50	14,232,287.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	117,608	137.85	16,212,262.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	102,814	146.75	15,087,954.50	
	PETRONET LNG LTD	49,423	218.55	10,801,396.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	258,794	1,184.35	306,502,673.90	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	212.65	7,907,390.25	
	ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,400.45	34,955,232.00	

GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	824.95	22,555,782.90	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	208.80	25,339,341.60	
JSW STEEL LTD	80,284	285.60	22,929,110.40	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,148.80	9,314,470.40	
SHREE CEMENT LTD	901	15,590.25	14,046,815.25	
TATA STEEL LTD	25,839	470.65	12,161,125.35	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,354	3,819.95	28,091,912.30	
UNITED PHOSPHORUS LTD	26,218	766.05	20,084,298.90	
VEDANTA LTD	110,508	198.70	21,957,939.60	
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	92.30	13,254,556.90	
HAVELLS INDIA LTD	23,476	677.50	15,904,990.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,317.90	58,759,889.40	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	399.30	24,966,631.80	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,038	683.85	17,806,086.30	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,076.00	8,995,360.00	
BAJAJ AUTO LTD	9,465	2,720.75	25,751,898.75	
BHARAT FORGE LTD	13,392	479.80	6,425,481.60	
BOSCH LTD	431	19,210.45	8,279,703.95	
EICHER MOTORS LTD	1,381	20,122.75	27,789,517.75	
HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,898.75	9,418,038.75	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	734.95	46,263,632.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	7,357.95	69,893,167.05	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	157.55	12,105,669.35	
TATA MOTORS LTD	147,050	183.30	26,954,265.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	601	22,969.70	13,804,789.70	
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	960.95	26,732,668.05	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	440.30	21,709,872.10	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,383.05	15,249,509.30	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,478	3,171.35	17,372,655.30	
ITC LTD	316,525	291.45	92,251,211.25	
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	11,248.40	26,939,918.00	
UNITED SPIRITS LTD	37,523	584.30	21,924,688.90	
DABUR INDIA LTD	58,111	424.10	24,644,875.10	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	789.65	22,059,662.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,744.10	104,105,329.00	
MARICO LTD	42,465	379.35	16,109,097.75	
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	770.05	15,659,736.80	
CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	347.05	3,646,107.30	
CIPLA LTD	31,308	509.40	15,948,295.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,509.15	13,669,880.70	
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,596.80	27,069,043.20	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	640.40	10,269,454.40	

	LUPIN LTD	16,340	862.30	14,089,982.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	2,296.20	15,386,836.20	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	390.75	32,412,712.50	
	AXIS BANK LTD	167,398	664.60	111,252,710.80	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	145,120	2,006.85	291,234,072.00	
	ICICI BANK LTD	230,892	372.00	85,891,824.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	817.35	22,001,427.30	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	476.05	13,315,594.55	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	294.95	49,382,888.60	
	YES BANK LTD	152,956	198.60	30,377,061.60	
	BAJAJ FINANCE LTD	17,670	2,542.90	44,933,043.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	441.55	12,332,049.95	
	REC LTD	48,168	126.15	6,076,393.20	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,135.80	13,785,204.60	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	6,249.90	19,793,433.30	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	966.30	44,294,225.70	
	INFOSYS LTD	314,410	730.95	229,817,989.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	81,948	1,900.65	155,754,466.20	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	709.15	34,078,203.25	
	WIPRO LTD	89,034	346.15	30,819,119.10	
	BHARTI AIRTEL LTD	124,727	311.15	38,808,806.05	
	BHARTI INFRATEL LTD	45,240	278.05	12,578,982.00	
	IDEA CELLULAR LTD	142,255	35.20	5,007,376.00	
	GAIL INDIA LTD	87,384	322.15	28,150,755.60	
	NTPC LTD	145,475	144.30	20,992,042.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	113,285	193.60	21,931,976.00	
	TATA POWER CO LTD	93,250	76.00	7,087,000.00	
インドルピー 小計		5,000,196		2,868,564,077.45 (4,446,274,320)	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	145.15	10,595,950.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	134.05	8,914,325.00	
	MCB BANK LTD	53,300	195.79	10,435,607.00	
パキスタンルピー 小計		192,800		29,945,882.00 (23,956,705)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	15,948	148.20	2,363,493.60	
	COMMERCIAL BANK QSC	20,399	41.80	852,678.20	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	41.74	1,124,809.52	
	QATAR ISLAMIC BANK	11,423	158.00	1,804,834.00	
	QATAR NATIONAL BANK	41,282	197.95	8,171,771.90	
	QATAR INSURANCE CO	18,964	39.72	753,250.08	
	BARWA REAL ESTATE CO	20,749	39.95	828,922.55	
	EZDAN HOLDING GROUP	67,796	14.78	1,002,024.88	

	OOREDOO QSC	7,280	76.20	554,736.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,782	188.50	712,907.00	
カタールリアル 小計		234,571		18,169,427.73 (545,991,303)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	143.07	2,809,608.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	578.83	1,847,625.36	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	48,402	169.61	8,209,463.22	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	49.53	3,198,696.93	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	279.38	1,500,829.36	
	MONDI LTD	9,893	321.85	3,184,062.05	
	SAPPI LIMITED	49,985	74.19	3,708,387.15	
	SASOL LTD	48,270	418.82	20,216,441.40	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	203.00	5,623,506.00	
	NASPERS LTD-N SHS	39,879	3,062.52	122,130,235.08	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	208.97	4,450,852.03	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	173.69	4,174,118.08	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	79.95	3,786,991.65	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	50.25	4,205,121.00	
	BID CORP LTD	33,071	264.75	8,755,547.25	
	CLICKS GROUP LTD	20,499	194.50	3,987,055.50	
	PICK N PAY STORES LTD	52,108	73.88	3,849,739.04	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	190.07	8,513,615.44	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	202.73	2,962,493.49	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	285.24	3,714,680.52	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	27.87	4,362,853.41	
	NETCARE LTD	99,170	26.49	2,627,013.30	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	30,125	139.98	4,216,897.50	
	ABSA GROUP LTD	61,049	174.59	10,658,544.91	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,118.29	3,603,130.38	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	277.70	10,562,874.90	
	STANDARD BANK GROUP LTD	112,744	184.27	20,775,336.88	
	FIRSTRAND LTD	312,664	68.26	21,342,444.64	
	INVESTEC LTD	28,883	86.47	2,497,513.01	
	PSG GROUP LTD	18,494	239.35	4,426,538.90	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,647	207.37	2,415,238.39	
	REMGRO LTD	46,153	206.00	9,507,518.00	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	80.58	5,994,990.84	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	165.22	5,782,039.12	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	108.61	676,205.86	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	17.20	1,170,941.60	
	OLD MUTUAL LTD	407,000	22.51	9,161,570.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	36.63	1,480,145.04	

	SANLAM LTD	172,493	83.72	14,441,113.96	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	117.17	3,622,193.38	
	MTN GROUP LTD	164,317	85.48	14,045,817.16	
	TELKOM SA LTD	11,353	63.76	723,867.28	
	VODACOM GROUP	63,550	132.99	8,451,514.50	
南アフリカランド 小計		2,663,866		383,375,372.17 (3,044,000,455)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	184,540	8.49	1,566,744.60	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.07	651,941.16	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	223,903	14.58	3,264,505.74	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	1.53	975,010.86	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	181,209	1.21	219,262.89	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	3.99	121,874.55	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.68	301,800.24	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	4.02	1,208,500.44	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	137,725	16.86	2,322,043.50	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,004,037		10,631,683.98 (317,993,667)	
香港・オフショア人民元	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	31.05	914,112.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.57	228,906.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.44	263,396.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	29.52	315,864.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	9.43	222,548.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.24	280,160.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	22.52	256,728.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	14.03	238,510.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	16,640	15.09	251,097.60	
	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	8.16	184,416.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	16,900	10.99	185,731.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	25.53	265,512.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	8.13	210,567.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.09	203,600.00	
	COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	98,400	2.42	238,128.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	8.37	513,081.00	
	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.50	221,550.00	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	49.99	265,896.81	
	SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	31.81	264,023.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.96	856,408.00	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	25.39	1,081,614.00	
	HEILAN HOME CO LTD -A	21,400	8.72	186,608.00	
	MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	42.08	866,848.00	
	CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	59.43	879,564.00	

	CHINA FILM CO LTD-A	17,000	15.49	263,330.00	
	SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	21,060	10.20	214,812.00	
	LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	10.54	179,180.00	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,300	72.15	310,245.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,400	683.61	1,640,664.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	42.20	185,680.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,800	53.88	204,744.00	
	CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	23.27	237,354.00	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	11,800	59.17	698,206.00	
	SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	21.20	148,400.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.58	1,265,888.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.64	829,336.00	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	5.83	1,120,526.00	
	ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.58	146,102.00	
	CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	5.63	1,038,735.00	
	EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	9.72	989,496.00	
	HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	5.14	223,076.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	23,800	59.92	1,426,096.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	21,100	12.07	254,677.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	15.75	1,083,600.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	3.80	1,133,540.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.08	762,000.00	
	ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	113,300	4.53	513,249.00	
香港・オフショア人民元 小計		2,625,159		24,263,804.41 (391,375,165)	
合　計		224,346,945		49,954,153,688 (49,954,153,688)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,932,357.00	
		KLABIN SA-UNIT	55,100	1,002,820.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	503,484.80	
	ブラジルレアル 小計		111,562	3,438,661.80 (100,443,311)	
投資信託受益証券合計			111,562	100,443,311 (100,443,311)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,509,540.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	7,509,540.00 (43,104,759)	

	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	49,578	922,150.80	
		FORTRESS REIT LTD-B	85,801	1,240,682.46	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	7,255,205.73	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,016,077.85	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	5,446,970.90	
		RESILIENT REIT LTD	23,098	1,358,162.40	
	南アフリカランド 小計		1,024,432	18,239,250.14 (144,819,646)	
投資証券合計			1,332,832	187,924,405 (187,924,405)	
合計				288,367,716 (288,367,716)	

(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　43銘柄	100.0%	—	—	11.8%
メキシコペソ	株式　25銘柄	97.0%	—	—	2.8%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.0%	0.1%
ブラジルレアル	株式　49銘柄	97.5%	—	—	7.8%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.5%	—	0.2%
チリペソ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	1.2%
コロンビアペソ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.4%
ユーロ	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.2%
トルコリラ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.6%
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　20銘柄	100.0%	—	—	1.2%
香港ドル	株式　203銘柄	100.0%	—	—	22.6%
マレーシアリンギット	株式　44銘柄	100.0%	—	—	2.3%
タイバーツ	株式　35銘柄	100.0%	—	—	2.4%
フィリピンペソ	株式　23銘柄	100.0%	—	—	1.1%
インドネシアルピア	株式　28銘柄	100.0%	—	—	2.4%
韓国ウォン	株式　113銘柄	100.0%	—	—	13.6%

新台湾ドル	株式　86銘柄	100.0%	—	—	10.9%
インドルピー	株式　78銘柄	100.0%	—	—	8.8%
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　10銘柄	100.0%	—	—	1.1%
南アフリカランド	株式　43銘柄	95.5%	—	—	6.1%
	投資証券　6銘柄	—	—	4.5%	0.3%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.6%
香港・オフショア人民元	株式　47銘柄	100.0%	—	—	0.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期中間計算期間(2019年1月22日から2019年7月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2019年 1月21日現在）	第9期中間計算期間 （2019年 7月21日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	469,277,170	403,230,623
親投資信託受益証券	47,526,006,019	53,875,829,977
未収入金	24,760,000	173,571,512
流動資産合計	48,020,043,189	54,452,632,112
資産合計	48,020,043,189	54,452,632,112
負債の部		
流動負債		
未払解約金	43,323,551	59,523,245
未払受託者報酬	10,175,695	11,061,329
未払委託者報酬	117,020,454	127,205,239
未払利息	1,310	2,632
その他未払費用	1,700,318	861,295
流動負債合計	172,221,328	198,653,740
負債合計	172,221,328	198,653,740
純資産の部		
元本等		
元本	26,009,857,171	28,022,144,893
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	21,837,964,690	26,231,833,479
（分配準備積立金）	6,352,229,130	6,148,942,748
元本等合計	47,847,821,861	54,253,978,372
純資産合計	47,847,821,861	54,253,978,372
負債純資産合計	48,020,043,189	54,452,632,112

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自　2018年 1月23日 至　2018年 7月22日	第9期中間計算期間 自　2019年 1月22日 至　2019年 7月21日
営業収益		
受取利息	73	195
有価証券売買等損益	△1,319,039,060	2,726,453,958
営業収益合計	△1,319,038,987	2,726,454,153
営業費用		
支払利息	166,040	144,134
受託者報酬	9,206,824	11,061,329
委託者報酬	105,878,363	127,205,239
その他費用	849,642	863,766
営業費用合計	116,100,869	139,274,468
営業利益又は営業損失（△）	△1,435,139,856	2,587,179,685
経常利益又は経常損失（△）	△1,435,139,856	2,587,179,685
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,435,139,856	2,587,179,685
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△59,088,118	58,085,329
期首剰余金又は期首欠損金（△）	21,378,511,462	21,837,964,690
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,933,330,606	2,605,776,309
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,933,330,606	2,605,776,309
剰余金減少額又は欠損金増加額	651,177,351	741,001,876
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	651,177,351	741,001,876
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	22,284,612,979	26,231,833,479

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第9期中間計算期間は2019年 1月22日から2019年 7月21日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第8期 (2019年 1月21日現在)	第9期中間計算期間 (2019年 7月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,009,857,171口	28,022,144,893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 1.8396円 (1万口当たり純資産額) (18,396円)	1口当たり純資産額 1.9361円 (1万口当たり純資産額) (19,361円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第9期中間計算期間 (2019年 7月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第9期中間計算期間 (2019年 7月21日現在)
	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第8期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月21日	第9期中間計算期間 自 2019年 1月22日 至 2019年 7月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	21,270,056,988円	26,009,857,171円
期中追加設定元本額	6,146,205,344円	2,891,759,212円
期中一部解約元本額	1,406,405,161円	879,471,490円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	747,118,495
国債証券	392,679,104,250
地方債証券	25,776,170,419
特殊債券	31,867,890,627
社債券	18,896,300,680
派生商品評価勘定	119,676
未収利息	796,177,842
前払費用	19,145,289
差入委託証拠金	10,000
流動資産合計	470,782,037,278
資産合計	470,782,037,278
負債の部	
流動負債	
前受金	120,000
未払解約金	182,908,990
未払利息	1,626
その他未払費用	304
流動負債合計	183,030,920
負債合計	183,030,920
純資産の部	
元本等	
元本	329,241,217,909
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	141,357,788,449
元本等合計	470,599,006,358
純資産合計	470,599,006,358
負債純資産合計	470,782,037,278

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益

	2019年 7月21日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 7月21日現在	
1．計算期間の末日における受益権の総数		329,241,217,909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	102,598,000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	1.4293円
	(1万口当たり純資産額)	(14,293円)

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

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	307,793,237,795円
期中追加設定元本額	27,000,492,381円
期中一部解約元本額	5,552,512,267円
期末元本額	329,241,217,909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
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,901,351,271円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,090,251円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	15,268,009,702円
世界経済インデックスファンド	1,835,230,830円
ＤＣマイセレクション２５	20,153,276,710円
ＤＣマイセレクション５０	22,020,937,537円
ＤＣマイセレクション７５	5,898,976,963円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	457,272,883円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	85,130,990,570円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	39,054,781,089円
ＤＣマイセレクションＳ２５	8,164,249,124円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,964,893,653円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,692,322,656円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,184,839,365円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,275,639,897円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	426,499,502円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,618,183,512円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	85,176,741円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,937,984円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	45,786,485円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,389,556円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	200,864,734円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	301,584,979円

区分	2019年 7月21日現在
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,311,149円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	145,106,653円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,389,380,851円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	956,211,725円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,605,105,668円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	814,714,629円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	105,650,919円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,245,247,914円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	29,101,083円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,468,640,730円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,810,893,661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	10,082,538,321円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	63,648,839円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	789,239,965円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	52,101,348円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,492,215円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	65,549,064円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	10,119,957円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	10,522,048円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,912,870円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,245,696円
グローバル経済コア	216,901,623円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,403,312円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	814,338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）	78,843,054,665円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	153,440,000	－	153,560,000	120,000
合計		153,440,000	－	153,560,000	120,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,962,196,284
株式	276,823,786,870
派生商品評価勘定	37,383,790
未収入金	10,232,060
未収配当金	411,516,600
差入委託証拠金	127,440,000
流動資産合計	280,372,555,604
資産合計	280,372,555,604
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,543,840
前受金	34,858,310
未払金	798,272,550
未払解約金	263,108,680
未払利息	6,447
その他未払費用	832
流動負債合計	1,098,790,659
負債合計	1,098,790,659
純資産の部	
元本等	
元本	193,820,748,859
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	85,453,016,086
元本等合計	279,273,764,945
純資産合計	279,273,764,945
負債純資産合計	280,372,555,604

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	2019年 7月21日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月21日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	193,820,748,859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　1.4409円 (1万口当たり純資産額)　(14,409円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2019年 7月21日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	181,739,336,499円
期中追加設定元本額	21,373,088,091円
期中一部解約元本額	9,291,675,731円
期末元本額	193,820,748,859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）	604,469,886円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,021,350,132円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,925,970円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,894,576,384円
世界経済インデックスファンド	2,034,041,313円
日本株式インデックス・オープン	5,392,882,905円
ＤＣマイセレクション２５	6,735,633,760円
ＤＣマイセレクション５０	19,184,123,001円
ＤＣマイセレクション７５	17,659,232,778円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,600,128,080円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,730,023,302円
ＤＣマイセレクションＳ５０	7,807,236,235円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,066,575,721円

区分	2019年 7月21日現在
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	6,398,188,211円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	380,097,694円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	648,823,625円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	425,912,255円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,796,743,950円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,176,916,353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）	39,678,732円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	38,766,263円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	290,492,743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）	99,711,429円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	358,733,279円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	63,720,310円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	516,866,865円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,870,562,398円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	749,173,985円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,337,411,641円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	677,499,926円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	47,919,188円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	820,910,624円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	39,628,784円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	477,146,421円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	598,552,039円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	56,015,261円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	908,522,863円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,162,966,236円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,371,231,223円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,205,290,370円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,047,855,488円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,245,019,382円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	247,194,502円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	272,337,373円
コア投資戦略ファンド（切替型）	544,973,808円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,753,450円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,134,367円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	76,363,044円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	12,772,721,002円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	673,595,588円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	13,265,510円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	55,924,739円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	8,026,955円

区分	2019年 7月21日現在
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,313,549円
グローバル経済コア	302,960,583円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,794,702円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	47,209,756円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,827,207円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	148,867,684円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,476,683円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	17,365円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	19,408円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	21,791円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	23,834円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	54,507,293,367円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	646,940,632円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,722,801,690	－	2,757,660,000	34,858,310
合計		2,722,801,690	－	2,757,660,000	34,858,310

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,308,144,098
コール・ローン	2,541,944,867
国債証券	374,504,654,509
派生商品評価勘定	6,427,140
未収入金	2,940,490
未収利息	2,244,423,478

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
前払費用	472,582,879
差入委託証拠金	245,013,264
流動資産合計	383,326,130,725
資産合計	383,326,130,725
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,074,376
前受金	6,427,140
未払金	3,144,057,651
未払解約金	217,252,461
未払利息	5,533
その他未払費用	600
流動負債合計	3,375,817,761
負債合計	3,375,817,761
純資産の部	
元本等	
元本	137,122,179,620
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	242,828,133,344
元本等合計	379,950,312,964
純資産合計	379,950,312,964
負債純資産合計	383,326,130,725

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2019年 7月21日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月21日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	137,122,179,620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 2.7709円 (1万口当たり純資産額) (27,709円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21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 7月21日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	91,483,392,692円
期中追加設定元本額	50,393,049,799円
期中一部解約元本額	4,754,262,871円
期末元本額	137,122,179,620円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,786,708,849円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	725,979,304円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	487,018,147円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,003,307,907円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,874,102円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,158,354,489円
世界経済インデックスファンド	6,555,555,422円
ＤＣマイセレクション２５	1,657,319,330円
ＤＣマイセレクション５０	1,263,984,858円
ＤＣマイセレクション７５	808,201,628円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,869,175,798円
ＤＣマイセレクションＳ２５	672,121,652円
ＤＣマイセレクションＳ５０	517,019,248円
ＤＣマイセレクションＳ７５	231,412,079円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	50,776,055円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	65,667,383円

区分	2019年 7月21日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	31,293,595円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,710,641,801円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	617,467,133円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	41,628,124円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,580,113円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,021,753円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,564,536円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	116,041,491円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	181,243,274円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	158,048,512円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	427,449,509円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,191,599,757円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	614,624,281円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,184,124,670円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	875,137,662円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	86,660,839円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	618,191,982円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	38,054,503円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	240,750,943円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	298,678,822円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	991,547,649円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	2,068,981,325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	471,233,460円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,410,439,035円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,735,282,821円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,251,239,893円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,134,446,524円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	258,699,858円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,639,157,464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）	236,751,377円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	110,443,592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）	1,066,491,936円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	236,104,830円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	24,304,593,580円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	64,542,509円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	90,629,339円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	122,252,798円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,213,111円
グローバル経済コア	939,339,403円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	5,538,138円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	103,814円

区分	2019年 7月21日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	185,396,092円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	17,043,568円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	16,800円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	22,219円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	27,638円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	32,515円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	864,133,831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）	11,511,376,977円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	351,226,100円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	40,228,325,845円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,791,755,748	－	1,798,182,888	6,427,140
合計		1,791,755,748	－	1,798,182,888	6,427,140

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,250,858,676	－	2,242,784,300	△8,074,376
	アメリカドル	1,198,933,617	－	1,194,471,600	△4,462,017
	カナダドル	104,065,038	－	103,798,800	△266,238
	ユーロ	781,772,260	－	778,673,000	△3,099,260
	イギリスポンド	166,087,761	－	165,840,900	△246,861
合計		2,250,858,676	－	2,242,784,300	△8,074,376

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,750,121,443
コール・ローン	620,553,942
株式	340,120,535,866
投資信託受益証券	265,828,550
投資証券	9,197,957,952
派生商品評価勘定	79,416,060
未収入金	5,589,637
未収配当金	309,995,939
差入委託証拠金	2,396,752,797
流動資産合計	355,746,752,186
資産合計	355,746,752,186
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,359,204
前受金	77,789,556
未払解約金	751,245,421
未払利息	1,350
その他未払費用	587
流動負債合計	830,396,118
負債合計	830,396,118
純資産の部	
元本等	
元本	135,611,982,024
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	219,304,374,044
元本等合計	354,916,356,068
純資産合計	354,916,356,068
負債純資産合計	355,746,752,186

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2019年 7月21日現在
	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。 (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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

	2019年 7月21日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月21日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	135,611,982,024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　2.6171円 (1万口当たり純資産額)　(26,171円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	141,058,766,855円
期中追加設定元本額	6,471,999,371円
期中一部解約元本額	11,918,784,202円
期末元本額	135,611,982,024円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,447,547,181円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	9,751,940円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,154,248,395円
世界経済インデックスファンド	7,448,616,705円
外国株式インデックス・オープン	884,929,862円
ＤＣマイセレクション２５	1,077,791,484円
ＤＣマイセレクション５０	4,803,485,840円
ＤＣマイセレクション７５	5,047,443,499円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	8,481,745,136円
ＤＣマイセレクションＳ２５	434,200,011円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,948,939,064円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,444,006,022円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	111,286,186円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	189,884,633円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	124,642,951円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	6,482,408,915円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,792,592,411円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,512,668円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	10,674,210円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	44,535,520円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	57,110,644円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	202,986,627円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	35,577,292円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	288,710,940円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	732,540,014円

区分	2019年 7月21日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	373,755,378円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,433,016,105円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,881,756,458円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	79,866,302円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	352,894,136円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	9,304,582円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	125,694,288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）	2,095,242,459円
外国株式ファンド・シリーズ１	919,630,345円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,504,660,906円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,581,705,796円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,320,725,574円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,791,427,715円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	895,833,941円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,015,906,090円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,138,158,082円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	824,208,706円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,659,515円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	275,655,254円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,664,466,869円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	30,052,693,934円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	74,604,735円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	314,925,822円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	47,624,383円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,339,715円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	45,061,448円
グローバル経済コア	1,015,416,353円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	6,444,404円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	521,935円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	320,545,715円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	60,959,003円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	58,867円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	66,613円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	74,359円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	81,330円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,369,264,473円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	341,473,280円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	361,816,669円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,475,383,981	－	4,553,173,537	77,789,556
合計		4,475,383,981	－	4,553,173,537	77,789,556

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	883,854,300	－	883,587,000	267,300
	アメリカドル	591,595,000	－	591,315,000	280,000
	カナダドル	65,992,800	－	66,000,000	△7,200
	ユーロ	145,318,100	－	145,320,000	△1,900
	イギリスポンド	80,948,400	－	80,952,000	△3,600
合計		883,854,300	－	883,587,000	267,300

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,267,571,369

	2019年 7月21日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	546,030,155
国債証券	48,337,445,775
未収利息	680,242,600
前払費用	37,182,819
流動資産合計	50,868,472,718
資産合計	50,868,472,718
負債の部	
流動負債	
前受収益	53,568
未払解約金	30,491,405
未払利息	1,188
その他未払費用	180
流動負債合計	30,546,341
負債合計	30,546,341
純資産の部	
元本等	
元本	29,408,028,678
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	21,429,897,699
元本等合計	50,837,926,377
純資産合計	50,837,926,377
負債純資産合計	50,868,472,718

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月21日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	29,408,028,678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　1.7287円
		(1万口当たり純資産額)　(17,287円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日

区分	2019年 7月21日現在
期首元本額	28,341,111,188円
期中追加設定元本額	2,078,841,276円
期中一部解約元本額	1,011,923,786円
期末元本額	29,408,028,678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	4,140,969,550円
世界経済インデックスファンド	5,454,765,119円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	4,170,968,744円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,760,895,832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）	1,872,871,790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）	97,435,074円
分散投資コア戦略ファンドＡ	143,981,727円
分散投資コア戦略ファンドＳ	456,719,090円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	216,385,874円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,212,767,166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）	202,000,320円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,826,665円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	203,746,138円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,433,925,483円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	77,572,149円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	108,610,302円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	144,714,892円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,996,035円
グローバル経済コア	766,107,041円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	15,860,308円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	1,981,020円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	22,339円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	23,809円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	25,278円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	26,454円
ＦＯＦｓ用　新興国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	121,421,293円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

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 7月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,122,133,022
コール・ローン	26,664,315
株式	52,908,121,335
投資信託受益証券	149,704,101
投資証券	149,058,683
派生商品評価勘定	48,593,724
未収入金	4,806,560
未収配当金	323,619,987
差入委託証拠金	150,573,069
流動資産合計	54,883,274,796
資産合計	54,883,274,796
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	525,305
前受金	48,080,765
未払金	187,170
未払株式払込金	12,210,226
未払解約金	20,007,340
未払利息	58
その他未払費用	11
流動負債合計	81,010,875
負債合計	81,010,875
純資産の部	
元本等	
元本	19,662,797,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,139,466,887
元本等合計	54,802,263,921
純資産合計	54,802,263,921
負債純資産合計	54,883,274,796

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月21日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (2)投資信託受益証券

	2019年 7月21日現在
	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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月21日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	19,662,797,034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　2.7871円
		(1万口当たり純資産額)　(27,871円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 7月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月22日
期首元本額	19,183,829,395円
期中追加設定元本額	1,191,058,651円
期中一部解約元本額	712,091,012円
期末元本額	19,662,797,034円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,144,678,923円
世界経済インデックスファンド	3,267,161,092円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	4,089,336,055円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,854,272,027円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	196,885,920円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	400,055,339円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	443,125,070円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	367,079,293円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,691,139円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	120,173,897円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	46,191,765円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	199,494,418円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	28,741,022円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	1,191,793円
グローバル経済コア	470,609,339円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	14,984,555円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	26,252円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	29,706円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	33,160円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	36,269円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,523,082,769	－	1,571,163,534	48,080,765

合計	1,523,082,769	－	1,571,163,534	48,080,765

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 7月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,471,864	－	1,472,885	1,021
	アメリカドル	1,471,864	－	1,472,885	1,021
	売建	1,471,864	－	1,485,231	△13,367
	ブラジルレアル	1,471,864	－	1,485,231	△13,367
合計		2,943,728	－	2,958,116	△12,346

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	53,927,784,684円
Ⅱ　負債総額	84,368,519円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,843,416,165円
Ⅳ　発行済口数	28,668,272,555口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8782円
（1万口当たり純資産額）	（18,782円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	508,754,613,690円
Ⅱ　負債総額	9,565,619,584円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	499,188,994,106円
Ⅳ　発行済口数	343,934,832,685口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4514円
（1万口当たり純資産額）	（14,514円）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	290,696,480,330円
Ⅱ　負債総額	1,411,618,854円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	289,284,861,476円
Ⅳ　発行済口数	207,602,993,701口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3935円
（1万口当たり純資産額）	（13,935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 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**388,434,578,079円**
Ⅱ　負債総額	**67,883,209円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**388,366,694,870円**
Ⅳ　発行済口数	**138,636,933,725口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.8013円**
（1万口当たり純資産額）	**（28,013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 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**346,092,168,985円**
Ⅱ　負債総額	**284,400,333円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**345,807,768,652円**
Ⅳ　発行済口数	**137,627,636,128口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.5126円**
（1万口当たり純資産額）	**（25,126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 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**49,414,682,450円**
Ⅱ　負債総額	**1,461,055円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**49,413,221,395円**
Ⅳ　発行済口数	**29,923,204,098口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6513円**
（1万口当たり純資産額）	**（16,513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 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	53,236,870,617円
Ⅱ　負債総額	65,537,320円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,171,333,297円
Ⅳ　発行済口数	20,835,427,259口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5520円
（1万口当たり純資産額）	（25,520円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年 8月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2019年10月21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8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	517	12,293,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	88	343,157
単位型公社債投資信託	7	58,802
合計	612	12,695,174

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	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なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

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

(*) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

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

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

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

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

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

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

（7）デリバティブ取引
　（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位:千円）

区分	前事業年度 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				
	米ドル	有価証券	3,432,867	－	13,731
	英ポンド	投資有価証券	2,575,513	－	50,256
	カナダドル	子会社株式	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

①対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

②企業結合日

2018年10月1日

③企業結合の法的形式

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

④結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 （当社）

⑤その他取引の概要に関する事項

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

(2)実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

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

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

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

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (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

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

③ 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

④ 吸収分割

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

（１株当たり情報）

	前事業年度 （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おりません。

２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　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)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年10月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円）（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。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

２０１９年3月２０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC世界経済インデックスファンドの２０１８年1月２３日から２０１９年1月２１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC世界経済インデックスファンドの２０１９年1月２１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

２０１９年9月２０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC世界経済インデックスファンドの２０１９年1月２２日から２０１９年7月２１日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC世界経済インデックスファンドの２０１９年7月２１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０１９年1月２２日から２０１９年7月２１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。