

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月10日提出
【計算期間】	第5期(自 2019年5月11日至 2019年11月11日)
【ファンド名】	S M T 8 資産インデックスバランス・オープン
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

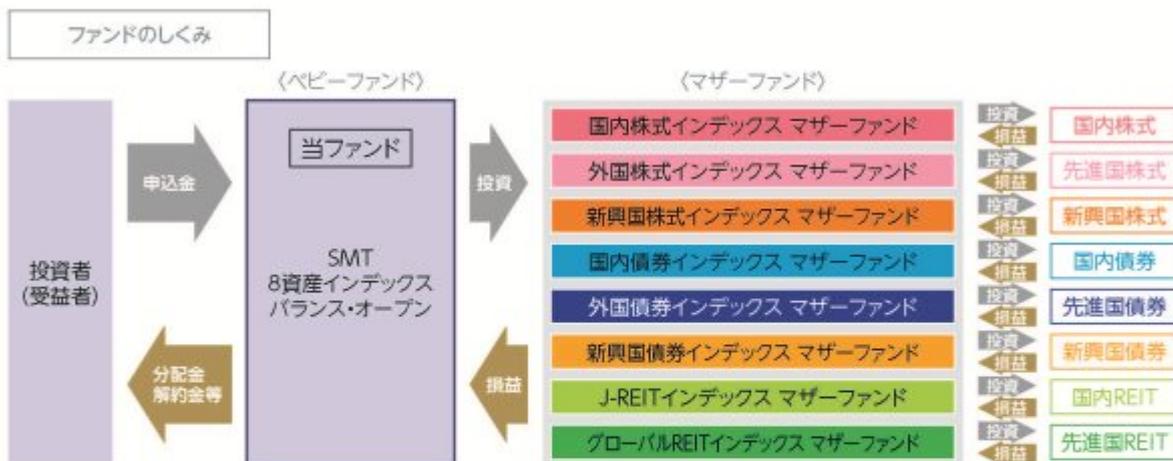
- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

特色1

国内及び海外の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)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。

- 国内、先進国及び新興国の株式及び債券、並びに国内及び先進国のREIT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。

? 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。

? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

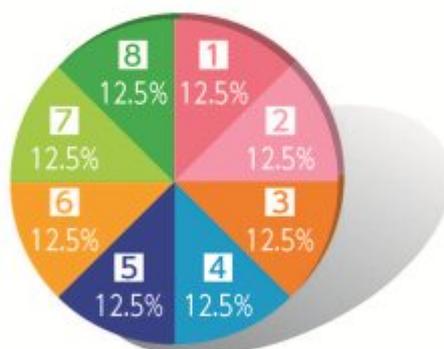
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

マザーファンド	インデックス
1 国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)
2 外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
3 新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)
4 国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
5 外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
6 新興国債券インデックス マザーファンド	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)
7 J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
8 グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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

詳しくは下記をご覧ください。

「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。

「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。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」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。

「NOMURA-BPI総合」とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。

「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。

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)」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。

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

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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。

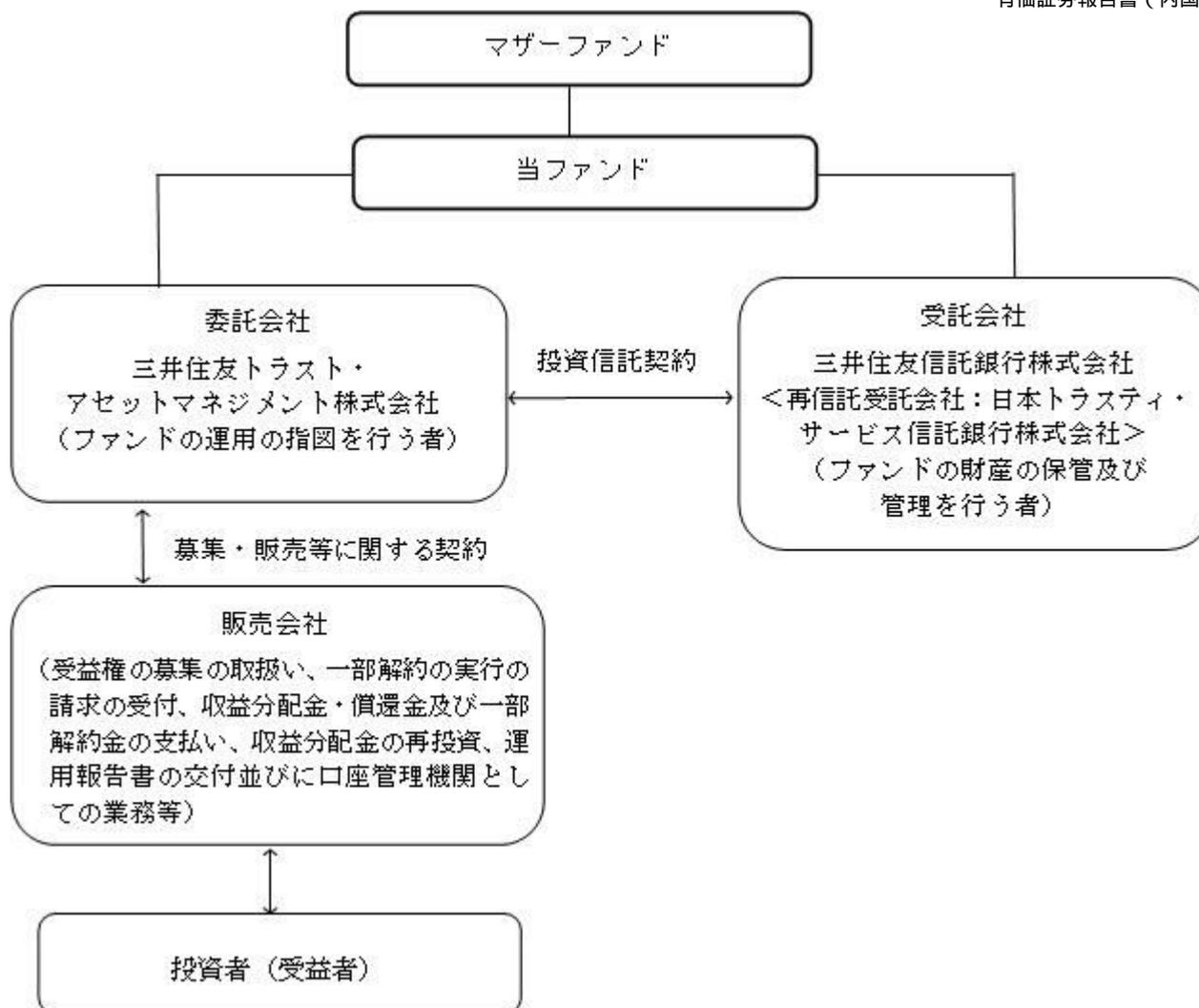
(2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年11月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス 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」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ハ．各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

- ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ホ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
 3. 金銭債権
 4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の

性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第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。以下同じ。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式インデックス 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めざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件の

もとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

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なら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ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

なるよう調整を行うこととします。

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

「J-REIT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、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバルREIT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、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所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ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口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。）に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

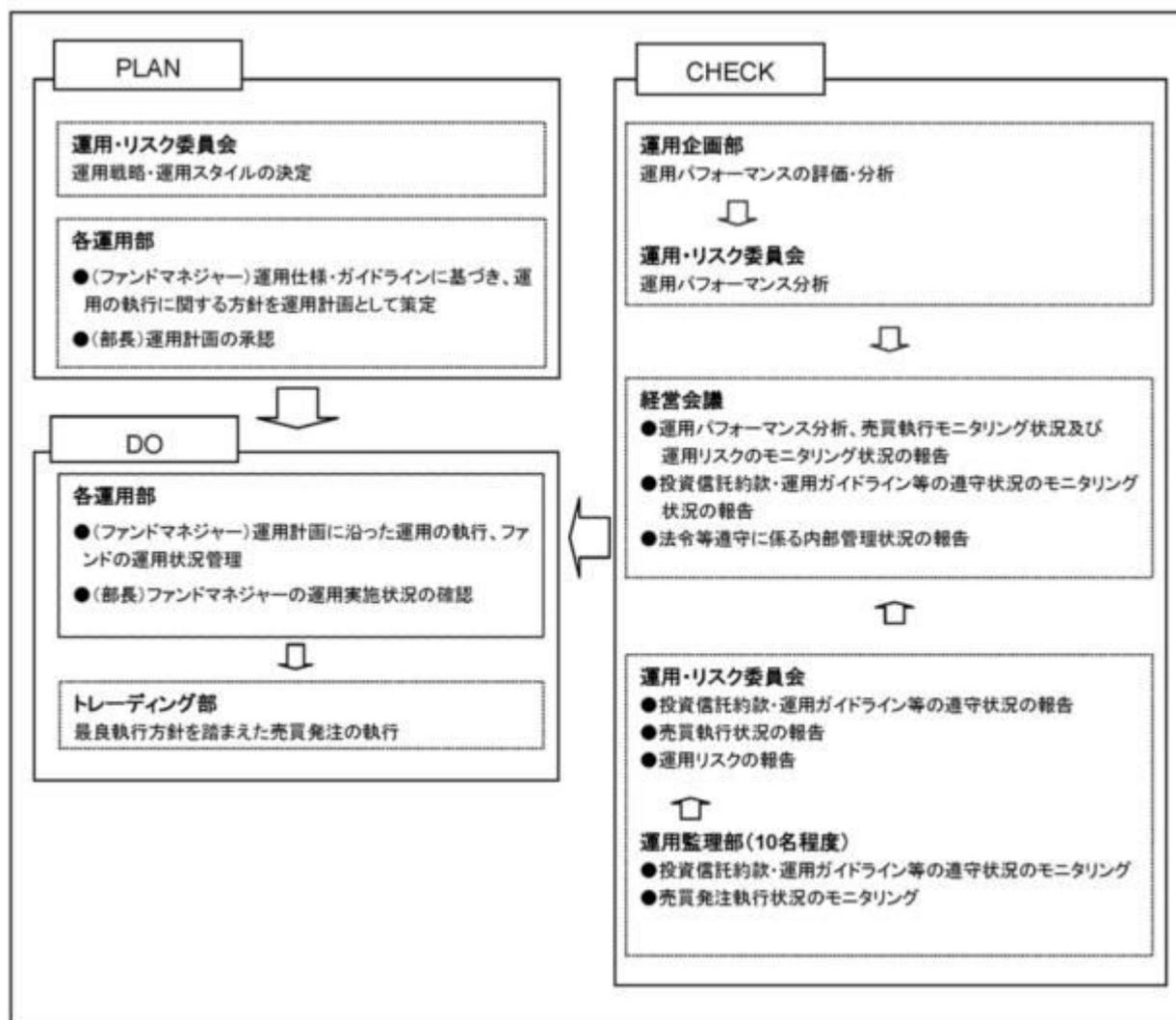
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(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2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。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

す。（以下同じ。）

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとし、
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとし、
- (ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとし、
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル.の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ. 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヨ. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

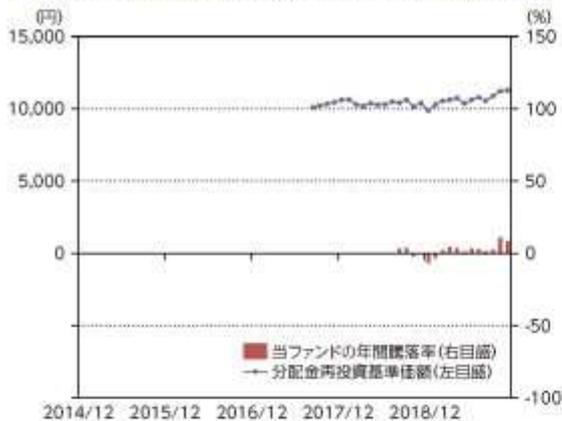
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年8月～2019年11月の1年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2014年12月～2019年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 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を銘柄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ロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロ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.は同指数の内部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.は同指数の内部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)に関して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、本ファンドの権限、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、誤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 ダモス・グローバル・デベロップメント・インデックス -エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント(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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 2 ）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55%（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 0.22% (税抜 0.2%)	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 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

（ 4 ）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息

（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

NISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2019年11月29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11月29日現在の状況について記載してあります。

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

(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	33,847,591	99.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		306,329	0.90
合計(純資産総額)		34,153,920	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	2,094,946	2.1345	4,471,817	2.1895	4,586,884	13.43
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,583,470	2.7384	4,336,257	2.7963	4,427,857	12.96
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	2,133,594	1.9790	4,222,407	2.0327	4,336,956	12.70
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	1,500,193	2.8108	4,216,819	2.8435	4,265,798	12.49
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	2,695,158	1.5854	4,273,132	1.5816	4,262,661	12.48
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	1,454,336	2.8737	4,179,419	2.8549	4,151,983	12.16
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	2,365,530	1.7515	4,143,387	1.7376	4,110,344	12.03
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	2,599,894	1.4210	3,694,598	1.4251	3,705,108	10.85

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.10
合計	99.10

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末 (2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末 (2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末 (2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末 (2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
2018年11月末日	14,816,305		10,394	
12月末日	15,383,985		9,873	
2019年 1月末日	18,719,191		10,292	
2月末日	20,601,752		10,536	
3月末日	21,935,234		10,618	
4月末日	23,547,218		10,731	
5月末日	24,376,194		10,373	
6月末日	26,755,421		10,618	
7月末日	28,136,818		10,783	
8月末日	29,535,689		10,562	
9月末日	30,794,306		10,883	
10月末日	33,637,756		11,221	
11月末日	34,153,920		11,275	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	319,091,943,500	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,939,364,922	1.83
合計(純資産総額)		325,031,308,422	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,803,740,000	1.79

(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	1,482,300	6,645.97	9,851,321,331	7,638.00	11,321,807,400	3.48
日本	株式	ソニー	電気機器	840,700	5,405.49	4,544,395,443	6,904.00	5,804,192,800	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,031,100	508.66	4,593,759,326	578.10	5,220,878,910	1.61
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,106,700	3,827.87	4,236,303,729	4,455.00	4,930,348,500	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	872,400	4,937.06	4,307,091,144	5,527.00	4,821,754,800	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	120,500	31,440.53	3,788,583,865	37,440.00	4,511,520,000	1.39
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,035,700	5,188.25	5,373,470,525	4,253.00	4,404,832,100	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	907,300	3,800.91	3,448,565,643	3,989.00	3,619,219,700	1.11
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	910,500	3,593.73	3,272,091,165	3,962.00	3,607,401,000	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	81,600	39,047.07	3,186,240,912	42,350.00	3,455,760,000	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,047,300	2,751.91	2,882,075,343	3,067.00	3,212,069,100	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	972,800	2,791.20	2,715,279,360	3,139.00	3,053,619,200	0.94
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,826,900	155.83	2,777,965,827	169.20	3,016,311,480	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	964,200	2,589.11	2,496,419,862	3,003.00	2,895,492,600	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	469,100	5,566.91	2,611,437,481	5,952.00	2,792,083,200	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	639,200	3,820.49	2,442,057,208	4,300.00	2,748,560,000	0.85
日本	株式	花王	化学	318,500	8,599.35	2,738,892,975	8,612.00	2,742,922,000	0.84
日本	株式	HOYA	精密機器	267,800	7,978.25	2,136,575,350	9,990.00	2,675,322,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	169,500	13,794.65	2,338,193,175	15,745.00	2,668,777,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	126,400	18,482.34	2,336,167,776	20,905.00	2,642,392,000	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	919,300	2,830.00	2,601,619,000	2,866.00	2,634,713,800	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	223,700	9,452.82	2,114,595,834	11,710.00	2,619,527,000	0.81
日本	株式	第一三共	医薬品	380,600	5,566.41	2,118,575,646	6,862.00	2,611,677,200	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	160,100	13,782.50	2,206,578,250	16,190.00	2,592,019,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	390,800	4,689.66	1,832,719,128	6,344.00	2,479,235,200	0.76
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	110,600	22,636.82	2,503,632,292	22,095.00	2,443,707,000	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	234,100	10,404.30	2,435,646,630	10,070.00	2,357,387,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	1,151,500	1,684.86	1,940,116,290	1,939.50	2,233,334,250	0.69
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	916,300	2,021.08	1,851,915,604	2,388.00	2,188,124,400	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,170,100	1,538.98	1,800,760,498	1,867.50	2,185,161,750	0.67

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.73
		食料品	3.84
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.01
		医薬品	5.91
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.57
		機械	5.02
		電気機器	13.96
		輸送用機器	7.69
		精密機器	2.30
		その他製品	2.29
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.48
		海運業	0.17
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.40
		卸売業	4.87
		小売業	4.58
		銀行業	5.75
		証券、商品先物取引業	0.82
		保険業	2.25
その他金融業	1.15		
不動産業	2.37		
サービス業	5.04		
		小計	98.17
合計			98.17

(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	342	円	5,590,660,390	5,803,740,000	1.79

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	245,730,778,379	62.40
	イギリス	22,329,250,778	5.67
	カナダ	14,351,615,949	3.64
	フランス	14,204,663,525	3.61
	スイス	13,993,490,225	3.55
	ドイツ	12,107,188,273	3.07
	オーストラリア	8,559,182,912	2.17
	オランダ	7,376,200,526	1.87
	アイルランド	7,139,086,183	1.81
	スペイン	3,891,191,076	0.99
	スウェーデン	3,348,662,178	0.85
	香港	3,243,702,795	0.82
	イタリア	2,656,134,045	0.67
	デンマーク	2,500,229,940	0.63
	シンガポール	1,621,013,302	0.41
	バミューダ	1,503,354,855	0.38
	フィンランド	1,479,919,071	0.38
	ベルギー	1,369,276,623	0.35
	ジャージー	1,061,986,566	0.27
	ケイマン	881,687,572	0.22
ノルウェー	863,129,211	0.22	
イスラエル	820,689,326	0.21	

	キュラソー	495,596,735	0.13
	ニュージーランド	370,837,990	0.09
	ルクセンブルク	355,345,978	0.09
	オーストリア	309,180,751	0.08
	ポルトガル	211,388,309	0.05
	リベリア	203,211,702	0.05
	パナマ	174,024,854	0.04
	パプアニューギニア	64,991,404	0.02
	マン島	51,110,836	0.01
	英ヴァージン諸島	47,440,849	0.01
	小計	373,315,562,718	94.80
投資信託受益証券	オーストラリア	209,162,652	0.05
	香港	84,793,380	0.02
	小計	293,956,032	0.07
投資証券	アメリカ	8,538,428,780	2.17
	オーストラリア	668,449,482	0.17
	フランス	429,636,828	0.11
	イギリス	264,585,581	0.07
	香港	203,553,000	0.05
	シンガポール	201,444,292	0.05
	カナダ	92,200,384	0.02
	小計	10,398,298,347	2.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,775,850,509	2.48
合計(純資産総額)		393,783,667,606	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	6,651,458,814	1.69
	買建	カナダ	421,814,200	0.11
	買建	ドイツ	1,425,268,259	0.36
	買建	イギリス	587,356,980	0.15
	買建	オーストラリア	369,380,308	0.09

(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		325,304,100	0.08
	売建		260,765,280	0.07

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	395,946	19,651.77	7,781,042,576	29,344.55	11,618,857,353	2.95
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	635,320	13,876.86	8,816,252,794	16,688.17	10,602,334,009	2.69
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,824	200,660.26	7,389,113,415	199,235.95	7,336,664,829	1.86
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	210,848	20,161.14	4,250,937,964	22,131.12	4,666,302,390	1.18
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	279,555	11,914.64	3,330,799,980	14,468.49	4,044,739,728	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,512	124,615.20	3,428,413,455	143,851.18	3,957,633,785	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	26,286	125,200.22	3,291,013,153	143,756.96	3,778,795,524	0.96
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	230,855	14,974.66	3,456,975,319	15,091.89	3,484,038,266	0.88
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	150,915	17,994.13	2,715,584,793	20,199.57	3,048,419,193	0.77
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	259,686	10,882.44	2,826,019,807	11,439.62	2,970,710,198	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	220,272	11,552.91	2,544,783,964	13,340.02	2,938,434,119	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	772,510	3,060.01	2,363,888,943	3,661.49	2,828,541,657	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	371,576	7,939.30	2,950,054,116	7,526.77	2,796,767,833	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	115,181	21,919.48	2,524,707,899	24,157.97	2,782,540,294	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	641,062	3,523.57	2,258,831,472	4,126.02	2,645,040,787	0.67
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	158,140	14,525.80	2,297,110,868	16,596.14	2,624,514,971	0.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	83,701	26,403.36	2,209,988,076	30,750.20	2,573,822,925	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	78,756	27,863.29	2,194,401,992	31,958.65	2,516,935,597	0.64

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	387,248	4,800.91	1,859,146,358	6,410.35	2,482,397,385	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	363,367	6,435.53	2,338,459,502	6,584.55	2,392,610,360	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	96,670	21,100.95	2,039,829,141	24,431.88	2,361,829,840	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	365,317	5,010.17	1,830,303,488	5,953.49	2,174,911,252	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	167,394	12,956.14	2,168,780,939	12,935.74	2,165,366,802	0.55
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	223,750	8,813.00	1,971,910,181	9,598.55	2,147,675,920	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	356,211	5,409.53	1,926,937,538	5,910.76	2,105,478,443	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	61,860	29,564.25	1,828,845,026	33,891.11	2,096,504,683	0.53
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	489,061	4,552.85	2,226,623,446	4,232.30	2,069,854,240	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	398,164	4,663.99	1,857,034,975	4,866.65	1,937,726,901	0.49
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	189,231	9,694.56	1,834,511,520	10,127.85	1,916,503,411	0.49
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	46,987	38,972.65	1,831,208,162	40,318.08	1,894,425,625	0.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.11
		素材	4.19
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	1.09
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.74
		メディア・娯楽	5.94
		小売	4.62
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.66
		家庭用品・パーソナル用品	2.04
		ヘルスケア機器・サービス	4.92
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.97		

	銀行	7.62
	各種金融	4.34
	保険	3.76
	不動産	0.52
	ソフトウェア・サービス	9.50
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.47
	電気通信サービス	2.32
	公益事業	3.39
	半導体・半導体製造装置	3.19
	小計	94.80
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.64
合計		97.52

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	385	アメリカドル	57,873,807.5	6,340,654,350	60,710,650	6,651,458,814	1.69
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	4,976,392.5	410,303,562	5,116,000	421,814,200	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	28	スイスフラン	2,811,086	308,319,912	2,946,720	323,196,249	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	247	ユーロ	8,790,641.5	1,060,063,458	9,139,000	1,102,072,010	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	4,851,178	359,666,337	4,982,200	369,380,308	0.09
	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	56	イギリスポンド	4,073,015	576,127,972	4,152,400	587,356,980	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
----	-------	---------	----	-----------	-----------	-------------

為替予約取引	アメリカドル	買建	2,970,000.00	324,433,162	325,304,100	0.08
	イギリスポンド	売建	800,000.00	113,140,000	113,136,000	0.03
	スイスフラン	売建	1,346,000.00	147,618,512	147,629,280	0.04

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	10,792,683,327	17.43
	中国	7,358,640,950	11.88
	韓国	7,091,317,495	11.45
	台湾	7,046,583,321	11.38
	インド	5,567,375,064	8.99
	ブラジル	4,142,539,092	6.69
	南アフリカ	2,617,622,252	4.23
	ロシア	2,287,023,195	3.69
	香港	1,836,982,187	2.97
	タイ	1,637,978,311	2.64
	サウジアラビア	1,463,367,566	2.36
	メキシコ	1,340,639,797	2.16
	インドネシア	1,159,357,698	1.87
	マレーシア	1,135,546,020	1.83
	フィリピン	589,660,281	0.95
	カタール	579,182,534	0.94
	ポーランド	550,860,614	0.89
	パミュダ	525,740,106	0.85
	チリ	433,883,625	0.70
	アラブ首長国連邦	390,557,617	0.63
	トルコ	311,462,534	0.50
	コロンビア	212,727,807	0.34
	ギリシャ	184,234,418	0.30
	アメリカ	183,718,933	0.30
	ハンガリー	166,916,674	0.27
	チェコ	86,710,323	0.14
エジプト	77,375,782	0.12	
ルクセンブルク	62,070,539	0.10	
アルゼンチン	48,381,205	0.08	

	ジャージー	43,809,894	0.07
	シンガポール	33,670,000	0.05
	マン島	29,603,266	0.05
	ペルー	27,748,568	0.04
	パキスタン	21,045,704	0.03
	小計	60,037,016,699	96.93
投資信託受益証券	ブラジル	163,337,760	0.26
	メキシコ	27,271,786	0.04
	小計	190,609,546	0.31
投資証券	南アフリカ	111,123,432	0.18
	メキシコ	51,632,266	0.08
	小計	162,755,698	0.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,546,360,983	2.50
合計(純資産総額)		61,936,742,926	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,497,261,750	2.42

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		16,429,500	0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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	158,136	20,550.97	3,249,849,262	22,001.83	3,479,282,844	5.62
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,332,389	1,096.74	2,558,035,974	1,111.10	2,591,529,080	4.18
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	543,100	4,580.80	2,487,832,480	4,732.00	2,569,949,200	4.15
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	451,537	4,850.51	2,190,184,734	4,776.02	2,156,554,258	3.48
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,117,620	90.58	825,874,020	89.60	816,938,752	1.32
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	275,350	2,226.07	612,948,375	2,433.66	670,108,832	1.08
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	525,500	1,317.40	692,293,700	1,264.90	664,704,950	1.07
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	41,715	15,974.49	666,376,267	15,733.99	656,343,430	1.06
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	158,513	3,439.12	545,146,497	3,557.01	563,833,119	0.91
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,262,515	82.03	513,776,730	80.35	503,255,705	0.81
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	580,500	900.20	522,566,100	844.20	490,058,100	0.79
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	507,052	906.06	459,420,143	865.52	438,865,675	0.71
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	457,781	943.02	431,696,639	899.60	411,819,788	0.66
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	253,773	1,657.09	420,525,969	1,609.98	408,570,520	0.66
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	52,182	7,662.13	399,825,268	7,708.68	402,254,340	0.65
ブラジル	株式	VALE SA	素材	302,478	1,278.67	386,772,569	1,309.61	396,131,238	0.64
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	326.33	390,372,806	322.38	385,648,823	0.62
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	36,794	10,342.46	380,540,620	10,452.02	384,571,771	0.62
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	326,529	1,090.55	356,096,527	1,080.84	352,928,543	0.57
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,726,200	46.34	358,032,108	44.94	347,215,428	0.56
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	26,080	13,646.79	355,908,377	13,093.51	341,478,887	0.55
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	414,357	758.94	314,472,648	799.49	331,274,692	0.53
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	383,453	890.23	341,365,198	863.45	331,096,327	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	77,555	3,966.05	307,587,783	3,882.27	301,089,450	0.49
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	391,240	780.52	305,370,645	767.77	300,386,247	0.48
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,712,000	177.80	304,393,600	164.36	281,384,320	0.45
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	86,554	3,280.12	283,907,766	3,199.11	276,896,546	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,198,840	85.64	273,976,808	84.63	270,740,861	0.44
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	71,913	3,640.67	261,812,135	3,631.91	261,181,832	0.42
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	432,557	579.83	250,810,390	576.53	249,385,331	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	7.32
		素材	6.93
		資本財	3.03
		商業・専門サービス	0.23
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.26
		耐久消費財・アパレル	1.33
		消費者サービス	1.41
		メディア・娯楽	6.69
		小売	8.94
		食品・生活必需品小売り	1.56
		食品・飲料・タバコ	3.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.06
		ヘルスケア機器・サービス	0.79
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.97
		銀行	17.40
		各種金融	2.47
		保険	3.90
		不動産	2.57
		ソフトウェア・サービス	1.75
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.23
		電気通信サービス	4.11
		公益事業	2.52
半導体・半導体製造装置	6.00		
	小計	96.93	
投資信託受益証券			0.31
投資証券			0.26
合計			97.50

(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	259	アメリカドル	13,796,744	1,511,571,272	13,666,135	1,497,261,750	2.42

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	150,000.00	16,405,500	16,429,500	0.03

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

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

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	456,973,896,800	83.28
地方債証券	日本	29,410,393,434	5.36
特殊債券	日本	37,868,858,098	6.90
社債券	日本	20,054,367,970	3.65
	フランス	1,599,637,000	0.29
	オーストラリア	701,358,000	0.13
	アメリカ	209,108,000	0.04
	イギリス	100,418,000	0.02
	小計	22,664,888,970	4.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,779,897,592	0.32
合計(純資産総額)		548,697,934,894	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	153,160,000	0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,710,000,000	101.37	9,843,793,200	101.18	9,824,869,300	0.100	2023/12/20	1.79
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,340,000,000	101.99	7,486,099,800	101.30	7,435,933,800	0.100	2024/6/20	1.36
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	6,840,000,000	103.04	7,047,952,000	101.92	6,971,806,800	0.100	2029/6/20	1.27
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,830,000,000	101.59	6,938,836,600	101.11	6,905,813,000	0.100	2023/9/20	1.26
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,550,000,000	102.61	6,721,481,900	102.27	6,698,750,500	0.100	2028/3/20	1.22
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	6,460,000,000	102.39	6,614,812,400	101.91	6,583,515,200	0.100	2026/3/20	1.20
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	103.52	6,542,464,000	0.400	2025/9/20	1.19
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,890,000,000	103.97	6,124,268,300	103.36	6,088,257,400	0.400	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	5,970,000,000	101.28	6,046,822,900	100.95	6,026,774,700	0.100	2022/12/20	1.10
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	5,600,000,000	101.20	5,667,200,000	101.09	5,661,040,000	0.100	2023/6/20	1.03
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	5,580,000,000	101.13	5,643,054,000	101.01	5,636,469,600	0.100	2023/3/20	1.03
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	100.81	5,585,261,800	100.66	5,577,007,200	0.100	2022/3/20	1.02
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	4,960,000,000	102.47	5,082,550,600	102.03	5,060,787,200	0.100	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	4,890,000,000	102.42	5,008,771,900	102.13	4,994,548,200	0.100	2028/9/20	0.91
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	4,870,000,000	101.51	4,943,537,000	101.25	4,931,167,200	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,870,000,000	100.89	4,913,579,300	100.75	4,906,768,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	100.50	4,804,234,600	100.35	4,796,730,000	0.100	2021/3/20	0.87
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	102.41	4,680,411,200	1.000	2021/12/20	0.85
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,490,000,000	102.03	4,581,457,900	102.10	4,584,559,400	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	4,410,000,000	101.45	4,474,347,300	101.38	4,470,858,000	0.100	2024/9/20	0.81
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.90	4,419,463,800	0.100	2022/9/20	0.81
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,110,000,000	103.24	4,243,537,400	102.29	4,204,365,600	0.100	2027/9/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	102.12	4,023,833,200	102.02	4,019,588,000	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	3,270,000,000	120.55	3,942,310,900	120.33	3,934,889,100	1.500	2034/6/20	0.72
日本	国債証券	第403回利付国債(2年)	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.47	3,787,907,500	0.100	2021/8/1	0.69
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	103.34	3,740,980,400	0.500	2024/9/20	0.68

日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	102.20	3,669,267,200	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	3,430,000,000	103.28	3,542,778,400	103.06	3,534,992,300	0.300	2025/12/20	0.64
日本	国債証券	第401回利付国債（2年）	3,460,000,000	100.59	3,480,483,800	100.41	3,474,497,400	0.100	2021/6/1	0.63
日本	国債証券	第398回利付国債（2年）	3,460,000,000	100.47	3,476,284,000	100.34	3,471,833,200	0.100	2021/3/1	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。

□.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.28
地方債証券	5.36
特殊債券	6.90
社債券	4.13
合計	99.68

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	1円		153,320,330	153,160,000	0.03

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	189,255,730,568	47.85
	フランス	38,131,686,599	9.64
	イタリア	34,234,072,474	8.66
	イギリス	24,803,106,077	6.27
	ドイツ	24,198,652,853	6.12
	スペイン	21,828,507,537	5.52

	ベルギー	9,125,808,232	2.31
	オーストラリア	7,791,164,796	1.97
	カナダ	7,326,883,285	1.85
	オランダ	7,151,853,462	1.81
	オーストリア	5,344,340,274	1.35
	メキシコ	3,238,549,130	0.82
	アイルランド	2,701,976,923	0.68
	ポーランド	2,215,605,829	0.56
	南アフリカ	2,191,785,422	0.55
	フィンランド	2,133,239,855	0.54
	デンマーク	2,025,212,312	0.51
	マレーシア	1,769,646,209	0.45
	シンガポール	1,602,761,935	0.41
	スウェーデン	1,318,735,396	0.33
	ノルウェー	904,057,509	0.23
	小計	389,293,376,677	98.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,217,821,373	1.57
合計(純資産総額)		395,511,198,050	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	938,656,174	0.24
	買建	ドイツ	1,152,493,100	0.29

(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		2,585,447,000	0.65

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	20,000,000	11,536.31	2,307,262,386	11,754.58	2,350,917,948	2.625	2029/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,323.68	2,264,736,672	11,373.26	2,274,653,912	2.750	2023/5/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,196.98	2,099,434,072	11,460.14	2,148,777,608	2.375	2027/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	19,200,000	10,099.96	1,939,193,169	11,064.70	2,124,423,190	2.250	2046/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,387.66	2,049,779,952	11,550.02	2,079,003,712	2.625	2026/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,438.10	2,060,002,983	11,526.91	2,075,996,557	2.375	2029/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	11,027.31	2,040,054,105	11,062.99	2,046,653,564	2.125	2021/12/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,275.26	1,882,969,212	11,543.60	1,927,781,377	2.625	2025/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,826.32	1,894,606,952	11,003.93	1,925,688,187	1.750	2023/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,792.57	1,765,348,178	12,857.89	1,924,826,600	3.000	2049/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,536.59	1,738,537,453	11,615.07	1,916,486,859	2.500	2046/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,520.06	1,833,994,008	11,946.31	1,901,854,102	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,529.74	1,684,758,900	11,620.20	1,859,233,200	2.500	2046/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,367.07	1,807,365,593	11,360.43	1,806,308,440	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,511.93	1,726,789,715	11,753.73	1,763,060,062	3.000	2025/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,759.72	1,693,400,453	12,192.82	1,755,767,483	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,516.63	1,642,272,737	11,927.48	1,700,859,947	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,143.34	1,671,502,140	11,241.45	1,686,218,278	2.250	2024/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,173.03	1,675,955,754	11,209.78	1,681,467,816	2.375	2023/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,074.11	1,661,117,906	11,151.15	1,672,673,062	2.500	2022/1/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,975.68	1,607,938,089	11,378.83	1,666,999,052	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,270.03	1,645,424,695	11,401.51	1,664,621,254	2.375	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,926.96	1,644,508,473	10,978.46	1,652,259,485	1.750	2021/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	11,032.18	1,649,311,157	11,038.59	1,650,270,392	2.125	2021/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,897.60	1,634,640,677	10,959.42	1,643,913,562	1.625	2022/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/47	12,750,000	12,299.82	1,568,228,010	12,785.99	1,630,214,282	3.000	2047/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,892.23	1,595,712,087	11,037.31	1,616,966,518	1.875	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	13,900,000	11,371.32	1,580,614,138	11,424.62	1,588,022,987	2.750	2023/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,955.92	1,434,711,208	12,915.24	1,549,828,919	3.125	2044/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,794.98	1,409,500,632	12,833.07	1,533,551,983	3.000	2048/8/15	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.43
合計	98.43

(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	31	アメリカドル	3,693,311.65	404,639,224	3,687,789.14	404,034,178	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	18	アメリカドル	2,335,446.97	255,871,570	2,330,718.84	255,353,556	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカドル	2,556,595.25	280,100,576	2,549,000	279,268,440	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,794,079	216,347,987	1,792,000	216,097,280	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	17	ユーロ	2,293,398	276,560,865	2,284,800	275,524,032	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	32	ユーロ	5,508,588	664,280,626	5,480,320	660,871,788	0.17

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,070,000.00	1,312,638,068	1,320,578,700	0.33
	カナダドル	買建	1,290,000.00	105,929,212	106,231,500	0.03
	ユーロ	買建	8,120,000.00	974,712,940	979,109,600	0.25
	イギリスポンド	買建	1,270,000.00	177,797,219	179,527,200	0.05

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	インドネシア	5,364,558,942	10.09
	メキシコ	5,209,024,623	9.80
	ブラジル	5,107,452,726	9.60

	タイ	4,997,254,921	9.40
	ポーランド	4,657,399,506	8.76
	南アフリカ	4,626,962,475	8.70
	ロシア	4,580,465,007	8.61
	マレーシア	3,352,502,739	6.30
	コロンビア	3,328,093,579	6.26
	ハンガリー	2,260,105,795	4.25
	チェコ	2,109,214,774	3.97
	ペルー	2,022,565,725	3.80
	トルコ	1,954,462,504	3.68
	チリ	1,470,115,700	2.76
	フィリピン	161,181,630	0.30
	ドミニカ共和国	95,372,780	0.18
	ウルグアイ	87,027,906	0.16
	小計	51,383,761,332	96.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,795,087,658	3.38
合計(純資産総額)		53,178,848,990	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	59,100,000,000	3.91	2,313,160,762	3.89	2,300,179,565	9.850	2027/6/28	4.33
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000	2,910.28	926,925,533	2,892.22	921,173,563	10.000	2023/1/1	1.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	98,900,000	822.43	813,391,028	822.08	813,041,986	10.500	2026/12/21	1.53
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	440.95	776,513,637	439.42	773,829,838	3.400	2036/6/17	1.46
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000	3,014.47	737,038,905	2,985.55	729,967,705	10.000	2025/1/1	1.37
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.06	723,705,325	3.04	720,894,002	4.375	2023/3/21	1.36
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	2,335.55	666,799,777	2,332.81	666,018,282	0.000	2022/1/1	1.25
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	23,750,000	2,748.78	652,837,052	2,740.47	650,863,902	10.000	2021/1/1	1.22
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,866.11	606,183,035	2,871.47	607,316,810	2.500	2023/1/25	1.14
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	434.74	595,161,922	433.46	593,417,487	3.650	2031/6/20	1.12
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	19,350,000	3,099.65	599,783,742	3,057.58	591,642,888	10.000	2027/1/1	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	649.69	580,176,796	641.70	573,040,864	8.750	2048/2/28	1.08
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000	463.89	538,116,982	465.22	539,666,487	4.875	2029/6/22	1.01

メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	584.05	538,209,907	576.44	531,190,003	7.500	2027/6/3	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	641.19	527,384,565	634.37	521,775,222	10.000	2024/12/5	0.98
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000	0.83	492,535,789	0.83	490,703,522	8.375	2024/3/15	0.92
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	23,250,000	2,112.04	491,051,007	2,104.84	489,375,575	0.000	2023/7/1	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	83,000,000	561.03	465,660,021	560.75	465,426,791	6.500	2021/6/10	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	79,600,000	588.67	468,583,325	583.63	464,575,052	8.000	2023/12/7	0.87
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	561.01	455,540,835	558.27	453,323,003	6.500	2022/6/9	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	15,600,000	2,871.66	447,980,476	2,900.03	452,405,684	2.500	2026/7/25	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000	651.83	444,553,253	643.77	439,055,276	8.750	2044/1/31	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	63,300,000	686.16	434,339,597	683.94	432,935,694	8.000	2030/1/31	0.81
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000	0.85	429,683,846	0.84	426,087,539	8.375	2026/9/15	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	68,500,000	626.45	429,118,360	616.61	422,379,460	8.500	2029/5/31	0.79
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	14,300,000	2,869.78	410,379,272	2,904.41	415,332,043	2.500	2027/7/25	0.78
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	16,250,000	2,410.61	391,725,100	2,407.40	391,202,721	0.000	2021/7/1	0.74
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000	2,982.65	378,796,769	3,005.58	381,709,676	3.250	2025/7/25	0.72
マレーシア	国債証券	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000	2,710.12	365,866,727	2,716.49	366,726,414	3.899	2027/11/16	0.69
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000	569.36	366,103,507	566.45	364,229,825	7.250	2021/12/9	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.62
合計	96.62

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	122,839,517,210	97.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,285,748,736	2.61
合計(純資産総額)		126,125,265,946	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,275,982,000	2.60

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	10,531	798,170.59	8,405,534,483	822,000	8,656,482,000	6.86
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,874	715,179.92	7,776,866,450	745,000	8,101,130,000	6.42
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,913	195,126.65	6,617,330,081	199,800	6,775,817,400	5.37
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,667	235,922.92	5,111,741,907	240,700	5,215,246,900	4.13
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,417	214,010.11	5,225,484,855	213,000	5,200,821,000	4.12
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	20,553	243,145.12	4,997,361,651	249,300	5,123,862,900	4.06
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,624	293,594.57	4,587,121,561	293,700	4,588,768,800	3.64
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,661	300,504.13	4,405,691,049	299,400	4,389,503,400	3.48
日本	投資証券	GLP投資法人	27,085	133,646.56	3,619,817,077	145,600	3,943,576,000	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,314	348,017.96	3,589,457,239	353,500	3,645,999,000	2.89
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,884	499,470.62	3,438,355,748	498,500	3,431,674,000	2.72
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,031	87,009.64	3,048,034,698	89,700	3,142,280,700	2.49
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	47,700	63,709.21	3,038,929,317	65,100	3,105,270,000	2.46
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	5,449	562,032.44	3,062,514,765	565,000	3,078,685,000	2.44
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,796	95,297.98	3,030,094,572	96,800	3,077,852,800	2.44
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,364	820,057.94	2,758,674,910	829,000	2,788,756,000	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,614	674,057.06	2,436,042,214	688,000	2,486,432,000	1.97
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,380	166,734.94	2,230,913,497	171,200	2,290,656,000	1.82
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,511	172,626.24	2,159,726,888	177,400	2,219,451,400	1.76

日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,510	837,911.03	2,103,156,685	822,000	2,063,220,000	1.64
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,105	274,118.46	1,947,611,658	280,200	1,990,821,000	1.58
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,248	200,214.87	1,851,587,117	202,000	1,868,096,000	1.48
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,863	477,013.34	1,842,702,532	476,000	1,838,788,000	1.46
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	9,738	182,393.24	1,776,145,371	185,000	1,801,530,000	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,736	146,130.24	1,714,984,496	152,400	1,788,566,400	1.42
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,532	471,660.19	1,665,903,791	484,500	1,711,254,000	1.36
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	10,111	160,814.06	1,625,990,960	167,200	1,690,559,200	1.34
日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人	13,951	116,158.3	1,620,524,443	118,300	1,650,403,300	1.31
日本	投資証券	プレミアム投資法人	9,822	156,734.24	1,539,443,705	163,400	1,604,914,800	1.27
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,528	346,498.11	1,568,943,442	350,000	1,584,800,000	1.26

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.39
合計	97.39

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,476	円	3,193,503,000	3,275,982,000	2.60

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	67,296,084,585	73.73
	オーストラリア	5,948,439,316	6.52
	イギリス	4,645,592,205	5.09

	シンガポール	3,575,696,335	3.92
	フランス	3,170,445,208	3.47
	カナダ	1,767,188,062	1.94
	香港	1,683,884,720	1.84
	ベルギー	946,091,137	1.04
	スペイン	596,362,047	0.65
	ニュージーランド	368,862,839	0.40
	ドイツ	244,755,011	0.27
	オランダ	227,204,403	0.25
	ガーンジー	163,578,721	0.18
	アイルランド	117,335,119	0.13
	イスラエル	72,727,200	0.08
	マン島	27,824,007	0.03
	イタリア	25,996,816	0.03
	韓国	13,278,387	0.01
	小計	90,891,346,118	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		376,223,340	0.41
合計(純資産総額)		91,267,569,458	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		219,060,000	0.24
	売建		38,585,600	0.04

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	388,530	9,543.82	3,708,060,587	10,123.34	3,933,222,844	4.31
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	52,250	58,123.29	3,036,942,223	61,922.21	3,235,435,807	3.55
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	188,510	16,925.92	3,190,706,009	16,567.66	3,123,170,190	3.42
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	247,760	9,080.33	2,249,743,254	9,402.43	2,329,548,336	2.55

アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	91,770	23,155.50	2,124,980,786	23,239.86	2,132,722,613	2.34
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,620	22,991.16	1,968,503,633	23,617.84	2,022,160,249	2.22
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	213,740	9,200.84	1,966,589,422	9,381.62	2,005,228,057	2.20
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	127,790	12,771.40	1,632,058,382	13,278.67	1,696,881,495	1.86
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	195,300	8,361.61	1,633,024,230	8,511.71	1,662,338,213	1.82
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	228,590	6,523.20	1,491,138,837	6,432.26	1,470,352,051	1.61
香港	投資証券	LINK REIT	1,285,000	1,191.40	1,530,949,000	1,134.00	1,457,190,000	1.60
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	84,560	17,244.36	1,458,183,927	17,093.63	1,445,437,564	1.58
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	40,370	34,502.63	1,392,871,383	34,287.89	1,384,202,426	1.52
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	88,380	15,156.53	1,339,534,156	15,229.93	1,346,021,708	1.47
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	69,760	16,862.37	1,176,319,601	17,782.68	1,240,520,008	1.36
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,010	3,691.07	1,114,741,984	3,845.55	1,161,396,368	1.27
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	333,400	3,245.04	1,081,896,653	3,325.14	1,108,603,676	1.21
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	986,690	1,051.30	1,037,312,328	1,092.82	1,078,278,118	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,220	14,679.94	1,030,825,696	15,021.77	1,054,828,802	1.16
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	56,040	16,873.02	945,564,225	18,109.17	1,014,838,021	1.11
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	105,150	9,253.43	972,998,964	9,273.15	975,072,606	1.07
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,281,570	286.92	941,553,971	291.37	956,151,707	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	180,990	5,193.71	940,010,892	5,262.16	952,399,569	1.04
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	79,200	11,645.13	922,294,486	11,636.36	921,600,314	1.01
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,360	7,320.79	822,564,998	8,086.62	908,613,028	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	450,520	1,881.14	847,493,536	1,944.69	876,121,739	0.96
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	223,080	3,789.68	845,401,904	3,865.27	862,265,949	0.94
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	674,590	1,184.57	799,103,978	1,263.43	852,298,188	0.93
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	279,550	2,660.11	743,635,651	2,726.94	762,318,425	0.84
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	103,470	7,084.14	732,996,959	7,129.06	737,644,790	0.81

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.59
合計	99.59

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,000,000.00	218,740,000	219,060,000	0.24

	ユーロ	売建	320,000.00	38,526,400	38,585,600	0.04
--	-----	----	------------	------------	------------	------

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2017年8月25日
作成基準日：2019年11月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額	11,275円
純資産総額	0.34億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年11月	0円
2018年5月	0円
2018年11月	0円
2019年5月	0円
2019年11月	0円
設定後 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。

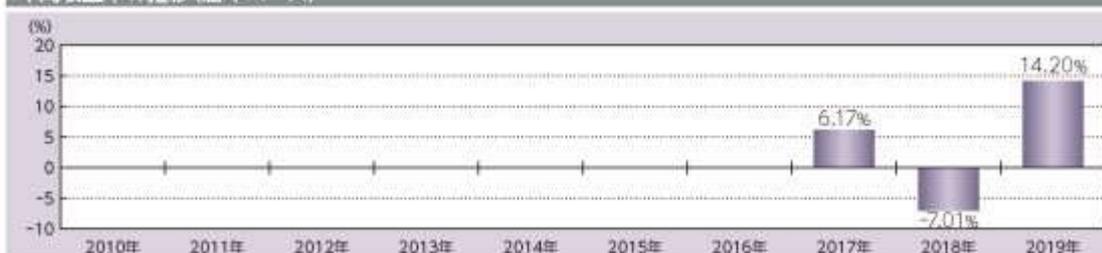
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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	実効投資比率
J-REITインデックスマザーファンド	13.4%	日本ビルファンド投資法人 アパホテルリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.9%
外国株式インデックスマザーファンド	13.0%	APPLE INC. MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	0.4%
グローバル801インデックスマザーファンド	12.7%	PROLOGIS INC. EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
外国債券インデックスマザーファンド	12.5%	T 2.625% 02/15/29 T 2.75% 05/31/23	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.1%
国内株式インデックスマザーファンド	12.5%	トヨタ自動車 ソニー	日本	株式	輸送用機器 電気機器	-	-	0.4%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.2%	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	ケイマン島 台湾	株式	小売 半導体・半導体製造装置	-	-	0.7%
新興国債券インデックスマザーファンド	12.0%	COLOM 9.85% 06/28/27 BNTNF 10% 01/01/23	コロンビア ブラジル	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
国内債券インデックスマザーファンド	10.8%	第138回利付国債(5年) 第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.2%
			日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.1%

※投資比率及び実効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（周年ベース）



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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと

引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<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。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<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。（2017年 8月25日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2017年11月10日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2019年5月11日から2019年11月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年 5月10日現在)	第5期 (2019年11月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	232,317	388,683
親投資信託受益証券	23,295,072	32,057,162
未収入金	-	362,973
流動資産合計	23,527,389	32,808,818
資産合計	23,527,389	32,808,818
負債の部		
流動負債		
未払解約金	395	379,536
未払受託者報酬	4,983	7,812
未払委託者報酬	44,793	70,226
その他未払費用	454	721
流動負債合計	50,625	458,295
負債合計	50,625	458,295
純資産の部		
元本等		
元本	22,420,915	28,946,438
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,055,849	3,404,085
(分配準備積立金)	462,609	1,988,308
元本等合計	23,476,764	32,350,523
純資産合計	23,476,764	32,350,523
負債純資産合計	23,527,389	32,808,818

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2018年11月13日	自	2019年5月11日
	至	2019年5月10日	至	2019年11月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		365,051		2,062,246
営業収益合計		365,051		2,062,246
営業費用				
支払利息		35		20
受託者報酬		4,983		7,812
委託者報酬		44,793		70,226
その他費用		454		721
営業費用合計		50,265		78,779
営業利益又は営業損失()		314,786		1,983,467
経常利益又は経常損失()		314,786		1,983,467
当期純利益又は当期純損失()		314,786		1,983,467
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()		43,929		167,302
期首剰余金又は期首欠損金()		475,091		1,055,849
剰余金増加額又は欠損金減少額		349,356		737,685
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		349,356		737,685
剰余金減少額又は欠損金増加額		39,455		205,614
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		39,455		205,614
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,055,849		3,404,085

(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5月11日から11月10日まで、及び11月11日から翌年5月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2019年 5月11日から2019年11月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2019年 5月10日現在)	第5期 (2019年11月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,420,915口	28,946,438口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0471円 (10,471円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1176円 (11,176円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日	第5期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>242,777円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>746,379円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>219,832円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,208,988円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>22,420,915口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>539円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	242,777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	746,379円	分配準備積立金額	D	219,832円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,208,988円	当ファンドの期末残存口数	F	22,420,915口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	539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	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>412,737円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,175,064円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,415,777円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>400,507円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,404,085円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>28,946,438口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,175円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	412,737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	1,175,064円	収益調整金額	C	1,415,777円	分配準備積立金額	D	400,507円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,404,085円	当ファンドの期末残存口数	F	28,946,438口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,175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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	242,777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	746,379円																																																											
分配準備積立金額	D	219,832円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,208,988円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	22,420,915口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	539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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	412,737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	1,175,064円																																																											
収益調整金額	C	1,415,777円																																																											
分配準備積立金額	D	400,507円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,404,085円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	28,946,438口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,175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5期 自 2019年 5月11日 至 2019年11月11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5期 (2019年11月11日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2018年11月13日 至 2019年 5月10日	自 2019年 5月11日 至 2019年11月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,730,817円	22,420,915円
期中追加設定元本額	9,998,798円	10,577,572円
期中一部解約元本額	1,308,700円	4,052,049円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2019年 5月10日現在)	(2019年11月11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	334,871	1,926,748
合計	334,871	1,926,748

（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	J-REITインデックス マザーファンド	2,007,905	4,284,467	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	2,039,066	4,035,311	
	新興国株式インデックス マザーファンド	1,388,661	3,992,678	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,576,884	4,086,422	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,515,161	4,149,268	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,478,881	3,522,489	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,433,772	4,029,902	
	新興国債券インデックス マザーファンド	2,258,348	3,956,625	
合計		15,698,678	32,057,162	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年11月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,658,632,976
株式	322,532,009,460
派生商品評価勘定	344,176,060
未収入金	917,096,102
未収配当金	3,030,853,637
差入委託証拠金	148,826,000
流動資産合計	330,631,594,235
資産合計	330,631,594,235
負債の部	
流動負債	

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	61,650
前受金	344,133,500
未払解約金	1,433,533,347
未払利息	8,155
流動負債合計	1,777,736,652
負債合計	1,777,736,652
純資産の部	
元本等	
元本	207,370,772,902
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	121,483,084,681
元本等合計	328,853,857,583
純資産合計	328,853,857,583
負債純資産合計	330,631,594,235

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年11月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2019年11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		207,370,772,902口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5858円 (15,858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11月11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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。	

	2019年11月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	189,478,719,904円
期中追加設定元本額	33,610,220,802円
期中一部解約元本額	15,718,167,804円
期末元本額	207,370,772,902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）	581,036,033円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,046,748,175円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,801,678円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,413,052,615円
世界経済インデックスファンド	2,082,991,291円
日本株式インデックス・オープン	5,201,429,275円
DCマイセレクション25	6,840,275,199円

区分	2019年11月11日現在
DCマイセレクション50	19,342,214,709円
DCマイセレクション75	17,497,379,291円
DC日本株式インデックス・オープン	5,672,982,821円
DCマイセレクションS25	2,757,949,563円
DCマイセレクションS50	7,851,950,682円
DCマイセレクションS75	5,066,937,423円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,538,801,257円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	389,828,338円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	704,775,986円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	465,036,858円
DC世界経済インデックスファンド	1,871,190,589円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,074,590,739円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,112,186円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,456,712円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,943,720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)	281,082,454円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,582,381円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,841,365円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	329,363,331円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	58,243,673円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	449,976,488円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,731,706,183円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	707,743,999円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,127,003,783円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	624,196,835円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	41,297,735円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	788,666,505円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	37,334,854円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	440,019,967円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	580,461,695円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,644,620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)	871,171,921円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,011,550,659円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,753,031,891円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,451,829,593円
分散投資コア戦略ファンドA	5,961,437,227円
分散投資コア戦略ファンドS	15,951,269,188円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	265,557,451円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	284,083,052円
コア投資戦略ファンド(切替型)	779,159,346円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	215,579,423円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,185,308円

区分	2019年11月11日現在
SMT インデックスバランス・オープン	73,115,905円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,681,864,531円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	636,138,955円
SMT 世界経済インデックス・オープン	16,275,802円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	61,671,423円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	9,204,938円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,576,884円
グローバル経済コア	292,970,046円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,783,508円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	42,325,603円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,834,519円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	353,247,293円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	30,403,574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)	48,986,507,228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)	614,714,490円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	5,961,456円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,119,885,640
合計	31,119,885,640

(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11月11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	5,845,686,500	-	6,189,820,000	344,133,500
	合計	5,845,686,500	-	6,189,820,000	344,133,500

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,400	2,996.00	19,174,400	
日本水産	182,000	640.00	116,480,000	
マルハニチロ	26,300	2,910.00	76,533,000	
カネコ種苗	5,500	1,508.00	8,294,000	
サカタのタネ	21,700	3,660.00	79,422,000	
ホクト	13,900	1,941.00	26,979,900	
ホクリヨウ	2,800	687.00	1,923,600	
住石ホールディングス	36,800	141.00	5,188,800	
日鉄鉱業	4,200	4,705.00	19,761,000	
三井松島ホールディングス	7,100	1,257.00	8,924,700	
国際石油開発帝石	730,100	1,063.50	776,461,350	
石油資源開発	23,800	2,937.00	69,900,600	
K&Oエナジーグループ	8,800	1,675.00	14,740,000	
ヒノキヤグループ	4,500	2,154.00	9,693,000	
ショーボンドホールディングス	26,000	4,355.00	113,230,000	
ミライト・ホールディングス	54,100	1,735.00	93,863,500	
タマホーム	8,800	1,967.00	17,309,600	
サンヨーホームズ	1,600	690.00	1,104,000	
日本アクア	7,200	688.00	4,953,600	
ファーストコーポレーション	5,600	691.00	3,869,600	
ベステラ	3,100	1,244.00	3,856,400	
T A T E R U	37,500	205.00	7,687,500	
スペースバリューホールディングス	22,200	531.00	11,788,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	929.00	3,251,500	
第一カッター興業	2,200	1,822.00	4,008,400	
安藤・間	108,400	886.00	96,042,400	
東急建設	53,300	818.00	43,599,400	
コムシスホールディングス	64,500	3,100.00	199,950,000	
ミサワホーム	12,500	1,223.00	15,287,500	
ピーアールホールディングス	19,800	460.00	9,108,000	

高松コンストラクショングループ	11,300	2,722.00	30,758,600
東建コーポレーション	5,600	7,310.00	40,936,000
ソネック	1,900	811.00	1,540,900
ヤマウラ	7,900	888.00	7,015,200
大成建設	140,100	4,240.00	594,024,000
大林組	420,300	1,126.00	473,257,800
清水建設	426,500	1,033.00	440,574,500
飛島建設	12,100	1,436.00	17,375,600
長谷工コーポレーション	162,700	1,458.00	237,216,600
松井建設	16,500	867.00	14,305,500
銭高組	1,800	4,230.00	7,614,000
鹿島建設	329,900	1,511.00	498,478,900
不動テトラ	11,000	1,583.00	17,413,000
大末建設	4,900	990.00	4,851,000
鉄建建設	9,100	2,964.00	26,972,400
西松建設	32,400	2,377.00	77,014,800
三井住友建設	101,500	625.00	63,437,500
大豊建設	9,400	3,135.00	29,469,000
前田建設工業	105,300	1,061.00	111,723,300
佐田建設	9,000	419.00	3,771,000
ナカノフドー建設	11,500	512.00	5,888,000
奥村組	22,800	3,170.00	72,276,000
東鉄工業	18,000	3,380.00	60,840,000
イチケン	3,000	1,817.00	5,451,000
富士ピー・エス	6,200	642.00	3,980,400
浅沼組	4,700	4,450.00	20,915,000
戸田建設	174,500	693.00	120,928,500
熊谷組	19,500	3,360.00	65,520,000
北野建設	2,600	2,985.00	7,761,000
植木組	1,900	2,652.00	5,038,800
矢作建設工業	18,600	835.00	15,531,000
ピーエス三菱	13,800	747.00	10,308,600
日本ハウスホールディングス	28,700	515.00	14,780,500
大東建託	50,300	14,085.00	708,475,500
新日本建設	17,900	911.00	16,306,900
N I P P O	34,800	2,275.00	79,170,000
東亜道路工業	2,600	3,380.00	8,788,000
前田道路	44,500	2,422.00	107,779,000
日本道路	4,100	6,690.00	27,429,000
東亜建設工業	13,100	1,586.00	20,776,600
日本国土開発	24,500	670.00	16,415,000
若築建設	7,600	1,691.00	12,851,600

東洋建設	47,100	525.00	24,727,500
五洋建設	166,600	671.00	111,788,600
世紀東急工業	20,200	809.00	16,341,800
福田組	4,900	4,920.00	24,108,000
住友林業	106,400	1,588.00	168,963,200
日本基礎技術	14,100	387.00	5,456,700
巴コーポレーション	18,700	431.00	8,059,700
大和ハウス工業	415,800	3,440.00	1,430,352,000
ライト工業	24,100	1,624.00	39,138,400
積水ハウス	459,800	2,315.50	1,064,666,900
日特建設	11,000	736.00	8,096,000
北陸電気工事	7,300	1,074.00	7,840,200
ユアテック	24,000	702.00	16,848,000
四電工	2,300	2,752.00	6,329,600
中電工	16,900	2,593.00	43,821,700
関電工	59,800	1,039.00	62,132,200
きんでん	99,800	1,662.00	165,867,600
東京エネシス	14,000	968.00	13,552,000
トーエネック	4,200	3,710.00	15,582,000
住友電設	11,900	2,406.00	28,631,400
日本電設工業	23,000	2,318.00	53,314,000
協和エクシオ	63,700	2,737.00	174,346,900
新日本空調	11,100	2,181.00	24,209,100
九電工	29,500	3,700.00	109,150,000
三機工業	30,300	1,401.00	42,450,300
日揮ホールディングス	129,400	1,621.00	209,757,400
中外炉工業	4,500	1,769.00	7,960,500
ヤマト	13,400	749.00	10,036,600
太平電業	10,200	2,373.00	24,204,600
高砂熱学工業	36,500	1,941.00	70,846,500
三晃金属工業	1,800	2,610.00	4,698,000
朝日工業社	2,800	3,345.00	9,366,000
明星工業	27,200	919.00	24,996,800
大気社	20,400	3,815.00	77,826,000
ダイダン	10,000	2,720.00	27,200,000
日比谷総合設備	13,500	1,997.00	26,959,500
東芝プラントシステム	32,500	2,103.00	68,347,500
OSJBホールディングス	66,300	265.00	17,569,500
東洋エンジニアリング	17,600	718.00	12,636,800
レイズネクスト	22,500	1,186.00	26,685,000
日本製粉	39,400	1,769.00	69,698,600
日清製粉グループ本社	152,000	2,118.00	321,936,000

日東富士製粉	1,000	6,390.00	6,390,000
昭和産業	12,300	3,055.00	37,576,500
鳥越製粉	11,900	946.00	11,257,400
中部飼料	16,400	1,333.00	21,861,200
フィード・ワン	90,300	167.00	15,080,100
東洋精糖	2,000	1,139.00	2,278,000
日本甜菜製糖	7,000	2,099.00	14,693,000
三井製糖	11,800	2,309.00	27,246,200
塩水港精糖	14,600	216.00	3,153,600
日新製糖	6,400	2,029.00	12,985,600
森永製菓	31,600	5,720.00	180,752,000
中村屋	3,500	4,680.00	16,380,000
江崎グリコ	39,900	5,090.00	203,091,000
名糖産業	6,500	1,316.00	8,554,000
井村屋グループ	5,700	2,110.00	12,027,000
不二家	7,500	2,142.00	16,065,000
山崎製パン	100,800	1,903.00	191,822,400
第一屋製パン	2,300	983.00	2,260,900
モロゾフ	2,300	5,040.00	11,592,000
亀田製菓	7,700	5,130.00	39,501,000
寿スピリッツ	12,900	7,330.00	94,557,000
カルビー	61,300	3,610.00	221,293,000
森永乳業	24,900	4,645.00	115,660,500
六甲バター	8,900	1,779.00	15,833,100
ヤクルト本社	92,500	6,250.00	578,125,000
明治ホールディングス	88,900	7,930.00	704,977,000
雪印メグミルク	32,400	2,856.00	92,534,400
プリマハム	21,000	2,575.00	54,075,000
日本ハム	51,400	4,900.00	251,860,000
林兼産業	4,400	667.00	2,934,800
丸大食品	14,300	2,460.00	35,178,000
S Foods	10,700	2,990.00	31,993,000
伊藤ハム米久ホールディングス	86,600	718.00	62,178,800
サッポロホールディングス	45,900	2,652.00	121,726,800
アサヒグループホールディングス	281,700	5,316.00	1,497,517,200
キリンホールディングス	570,400	2,547.00	1,452,808,800
宝ホールディングス	100,700	1,073.00	108,051,100
オエノンホールディングス	35,500	383.00	13,596,500
養命酒製造	4,100	2,001.00	8,204,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	94,400	2,673.00	252,331,200
サントリー食品インターナショナル	90,000	4,865.00	437,850,000
ダイドーグループホールディングス	6,900	4,490.00	30,981,000

伊藤園	40,800	5,340.00	217,872,000
キーコーヒー	13,200	2,434.00	32,128,800
ユニカフェ	3,500	1,051.00	3,678,500
ジャパンフーズ	1,900	1,230.00	2,337,000
日清オイリオグループ	17,300	4,035.00	69,805,500
不二製油グループ本社	32,800	3,335.00	109,388,000
かどや製油	1,500	3,905.00	5,857,500
J - オイルミルズ	7,000	4,480.00	31,360,000
キッコーマン	96,800	5,530.00	535,304,000
味の素	297,000	1,892.00	561,924,000
キューピー	74,900	2,501.00	187,324,900
ハウス食品グループ本社	50,300	3,970.00	199,691,000
カゴメ	51,000	2,715.00	138,465,000
焼津水産化学工業	6,500	1,058.00	6,877,000
アリアケジャパン	12,300	8,370.00	102,951,000
ピエトロ	1,800	1,634.00	2,941,200
エバラ食品工業	3,300	2,199.00	7,256,700
やまみ	600	2,072.00	1,243,200
ニチレイ	64,100	2,501.00	160,314,100
東洋水産	69,200	4,820.00	333,544,000
イトアンド	4,600	1,780.00	8,188,000
大冷	1,700	1,995.00	3,391,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,400	952.00	7,044,800
日清食品ホールディングス	57,200	8,420.00	481,624,000
永谷園ホールディングス	6,600	2,181.00	14,394,600
一正蒲鉾	5,200	1,093.00	5,683,600
フジッコ	14,600	2,038.00	29,754,800
ロック・フィールド	14,500	1,531.00	22,199,500
日本たばこ産業	776,700	2,463.00	1,913,012,100
ケンコーマヨネーズ	7,500	2,717.00	20,377,500
わらべや日洋ホールディングス	8,800	1,907.00	16,781,600
なとり	7,500	1,709.00	12,817,500
イフジ産業	2,300	757.00	1,741,100
ピククルスコーポレーション	2,900	2,694.00	7,812,600
北の達人コーポレーション	47,000	667.00	31,349,000
ユーグレナ	57,400	772.00	44,312,800
ミヨシ油脂	5,100	1,298.00	6,619,800
理研ビタミン	6,400	4,010.00	25,664,000
片倉工業	19,400	1,412.00	27,392,800
ゲンゼ	9,700	5,260.00	51,022,000
東洋紡	52,200	1,659.00	86,599,800
ユニチカ	39,800	377.00	15,004,600

富士紡ホールディングス	6,500	3,410.00	22,165,000
倉敷紡績	13,700	2,572.00	35,236,400
シキボウ	6,900	945.00	6,520,500
日本毛織	43,600	1,094.00	47,698,400
トーア紡コーポレーション	5,200	543.00	2,823,600
帝国繊維	15,000	2,066.00	30,990,000
帝人	107,300	2,142.00	229,836,600
東レ	951,000	788.60	749,958,600
サカイオーベックス	3,700	1,858.00	6,874,600
住江織物	3,800	2,953.00	11,221,400
日本フェルト	8,400	499.00	4,191,600
イチカワ	2,200	1,577.00	3,469,400
日東製網	1,500	1,633.00	2,449,500
アツギ	11,000	800.00	8,800,000
ダイニック	5,000	792.00	3,960,000
セーレン	32,600	1,526.00	49,747,600
ソトー	5,400	988.00	5,335,200
東海染工	1,900	1,140.00	2,166,000
小松マテーレ	21,700	848.00	18,401,600
ワコールホールディングス	34,300	2,927.00	100,396,100
ホギメディカル	15,000	3,660.00	54,900,000
レナウン	33,700	113.00	3,808,100
クラウディアホールディングス	3,500	488.00	1,708,000
T S Iホールディングス	44,200	596.00	26,343,200
マツオカコーポレーション	3,800	1,994.00	7,577,200
ワールド	18,700	2,910.00	54,417,000
三陽商会	6,900	1,528.00	10,543,200
ナイガイ	5,100	463.00	2,361,300
オンワードホールディングス	79,100	640.00	50,624,000
ルックホールディングス	4,600	1,148.00	5,280,800
ゴールドウイン	23,800	7,680.00	182,784,000
デサント	25,700	1,500.00	38,550,000
キング	6,400	575.00	3,680,000
ヤマトインターナショナル	8,300	397.00	3,295,100
特種東海製紙	8,300	4,200.00	34,860,000
王子ホールディングス	548,700	634.00	347,875,800
日本製紙	58,000	1,969.00	114,202,000
三菱製紙	14,900	513.00	7,643,700
北越コーポレーション	87,100	587.00	51,127,700
中越パルプ工業	5,600	1,688.00	9,452,800
巴川製紙所	3,900	968.00	3,775,200
大王製紙	57,600	1,495.00	86,112,000

阿波製紙	3,400	422.00	1,434,800
レンゴー	124,100	806.00	100,024,600
トーモク	8,000	1,882.00	15,056,000
ザ・パック	9,900	3,795.00	37,570,500
クラレ	206,700	1,388.00	286,899,600
旭化成	875,400	1,272.50	1,113,946,500
共和レザー	7,100	811.00	5,758,100
昭和電工	93,400	3,170.00	296,078,000
住友化学	964,300	520.00	501,436,000
住友精化	5,800	3,660.00	21,228,000
日産化学	73,400	4,975.00	365,165,000
ラサ工業	4,600	1,538.00	7,074,800
クレハ	11,300	7,080.00	80,004,000
多木化学	3,800	4,590.00	17,442,000
テイカ	9,600	2,075.00	19,920,000
石原産業	23,500	1,191.00	27,988,500
片倉コープアグリ	3,400	1,209.00	4,110,600
日本曹達	19,400	3,055.00	59,267,000
東ソー	202,900	1,665.00	337,828,500
トクヤマ	37,800	3,080.00	116,424,000
セントラル硝子	26,800	2,741.00	73,458,800
東亜合成	82,400	1,252.00	103,164,800
大阪ソーダ	13,300	3,115.00	41,429,500
関東電化工業	31,100	969.00	30,135,900
デンカ	47,900	3,445.00	165,015,500
信越化学工業	231,300	12,020.00	2,780,226,000
日本カーバイド工業	4,400	1,540.00	6,776,000
堺化学工業	8,500	2,596.00	22,066,000
第一稀元素化学工業	14,200	870.00	12,354,000
エア・ウォーター	107,500	2,015.00	216,612,500
大陽日酸	126,100	2,595.00	327,229,500
日本化学工業	4,100	3,410.00	13,981,000
東邦アセチレン	2,000	1,415.00	2,830,000
日本パーカライズニング	66,200	1,281.00	84,802,200
高压ガス工業	20,800	897.00	18,657,600
チタン工業	1,600	2,584.00	4,134,400
四国化成工業	20,200	1,297.00	26,199,400
戸田工業	3,000	2,304.00	6,912,000
ステラ ケミファ	7,100	3,270.00	23,217,000
保土谷化学工業	4,900	3,965.00	19,428,500
日本触媒	20,400	6,970.00	142,188,000
大日精化工業	11,600	3,335.00	38,686,000

カネカ	34,000	3,920.00	133,280,000
三菱瓦斯化学	123,900	1,681.00	208,275,900
三井化学	119,200	2,801.00	333,879,200
J S R	122,300	2,063.00	252,304,900
東京応化工業	22,500	4,180.00	94,050,000
大阪有機化学工業	12,100	1,272.00	15,391,200
三菱ケミカルホールディングス	877,400	877.10	769,567,540
K Hネオケム	23,100	2,554.00	58,997,400
ダイセル	179,500	1,134.00	203,553,000
住友ベークライト	20,600	4,615.00	95,069,000
積水化学工業	282,200	1,888.00	532,793,600
日本ゼオン	118,400	1,371.00	162,326,400
アイカ工業	39,400	3,470.00	136,718,000
宇部興産	66,300	2,418.00	160,313,400
積水樹脂	23,600	2,266.00	53,477,600
タキロンシーアイ	28,400	689.00	19,567,600
旭有機材	7,400	1,701.00	12,587,400
日立化成	60,700	3,390.00	205,773,000
ニチバン	6,900	1,950.00	13,455,000
リケンテクノス	33,000	546.00	18,018,000
大倉工業	6,200	2,095.00	12,989,000
積水化成品工業	17,600	857.00	15,083,200
群栄化学工業	3,000	2,582.00	7,746,000
タイガースポリマー	6,900	607.00	4,188,300
ミライアル	4,600	1,407.00	6,472,200
ダイキアクシス	4,600	951.00	4,374,600
ダイキョーニシカワ	27,700	910.00	25,207,000
竹本容器	4,700	1,011.00	4,751,700
森六ホールディングス	7,100	2,540.00	18,034,000
日本化薬	81,200	1,424.00	115,628,800
カーリットホールディングス	14,000	641.00	8,974,000
日本精化	10,600	1,305.00	13,833,000
扶桑化学工業	13,300	3,125.00	41,562,500
トリケミカル研究所	2,900	7,810.00	22,649,000
A D E K A	60,400	1,650.00	99,660,000
日油	49,400	3,815.00	188,461,000
新日本理化	21,700	208.00	4,513,600
ハリマ化成グループ	10,900	1,301.00	14,180,900
花王	320,900	8,612.00	2,763,590,800
第一工業製薬	4,900	3,880.00	19,012,000
石原ケミカル	3,600	1,785.00	6,426,000
日華化学	4,400	916.00	4,030,400

ニイタカ	2,000	1,725.00	3,450,000
三洋化成工業	7,800	5,410.00	42,198,000
有機合成薬品工業	10,100	279.00	2,817,900
大日本塗料	14,800	1,158.00	17,138,400
日本ペイントホールディングス	108,300	6,030.00	653,049,000
関西ペイント	147,500	2,657.00	391,907,500
神東塗料	10,300	195.00	2,008,500
中国塗料	37,400	1,098.00	41,065,200
日本特殊塗料	9,800	1,411.00	13,827,800
藤倉化成	17,700	584.00	10,336,800
太陽ホールディングス	9,600	4,310.00	41,376,000
D I C	55,400	3,255.00	180,327,000
サカタインクス	28,700	1,267.00	36,362,900
東洋インキS Cホールディングス	27,700	2,765.00	76,590,500
T & K T O K A	10,200	1,055.00	10,761,000
富士フィルムホールディングス	257,000	4,819.00	1,238,483,000
資生堂	266,300	8,046.00	2,142,649,800
ライオン	174,200	2,133.00	371,568,600
高砂香料工業	8,400	2,729.00	22,923,600
マンダム	30,100	3,000.00	90,300,000
ミルボン	17,900	5,720.00	102,388,000
ファンケル	54,200	2,923.00	158,426,600
コーセー	25,200	17,560.00	442,512,000
コタ	7,000	1,392.00	9,744,000
シーボン	1,600	2,523.00	4,036,800
ポーラ・オルビスホールディングス	57,200	2,590.00	148,148,000
ノエビアホールディングス	12,800	6,050.00	77,440,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	947.00	2,841,000
エステー	8,600	1,684.00	14,482,400
アグロ カネショウ	4,200	1,596.00	6,703,200
コニシ	22,000	1,519.00	33,418,000
長谷川香料	17,800	2,010.00	35,778,000
星光P M C	7,700	876.00	6,745,200
小林製薬	37,600	8,890.00	334,264,000
荒川化学工業	12,000	1,637.00	19,644,000
メック	9,200	1,807.00	16,624,400
日本高純度化学	3,700	2,605.00	9,638,500
タカラバイオ	35,100	2,238.00	78,553,800
J C U	16,200	2,759.00	44,695,800
新田ゼラチン	8,400	733.00	6,157,200
O A T アグリオ	2,300	1,757.00	4,041,100
デクセリアルズ	34,600	1,016.00	35,153,600

アース製薬	10,100	5,880.00	59,388,000
北興化学工業	13,700	644.00	8,822,800
大成ラミック	4,400	2,969.00	13,063,600
クミアイ化学工業	55,400	1,051.00	58,225,400
日本農薬	23,900	605.00	14,459,500
アキレス	9,200	1,897.00	17,452,400
有沢製作所	21,200	1,062.00	22,514,400
日東電工	92,500	6,150.00	568,875,000
レック	14,300	1,376.00	19,676,800
三光合成	15,300	426.00	6,517,800
きもと	22,800	180.00	4,104,000
藤森工業	12,000	3,670.00	44,040,000
前澤化成工業	8,500	1,220.00	10,370,000
未来工業	7,200	2,236.00	16,099,200
ウェーブロックホールディングス	4,600	813.00	3,739,800
J S P	7,800	1,977.00	15,420,600
エフピコ	14,700	6,710.00	98,637,000
天馬	8,900	2,049.00	18,236,100
信越ポリマー	24,100	977.00	23,545,700
東リ	33,400	305.00	10,187,000
ニフコ	49,200	3,025.00	148,830,000
バルカー	10,900	2,436.00	26,552,400
ユニ・チャーム	258,300	3,411.00	881,061,300
ショーエイコーポレーション	1,500	739.00	1,108,500
協和キリン	134,800	2,041.00	275,126,800
武田薬品工業	1,115,000	4,319.00	4,815,685,000
アステラス製薬	1,178,900	1,813.50	2,137,935,150
大日本住友製薬	99,300	1,878.00	186,485,400
塩野義製薬	171,400	6,314.00	1,082,219,600
田辺三菱製薬	163,500	1,349.00	220,561,500
わかもと製薬	15,900	280.00	4,452,000
あすか製薬	15,300	1,163.00	17,793,900
日本新薬	35,100	9,370.00	328,887,000
バイオフェルミン製薬	2,300	2,249.00	5,172,700
中外製薬	139,700	9,244.00	1,291,386,800
科研製薬	22,900	5,930.00	135,797,000
エーザイ	160,400	7,471.00	1,198,348,400
ロート製薬	68,800	3,300.00	227,040,000
小野薬品工業	316,500	2,239.00	708,643,500
久光製薬	39,600	5,080.00	201,168,000
持田製薬	18,600	4,345.00	80,817,000
参天製薬	249,600	2,056.00	513,177,600

扶桑薬品工業	4,700	2,145.00	10,081,500	
日本ケミファ	1,800	2,961.00	5,329,800	
ツムラ	41,500	3,220.00	133,630,000	
日医工	38,000	1,276.00	48,488,000	
キッセイ薬品工業	23,700	2,932.00	69,488,400	
生化学工業	26,000	1,285.00	33,410,000	
栄研化学	23,600	1,874.00	44,226,400	
日水製薬	5,600	1,280.00	7,168,000	
鳥居薬品	8,400	2,781.00	23,360,400	
JCRファーマ	9,400	8,380.00	78,772,000	
東和薬品	17,100	2,769.00	47,349,900	
富士製薬工業	9,100	1,328.00	12,084,800	
沢井製薬	27,500	6,060.00	166,650,000	
ゼリア新薬工業	24,300	2,139.00	51,977,700	
第一三共	383,500	6,699.00	2,569,066,500	
キョーリン製薬ホールディングス	29,600	1,819.00	53,842,400	
大幸薬品	5,400	2,830.00	15,282,000	
ダイト	7,800	3,200.00	24,960,000	
大塚ホールディングス	255,300	4,493.00	1,147,062,900	
大正製薬ホールディングス	28,300	7,710.00	218,193,000	
ペプチドリーム	67,800	5,290.00	358,662,000	
日本コークス工業	113,200	84.00	9,508,800	
ニチレキ	15,800	1,309.00	20,682,200	
ユシロ化学工業	7,500	1,458.00	10,935,000	
ビーピー・カストロール	4,800	1,530.00	7,344,000	
富士石油	35,800	248.00	8,878,400	
MORESCO	4,800	1,358.00	6,518,400	
出光興産	150,800	3,220.00	485,576,000	
JXTGホールディングス	2,078,500	514.80	1,070,011,800	
コスモエネルギーホールディングス	38,800	2,342.00	90,869,600	
横浜ゴム	77,600	2,488.00	193,068,800	
TOYO TIRE	76,900	1,616.00	124,270,400	
ブリヂストン	411,900	4,607.00	1,897,623,300	
住友ゴム工業	120,400	1,431.00	172,292,400	
藤倉コンポジット	11,700	499.00	5,838,300	
オカモト	8,200	4,425.00	36,285,000	
フコク	5,900	734.00	4,330,600	
ニッタ	15,100	3,255.00	49,150,500	
住友理工	26,000	1,007.00	26,182,000	
三ツ星ベルト	17,600	2,186.00	38,473,600	
バンドー化学	23,600	987.00	23,293,200	
日東紡績	20,000	3,805.00	76,100,000	

A G C	132,500	4,070.00	539,275,000
日本板硝子	64,100	657.00	42,113,700
石塚硝子	2,500	2,211.00	5,527,500
日本山村硝子	5,600	1,249.00	6,994,400
日本電気硝子	53,800	2,506.00	134,822,800
オハラ	5,300	1,480.00	7,844,000
住友大阪セメント	25,400	4,950.00	125,730,000
太平洋セメント	84,700	3,220.00	272,734,000
日本ヒューム	13,500	825.00	11,137,500
日本コンクリート工業	29,000	329.00	9,541,000
三谷セキサン	6,200	3,815.00	23,653,000
アジアパイルホールディングス	19,100	558.00	10,657,800
東海カーボン	140,400	1,070.00	150,228,000
日本カーボン	6,900	4,195.00	28,945,500
東洋炭素	7,900	2,442.00	19,291,800
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	4,710.00	34,854,000
T O T O	95,700	4,630.00	443,091,000
日本碍子	163,600	1,871.00	306,095,600
日本特殊陶業	104,300	2,251.00	234,779,300
M A R U W A	5,200	7,720.00	40,144,000
品川リフラクトリーズ	3,500	3,270.00	11,445,000
黒崎播磨	2,700	6,090.00	16,443,000
ヨータイ	10,700	734.00	7,853,800
イソライト工業	6,900	654.00	4,512,600
東京窯業	17,200	330.00	5,676,000
ニッカトー	6,100	783.00	4,776,300
フジミインコーポレーテッド	12,000	2,923.00	35,076,000
クニミネ工業	5,400	1,255.00	6,777,000
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,246.00	2,865,800
ニチアス	36,700	2,487.00	91,272,900
ニチハ	18,600	3,030.00	56,358,000
日本製鉄	593,200	1,622.50	962,467,000
神戸製鋼所	242,700	592.00	143,678,400
中山製鋼所	18,500	499.00	9,231,500
合同製鐵	7,200	2,676.00	19,267,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	358,000	1,402.00	501,916,000
東京製鐵	64,600	875.00	56,525,000
共英製鋼	15,000	2,223.00	33,345,000
大和工業	28,200	2,823.00	79,608,600
東京鐵鋼	5,500	1,609.00	8,849,500
大阪製鐵	7,100	1,476.00	10,479,600
淀川製鋼所	17,900	2,187.00	39,147,300

丸一鋼管	43,000	3,065.00	131,795,000
モリ工業	4,000	2,387.00	9,548,000
大同特殊鋼	21,700	5,140.00	111,538,000
日本高周波鋼業	5,000	451.00	2,255,000
日本冶金工業	11,000	2,481.00	27,291,000
山陽特殊製鋼	9,600	1,539.00	14,774,400
愛知製鋼	7,500	3,665.00	27,487,500
日立金属	142,800	1,430.00	204,204,000
日本金属	3,100	1,007.00	3,121,700
大平洋金属	9,000	2,532.00	22,788,000
新日本電工	85,700	182.00	15,597,400
栗本鐵工所	6,700	1,978.00	13,252,600
虹技	2,000	1,444.00	2,888,000
三菱製鋼	9,900	1,194.00	11,820,600
日亜鋼業	19,600	352.00	6,899,200
日本精線	2,200	2,800.00	6,160,000
エンビプロ・ホールディングス	5,100	674.00	3,437,400
シンニッタン	20,700	442.00	9,149,400
新家工業	3,100	1,615.00	5,006,500
大紀アルミニウム工業所	22,000	774.00	17,028,000
日本軽金属ホールディングス	335,900	233.00	78,264,700
三井金属鉱業	35,800	3,175.00	113,665,000
東邦亜鉛	6,800	2,095.00	14,246,000
三菱マテリアル	87,600	3,140.00	275,064,000
住友金属鉱山	169,400	3,529.00	597,812,600
D O W Aホールディングス	33,600	4,005.00	134,568,000
古河機械金属	23,600	1,568.00	37,004,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	1,687.00	23,449,300
東邦チタニウム	23,900	925.00	22,107,500
U A C J	20,200	2,497.00	50,439,400
C Kサンエツ	2,500	2,976.00	7,440,000
古河電気工業	41,200	3,125.00	128,750,000
住友電気工業	495,600	1,573.00	779,578,800
フジクラ	160,300	488.00	78,226,400
昭和電線ホールディングス	15,400	1,055.00	16,247,000
東京特殊電線	2,000	2,172.00	4,344,000
タツタ電線	26,500	581.00	15,396,500
カナレ電気	2,300	1,888.00	4,342,400
平河ヒューテック	5,100	1,261.00	6,431,100
リョービ	16,400	2,220.00	36,408,000
アーレスティ	17,600	569.00	10,014,400
アサヒホールディングス	23,300	2,541.00	59,205,300

稲葉製作所	7,500	1,466.00	10,995,000
宮地エンジニアリンググループ	4,000	2,240.00	8,960,000
トーカロ	36,800	1,095.00	40,296,000
アルファC o	4,700	1,333.00	6,265,100
SUMCO	158,600	1,762.00	279,453,200
川田テクノロジーズ	2,700	7,180.00	19,386,000
RS Technologies	3,700	4,270.00	15,799,000
信和	5,700	1,052.00	5,996,400
東洋製罐グループホールディングス	84,400	1,965.00	165,846,000
ホッカンホールディングス	7,300	1,808.00	13,198,400
コロナ	7,300	1,180.00	8,614,000
横河ブリッジホールディングス	24,600	1,928.00	47,428,800
駒井ハルテック	2,500	1,777.00	4,442,500
高田機工	1,200	2,636.00	3,163,200
三和ホールディングス	127,100	1,254.00	159,383,400
文化シャッター	39,100	982.00	38,396,200
三協立山	18,400	1,219.00	22,429,600
アルインコ	9,600	1,213.00	11,644,800
東洋シャッター	3,200	759.00	2,428,800
LIXILグループ	195,500	2,055.00	401,752,500
日本フィルコン	10,100	553.00	5,585,300
ノーリツ	27,500	1,410.00	38,775,000
長府製作所	13,500	2,416.00	32,616,000
リンナイ	25,800	8,670.00	223,686,000
ダイニチ工業	7,100	696.00	4,941,600
日東精工	18,300	603.00	11,034,900
三洋工業	1,800	2,053.00	3,695,400
岡部	26,900	921.00	24,774,900
ジーテクト	16,500	1,861.00	30,706,500
東プレ	24,700	1,934.00	47,769,800
高周波熱錬	25,500	930.00	23,715,000
東京製綱	9,500	1,166.00	11,077,000
サンコール	7,400	504.00	3,729,600
モリテック スチール	10,300	427.00	4,398,100
パイオラックス	19,600	2,226.00	43,629,600
エイチワン	13,000	747.00	9,711,000
日本発條	142,200	970.00	137,934,000
中央発條	1,600	2,974.00	4,758,400
アドバネクス	1,900	1,741.00	3,307,900
立川ブラインド工業	5,800	1,451.00	8,415,800
三益半導体工業	11,800	2,053.00	24,225,400
日本ドライケミカル	3,400	1,323.00	4,498,200

日本製鋼所	40,300	2,329.00	93,858,700
三浦工業	57,400	3,625.00	208,075,000
タクマ	45,000	1,317.00	59,265,000
ツガミ	27,600	1,040.00	28,704,000
オークマ	15,500	6,460.00	100,130,000
東芝機械	15,000	2,504.00	37,560,000
アマダホールディングス	168,600	1,296.00	218,505,600
アイダエンジニアリング	35,900	950.00	34,105,000
滝澤鉄工所	4,200	1,373.00	5,766,600
F U J I	57,100	1,924.00	109,860,400
牧野フライス製作所	15,600	5,450.00	85,020,000
オーエスジー	61,300	2,356.00	144,422,800
ダイジェット工業	1,600	1,523.00	2,436,800
旭ダイヤモンド工業	34,900	666.00	23,243,400
D M G 森精機	83,900	1,782.00	149,509,800
ソディック	31,300	966.00	30,235,800
ディスコ	17,900	23,300.00	417,070,000
日東工器	7,300	2,352.00	17,169,600
日進工具	4,000	2,294.00	9,176,000
パンチ工業	12,300	548.00	6,740,400
富士ダイス	6,100	668.00	4,074,800
豊和工業	7,500	755.00	5,662,500
O K K	5,600	745.00	4,172,000
東洋機械金属	9,800	588.00	5,762,400
津田駒工業	2,600	1,294.00	3,364,400
エンシュウ	3,300	1,309.00	4,319,700
島精機製作所	21,400	2,843.00	60,840,200
オプトラン	14,800	3,245.00	48,026,000
N C ホールディングス	4,300	495.00	2,128,500
イワキポンプ	6,500	1,079.00	7,013,500
フリー	13,100	980.00	12,838,000
ヤマシンフィルタ	29,000	1,004.00	29,116,000
日阪製作所	16,500	976.00	16,104,000
やまびこ	25,800	1,276.00	32,920,800
平田機工	6,300	7,560.00	47,628,000
ペガサスミシン製造	13,800	525.00	7,245,000
マルマエ	5,600	1,007.00	5,639,200
タツモ	6,300	1,315.00	8,284,500
ナプテスコ	78,100	3,375.00	263,587,500
三井海洋開発	14,100	2,642.00	37,252,200
レオン自動機	13,100	1,827.00	23,933,700
S M C	42,100	49,390.00	2,079,319,000

ヤマハモーターロボティクスホールディングス	11,800	558.00	6,584,400
ホソカワミクロン	4,700	4,210.00	19,787,000
ユニオンツール	5,000	3,375.00	16,875,000
オイレス工業	17,200	1,755.00	30,186,000
日精エー・エス・ビー機械	4,500	3,945.00	17,752,500
サトーホールディングス	18,900	3,305.00	62,464,500
技研製作所	11,700	3,970.00	46,449,000
日本エアーテック	4,400	703.00	3,093,200
カワタ	4,000	1,209.00	4,836,000
日精樹脂工業	11,200	1,041.00	11,659,200
オカダアイヨン	4,300	1,323.00	5,688,900
ワイエイシイホールディングス	5,700	865.00	4,930,500
小松製作所	607,100	2,664.50	1,617,617,950
住友重機械工業	76,700	3,345.00	256,561,500
日立建機	53,700	2,858.00	153,474,600
日工	18,500	682.00	12,617,000
巴工業	5,800	2,337.00	13,554,600
井関農機	13,500	1,711.00	23,098,500
TOWA	13,700	1,095.00	15,001,500
丸山製作所	3,000	1,266.00	3,798,000
北川鉄工所	6,100	2,244.00	13,688,400
ローツェ	5,900	3,665.00	21,623,500
タカキタ	4,900	569.00	2,788,100
クボタ	711,100	1,715.50	1,219,892,050
荏原実業	3,400	2,143.00	7,286,200
三菱化工機	4,700	1,990.00	9,353,000
月島機械	24,700	1,754.00	43,323,800
帝国電機製作所	11,200	1,385.00	15,512,000
新東工業	31,900	1,056.00	33,686,400
澁谷工業	11,800	2,804.00	33,087,200
アイチ コーポレーション	23,300	686.00	15,983,800
小森コーポレーション	34,100	1,203.00	41,022,300
鶴見製作所	10,500	2,024.00	21,252,000
住友精密工業	2,000	3,455.00	6,910,000
日本ギア工業	4,400	421.00	1,852,400
酒井重工業	2,500	3,305.00	8,262,500
荏原製作所	59,500	3,265.00	194,267,500
石井鐵工所	1,800	2,502.00	4,503,600
西島製作所	13,600	1,042.00	14,171,200
北越工業	13,900	1,285.00	17,861,500
ダイキン工業	170,800	15,290.00	2,611,532,000
オルガノ	4,800	6,380.00	30,624,000

トーヨーカネツ	5,900	2,063.00	12,171,700
栗田工業	72,600	3,230.00	234,498,000
椿本チエイン	19,100	3,905.00	74,585,500
大同工業	6,500	863.00	5,609,500
木村化工機	11,400	438.00	4,993,200
アネスト岩田	21,000	1,065.00	22,365,000
ダイフク	68,500	6,000.00	411,000,000
サムコ	3,800	1,098.00	4,172,400
加藤製作所	7,400	1,959.00	14,496,600
油研工業	2,300	1,692.00	3,891,600
タダノ	64,800	1,050.00	68,040,000
フジテック	48,800	1,673.00	81,642,400
C K D	37,400	1,593.00	59,578,200
キトー	10,200	1,767.00	18,023,400
平和	37,500	2,265.00	84,937,500
理想科学工業	11,900	1,830.00	21,777,000
S A N K Y O	29,900	3,770.00	112,723,000
日本金銭機械	15,000	919.00	13,785,000
マースグループホールディングス	8,600	2,052.00	17,647,200
福島工業	8,300	3,590.00	29,797,000
オーイズミ	5,900	549.00	3,239,100
ダイコク電機	6,300	1,558.00	9,815,400
竹内製作所	22,500	1,777.00	39,982,500
アマノ	35,100	3,185.00	111,793,500
J U K I	18,600	983.00	18,283,800
蛇の目マシン工業	12,600	417.00	5,254,200
マックス	20,500	2,025.00	41,512,500
グローリー	37,200	3,375.00	125,550,000
新晃工業	12,500	2,019.00	25,237,500
大和冷機工業	19,500	1,262.00	24,609,000
セガサミーホールディングス	133,000	1,646.00	218,918,000
日本ピストンリング	5,000	1,429.00	7,145,000
リケン	6,200	4,320.00	26,784,000
T P R	18,100	2,035.00	36,833,500
ツバキ・ナカシマ	27,400	1,995.00	54,663,000
ホシザキ	39,200	9,750.00	382,200,000
大豊工業	11,100	885.00	9,823,500
日本精工	252,500	1,101.00	278,002,500
N T N	310,700	361.00	112,162,700
ジェイテクト	128,700	1,464.00	188,416,800
不二越	12,500	5,360.00	67,000,000
日本トムソン	40,100	494.00	19,809,400

THK	78,000	3,175.00	247,650,000
ユーシン精機	10,500	1,045.00	10,972,500
前澤給装工業	4,900	2,123.00	10,402,700
イーグル工業	16,700	1,129.00	18,854,300
前澤工業	9,300	401.00	3,729,300
日本ピラー工業	13,700	1,482.00	20,303,400
キッツ	54,500	768.00	41,856,000
マキタ	174,800	3,720.00	650,256,000
日立造船	106,500	415.00	44,197,500
三菱重工業	224,600	4,386.00	985,095,600
IHI	96,600	2,588.00	250,000,800
スター精密	21,100	1,672.00	35,279,200
日清紡ホールディングス	89,500	951.00	85,114,500
イビデン	82,300	2,446.00	201,305,800
コニカミノルタ	293,700	720.00	211,464,000
ブラザー工業	164,000	2,222.00	364,408,000
ミネベアミツミ	249,100	2,164.00	539,052,400
日立製作所	644,000	4,281.00	2,756,964,000
三菱電機	1,340,200	1,568.00	2,101,433,600
富士電機	80,800	3,515.00	284,012,000
東洋電機製造	5,400	1,584.00	8,553,600
安川電機	144,300	4,195.00	605,338,500
シンフォニアテクノロジー	17,500	1,413.00	24,727,500
明電舎	24,700	2,133.00	52,685,100
オリジン	3,700	1,552.00	5,742,400
山洋電気	6,600	5,250.00	34,650,000
デンヨー	11,500	2,000.00	23,000,000
東芝テック	16,800	4,195.00	70,476,000
芝浦メカトロニクス	2,500	4,100.00	10,250,000
マブチモーター	37,200	4,620.00	171,864,000
日本電産	161,300	16,335.00	2,634,835,500
トレックス・セミコンダクター	8,100	1,434.00	11,615,400
東光高岳	8,000	1,203.00	9,624,000
ダイヘン	14,700	3,740.00	54,978,000
ヤーマン	20,400	699.00	14,259,600
JVCケンウッド	111,600	281.00	31,359,600
ミマキエンジニアリング	13,200	551.00	7,273,200
第一精工	5,100	3,160.00	16,116,000
日新電機	31,500	1,245.00	39,217,500
大崎電気工業	26,900	751.00	20,201,900
オムロン	124,700	6,540.00	815,538,000
日東工業	19,700	2,292.00	45,152,400

I D E C	19,400	2,289.00	44,406,600
正興電機製作所	3,900	831.00	3,240,900
不二電機工業	1,900	1,248.00	2,371,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	45,000	2,228.00	100,260,000
サクサホールディングス	3,200	1,937.00	6,198,400
メルコホールディングス	4,800	3,020.00	14,496,000
テクノメディカ	3,300	2,134.00	7,042,200
日本電気	162,600	4,395.00	714,627,000
富士通	129,200	9,422.00	1,217,322,400
沖電気工業	54,500	1,642.00	89,489,000
岩崎通信機	5,900	823.00	4,855,700
電気興業	6,500	3,240.00	21,060,000
サンケン電気	14,700	3,070.00	45,129,000
ナカヨ	2,700	1,713.00	4,625,100
アイホン	7,700	1,896.00	14,599,200
ルネサスエレクトロニクス	639,900	700.00	447,930,000
セイコーエプソン	166,400	1,564.00	260,249,600
ワコム	91,600	455.00	41,678,000
アルバック	26,700	4,810.00	128,427,000
アクセル	6,600	646.00	4,263,600
E I Z O	10,400	4,235.00	44,044,000
日本信号	34,200	1,309.00	44,767,800
京三製作所	31,700	519.00	16,452,300
能美防災	18,000	2,301.00	41,418,000
ホーチキ	10,200	1,492.00	15,218,400
星和電機	7,800	582.00	4,539,600
エレコム	14,700	3,905.00	57,403,500
パナソニック	1,531,300	1,020.00	1,561,926,000
シャープ	155,200	1,622.00	251,734,400
アンリツ	86,300	2,147.00	185,286,100
富士通ゼネラル	36,500	1,999.00	72,963,500
ソニー	847,000	6,683.00	5,660,501,000
T D K	64,800	11,280.00	730,944,000
帝国通信工業	6,500	1,212.00	7,878,000
タムラ製作所	45,000	637.00	28,665,000
アルプスアルパイン	118,900	2,379.00	282,863,100
池上通信機	4,200	1,080.00	4,536,000
鈴木	8,000	797.00	6,376,000
日本トリム	1,900	5,220.00	9,918,000
ローランド ディー . ジー .	7,700	2,189.00	16,855,300
フォスター電機	14,100	2,062.00	29,074,200
S M K	3,500	3,060.00	10,710,000

ヨコオ	8,900	3,140.00	27,946,000
ホシデン	37,200	1,259.00	46,834,800
ヒロセ電機	20,800	13,860.00	288,288,000
日本航空電子工業	30,800	2,150.00	66,220,000
TOA	14,500	1,152.00	16,704,000
マクセルホールディングス	29,300	1,514.00	44,360,200
古野電気	17,800	1,208.00	21,502,400
ユニデンホールディングス	3,800	1,987.00	7,550,600
スミダコーポレーション	10,800	1,221.00	13,186,800
アイコム	7,500	2,523.00	18,922,500
リオン	5,900	2,590.00	15,281,000
本多通信工業	12,700	505.00	6,413,500
横河電機	123,000	1,975.00	242,925,000
新電元工業	4,800	3,850.00	18,480,000
アズビル	84,600	3,160.00	267,336,000
東亜ディーケーケー	7,400	920.00	6,808,000
日本光電工業	55,600	3,015.00	167,634,000
チノー	4,700	1,489.00	6,998,300
共和電業	14,400	423.00	6,091,200
日本電子材料	5,500	733.00	4,031,500
堀場製作所	26,600	7,580.00	201,628,000
アドバンテスト	99,700	5,430.00	541,371,000
小野測器	6,800	525.00	3,570,000
エスペック	12,200	2,019.00	24,631,800
キーエンス	60,700	73,760.00	4,477,232,000
日置電機	7,200	3,775.00	27,180,000
シスメックス	95,800	7,775.00	744,845,000
日本マイクロニクス	24,000	1,044.00	25,056,000
メガチップス	12,700	2,273.00	28,867,100
OBARA GROUP	7,100	4,060.00	28,826,000
澤藤電機	2,000	1,806.00	3,612,000
原田工業	7,100	900.00	6,390,000
コーセル	16,900	1,249.00	21,108,100
イリソ電子工業	11,400	5,420.00	61,788,000
オブテックスグループ	22,400	1,632.00	36,556,800
千代田インテグレ	6,500	2,374.00	15,431,000
アイ・オー・データ機器	5,600	942.00	5,275,200
レーザーテック	27,500	7,920.00	217,800,000
スタンレー電気	94,800	3,125.00	296,250,000
岩崎電気	5,700	1,473.00	8,396,100
ウシオ電機	78,200	1,645.00	128,639,000
岡谷電機産業	10,900	402.00	4,381,800

ヘリオス テクノ ホールディング	13,500	501.00	6,763,500	
エノモト	4,500	1,136.00	5,112,000	
日本セラミック	13,800	2,815.00	38,847,000	
遠藤照明	7,700	700.00	5,390,000	
古河電池	10,500	768.00	8,064,000	
双信電機	7,900	464.00	3,665,600	
山一電機	10,100	1,606.00	16,220,600	
図研	9,000	2,294.00	20,646,000	
日本電子	26,600	3,020.00	80,332,000	
カシオ計算機	118,600	1,973.00	233,997,800	
ファナック	127,300	21,250.00	2,705,125,000	
日本シイエムケイ	32,400	700.00	22,680,000	
エンプラス	7,000	3,580.00	25,060,000	
大真空	5,500	1,172.00	6,446,000	
ローム	59,600	8,560.00	510,176,000	
浜松ホトニクス	96,300	4,410.00	424,683,000	
三井ハイテック	15,100	1,973.00	29,792,300	
新光電気工業	45,600	1,069.00	48,746,400	
京セラ	188,600	7,180.00	1,354,148,000	
太陽誘電	59,800	2,939.00	175,752,200	
村田製作所	393,800	6,145.00	2,419,901,000	
双葉電子工業	21,600	1,398.00	30,196,800	
北陸電気工業	6,000	1,180.00	7,080,000	
ニチコン	46,000	1,140.00	52,440,000	
日本ケミコン	10,200	1,970.00	20,094,000	
K O A	20,700	1,455.00	30,118,500	
市光工業	20,800	842.00	17,513,600	
小糸製作所	80,400	5,930.00	476,772,000	
ミツバ	25,600	752.00	19,251,200	
S C R E E Nホールディングス	23,300	7,400.00	172,420,000	
キャノン電子	14,400	2,007.00	28,900,800	
キャノン	721,500	3,007.00	2,169,550,500	
リコー	341,100	1,075.00	366,682,500	
象印マホービン	39,700	1,745.00	69,276,500	
M U T O Hホールディングス	2,200	1,837.00	4,041,400	
東京エレクトロン	89,400	21,865.00	1,954,731,000	
トヨタ紡織	39,100	1,710.00	66,861,000	
芦森工業	2,800	1,442.00	4,037,600	
ユニプレス	26,000	1,688.00	43,888,000	
豊田自動織機	108,500	6,600.00	716,100,000	
モリタホールディングス	23,500	1,875.00	44,062,500	
三櫻工業	17,000	1,385.00	23,545,000	

デンソー	295,100	5,122.00	1,511,502,200
東海理化電機製作所	35,300	2,169.00	76,565,700
三井E & Sホールディングス	48,400	902.00	43,656,800
川崎重工業	104,300	2,599.00	271,075,700
名村造船所	43,100	294.00	12,671,400
日本車輛製造	4,900	2,947.00	14,440,300
三菱ロジスネクスト	17,700	1,029.00	18,213,300
近畿車輛	2,000	1,475.00	2,950,000
日産自動車	1,580,500	707.40	1,118,045,700
いすゞ自動車	388,300	1,260.00	489,258,000
トヨタ自動車	1,493,400	7,929.00	11,841,168,600
日野自動車	167,400	1,056.00	176,774,400
三菱自動車工業	496,100	509.00	252,514,900
エフテック	9,400	747.00	7,021,800
レシップホールディングス	5,200	675.00	3,510,000
G M B	2,500	827.00	2,067,500
ファルテック	2,400	811.00	1,946,400
武蔵精密工業	29,900	1,575.00	47,092,500
日産車体	26,200	1,047.00	27,431,400
新明和工業	36,100	1,399.00	50,503,900
極東開発工業	24,900	1,554.00	38,694,600
日信工業	27,300	2,232.00	60,933,600
トピー工業	11,100	2,207.00	24,497,700
ティラド	4,900	2,115.00	10,363,500
曙ブレーキ工業	73,600	228.00	16,780,800
タチエス	22,100	1,504.00	33,238,400
N O K	72,100	1,752.00	126,319,200
フタバ産業	37,400	857.00	32,051,800
K Y B	15,000	3,655.00	54,825,000
大同メタル工業	25,800	729.00	18,808,200
プレス工業	66,600	494.00	32,900,400
ミクニ	17,200	351.00	6,037,200
太平洋工業	28,100	1,581.00	44,426,100
ケーヒン	30,800	2,583.00	79,556,400
河西工業	18,200	931.00	16,944,200
アイシン精機	110,400	4,370.00	482,448,000
マツダ	394,300	1,003.00	395,482,900
今仙電機製作所	12,500	994.00	12,425,000
本田技研工業	1,055,200	3,201.00	3,377,695,200
スズキ	265,600	5,015.00	1,331,984,000
S U B A R U	416,100	3,014.00	1,254,125,400
安永	6,500	1,380.00	8,970,000

ヤマハ発動機	174,800	2,177.00	380,539,600
ショーワ	31,700	2,285.00	72,434,500
T B K	16,100	468.00	7,534,800
エクセディ	18,200	2,520.00	45,864,000
豊田合成	43,300	2,621.00	113,489,300
愛三工業	21,100	961.00	20,277,100
盟和産業	2,100	1,166.00	2,448,600
日本プラスト	10,600	733.00	7,769,800
ヨロズ	12,600	1,462.00	18,421,200
エフ・シー・シー	21,900	2,446.00	53,567,400
シマノ	50,200	17,720.00	889,544,000
テイ・エス テック	31,100	3,460.00	107,606,000
ジャムコ	6,800	1,468.00	9,982,400
テルモ	379,200	3,863.00	1,464,849,600
クリエートメディック	4,500	1,069.00	4,810,500
日機装	40,200	1,196.00	48,079,200
日本エム・ディ・エム	7,700	2,034.00	15,661,800
島津製作所	160,200	3,200.00	512,640,000
J M S	11,400	682.00	7,774,800
長野計器	9,800	772.00	7,565,600
ブイ・テクノロジー	6,300	6,250.00	39,375,000
東京計器	8,600	997.00	8,574,200
愛知時計電機	1,800	4,320.00	7,776,000
インターアクション	7,200	2,185.00	15,732,000
オーバル	12,200	257.00	3,135,400
東京精密	24,300	3,740.00	90,882,000
マニー	53,400	2,957.00	157,903,800
ニコン	216,900	1,522.00	330,121,800
トプコン	67,500	1,519.00	102,532,500
オリンパス	741,600	1,718.00	1,274,068,800
理研計器	11,800	2,215.00	26,137,000
タムロン	10,800	2,476.00	26,740,800
H O Y A	269,800	9,361.00	2,525,597,800
シード	5,700	929.00	5,295,300
ノーリツ鋼機	9,100	1,712.00	15,579,200
エー・アンド・デイ	12,300	811.00	9,975,300
朝日インテック	113,700	3,115.00	354,175,500
シチズン時計	157,000	605.00	94,985,000
リズム時計工業	4,200	922.00	3,872,400
大研医器	9,400	538.00	5,057,200
メニコン	18,400	3,955.00	72,772,000
シンシア	1,500	660.00	990,000

松風	6,100	1,718.00	10,479,800
セイコーホールディングス	19,000	2,725.00	51,775,000
ニプロ	92,800	1,265.00	117,392,000
中本パックス	3,400	1,518.00	5,161,200
スノーピーク	6,100	1,038.00	6,331,800
パラマウントベッドホールディングス	14,100	4,200.00	59,220,000
トランザクション	8,600	969.00	8,333,400
SHO - B I	3,900	396.00	1,544,400
ニホンフラッシュ	6,300	2,508.00	15,800,400
前田工織	14,800	1,840.00	27,232,000
永大産業	17,500	356.00	6,230,000
アートネイチャー	14,300	759.00	10,853,700
バンダイナムコホールディングス	138,600	6,549.00	907,691,400
アイフィスジャパン	3,400	753.00	2,560,200
共立印刷	22,400	165.00	3,696,000
SHOEI	6,400	4,845.00	31,008,000
フランスベッドホールディングス	18,900	1,030.00	19,467,000
パイロットコーポレーション	23,400	4,370.00	102,258,000
萩原工業	7,400	1,572.00	11,632,800
トッパン・フォームズ	28,700	1,088.00	31,225,600
フジシールインターナショナル	30,000	2,533.00	75,990,000
タカラトミー	60,100	1,207.00	72,540,700
廣済堂	9,300	729.00	6,779,700
エステールホールディングス	3,600	664.00	2,390,400
アーク	51,100	94.00	4,803,400
タカノ	5,200	830.00	4,316,000
プロネクサス	11,500	1,238.00	14,237,000
ホクシン	8,300	169.00	1,402,700
ウッドワン	4,500	1,194.00	5,373,000
大建工業	9,000	1,993.00	17,937,000
凸版印刷	189,200	2,063.00	390,319,600
大日本印刷	175,400	2,948.00	517,079,200
共同印刷	4,100	2,917.00	11,959,700
N I S S H A	27,500	1,213.00	33,357,500
光村印刷	1,200	1,774.00	2,128,800
宝印刷	6,500	1,779.00	11,563,500
アシックス	110,600	1,664.00	184,038,400
ツツミ	4,200	2,108.00	8,853,600
小松ウオール工業	4,100	2,337.00	9,581,700
ヤマハ	79,700	5,890.00	469,433,000
河合楽器製作所	4,100	3,410.00	13,981,000
クリナップ	12,500	677.00	8,462,500

ピジョン	81,000	5,160.00	417,960,000
兼松サステック	900	1,761.00	1,584,900
キングジム	11,100	886.00	9,834,600
リンテック	31,900	2,350.00	74,965,000
イトーキ	28,500	520.00	14,820,000
任天堂	82,200	41,960.00	3,449,112,000
三菱鉛筆	22,100	1,761.00	38,918,100
タカラスタンダード	27,700	1,948.00	53,959,600
コクヨ	64,300	1,623.00	104,358,900
ナカバヤシ	13,200	605.00	7,986,000
グロープライド	6,000	2,763.00	16,578,000
オカムラ	46,800	1,085.00	50,778,000
美津濃	12,200	2,962.00	36,136,400
東京電力ホールディングス	1,069,800	510.00	545,598,000
中部電力	410,000	1,576.50	646,365,000
関西電力	507,800	1,254.50	637,035,100
中国電力	185,300	1,479.00	274,058,700
北陸電力	122,500	821.00	100,572,500
東北電力	334,800	1,135.00	379,998,000
四国電力	120,700	1,140.00	137,598,000
九州電力	276,200	986.00	272,333,200
北海道電力	125,400	556.00	69,722,400
沖縄電力	24,800	1,960.00	48,608,000
電源開発	106,600	2,621.00	279,398,600
エフオン	6,300	706.00	4,447,800
イーレックス	19,000	1,624.00	30,856,000
レノバ	22,100	1,116.00	24,663,600
東京瓦斯	257,700	2,615.00	673,885,500
大阪瓦斯	260,100	2,125.00	552,712,500
東邦瓦斯	66,400	4,360.00	289,504,000
北海道瓦斯	7,200	1,620.00	11,664,000
広島ガス	27,600	366.00	10,101,600
西部瓦斯	15,100	2,558.00	38,625,800
静岡ガス	38,000	907.00	34,466,000
メタウォーター	6,500	4,015.00	26,097,500
SBSホールディングス	11,600	1,850.00	21,460,000
東武鉄道	141,300	3,945.00	557,428,500
相鉄ホールディングス	42,900	3,030.00	129,987,000
東急	338,000	2,152.00	727,376,000
京浜急行電鉄	172,100	2,229.00	383,610,900
小田急電鉄	199,300	2,748.00	547,676,400
京王電鉄	69,500	6,910.00	480,245,000

京成電鉄	93,300	4,575.00	426,847,500	
富士急行	18,300	4,300.00	78,690,000	
新京成電鉄	3,400	2,265.00	7,701,000	
東日本旅客鉄道	235,900	10,120.00	2,387,308,000	
西日本旅客鉄道	119,400	9,704.00	1,158,657,600	
東海旅客鉄道	111,400	22,555.00	2,512,627,000	
西武ホールディングス	179,800	1,849.00	332,450,200	
鴻池運輸	21,300	1,681.00	35,805,300	
西日本鉄道	37,100	2,480.00	92,008,000	
ハマキョウレックス	10,300	3,620.00	37,286,000	
サカイ引越センター	7,000	6,490.00	45,430,000	
近鉄グループホールディングス	126,900	6,100.00	774,090,000	
阪急阪神ホールディングス	169,300	4,590.00	777,087,000	
南海電気鉄道	60,200	2,963.00	178,372,600	
京阪ホールディングス	56,500	5,430.00	306,795,000	
神戸電鉄	3,000	3,965.00	11,895,000	
名古屋鉄道	104,300	3,585.00	373,915,500	
山陽電気鉄道	9,100	2,270.00	20,657,000	
日本通運	44,900	6,720.00	301,728,000	
ヤマトホールディングス	222,500	1,802.00	400,945,000	
山九	35,300	5,970.00	210,741,000	
丸運	7,200	275.00	1,980,000	
丸全昭和運輸	10,300	3,160.00	32,548,000	
センコーグループホールディングス	70,000	891.00	62,370,000	
トナミホールディングス	3,000	5,110.00	15,330,000	
ニッコンホールディングス	45,400	2,725.00	123,715,000	
日本石油輸送	1,400	2,864.00	4,009,600	
福山通運	16,200	4,030.00	65,286,000	
セイノーホールディングス	95,100	1,530.00	145,503,000	
エスライン	3,800	987.00	3,750,600	
神奈川中央交通	3,100	3,940.00	12,214,000	
日立物流	23,300	3,185.00	74,210,500	
丸和運輸機関	13,400	2,359.00	31,610,600	
C & F ロジホールディングス	12,800	1,442.00	18,457,600	
九州旅客鉄道	113,200	3,775.00	427,330,000	
S Gホールディングス	133,200	2,665.00	354,978,000	
日本郵船	106,600	1,998.00	212,986,800	
商船三井	80,600	3,030.00	244,218,000	
川崎汽船	39,100	1,765.00	69,011,500	
N S ユナイテッド海運	7,400	2,320.00	17,168,000	
飯野海運	62,600	369.00	23,099,400	
共栄タンカー	1,700	1,481.00	2,517,700	

乾汽船	7,300	1,195.00	8,723,500
日本航空	232,400	3,371.00	783,420,400
A N Aホールディングス	232,000	3,759.00	872,088,000
パスコ	2,500	1,159.00	2,897,500
トランコム	3,500	7,170.00	25,095,000
日新	11,000	1,784.00	19,624,000
三菱倉庫	40,300	2,878.00	115,983,400
三井倉庫ホールディングス	14,500	1,977.00	28,666,500
住友倉庫	46,700	1,527.00	71,310,900
澁澤倉庫	7,000	2,190.00	15,330,000
東陽倉庫	22,900	340.00	7,786,000
日本トランスシティ	27,900	558.00	15,568,200
ケイヒン	2,400	1,375.00	3,300,000
中央倉庫	7,700	1,269.00	9,771,300
川西倉庫	2,300	1,190.00	2,737,000
安田倉庫	10,400	1,019.00	10,597,600
ファイズホールディングス	2,700	660.00	1,782,000
東洋埠頭	3,900	1,445.00	5,635,500
宇徳	10,800	524.00	5,659,200
上組	72,700	2,656.00	193,091,200
サンリツ	3,000	698.00	2,094,000
キムラユニティー	3,400	1,114.00	3,787,600
キューソー流通システム	3,200	1,996.00	6,387,200
近鉄エクスプレス	27,000	1,882.00	50,814,000
東海運	7,200	290.00	2,088,000
エーアイティー	9,000	951.00	8,559,000
内外トランスライン	4,500	1,491.00	6,709,500
日本コンセプト	4,000	1,478.00	5,912,000
N E C ネットエスアイ	12,500	3,365.00	42,062,500
クロスキャット	3,700	1,022.00	3,781,400
システナ	47,100	1,520.00	71,592,000
デジタルアーツ	6,500	5,990.00	38,935,000
日鉄ソリューションズ	19,800	3,645.00	72,171,000
キューブシステム	7,300	797.00	5,818,100
エイジア	2,600	1,310.00	3,406,000
コア	5,700	1,416.00	8,071,200
ソリトンシステムズ	6,000	1,049.00	6,294,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,900	1,816.00	10,714,400
T I S	43,900	6,050.00	265,595,000
ネオス	5,300	843.00	4,467,900
電算システム	5,100	2,930.00	14,943,000
グリー	91,200	536.00	48,883,200

コーエーテックモホールディングス	27,000	2,529.00	68,283,000
三菱総合研究所	5,700	3,740.00	21,318,000
電算	1,600	2,179.00	3,486,400
A G S	7,800	770.00	6,006,000
ファインデックス	11,400	952.00	10,852,800
ブレインパッド	2,600	5,690.00	14,794,000
K L a b	25,400	903.00	22,936,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,100	1,051.00	16,921,100
イーブুকイニシアティブジャパン	2,000	1,864.00	3,728,000
ネクソン	374,300	1,434.00	536,746,200
アイスタイル	34,300	963.00	33,030,900
エムアップ	3,900	1,935.00	7,546,500
エイチーム	9,300	1,068.00	9,932,400
エニグモ	9,600	963.00	9,244,800
テクノスジャパン	10,800	487.00	5,259,600
コロプラ	43,300	1,223.00	52,955,900
ブロードリーフ	65,600	617.00	40,475,200
クロス・マーケティンググループ	6,500	376.00	2,444,000
デジタルハーツホールディングス	7,300	904.00	6,599,200
システム情報	6,900	1,012.00	6,982,800
メディアドゥホールディングス	4,200	3,475.00	14,595,000
じげん	33,000	606.00	19,998,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	757.00	1,892,500
サイバーリンクス	2,200	1,167.00	2,567,400
フィックスターズ	14,200	1,500.00	21,300,000
C A R T A H O L D I N G S	6,600	1,230.00	8,118,000
オブティム	3,500	2,695.00	9,432,500
セレス	4,500	1,163.00	5,233,500
ティーガイア	11,800	2,654.00	31,317,200
セック	2,000	3,240.00	6,480,000
日本アジアグループ	13,900	382.00	5,309,800
豆蔵ホールディングス	9,100	1,517.00	13,804,700
テクマトリックス	9,400	2,183.00	20,520,200
プロシップ	4,000	1,319.00	5,276,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,800	2,389.00	75,970,200
G M O ペイメントゲートウェイ	21,700	7,820.00	169,694,000
ザッパラス	7,500	391.00	2,932,500
システムリサーチ	3,600	1,901.00	6,843,600
インターネットイニシアティブ	19,600	2,526.00	49,509,600
さくらインターネット	14,500	637.00	9,236,500
ヴィンクス	3,900	1,130.00	4,407,000
G M O クラウド	2,500	2,853.00	7,132,500

S R Aホールディングス	7,100	2,561.00	18,183,100
M i n o r iソリューションズ	2,700	2,696.00	7,279,200
システムインテグレータ	4,500	766.00	3,447,000
朝日ネット	9,700	644.00	6,246,800
e B A S E	8,100	1,171.00	9,485,100
アバント	4,800	2,103.00	10,094,400
アドソル日進	4,800	2,104.00	10,099,200
フリービット	8,100	880.00	7,128,000
コムチュア	14,900	2,055.00	30,619,500
サイバーコム	2,500	2,069.00	5,172,500
アステリア	8,400	636.00	5,342,400
アイル	4,900	1,266.00	6,203,400
マークラインズ	6,700	2,198.00	14,726,600
メディカル・データ・ビジョン	10,200	1,170.00	11,934,000
ショーケース	3,500	726.00	2,541,000
モバイルファクトリー	3,100	1,446.00	4,482,600
テラスカイ	4,800	2,237.00	10,737,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,000	1,737.00	10,422,000
P C Iホールディングス	2,800	2,173.00	6,084,400
パイプドHD	1,900	1,819.00	3,456,100
アイビーシー	2,600	1,074.00	2,792,400
ネオジャパン	2,700	995.00	2,686,500
P R T I M E S	1,200	2,480.00	2,976,000
ランドコンピュータ	2,200	1,133.00	2,492,600
ダブルスタンダード	1,700	5,210.00	8,857,000
オープンドア	6,600	1,653.00	10,909,800
マイネット	4,200	535.00	2,247,000
アカツキ	4,700	6,100.00	28,670,000
ベネフィットジャパン	1,100	1,750.00	1,925,000
U b i c o mホールディングス	3,100	1,262.00	3,912,200
L I N E	30,100	4,350.00	130,935,000
カナミックネットワーク	8,500	641.00	5,448,500
ノムラシステムコーポレーション	3,300	544.00	1,795,200
チェンジ	2,700	2,122.00	5,729,400
シンクロ・フード	6,100	517.00	3,153,700
オークネット	8,300	1,516.00	12,582,800
セグエグループ	1,300	1,399.00	1,818,700
エイトレッド	1,800	1,466.00	2,638,800
A O I T Y O H o l d i n g s	13,700	672.00	9,206,400
マクロミル	23,700	1,001.00	23,723,700
ビーグリー	2,800	994.00	2,783,200
オロ	3,500	2,839.00	9,936,500

テモナ	2,300	516.00	1,186,800
ニーズウェル	2,000	693.00	1,386,000
サインポスト	2,200	1,848.00	4,065,600
ソルクシーズ	5,900	923.00	5,445,700
フェイス	5,000	810.00	4,050,000
プロトコーポレーション	12,000	1,322.00	15,864,000
ハイマックス	1,700	1,980.00	3,366,000
野村総合研究所	219,900	2,313.00	508,628,700
サイバネットシステム	9,700	736.00	7,139,200
C Eホールディングス	8,100	445.00	3,604,500
日本システム技術	2,300	1,245.00	2,863,500
インテージホールディングス	16,700	993.00	16,583,100
東邦システムサイエンス	3,700	948.00	3,507,600
ソースネクスト	62,900	507.00	31,890,300
インフォコム	14,500	2,269.00	32,900,500
ラクスル	7,000	3,600.00	25,200,000
F I G	15,100	323.00	4,877,300
システムサポート	1,300	1,382.00	1,796,600
アルテリア・ネットワークス	14,700	1,505.00	22,123,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,600.00	4,960,000
フォーカスシステムズ	8,400	880.00	7,392,000
クレスコ	4,100	3,530.00	14,473,000
フジ・メディア・ホールディングス	126,900	1,494.00	189,588,600
オービック	45,600	13,900.00	633,840,000
ジャストシステム	21,400	5,210.00	111,494,000
T D Cソフト	11,800	858.00	10,124,400
Zホールディングス	1,806,600	375.00	677,475,000
トレンドマイクロ	58,500	5,630.00	329,355,000
I Dホールディングス	5,200	1,450.00	7,540,000
日本オラクル	26,700	9,510.00	253,917,000
アルファシステムズ	4,200	2,884.00	12,112,800
フューチャー	16,000	1,773.00	28,368,000
C A C Holdings	8,700	1,394.00	12,127,800
S Bテクノロジー	4,800	1,948.00	9,350,400
トーセ	3,900	863.00	3,365,700
オービックビジネスコンサルタント	13,500	4,450.00	60,075,000
伊藤忠テクノソリューションズ	60,000	2,865.00	171,900,000
アイティフォー	16,200	887.00	14,369,400
東計電算	2,000	3,395.00	6,790,000
エクスネット	2,300	982.00	2,258,600
大塚商会	71,200	4,175.00	297,260,000
サイボウズ	15,600	1,099.00	17,144,400

ソフトブレン	8,200	551.00	4,518,200
電通国際情報サービス	8,200	3,790.00	31,078,000
デジタルガレージ	23,700	3,595.00	85,201,500
E Mシステムズ	9,300	2,147.00	19,967,100
ウェザーニューズ	4,500	3,455.00	15,547,500
C I J	10,100	920.00	9,292,000
ビジネスエンジニアリング	1,600	2,999.00	4,798,400
日本エンタープライズ	14,600	229.00	3,343,400
WOWOW	6,400	2,777.00	17,772,800
スカラ	9,600	868.00	8,332,800
インテリジェント ウェイブ	5,300	745.00	3,948,500
I M A G I C A G R O U P	11,600	618.00	7,168,800
ネットワンシステムズ	50,200	2,916.00	146,383,200
システムソフト	33,500	112.00	3,752,000
アルゴグラフィックス	11,300	3,095.00	34,973,500
マーベラス	20,400	789.00	16,095,600
エイベックス	22,800	1,395.00	31,806,000
日本ユニシス	41,100	3,460.00	142,206,000
兼松エレクトロニクス	7,200	3,410.00	24,552,000
東京放送ホールディングス	80,100	1,746.00	139,854,600
日本テレビホールディングス	110,000	1,479.00	162,690,000
朝日放送グループホールディングス	13,400	777.00	10,411,800
テレビ朝日ホールディングス	36,300	1,782.00	64,686,600
スカパーJ S A Tホールディングス	87,100	465.00	40,501,500
テレビ東京ホールディングス	10,900	2,324.00	25,331,600
日本BS放送	4,700	1,085.00	5,099,500
ビジョン	12,400	1,727.00	21,414,800
スマートバリュー	4,200	780.00	3,276,000
ワイヤレスゲート	6,600	740.00	4,884,000
コネクシオ	7,600	1,522.00	11,567,200
クロップス	2,800	720.00	2,016,000
日本電信電話	879,000	5,522.00	4,853,838,000
K D D I	980,100	3,200.00	3,136,320,000
ソフトバンク	1,195,300	1,493.00	1,784,582,900
光通信	13,600	24,930.00	339,048,000
N T T ドコモ	971,500	3,052.00	2,965,018,000
エムティーアイ	13,100	730.00	9,563,000
G M O インターネット	52,000	1,987.00	103,324,000
ファイバーゲート	2,700	1,369.00	3,696,300
アйдママーケティングコミュニケーション	4,300	798.00	3,431,400
K A D O K A W A	35,600	1,507.00	53,649,200
学研ホールディングス	4,500	5,710.00	25,695,000

ゼンリン	26,400	1,982.00	52,324,800
昭文社	6,700	450.00	3,015,000
インプレスホールディングス	10,900	156.00	1,700,400
アイネット	7,000	1,345.00	9,415,000
松竹	8,700	15,830.00	137,721,000
東宝	78,700	4,440.00	349,428,000
東映	4,900	15,080.00	73,892,000
エヌ・ティ・ティ・データ	350,300	1,459.00	511,087,700
ピー・シー・エー	1,800	3,630.00	6,534,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,451.00	5,882,400
D T S	29,500	2,263.00	66,758,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56,100	4,885.00	274,048,500
シーイーシー	14,200	1,992.00	28,286,400
カプコン	62,100	2,528.00	156,988,800
アイ・エス・ビー	2,700	1,822.00	4,919,400
ジャステック	8,600	1,131.00	9,726,600
S C S K	30,400	5,750.00	174,800,000
日本システムウエア	4,400	2,495.00	10,978,000
アイネス	13,100	1,263.00	16,545,300
T K C	11,200	4,650.00	52,080,000
富士ソフト	16,900	4,325.00	73,092,500
N S D	21,700	3,405.00	73,888,500
コナミホールディングス	47,800	4,635.00	221,553,000
福井コンピュータホールディングス	5,300	3,340.00	17,702,000
J B C Cホールディングス	9,000	1,680.00	15,120,000
ミロク情報サービス	11,700	2,923.00	34,199,100
ソフトバンクグループ	1,043,500	4,300.00	4,487,050,000
ハウスイ	1,100	864.00	950,400
高千穂交易	5,100	1,124.00	5,732,400
伊藤忠食品	3,300	5,260.00	17,358,000
エレマテック	12,400	1,101.00	13,652,400
J A L U X	3,700	2,569.00	9,505,300
あらた	10,500	4,185.00	43,942,500
トーメンデバイス	2,000	2,667.00	5,334,000
東京エレクトロン デバイス	4,800	2,131.00	10,228,800
フィールズ	10,100	480.00	4,848,000
双日	729,000	349.00	254,421,000
アルフレッサ ホールディングス	146,700	2,471.00	362,495,700
横浜冷凍	37,000	1,074.00	39,738,000
ラサ商事	7,000	891.00	6,237,000
ラクーンホールディングス	6,400	677.00	4,332,800
アルコニックス	14,000	1,435.00	20,090,000

神戸物産	45,500	3,100.00	141,050,000
あい ホールディングス	18,900	1,992.00	37,648,800
ディーブイエックス	4,700	970.00	4,559,000
ダイワボウホールディングス	11,200	5,190.00	58,128,000
マクニカ・富士エレホールディングス	31,500	1,805.00	56,857,500
ラクト・ジャパン	4,900	3,570.00	17,493,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,900	1,091.00	27,165,900
八洲電機	10,200	914.00	9,322,800
メディアスホールディングス	7,500	849.00	6,367,500
レスターホールディングス	13,800	1,981.00	27,337,800
ジューテックホールディングス	3,000	1,098.00	3,294,000
大光	5,600	740.00	4,144,000
O C H Iホールディングス	3,800	1,371.00	5,209,800
T O K A Iホールディングス	69,800	1,094.00	76,361,200
黒谷	3,100	458.00	1,419,800
C o m i n i x	2,300	818.00	1,881,400
三洋貿易	6,700	2,358.00	15,798,600
ビューティガレージ	2,100	1,651.00	3,467,100
ウイン・パートナーズ	9,500	1,485.00	14,107,500
ミタチ産業	4,000	770.00	3,080,000
シップヘルスケアホールディングス	21,200	4,725.00	100,170,000
明治電機工業	4,200	1,556.00	6,535,200
デリカフーズホールディングス	4,700	684.00	3,214,800
スターティアホールディングス	3,000	657.00	1,971,000
コメダホールディングス	28,700	2,063.00	59,208,100
アセンテック	1,100	1,821.00	2,003,100
富士興産	4,100	732.00	3,001,200
協栄産業	1,500	1,532.00	2,298,000
小野建	11,800	1,391.00	16,413,800
南陽	2,900	1,765.00	5,118,500
佐島電機	9,700	937.00	9,088,900
エコートレーディング	3,100	541.00	1,677,100
伯東	8,100	1,367.00	11,072,700
コンドーテック	10,200	1,091.00	11,128,200
中山福	7,600	564.00	4,286,400
ナガイレーベン	19,100	2,554.00	48,781,400
三菱食品	14,500	2,833.00	41,078,500
松田産業	9,600	1,663.00	15,964,800
第一興商	19,700	5,430.00	106,971,000
メディバルホールディングス	142,500	2,486.00	354,255,000
S P K	2,800	2,794.00	7,823,200
萩原電気ホールディングス	4,900	2,920.00	14,308,000

アズワン	8,600	9,260.00	79,636,000
スズデン	4,600	1,439.00	6,619,400
尾家産業	3,900	1,339.00	5,222,100
シモジマ	8,100	1,267.00	10,262,700
ドウシシャ	12,500	1,776.00	22,200,000
小津産業	2,900	1,845.00	5,350,500
高速	7,900	1,320.00	10,428,000
たけびし	4,600	1,457.00	6,702,200
リックス	3,000	1,641.00	4,923,000
丸文	11,700	614.00	7,183,800
ハピネット	11,000	1,410.00	15,510,000
橋本総業ホールディングス	2,700	1,748.00	4,719,600
日本ライフライン	39,100	1,538.00	60,135,800
タカショー	6,500	486.00	3,159,000
エクセル	3,800	1,252.00	4,757,600
マルカ	4,700	2,390.00	11,233,000
I D O M	35,700	468.00	16,707,600
進和	7,800	2,505.00	19,539,000
エスケイジャパン	2,900	451.00	1,307,900
ダイトロン	5,600	1,524.00	8,534,400
シークス	16,800	1,628.00	27,350,400
田中商事	4,100	724.00	2,968,400
オーハシテクニカ	7,500	1,499.00	11,242,500
白銅	4,700	1,436.00	6,749,200
伊藤忠商事	923,200	2,370.50	2,188,445,600
丸紅	1,373,900	806.10	1,107,500,790
高島	2,100	1,734.00	3,641,400
長瀬産業	74,200	1,613.00	119,684,600
蝶理	8,400	1,944.00	16,329,600
豊田通商	147,300	3,800.00	559,740,000
三共生興	20,000	586.00	11,720,000
兼松	49,200	1,408.00	69,273,600
ツカモトコーポレーション	2,400	1,094.00	2,625,600
三井物産	1,160,200	1,916.00	2,222,943,200
日本紙パルプ商事	7,500	4,080.00	30,600,000
日立ハイテクノロジーズ	45,900	6,690.00	307,071,000
カメイ	17,200	1,341.00	23,065,200
東都水産	1,700	2,533.00	4,306,100
O U Gホールディングス	2,100	2,709.00	5,688,900
スターゼン	4,900	4,695.00	23,005,500
山善	51,600	1,035.00	53,406,000
椿本興業	2,400	4,170.00	10,008,000

住友商事	832,800	1,679.50	1,398,687,600
内田洋行	5,600	4,265.00	23,884,000
三菱商事	926,200	2,872.00	2,660,046,400
第一実業	6,500	3,660.00	23,790,000
キャノンマーケティングジャパン	37,700	2,390.00	90,103,000
西華産業	7,500	1,496.00	11,220,000
佐藤商事	10,900	933.00	10,169,700
菱洋エレクトロ	13,400	1,921.00	25,741,400
東京産業	12,000	577.00	6,924,000
ユアサ商事	12,500	3,560.00	44,500,000
神鋼商事	3,300	2,641.00	8,715,300
小林産業	8,000	318.00	2,544,000
阪和興業	24,700	2,887.00	71,308,900
正栄食品工業	8,500	3,315.00	28,177,500
カナデン	10,700	1,378.00	14,744,600
菱電商事	9,500	1,688.00	16,036,000
フルサト工業	7,300	1,684.00	12,293,200
岩谷産業	29,300	3,690.00	108,117,000
すてきナイスグループ	5,600	988.00	5,532,800
昭光通商	4,200	668.00	2,805,600
ニチモウ	2,100	2,008.00	4,216,800
極東貿易	3,800	1,997.00	7,588,600
イワキ	17,400	467.00	8,125,800
三愛石油	32,500	1,174.00	38,155,000
稲畑産業	29,100	1,504.00	43,766,400
G S Iクレオス	3,300	1,127.00	3,719,100
明和産業	12,200	591.00	7,210,200
クワザワ	4,700	623.00	2,928,100
ワキタ	28,200	1,132.00	31,922,400
東邦ホールディングス	42,300	2,686.00	113,617,800
サンゲツ	36,300	2,120.00	76,956,000
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,442.00	25,379,200
シナネンホールディングス	5,400	2,060.00	11,124,000
伊藤忠エネクス	29,200	915.00	26,718,000
サンリオ	37,100	2,202.00	81,694,200
サンワテクノス	9,400	1,129.00	10,612,600
リョーサン	14,600	2,879.00	42,033,400
新光商事	20,700	901.00	18,650,700
トーホー	6,000	1,834.00	11,004,000
三信電気	7,100	1,611.00	11,438,100
東陽テクニカ	15,200	1,169.00	17,768,800
モスフードサービス	17,300	3,045.00	52,678,500

加賀電子	13,200	2,511.00	33,145,200
ソーダニッカ	13,700	649.00	8,891,300
立花エレテック	9,800	1,780.00	17,444,000
フォーバル	5,800	1,034.00	5,997,200
PALTAC	21,200	5,490.00	116,388,000
三谷産業	17,500	336.00	5,880,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,765.00	9,036,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,452.00	1,597,200
国際紙パルプ商事	31,300	329.00	10,297,700
ヤマタネ	6,600	1,483.00	9,787,800
丸紅建材リース	1,300	1,822.00	2,368,600
日鉄物産	9,400	5,030.00	47,282,000
泉州電業	4,100	2,959.00	12,131,900
トラスコ中山	27,500	2,697.00	74,167,500
オートバックスセブン	49,000	1,826.00	89,474,000
モリト	9,700	816.00	7,915,200
加藤産業	20,600	3,565.00	73,439,000
北恵	2,500	1,093.00	2,732,500
イノテック	7,900	1,047.00	8,271,300
イエローハット	24,900	1,885.00	46,936,500
J Kホールディングス	12,000	632.00	7,584,000
日伝	12,000	2,079.00	24,948,000
北沢産業	10,000	287.00	2,870,000
杉本商事	7,100	2,073.00	14,718,300
因幡電機産業	18,800	5,130.00	96,444,000
東テク	4,400	2,464.00	10,841,600
ミスミグループ本社	165,300	2,803.00	463,335,900
アルテック	10,600	243.00	2,575,800
タキヒヨー	4,000	1,902.00	7,608,000
蔵王産業	2,600	1,450.00	3,770,000
スズケン	55,900	5,540.00	309,686,000
ジェコス	9,100	955.00	8,690,500
グローセル	13,300	452.00	6,011,600
ローソン	33,400	6,090.00	203,406,000
サンエー	11,000	5,270.00	57,970,000
カワチ薬品	10,300	2,261.00	23,288,300
エービーシー・マート	20,600	7,430.00	153,058,000
ハードオフコーポレーション	5,400	814.00	4,395,600
アスクル	13,900	2,886.00	40,115,400
ゲオホールディングス	23,900	1,362.00	32,551,800
アダストリア	18,300	2,789.00	51,038,700
ジーフット	8,200	626.00	5,133,200

くら寿司	6,900	4,670.00	32,223,000
キャンドウ	6,400	1,605.00	10,272,000
パルグループホールディングス	6,800	3,590.00	24,412,000
エディオン	60,700	1,193.00	72,415,100
サーラコーポレーション	27,100	642.00	17,398,200
ワッツ	6,100	617.00	3,763,700
ハローズ	5,000	2,800.00	14,000,000
フジオフードシステム	5,600	3,795.00	21,252,000
あみやき亭	2,900	3,530.00	10,237,000
ひらまつ	24,800	320.00	7,936,000
大黒天物産	3,200	3,395.00	10,864,000
ハニーズホールディングス	11,700	1,391.00	16,274,700
ファーマライズホールディングス	3,300	652.00	2,151,600
アルペン	10,200	1,843.00	18,798,600
ハブ	3,900	1,010.00	3,939,000
クオールホールディングス	19,500	1,604.00	31,278,000
ジinzホールディングス	7,000	6,690.00	46,830,000
ビックカメラ	78,400	1,237.00	96,980,800
D C Mホールディングス	71,400	1,085.00	77,469,000
ペッパーフードサービス	10,600	1,681.00	17,818,600
MonotaRO	93,900	3,105.00	291,559,500
東京一番フーズ	3,600	627.00	2,257,200
DDホールディングス	5,200	1,485.00	7,722,000
きちりホールディングス	3,700	834.00	3,085,800
アークランドサービスホールディングス	9,700	1,940.00	18,818,000
J.フロント リテイリング	157,700	1,428.00	225,195,600
ドトール・日レスホールディングス	21,100	2,203.00	46,483,300
マツモトキヨシホールディングス	54,600	4,085.00	223,041,000
ブロンコビリー	7,000	2,678.00	18,746,000
Z O Z O	130,100	2,549.00	331,624,900
トレジャー・ファクトリー	4,000	1,148.00	4,592,000
物語コーポレーション	3,300	8,540.00	28,182,000
ココカラファイン	13,800	6,330.00	87,354,000
三越伊勢丹ホールディングス	230,800	1,005.00	231,954,000
Hamee	4,200	1,206.00	5,065,200
ウエルシアホールディングス	39,300	6,260.00	246,018,000
クリエイトSDホールディングス	19,500	2,783.00	54,268,500
丸善CHIホールディングス	15,400	378.00	5,821,200
ティーライフ	2,000	865.00	1,730,000
エー・ピーカンパニー	2,800	559.00	1,565,200
チムニー	4,100	2,358.00	9,667,800
シュッピン	9,200	1,007.00	9,264,400

ネクステージ	19,000	1,131.00	21,489,000
ジョイフル本田	38,800	1,467.00	56,919,600
鳥貴族	4,400	2,018.00	8,879,200
キリン堂ホールディングス	5,300	2,164.00	11,469,200
ホットランド	8,900	1,258.00	11,196,200
すかいらーくホールディングス	148,000	2,019.00	298,812,000
SFPホールディングス	5,700	2,294.00	13,075,800
綿半ホールディングス	5,000	2,071.00	10,355,000
ヨシックス	2,200	2,783.00	6,122,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,500	983.00	37,845,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,300	699.00	4,403,700
B E E N O S	4,700	1,530.00	7,191,000
あさひ	10,000	1,251.00	12,510,000
日本調剤	4,000	3,890.00	15,560,000
コスモス薬品	5,800	22,480.00	130,384,000
トーエル	6,600	804.00	5,306,400
オンリー	2,500	806.00	2,015,000
セブン&アイ・ホールディングス	516,400	4,245.00	2,192,118,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,600	1,848.00	65,788,800
ツルハホールディングス	28,700	12,580.00	361,046,000
サンマルクホールディングス	10,500	2,478.00	26,019,000
フェリシモ	3,100	1,042.00	3,230,200
トリドールホールディングス	16,400	2,399.00	39,343,600
T O K Y O B A S E	12,100	779.00	9,425,900
ウイルプラスホールディングス	2,200	820.00	1,804,000
ジャパンミート	6,700	2,215.00	14,840,500
サツドラホールディングス	2,100	1,772.00	3,721,200
デファクトスタンダード	1,600	359.00	574,400
アレンザホールディングス	6,800	853.00	5,800,400
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,488.00	5,224,800
パロックジャパンリミテッド	9,300	968.00	9,002,400
クスリのアオキホールディングス	13,100	8,200.00	107,420,000
力の源ホールディングス	6,100	869.00	5,300,900
スシローグローバルホールディングス	14,500	8,020.00	116,290,000
L I X I L ビバ	13,100	1,993.00	26,108,300
メディカルシステムネットワーク	13,100	561.00	7,349,100
はるやまホールディングス	6,400	849.00	5,433,600
ノジマ	23,500	2,331.00	54,778,500
カップ・クリエイト	18,500	1,477.00	27,324,500
ライトオン	9,900	578.00	5,722,200
良品計画	175,300	2,470.00	432,991,000

三城ホールディングス	14,600	286.00	4,175,600
アドヴァン	20,300	1,249.00	25,354,700
アルビス	5,100	2,405.00	12,265,500
コナカ	16,000	421.00	6,736,000
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,672.00	2,842,400
G - 7ホールディングス	3,900	3,780.00	14,742,000
イオン北海道	13,500	805.00	10,867,500
コジマ	23,100	440.00	10,164,000
ヒマラヤ	4,800	847.00	4,065,600
コーナン商事	18,800	2,567.00	48,259,600
エコス	4,900	1,704.00	8,349,600
ワタミ	15,700	1,424.00	22,356,800
マルシェ	3,700	783.00	2,897,100
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	316,400	1,800.00	569,520,000
西松屋チェーン	29,100	961.00	27,965,100
ゼンショーホールディングス	63,300	2,470.00	156,351,000
幸楽苑ホールディングス	8,500	2,063.00	17,535,500
ハークスレイ	2,900	1,057.00	3,065,300
サイゼリヤ	21,800	2,418.00	52,712,400
V Tホールディングス	55,000	490.00	26,950,000
魚力	3,800	1,540.00	5,852,000
フジ・コーポレーション	3,600	2,227.00	8,017,200
ユナイテッドアローズ	13,900	3,505.00	48,719,500
ハイデイ日高	19,100	2,189.00	41,809,900
京都きもの友禅	8,900	363.00	3,230,700
コロワイド	43,900	2,231.00	97,940,900
ピーシーデポコーポレーション	17,900	488.00	8,735,200
壱番屋	9,300	5,050.00	46,965,000
P L A N T	3,600	677.00	2,437,200
スギホールディングス	26,400	6,070.00	160,248,000
薬王堂ホールディングス	5,800	2,591.00	15,027,800
スクロール	20,800	347.00	7,217,600
ヨンドシーホールディングス	13,500	2,662.00	35,937,000
ファミリーマート	105,500	2,696.00	284,428,000
木曽路	17,300	2,848.00	49,270,400
S R Sホールディングス	15,700	1,044.00	16,390,800
タカキュー	11,100	195.00	2,164,500
ケーヨー	27,400	540.00	14,796,000
上新電機	15,600	2,563.00	39,982,800
日本瓦斯	20,900	3,070.00	64,163,000
ロイヤルホールディングス	23,100	2,542.00	58,720,200
いなげや	16,500	1,515.00	24,997,500

島忠	28,000	3,035.00	84,980,000
チヨダ	14,000	1,664.00	23,296,000
ライフコーポレーション	10,100	2,530.00	25,553,000
リンガーハット	16,300	2,455.00	40,016,500
MrMaxHD	18,500	503.00	9,305,500
テンアライド	12,200	443.00	5,404,600
AOKIホールディングス	26,600	1,167.00	31,042,200
オークワ	20,800	1,396.00	29,036,800
コメリ	20,400	2,370.00	48,348,000
青山商事	27,300	1,918.00	52,361,400
しまむら	15,400	9,480.00	145,992,000
はせがわ	7,400	408.00	3,019,200
高島屋	96,300	1,326.00	127,693,800
松屋	26,800	882.00	23,637,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	62,700	1,252.00	78,500,400
近鉄百貨店	5,100	3,560.00	18,156,000
パルコ	12,800	1,306.00	16,716,800
丸井グループ	121,100	2,556.00	309,531,600
アクシアル リテイリング	11,000	4,130.00	45,430,000
イオン	508,000	2,277.50	1,156,970,000
イズミ	26,900	4,295.00	115,535,500
平和堂	26,900	2,136.00	57,458,400
フジ	16,000	1,991.00	31,856,000
ヤオコー	15,000	5,250.00	78,750,000
ゼビオホールディングス	16,100	1,288.00	20,736,800
ケーズホールディングス	127,500	1,354.00	172,635,000
Olympicグループ	7,100	613.00	4,352,300
日産東京販売ホールディングス	20,000	311.00	6,220,000
Genky DrugStores	6,500	2,524.00	16,406,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	1,272.00	2,925,600
総合メディカルホールディングス	11,600	1,900.00	22,040,000
ブックオフグループホールディングス	7,700	1,065.00	8,200,500
アインホールディングス	17,700	6,520.00	115,404,000
元気寿司	3,400	3,005.00	10,217,000
ヤマダ電機	402,500	566.00	227,815,000
アークランドサカモト	20,800	1,324.00	27,539,200
ニトリホールディングス	57,200	16,815.00	961,818,000
グルメ杵屋	9,600	1,198.00	11,500,800
愛眼	10,500	256.00	2,688,000
ケーユーホールディングス	7,100	951.00	6,752,100
吉野家ホールディングス	43,400	2,697.00	117,049,800
松屋フーズホールディングス	6,400	4,180.00	26,752,000

サガミホールディングス	17,800	1,389.00	24,724,200
関西スーパーマーケット	11,100	1,055.00	11,710,500
王将フードサービス	9,700	6,610.00	64,117,000
プレナス	14,900	1,888.00	28,131,200
ミニストップ	9,900	1,522.00	15,067,800
アークス	27,100	2,323.00	62,953,300
パローホールディングス	29,300	1,970.00	57,721,000
ベルク	6,500	5,260.00	34,190,000
大庄	7,200	1,599.00	11,512,800
ファーストリテイリング	17,700	67,580.00	1,196,166,000
サンドラッグ	49,700	3,890.00	193,333,000
サクスパー ホールディングス	11,400	920.00	10,488,000
ヤマザワ	3,200	1,701.00	5,443,200
やまや	2,800	2,166.00	6,064,800
ペルーナ	28,600	753.00	21,535,800
島根銀行	2,600	708.00	1,840,800
じもとホールディングス	89,300	109.00	9,733,700
めぶきフィナンシャルグループ	686,800	287.00	197,111,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,900	1,541.00	27,583,900
九州フィナンシャルグループ	216,900	455.00	98,689,500
ゆうちょ銀行	374,500	1,096.00	410,452,000
富山第一銀行	31,500	347.00	10,930,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	777,400	470.00	365,378,000
西日本フィナンシャルホールディングス	90,100	866.00	78,026,600
関西みらいフィナンシャルグループ	77,600	739.00	57,346,400
三十三フィナンシャルグループ	12,200	1,727.00	21,069,400
第四北越フィナンシャルグループ	22,900	2,881.00	65,974,900
新生銀行	97,000	1,782.00	172,854,000
あおぞら銀行	78,700	2,834.00	223,035,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,099,000	592.70	5,392,977,300
りそなホールディングス	1,450,500	478.10	693,484,050
三井住友トラスト・ホールディングス	249,800	4,124.00	1,030,175,200
三井住友フィナンシャルグループ	914,200	4,018.00	3,673,255,600
千葉銀行	454,600	617.00	280,488,200
群馬銀行	259,700	389.00	101,023,300
武蔵野銀行	19,700	2,043.00	40,247,100
千葉興業銀行	36,200	357.00	12,923,400
筑波銀行	55,000	225.00	12,375,000
七十七銀行	44,700	1,806.00	80,728,200
青森銀行	10,200	2,910.00	29,682,000
秋田銀行	8,500	2,268.00	19,278,000
山形銀行	14,900	1,659.00	24,719,100

岩手銀行	8,700	3,065.00	26,665,500
東邦銀行	118,200	273.00	32,268,600
東北銀行	6,300	1,029.00	6,482,700
みちのく銀行	8,500	1,635.00	13,897,500
ふくおかフィナンシャルグループ	111,300	2,153.00	239,628,900
静岡銀行	327,300	843.00	275,913,900
十六銀行	16,600	2,655.00	44,073,000
スルガ銀行	135,200	496.00	67,059,200
八十二銀行	319,000	489.00	155,991,000
山梨中央銀行	15,300	1,132.00	17,319,600
大垣共立銀行	26,100	2,660.00	69,426,000
福井銀行	11,300	1,619.00	18,294,700
北國銀行	13,600	3,300.00	44,880,000
清水銀行	5,400	2,002.00	10,810,800
富山銀行	2,500	2,526.00	6,315,000
滋賀銀行	26,500	2,671.00	70,781,500
南都銀行	22,000	2,791.00	61,402,000
百五銀行	119,000	365.00	43,435,000
京都銀行	47,300	4,570.00	216,161,000
紀陽銀行	46,800	1,702.00	79,653,600
ほくほくフィナンシャルグループ	88,000	1,127.00	99,176,000
広島銀行	195,100	566.00	110,426,600
山陰合同銀行	78,400	673.00	52,763,200
中国銀行	113,700	1,089.00	123,819,300
鳥取銀行	4,500	1,404.00	6,318,000
伊予銀行	188,600	605.00	114,103,000
百十四銀行	14,000	2,284.00	31,976,000
四国銀行	20,100	1,018.00	20,461,800
阿波銀行	21,600	2,658.00	57,412,800
大分銀行	7,600	3,040.00	23,104,000
宮崎銀行	8,800	2,694.00	23,707,200
佐賀銀行	8,000	1,653.00	13,224,000
沖縄銀行	12,100	3,760.00	45,496,000
琉球銀行	30,500	1,197.00	36,508,500
セブン銀行	441,500	332.00	146,578,000
みずほフィナンシャルグループ	17,961,000	172.00	3,089,292,000
高知銀行	4,800	910.00	4,368,000
山口フィナンシャルグループ	165,000	775.00	127,875,000
長野銀行	4,300	1,665.00	7,159,500
名古屋銀行	10,700	3,320.00	35,524,000
北洋銀行	199,200	243.00	48,405,600
愛知銀行	4,800	3,820.00	18,336,000

中京銀行	5,400	2,211.00	11,939,400
大光銀行	4,500	1,834.00	8,253,000
愛媛銀行	18,500	1,182.00	21,867,000
トマト銀行	5,100	1,105.00	5,635,500
京葉銀行	56,400	649.00	36,603,600
栃木銀行	63,800	230.00	14,674,000
北日本銀行	4,100	1,988.00	8,150,800
東和銀行	23,200	946.00	21,947,200
福島銀行	12,400	310.00	3,844,000
大東銀行	6,900	630.00	4,347,000
トモニホールディングス	102,200	380.00	38,836,000
フィデアホールディングス	128,300	133.00	17,063,900
池田泉州ホールディングス	152,000	200.00	30,400,000
F P G	41,700	1,197.00	49,914,900
マーキュリアインベストメント	6,100	767.00	4,678,700
S B Iホールディングス	147,700	2,357.00	348,128,900
ジャフコ	20,400	4,225.00	86,190,000
大和証券グループ本社	1,061,000	512.60	543,868,600
野村ホールディングス	2,326,200	516.90	1,202,412,780
岡三証券グループ	113,200	397.00	44,940,400
丸三証券	39,700	522.00	20,723,400
東洋証券	48,500	171.00	8,293,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	152,500	321.00	48,952,500
光世証券	3,500	703.00	2,460,500
水戸証券	39,000	264.00	10,296,000
いちよし証券	25,000	699.00	17,475,000
松井証券	75,700	903.00	68,357,100
だいこう証券ビジネス	5,700	597.00	3,402,900
マネックスグループ	100,500	279.00	28,039,500
極東証券	18,000	819.00	14,742,000
岩井コスモホールディングス	12,700	1,223.00	15,532,100
藍澤証券	24,000	727.00	17,448,000
マネーパートナーズグループ	14,900	254.00	3,784,600
スパークス・グループ	46,600	245.00	11,417,000
かんぼ生命保険	46,800	1,766.00	82,648,800
S O M P Oホールディングス	248,500	4,433.00	1,101,600,500
アニコム ホールディングス	10,900	4,160.00	45,344,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	345,600	3,554.00	1,228,262,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	108,600	2,424.00	263,246,400
第一生命ホールディングス	748,000	1,877.00	1,403,996,000
東京海上ホールディングス	472,700	5,946.00	2,810,674,200
T & Dホールディングス	408,800	1,343.00	549,018,400

アドバンスクリエイト	3,100	1,990.00	6,169,000
全国保証	37,300	4,360.00	162,628,000
ジェイリース	3,700	336.00	1,243,200
イントラスト	4,600	729.00	3,353,400
日本モーゲージサービス	2,700	1,441.00	3,890,700
C a s a	4,600	1,273.00	5,855,800
アルヒ	21,000	2,535.00	53,235,000
プレミアグループ	7,100	1,997.00	14,178,700
クレディセゾン	92,600	1,660.00	153,716,000
芙蓉総合リース	13,900	7,300.00	101,470,000
みずほリース	20,400	3,220.00	65,688,000
東京センチュリー	26,600	5,740.00	152,684,000
日本証券金融	58,300	521.00	30,374,300
アイフル	201,600	252.00	50,803,200
リコーリース	10,400	3,795.00	39,468,000
イオンフィナンシャルサービス	80,900	1,690.00	136,721,000
アコム	265,700	433.00	115,048,100
ジャックス	14,600	2,634.00	38,456,400
オリエントコーポレーション	357,500	159.00	56,842,500
日立キャピタル	31,200	2,562.00	79,934,400
アプラスフィナンシャル	63,400	98.00	6,213,200
オリックス	826,700	1,763.00	1,457,472,100
三菱UFJリース	335,500	704.00	236,192,000
九州リースサービス	6,500	616.00	4,004,000
日本取引所グループ	379,400	1,882.00	714,030,800
イー・ギャランティ	14,100	1,400.00	19,740,000
アサックス	5,500	637.00	3,503,500
NECキャピタルソリューション	5,400	2,419.00	13,062,600
いちご	171,000	431.00	73,701,000
日本駐車場開発	152,700	167.00	25,500,900
スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,933.00	14,497,500
ヒューリック	283,300	1,184.00	335,427,200
三栄建築設計	6,100	1,577.00	9,619,700
野村不動産ホールディングス	80,600	2,530.00	203,918,000
三重交通グループホールディングス	28,800	621.00	17,884,800
サムティ	19,300	2,129.00	41,089,700
ディア・ライフ	19,400	568.00	11,019,200
コーセーアールイー	5,400	802.00	4,330,800
エー・ディー・ワークス	245,200	31.00	7,601,200
日本商業開発	9,200	1,546.00	14,223,200
プレサンスコーポレーション	21,700	1,810.00	39,277,000
ユニゾホールディングス	20,200	4,955.00	100,091,000

ハウスコム	2,500	1,660.00	4,150,000
日本管理センター	9,600	1,422.00	13,651,200
サンセイランディック	5,200	946.00	4,919,200
エストラスト	1,800	799.00	1,438,200
フージャースホールディングス	26,300	728.00	19,146,400
オープンハウス	38,800	2,853.00	110,696,400
東急不動産ホールディングス	361,100	705.00	254,575,500
飯田グループホールディングス	110,900	1,840.00	204,056,000
イーランド	3,700	793.00	2,934,100
ムゲンエステート	11,000	742.00	8,162,000
ハウストゥ	7,300	1,571.00	11,468,300
シーアールイー	4,400	1,064.00	4,681,600
ケイアイスター不動産	4,800	2,019.00	9,691,200
グッドコムアセット	3,800	1,719.00	6,532,200
ジェイ・エス・ビー	1,700	4,775.00	8,117,500
テンポイノベーション	2,200	1,670.00	3,674,000
パーク24	71,400	2,572.00	183,640,800
パラカ	4,000	2,046.00	8,184,000
三井不動産	660,500	2,765.00	1,826,282,500
三菱地所	926,700	2,061.00	1,909,928,700
平和不動産	24,700	2,587.00	63,898,900
東京建物	145,200	1,518.00	220,413,600
ダイビル	35,100	1,154.00	40,505,400
京阪神ビルディング	22,400	1,345.00	30,128,000
住友不動産	297,500	3,979.00	1,183,752,500
テーオーシー	27,400	852.00	23,344,800
東京楽天地	2,400	6,100.00	14,640,000
スターツコーポレーション	18,400	2,896.00	53,286,400
フジ住宅	17,100	711.00	12,158,100
空港施設	15,400	572.00	8,808,800
明和地所	9,400	595.00	5,593,000
ゴールドクレスト	11,000	2,334.00	25,674,000
エスリード	5,700	2,065.00	11,770,500
日神不動産	22,000	510.00	11,220,000
日本エスコン	25,300	905.00	22,896,500
タカラレーベン	63,000	478.00	30,114,000
サンヨーハウジング名古屋	8,700	970.00	8,439,000
イオンモール	67,000	1,751.00	117,317,000
毎日コムネット	4,300	820.00	3,526,000
ファースト住建	6,600	1,344.00	8,870,400
カチタス	16,600	4,640.00	77,024,000
トーセイ	19,100	1,400.00	26,740,000

穴吹興産	1,900	2,892.00	5,494,800
サンフロンティア不動産	19,200	1,346.00	25,843,200
エフ・ジェー・ネクスト	12,700	1,064.00	13,512,800
インテリックス	5,400	753.00	4,066,200
ランドビジネス	5,600	789.00	4,418,400
日本社宅サービス	4,500	1,094.00	4,923,000
グランディハウス	12,800	505.00	6,464,000
日本空港ビルデング	42,400	5,350.00	226,840,000
日本工営	8,700	3,460.00	30,102,000
L I F U L L	44,900	680.00	30,532,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,026.00	17,626,200
日本M&Aセンター	96,800	3,300.00	319,440,000
メンバーズ	3,800	2,385.00	9,063,000
中広	1,600	546.00	873,600
アイティメディア	4,000	792.00	3,168,000
タケエイ	12,400	1,222.00	15,152,800
E・Jホールディングス	1,700	1,469.00	2,497,300
トラスト・テック	14,200	1,403.00	19,922,600
コシダカホールディングス	30,900	1,581.00	48,852,900
アルトナー	3,300	747.00	2,465,100
パソナグループ	15,700	1,556.00	24,429,200
C D S	3,300	1,440.00	4,752,000
リンクアンドモチベーション	28,500	602.00	17,157,000
G C A	15,600	870.00	13,572,000
エス・エム・エス	39,900	2,851.00	113,754,900
サニーサイドアップ	3,000	1,005.00	3,015,000
パーソルホールディングス	128,100	2,120.00	271,572,000
リニカル	6,300	998.00	6,287,400
クックパッド	45,200	373.00	16,859,600
エスクリ	4,200	891.00	3,742,200
アイ・ケイ・ケイ	6,500	704.00	4,576,000
学情	4,600	1,525.00	7,015,000
スタジオアリス	6,500	1,928.00	12,532,000
シミックホールディングス	7,200	1,701.00	12,247,200
エプコ	2,100	1,460.00	3,066,000
N J S	2,900	1,732.00	5,022,800
総合警備保障	51,000	5,720.00	291,720,000
カカクコム	96,000	2,458.00	235,968,000
アイロムグループ	4,500	1,446.00	6,507,000
セントケア・ホールディング	8,600	513.00	4,411,800
サイネックス	2,400	661.00	1,586,400
ルネサンス	7,200	1,757.00	12,650,400

ディップ	18,100	3,070.00	55,567,000
オプトホールディング	7,000	1,766.00	12,362,000
ツクイ	30,500	464.00	14,152,000
キャリアデザインセンター	3,300	1,452.00	4,791,600
ベネフィット・ワン	35,200	2,044.00	71,948,800
エムスリー	282,400	2,804.00	791,849,600
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	613.00	5,149,200
プラス	1,700	688.00	1,169,600
アウトソーシング	73,400	1,175.00	86,245,000
ウェルネット	12,300	845.00	10,393,500
ワールドホールディングス	4,300	1,791.00	7,701,300
ディー・エヌ・エー	62,800	1,743.00	109,460,400
博報堂D Yホールディングス	178,200	1,732.00	308,642,400
ぐるなび	22,400	1,001.00	22,422,400
タカミヤ	13,800	720.00	9,936,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	1,246.00	10,840,200
ファンコミュニケーションズ	35,500	516.00	18,318,000
ライク	5,100	1,684.00	8,588,400
ビジネス・ブレークスルー	5,800	360.00	2,088,000
エスプール	24,900	645.00	16,060,500
WDBホールディングス	5,900	2,666.00	15,729,400
ティア	7,700	607.00	4,673,900
C D G	1,500	1,417.00	2,125,500
バリューコマース	7,300	1,702.00	12,424,600
インフォマート	70,200	1,843.00	129,378,600
J Pホールディングス	40,700	300.00	12,210,000
エコナックホールディングス	24,200	140.00	3,388,000
E P Sホールディングス	19,400	1,427.00	27,683,800
レグス	3,300	1,409.00	4,649,700
プレステージ・インターナショナル	48,100	882.00	42,424,200
アミューズ	7,000	2,889.00	20,223,000
ドリームインキュベータ	4,000	1,623.00	6,492,000
クイック	8,000	1,605.00	12,840,000
T A C	8,400	230.00	1,932,000
ケネディクス	122,100	586.00	71,550,600
電通	132,000	3,995.00	527,340,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,316.00	6,580,000
ぴあ	3,700	4,830.00	17,871,000
イオンファンタジー	5,000	3,030.00	15,150,000
シーティーエス	14,700	723.00	10,628,100
ネクシィーズグループ	4,500	2,138.00	9,621,000
みらかホールディングス	35,900	2,700.00	96,930,000

アルプス技研	11,400	1,693.00	19,300,200
ダイオーズ	2,600	1,345.00	3,497,000
日本空調サービス	13,600	713.00	9,696,800
オリエンタルランド	136,200	15,500.00	2,111,100,000
ダスキン	32,900	2,896.00	95,278,400
明光ネットワークジャパン	15,200	991.00	15,063,200
ファルコホールディングス	7,100	1,791.00	12,716,100
ラウンドワン	35,900	1,212.00	43,510,800
リゾートトラスト	58,800	1,841.00	108,250,800
ビー・エム・エル	16,500	3,250.00	53,625,000
ワタベウェディング	2,300	602.00	1,384,600
りらいあコミュニケーションズ	23,200	1,432.00	33,222,400
リソー教育	58,900	417.00	24,561,300
早稲田アカデミー	4,300	944.00	4,059,200
ユー・エス・エス	143,400	2,098.00	300,853,200
東京個別指導学院	4,700	771.00	3,623,700
サイバーエージェント	73,700	3,620.00	266,794,000
楽天	597,000	996.00	594,612,000
クリーク・アンド・リバー社	6,700	1,134.00	7,597,800
テー・オー・ダブリュー	11,400	825.00	9,405,000
山田コンサルティンググループ	6,300	1,825.00	11,497,500
セントラルスポーツ	4,800	3,340.00	16,032,000
フルキャストホールディングス	12,900	2,242.00	28,921,800
エン・ジャパン	22,800	4,960.00	113,088,000
リソルホールディングス	1,400	4,005.00	5,607,000
テクノプロ・ホールディングス	25,700	7,120.00	182,984,000
アトラ	3,300	398.00	1,313,400
インターワークス	2,700	509.00	1,374,300
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	3,720.00	19,344,000
K e e P e r 技研	4,800	1,492.00	7,161,600
ファーストロジック	3,200	666.00	2,131,200
三機サービス	2,900	995.00	2,885,500
G u n o s y	9,000	1,744.00	15,696,000
デザインワン・ジャパン	3,000	304.00	912,000
イー・ガーディアン	6,600	1,979.00	13,061,400
リブセンス	8,600	381.00	3,276,600
ジャパンマテリアル	39,500	1,724.00	68,098,000
ベクトル	16,100	992.00	15,971,200
ウチヤマホールディングス	6,600	538.00	3,550,800
チャーム・ケア・コーポレーション	4,200	2,162.00	9,080,400
ライクキッズ	3,200	908.00	2,905,600
キャリアリンク	4,400	580.00	2,552,000

I B J	8,800	997.00	8,773,600
アサンテ	5,200	2,094.00	10,888,800
N・フィールド	9,000	663.00	5,967,000
バリューHR	2,600	3,245.00	8,437,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,600	8,000.00	36,800,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,000	1,386.00	6,930,000
E R Iホールディングス	3,800	803.00	3,051,400
アビスト	2,000	2,740.00	5,480,000
シグマクシス	8,800	1,873.00	16,482,400
ウィルグループ	8,500	1,077.00	9,154,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,300	232.00	4,245,600
リクルートホールディングス	917,400	3,732.00	3,423,736,800
エラン	7,700	1,694.00	13,043,800
土木管理総合試験所	5,900	464.00	2,737,600
ネットマーケティング	4,800	931.00	4,468,800
日本郵政	1,049,800	1,020.00	1,070,796,000
ベルシステム24ホールディングス	21,500	1,715.00	36,872,500
鎌倉新書	9,600	1,567.00	15,043,200
S M N	2,200	966.00	2,125,200
一蔵	1,600	745.00	1,192,000
L I T A L I C O	4,500	2,214.00	9,963,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	850.00	1,785,000
エボラブルアジア	5,800	1,912.00	11,089,600
アトラエ	3,400	3,210.00	10,914,000
ストライク	4,900	4,210.00	20,629,000
ソラスト	35,400	1,278.00	45,241,200
セラク	4,200	745.00	3,129,000
インソース	6,300	3,270.00	20,601,000
ベйкаレント・コンサルティング	7,800	5,310.00	41,418,000
Orchestra Holdings	2,700	1,088.00	2,937,600
アイモバイル	4,300	678.00	2,915,400
キャリアインデックス	5,600	455.00	2,548,000
MS - Japan	4,300	1,388.00	5,968,400
船場	2,200	1,026.00	2,257,200
グレイステクノロジー	5,900	3,105.00	18,319,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,500	2,945.00	39,757,500
フルテック	1,900	1,394.00	2,648,600
グリーンズ	4,900	1,249.00	6,120,100
ツナググループ・ホールディングス	1,800	591.00	1,063,800
GameWith	3,000	854.00	2,562,000
ソウルドアウト	2,100	1,633.00	3,429,300
MS&Consulting	1,900	998.00	1,896,200

日総工産	8,600	1,203.00	10,345,800
キュービーネットホールディングス	7,900	2,289.00	18,083,100
RPAホールディングス	7,400	1,280.00	9,472,000
スプリックス	4,400	1,559.00	6,859,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,600	919.00	6,065,400
リログループ	70,100	2,875.00	201,537,500
東祥	8,000	2,555.00	20,440,000
エイチ・アイ・エス	20,000	2,856.00	57,120,000
ラックランド	2,600	2,466.00	6,411,600
共立メンテナンス	21,200	5,130.00	108,756,000
イチネンホールディングス	14,400	1,415.00	20,376,000
建設技術研究所	8,900	1,933.00	17,203,700
スペース	8,400	1,280.00	10,752,000
長大	4,800	1,282.00	6,153,600
燦ホールディングス	5,700	1,343.00	7,655,100
スバル興業	800	7,140.00	5,712,000
東京テアトル	5,100	1,390.00	7,089,000
タナベ経営	2,600	1,241.00	3,226,600
ナガワ	4,100	7,330.00	30,053,000
よみうりランド	2,800	4,625.00	12,950,000
東京都競馬	8,400	3,285.00	27,594,000
カナモト	21,000	3,040.00	63,840,000
東京ドーム	52,000	992.00	51,584,000
西尾レントオール	13,000	3,120.00	40,560,000
トランス・コスモス	12,200	2,925.00	35,685,000
乃村工藝社	55,000	1,374.00	75,570,000
藤田観光	5,600	3,005.00	16,828,000
KNT-CTホールディングス	8,000	1,572.00	12,576,000
日本管財	13,800	1,948.00	26,882,400
トーカイ	12,400	2,644.00	32,785,600
白洋舎	1,500	2,930.00	4,395,000
セコム	135,900	9,878.00	1,342,420,200
セントラル警備保障	6,200	6,180.00	38,316,000
丹青社	24,300	1,154.00	28,042,200
メイテック	15,900	5,900.00	93,810,000
応用地質	13,900	1,281.00	17,805,900
船井総研ホールディングス	26,500	2,498.00	66,197,000
進学会ホールディングス	5,300	570.00	3,021,000
オオバ	10,200	754.00	7,690,800
いであ	2,400	2,025.00	4,860,000
学究社	3,900	1,304.00	5,085,600
ベネッセホールディングス	42,700	2,979.00	127,203,300

イオンディライト	15,800	3,880.00	61,304,000
ナック	7,200	1,125.00	8,100,000
ニチイ学館	18,300	1,937.00	35,447,100
ダイセキ	21,500	3,155.00	67,832,500
ステップ	4,800	1,510.00	7,248,000
合 計	156,180,600		322,532,009,460

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,474,868,227
コール・ローン	109,753,259
株式	366,123,082,266
投資信託受益証券	295,751,624
投資証券	9,790,548,815
派生商品評価勘定	327,635,469
未収入金	42,520,025
未収配当金	422,868,173
差入委託証拠金	2,671,220,298
流動資産合計	390,258,248,156
資産合計	390,258,248,156
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,250,431
前受金	325,604,909
未払解約金	1,009,222,802
未払利息	244
流動負債合計	1,336,078,386
負債合計	1,336,078,386
純資産の部	
元本等	
元本	142,021,697,341
剰余金	

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	246,900,472,429
元本等合計	388,922,169,770
純資産合計	388,922,169,770
負債純資産合計	390,258,248,156

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2019年11月11日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,021,697,341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 2.7385円 (1万口当たり純資産額) (27,385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11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2019年11月11日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	137,979,051,302円
期中追加設定元本額	13,101,555,475円
期中一部解約元本額	9,058,909,436円
期末元本額	142,021,697,341円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,424,676,091円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,022,404円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,917,480,658円
世界経済インデックスファンド	7,610,837,654円
外国株式インデックス・オープン	915,876,119円
D C マイセレクション 2 5	1,102,538,250円
D C マイセレクション 5 0	4,863,225,109円
D C マイセレクション 7 5	5,106,733,575円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,685,994,987円
D C マイセレクション S 2 5	441,739,532円
D C マイセレクション S 5 0	1,987,308,573円
D C マイセレクション S 7 5	1,473,815,323円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	109,224,266円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	193,414,366円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	127,661,680円
D C 世界経済インデックスファンド	6,733,128,451円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,899,569,662円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,939,124円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,144,782円

区分	2019年11月11日現在
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	38,647,666円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	45,612,074円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	184,244,802円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	33,622,232円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	259,744,953円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	680,059,362円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	358,844,941円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,351,929,801円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,813,293,127円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	72,017,563円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	338,702,429円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,464,498円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	116,935,506円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,861,275,742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）	2,024,652,273円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,000,307,112円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,597,111,771円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,286,088,778円
分散投資コア戦略ファンドA	2,459,216,809円
分散投資コア戦略ファンドS	6,974,119,240円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	957,755,893円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,055,461,724円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,701,369,457円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	792,901,461円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,853,332円
SMT インデックスバランス・オープン	264,605,622円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,614,096,362円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	32,527,651,376円
SMT 世界経済インデックス・オープン	90,142,144円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	344,465,412円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	53,687,204円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,515,161円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	51,404,800円
グローバル経済コア	978,424,855円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	7,567,924円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	507,672円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,457,720円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,698,491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）	1,335,265,434円

区分	2019年11月11日現在
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)	742,566,004円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	360,817,303円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	30,979,536円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	29,265,344,815
投資信託受益証券	30,840,486
投資証券	300,909,564
合計	29,597,094,865

(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11月11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	11,632,562,091	-	11,958,167,000	325,604,909
合計		11,632,562,091	-	11,958,167,000	325,604,909

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年11月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,593,101,699	-	1,592,321,570	780,129
	アメリカドル	1,196,976,620	-	1,197,110,570	133,950

カナダドル	66,384,000	-	66,008,000	376,000
ユーロ	223,009,300	-	222,462,500	546,800
スイスフラン	77,558,219	-	77,564,600	6,381
オーストラリアドル	29,173,560	-	29,175,900	2,340
合計	1,593,101,699	-	1,592,321,570	780,129

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	34,273	24.43	837,289.39	
	BAKER HUGHES CO	57,644	22.25	1,282,579.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	18.37	659,097.23	
	CHENIERE ENERGY INC	19,927	61.74	1,230,292.98	
	CHEVRON CORP	167,394	120.93	20,242,956.42	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	46.54	353,657.46	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	72.75	1,271,742.75	
	CONOCOPHILLIPS	100,011	59.16	5,916,650.76	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	32.72	250,209.84	
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	22.91	867,395.51	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	75.43	1,017,324.41	
	EOG RESOURCES INC	51,609	74.70	3,855,192.30	
	EXXON MOBIL	371,576	70.77	26,296,433.52	
	HALLIBURTON CO	76,620	21.28	1,630,473.60	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	40.75	338,836.25	
	HESS CORP	24,844	71.85	1,785,041.40	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	54.14	763,915.40	
	KINDER MORGAN INC	181,360	20.03	3,632,640.80	
	MARATHON OIL CORP	74,537	12.53	933,948.61	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	66.23	3,822,795.60	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	23.38	708,671.18		
NOBLE ENERGY INC	38,291	21.43	820,576.13		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	40.10	3,071,339.20
ONEOK INC	36,957	70.48	2,604,729.36
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	17.10	350,122.50
PHILLIPS 66	40,336	119.70	4,828,219.20
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	134.99	1,951,280.45
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17,841	18.43	328,809.63
SCHLUMBERGER	123,022	36.34	4,470,619.48
TARGA RESOURCES CORP	20,002	39.90	798,079.80
TECHNIPFMC PLC	36,005	20.60	741,703.00
VALERO ENERGY CORP	37,256	100.86	3,757,640.16
WILLIAMS COS	103,730	22.09	2,291,395.70
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,553	233.87	4,572,860.11
ALBEMARLE CORP	8,647	67.98	587,823.06
AMCOR PLC	138,214	9.77	1,350,350.78
AVERY DENNISON CORP	7,457	133.83	997,970.31
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	30.23	532,229.38
BALL CORP	27,142	64.65	1,754,730.30
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	127.31	1,407,157.43
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	46.63	889,280.73
CORTEVA INC	64,411	26.20	1,687,568.20
CROWN HOLDINGS INC	11,700	75.00	877,500.00
DOW INC	65,790	55.99	3,683,582.10
DUPONT DE NEMOURS INC	66,679	71.13	4,742,877.27
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	83.90	994,886.20
ECOLAB INC	23,026	190.39	4,383,920.14
FMC CORP	12,118	97.70	1,183,928.60
FREEPORT-MCMORAN INC	124,849	11.52	1,438,260.48
INT'L PAPER CO	33,803	46.21	1,562,036.63
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	132.81	1,151,993.94
LINDE PLC	47,863	203.00	9,716,189.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	97.39	2,240,651.73
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	256.90	1,378,782.30
MOSAIC CO/THE	31,911	20.81	664,067.91
NEWMONT GOLDCORP CORP	73,290	36.61	2,683,146.90
NUCOR CORP	26,204	55.56	1,455,894.24
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	113.90	1,012,571.00
PPG INDUSTRIES INC	19,958	128.92	2,572,985.36
SEALED AIR CORP	14,689	40.02	587,853.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,387	581.35	4,294,432.45
STEEL DYNAMICS INC	18,273	31.62	577,792.26
VULCAN MATERIALS CO	11,960	136.44	1,631,822.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	74.70	258,088.50

WESTROCK CO	21,244	39.75	844,449.00
3 M COMPANY	50,865	173.15	8,807,274.75
ACUITY BRANDS INC	3,505	128.08	448,920.40
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	60.43	684,671.90
ALLEGION PLC	7,435	115.65	859,857.75
AMETEK INC	19,001	96.54	1,834,356.54
ARCONIC INC	36,550	28.97	1,058,853.50
BOEING CO	46,987	351.00	16,492,437.00
CATERPILLAR	50,571	148.16	7,492,599.36
CUMMINS INC	12,585	186.27	2,344,207.95
DEERE&CO	26,740	178.36	4,769,346.40
DOVER CORP	12,008	109.35	1,313,074.80
EATON CORP	36,194	92.22	3,337,810.68
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	73.88	3,883,280.56
FASTENAL CO	51,959	37.07	1,926,120.13
FLOWSERVE CORP	10,826	49.13	531,881.38
FLUOR CORP	11,267	18.80	211,819.60
FORTIVE CORP	25,813	72.88	1,881,251.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	62.06	794,988.60
GENERAL DYNAMICS CORP	21,828	185.08	4,039,926.24
GENERAL ELECTRIC CO	770,523	11.52	8,876,424.96
GRAINGER (WW) INC	3,976	324.92	1,291,881.92
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.83	621,677.58
HEICO CORP	3,640	121.69	442,951.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	93.68	604,142.32
HONEYWELL INTL INC	64,118	181.21	11,618,822.78
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	251.21	884,761.62
IDEX CORP	6,916	159.62	1,103,931.92
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	176.41	4,944,419.48
INGERSOLL-RAND PLC	21,603	130.44	2,817,895.32
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	94.60	1,137,659.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	57.00	1,145,700.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	31.83	652,515.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	42.52	2,894,846.64
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,659	196.02	3,853,557.18
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	245.01	706,853.85
LOCKHEED MARTIN CORP	22,452	381.86	8,573,520.72
MASCO CORP	24,547	46.30	1,136,526.10
MIDDLEBY CORP	4,364	120.05	523,898.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,290	350.11	5,003,071.90
OWENS CORNING	10,458	62.59	654,566.22
PACCAR INC	30,075	80.07	2,408,105.25

PARKER HANNIFIN CORP	11,340	199.54	2,262,783.60
PENTAIR PLC	13,583	43.37	589,094.71
RAYTHEON COMPANY	24,818	215.84	5,356,717.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	177.82	1,869,066.02
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,262	337.50	3,125,925.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	53.03	733,298.84
SMITH (A.O.) CORP	12,146	52.08	632,563.68
SNAP-ON INC	4,900	166.94	818,006.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	87.77	744,377.37
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	157.84	2,088,854.56
TEXTRON	21,534	46.61	1,003,699.74
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	541.08	2,203,277.76
UNITED RENTALS INC	6,446	155.32	1,001,192.72
UNITED TECHNOLOGIES CORP	72,207	148.88	10,750,178.16
WABCO HOLDINGS INC	3,841	134.67	517,267.47
WABTEC CORP	15,679	78.85	1,236,289.15
XYLEM INC	16,060	77.33	1,241,919.80
CINTAS CORP	7,616	260.88	1,986,862.08
COPART INC	17,540	81.46	1,428,808.40
COSTAR GROUP INC	3,300	549.31	1,812,723.00
EQUIFAX INC	10,799	133.96	1,446,634.04
IHS MARKIT LTD	32,775	69.64	2,282,451.00
MANPOWER GROUP	5,123	94.29	483,047.67
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	20.35	559,706.40
REPUBLIC SERVICES INC	20,400	86.18	1,758,072.00
ROBERT HALF INTL INC	9,566	57.94	554,254.04
ROLLINS INC	10,546	38.68	407,919.28
TRANSUNION	15,344	80.62	1,237,033.28
VERISK ANALYTICS INC	13,480	136.75	1,843,390.00
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	88.84	2,044,030.72
WASTE MANAGEMENT INC	37,723	111.03	4,188,384.69
AMERCO	602	387.07	233,016.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	30.76	305,139.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	78.06	893,630.88
CSX CORP	68,203	74.03	5,049,068.09
DELTA AIR LINES INC	15,095	57.58	869,170.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	77.27	1,226,120.36
FEDEX CORP	21,165	163.22	3,454,551.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	119.98	855,937.32
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	153.31	1,340,389.33
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	37.80	404,460.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,624	195.44	4,617,074.56

OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	194.18	1,018,474.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	58.18	667,033.70
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	27.01	425,380.49
UNION PACIFIC CORP	62,381	176.10	10,985,294.10
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	93.44	560,920.32
UNITED PARCEL SERVICE B	61,610	124.30	7,658,123.00
XPO LOGISTICS INC	8,001	84.64	677,204.64
APTIV PLC	22,107	96.88	2,141,726.16
AUTOLIV INC	6,639	86.31	573,012.09
BORGWARNER INC	15,953	46.31	738,783.43
FORD MOTOR COMPANY	335,147	9.04	3,029,728.88
GENERAL MOTORS CO	113,426	38.67	4,386,183.42
HARLEY-DAVIDSON	14,677	39.39	578,127.03
LEAR CORP	5,287	129.11	682,604.57
TESLA INC	11,730	337.14	3,954,652.20
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	36.62	422,851.14
DR HORTON INC	32,171	51.15	1,645,546.65
GARMIN LTD	11,464	95.89	1,099,282.96
HANESBRANDS INC	31,136	15.86	493,816.96
HASBRO INC	10,617	95.53	1,014,242.01
LEGGETT & PLATT INC	10,594	55.18	584,576.92
LENNAR CORP-CL A	23,545	57.80	1,360,901.00
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	204.13	1,938,418.48
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	152.03	769,575.86
NEWELL BRANDS INC	37,563	20.37	765,158.31
NIKE B	110,763	89.81	9,947,625.03
NVR INC	294	3,423.25	1,006,435.50
POLARIS INC	4,691	103.44	485,237.04
PULTE GROUP INC	21,959	38.18	838,394.62
PVH CORP	7,252	97.96	710,405.92
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	113.77	520,839.06
ROKU INC	7,065	121.94	861,506.10
TAPESTRY INC	25,989	27.23	707,680.47
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	17.56	280,082.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	15.88	258,574.04
VF CORP	28,754	87.07	2,503,610.78
WHIRLPOOL CORP	5,324	154.77	823,995.48
ARAMARK	19,980	42.99	858,940.20
BLOCK H & R INC	16,984	24.42	414,749.28
CARNIVAL CORPORATION	35,126	45.05	1,582,426.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	731.62	1,651,266.34
DARDEN RESTAURANTS INC	11,266	114.91	1,294,576.06

DOMINO'S PIZZA INC	3,453	280.66	969,118.98
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	99.09	2,330,894.07
LAS VEGAS SANDS CORP	31,490	64.08	2,017,879.20
MARRIOTT INTL A	25,274	133.20	3,366,496.80
MCDONALD'S CORP	67,182	193.61	13,007,107.02
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	22.19	391,919.78
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	31.41	1,402,644.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.82	924,365.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	114.53	1,751,278.23
STARBUCKS CORP	106,777	81.77	8,731,155.29
VAIL RESORTS INC	3,574	240.63	860,011.62
WYNN RESORTS LTD	8,052	126.47	1,018,336.44
YUM BRANDS INC	26,166	98.90	2,587,817.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	68,180	54.30	3,702,174.00
ALPHABET INC-CL A	26,286	1,309.00	34,408,374.00
ALPHABET INC-CL C	27,512	1,311.37	36,078,411.44
ALTICE USA INC- A	12,457	26.23	326,747.11
CBS CORP-CL B	28,628	38.11	1,091,013.08
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	469.75	6,403,632.00
COMCAST CORP-CL A	398,164	45.19	17,993,031.16
DISCOVERY INC - A	12,804	30.90	395,707.62
DISCOVERY INC-C	31,156	28.61	891,528.94
DISH NETWORK CORPORATION-A	22,866	35.32	807,627.12
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	98.27	2,500,676.69
FACEBOOK INC-A	210,848	190.84	40,238,232.32
FOX CORP - CLASS A	30,270	35.14	1,063,687.80
FOX CORP- CLASS B	15,092	34.43	519,617.56
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	219.95	1,478,283.95
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.97	777,166.98
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	116.76	1,011,491.88
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	24.82	385,107.12
LIBERTY GLOBAL PLC-C	34,106	23.45	799,785.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	39.86	745,102.98
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	46.53	708,791.49
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.21	295,004.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	63.16	798,152.92
NETFLIX INC	38,532	291.57	11,234,775.24
NEWS CORP-CLASS A	33,479	12.90	431,879.10
OMNICOM GROUP	19,030	80.77	1,537,053.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.85	887,109.25
SNAP INC - A	57,914	14.19	821,799.66
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	116.96	1,117,201.92

THE WALT DISNEY CO	158,140	137.96	21,816,994.40
TRIPADVISOR INC	10,393	31.96	332,160.28
TWITTER INC	65,352	29.21	1,908,931.92
VIACOM INC-CLASS B	31,895	22.75	725,611.25
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	37.55	374,073.10
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	167.40	1,035,536.40
AMAZON.COM	36,704	1,785.88	65,548,939.52
AUTOZONE INC	2,085	1,165.86	2,430,818.10
BEST BUY COMPANY INC	20,711	76.85	1,591,640.35
BOOKING HOLDINGS INC	3,823	1,879.19	7,184,143.37
BURLINGTON STORES INC	6,004	202.75	1,217,311.00
CARMAX INC	14,253	93.88	1,338,071.64
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	157.86	3,525,013.80
DOLLAR TREE INC	21,332	110.35	2,353,986.20
EBAY	71,876	35.14	2,525,722.64
EXPEDIA GROUP INC	12,028	101.32	1,218,676.96
GAP	21,891	16.68	365,141.88
GENUINE PARTS CO	12,722	106.15	1,350,440.30
GRUBHUB INC	8,261	36.19	298,965.59
HOME DEPOT	96,670	232.84	22,508,642.80
KOHL'S CORP	14,645	57.04	835,350.80
L BRANDS INC	19,499	17.75	346,107.25
LKQ CORP	29,351	35.20	1,033,155.20
LOWES COMPANIES	70,188	114.00	8,001,432.00
MACY'S INC	25,926	15.88	411,704.88
MERCADOLIBRE INC	3,995	494.42	1,975,207.90
NORDSTROM INC	10,094	36.65	369,945.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	439.23	2,942,401.77
QURATE RETAIL INC	35,071	9.40	329,667.40
ROSS STORES INC	31,827	111.82	3,558,895.14
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,436	110.15	5,004,775.40
TIFFANY & CO	9,326	125.67	1,171,998.42
TJX COMPANIES INC	107,309	59.23	6,355,912.07
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	94.82	1,063,121.84
ULTA BEAUTY INC	4,911	239.29	1,175,153.19
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	84.22	448,639.94
COSTCO WHOLESALE CORP	38,741	302.62	11,723,801.42
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	6.27	212,553.00
KROGER CO	68,147	27.02	1,841,331.94
SYSCO CORP	41,755	80.40	3,357,102.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	59.24	3,993,190.68
WALMART INC	126,110	119.44	15,062,578.40

ALTRIA GROUP INC	165,376	46.41	7,675,100.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	43.31	2,070,131.38
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	64.50	1,705,315.50
BUNGE LIMITED	11,767	55.89	657,657.63
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	46.25	650,830.00
COCA-COLA CO	356,211	52.21	18,597,776.31
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	51.29	1,039,648.30
CONAGRA BRANDS INC	39,943	27.44	1,096,035.92
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,937	187.56	2,801,583.72
GENERAL MILLS INC	53,542	52.50	2,810,955.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	140.97	1,765,085.37
HORMEL FOODS CORP	27,157	41.97	1,139,779.29
INGREDION INC	5,835	84.62	493,757.70
JM SMUCKER CO	9,442	106.27	1,003,401.34
KELLOGG CO	21,051	63.99	1,347,053.49
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	32.85	1,891,535.85
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	78.95	1,020,349.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,092	159.69	1,771,281.48
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	53.79	812,229.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	127,274	51.73	6,583,884.02
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	58.16	2,031,645.12
PEPSICO INC	123,268	133.13	16,410,668.84
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	137,103	83.57	11,457,697.71
TYSON FOODS INC	26,508	82.63	2,190,356.04
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	67.58	1,437,021.12
CLOROX COMPANY	10,995	148.00	1,627,260.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	72,272	66.63	4,815,483.36
COTY INC-CL A	30,534	12.84	392,056.56
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,514	187.27	3,654,386.78
KIMBERLY-CLARK CORP	30,548	131.46	4,015,840.08
PROCTER & GAMBLE CO	220,272	119.70	26,366,558.40
ABBOTT LABORATORIES	155,594	83.74	13,029,441.56
ABIOMED INC	3,502	219.62	769,109.24
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	259.92	1,628,138.88
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	86.07	1,105,741.29
ANTHEM INC	22,819	282.09	6,437,011.71
BAXTER INTERNATIONAL	43,221	78.51	3,393,280.71
BECTON DICKINSON & CO	23,911	244.79	5,853,173.69
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,474	40.51	5,001,931.74
CARDINAL HEALTH	25,252	53.75	1,357,295.00
CENTENE CORP	35,914	55.06	1,977,424.84
CERNER CORP	27,944	67.31	1,880,910.64

CIGNA CORP	33,690	188.20	6,340,458.00
CVS HEALTH CORP	114,987	72.47	8,333,107.89
DANAHER CORP	56,976	135.23	7,704,864.48
DAVITA INC	9,056	69.85	632,561.60
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	57.42	1,159,194.96
DEXCOM INC	7,827	198.08	1,550,372.16
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,568	234.16	4,347,882.88
HCA HEALTHCARE INC	24,531	136.84	3,356,822.04
HENRY SCHEIN INC	12,492	68.91	860,823.72
HOLOGIC INC	24,459	46.56	1,138,811.04
HUMANA INC	11,566	317.58	3,673,130.28
IDEXX LABORATORIES INC	7,763	254.74	1,977,546.62
INTUITIVE SURGICAL INC	10,243	548.95	5,622,894.85
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	168.41	1,486,555.07
MCKESSON CORP	16,655	140.20	2,335,031.00
MEDTRONIC PLC	118,252	107.03	12,656,511.56
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	101.57	1,176,180.60
RESMED INC	12,398	143.85	1,783,452.30
STERIS PLC	7,229	145.84	1,054,277.36
STRYKER CORP	28,773	199.78	5,748,269.94
TELEFLEX INC	3,971	331.18	1,315,115.78
THE COOPER COS INC	4,135	291.40	1,204,939.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	83,701	256.97	21,508,645.97
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	141.13	1,022,910.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	124.76	1,027,648.12
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	143.77	1,578,882.14
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	302.96	1,333,932.88
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,404	144.00	2,650,176.00
ABBVIE INC	130,602	85.21	11,128,596.42
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	76.64	2,098,939.68
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	110.79	2,110,327.92
ALKERMES PLC	12,547	20.11	252,320.17
ALLERGAN PLC	27,804	181.28	5,040,309.12
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	93.03	891,692.55
AMGEN	53,848	221.11	11,906,331.28
BEIGENE LTD-ADR	3,149	199.44	628,036.56
BIOGEN INC	17,270	293.25	5,064,427.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	75.90	1,228,972.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	144,780	58.02	8,400,135.60
CELGENE CORP	62,510	109.54	6,847,345.40
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	27.23	834,899.03
EXACT SCIENCES CORP	10,748	83.66	899,177.68

GILEAD SCIENCES INC	112,546	65.38	7,358,257.48
ILLUMINA INC	13,100	293.39	3,843,409.00
INCYTE CORP	16,120	85.10	1,371,812.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	57.06	641,126.16
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	137.59	1,961,345.45
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	130.14	646,925.94
JOHNSON & JOHNSON	233,555	133.00	31,062,815.00
LILLY (ELI) & CO	77,235	113.53	8,768,489.55
MERCK & CO	226,750	83.59	18,954,032.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	708.86	1,602,732.46
MYLAN NV	42,644	17.61	750,960.84
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	20.04	270,680.28
PERKINELMER INC	9,475	87.30	827,167.50
PERRIGO CO PLC	11,333	50.05	567,216.65
PFIZER	489,061	37.05	18,119,710.05
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	341.79	2,365,528.59
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	96.28	620,813.44
SEATTLE GENETICS INC	9,601	108.34	1,040,172.34
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	9.30	881,956.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,324	294.65	10,408,216.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,826	201.31	4,595,102.06
WATERS CORP	6,363	210.08	1,336,739.04
ZOETIS INC	42,491	117.86	5,007,989.26
BANK OF AMERICA CORP	793,510	33.26	26,392,142.60
BB&T CORP	68,214	54.94	3,747,677.16
CIT GROUP INC	7,038	44.81	315,372.78
CITIGROUP	203,474	76.12	15,488,440.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	38.52	1,541,185.20
COMERICA INC	14,360	71.83	1,031,478.80
EAST WEST BANCORP INC	13,827	45.89	634,521.03
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	30.56	1,925,677.28
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	110.22	1,556,967.72
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	14.98	1,283,231.74
JPMORGAN CHASE & CO	284,755	130.38	37,126,356.90
KEY CORP	87,033	19.36	1,684,958.88
M & T BANK CORP	11,742	167.59	1,967,841.78
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	16.96	622,771.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,972	152.20	6,083,738.40
REGIONS FINL CORP	83,851	16.88	1,415,404.88
SIGNATURE BANK	4,354	125.90	548,168.60
SUNTRUST BANKS	38,353	71.04	2,724,597.12
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	238.60	1,047,454.00

US BANCORP	133,575	58.90	7,867,567.50
WELLS FARGO & CO	375,317	54.10	20,304,649.70
ZIONS BANCORPORATION	15,186	51.07	775,549.02
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	86.86	385,050.38
ALLY FINANCIAL INC	36,028	31.56	1,137,043.68
AMERICAN EXPRESS	62,687	121.47	7,614,589.89
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	158.54	1,878,699.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	23.18	526,046.92
BANK NEW YORK CO	76,753	49.20	3,776,247.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	114,181	221.31	25,269,397.11
BLACKROCK INC	10,286	490.21	5,042,300.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,786	97.26	4,064,106.36
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	114.88	1,087,913.60
CME GROUP INC	31,640	198.17	6,270,098.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,078	84.71	2,463,197.38
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	43.48	917,775.84
EATON VANCE CORP	10,061	47.96	482,525.56
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	246.72	804,307.20
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	28.28	737,259.60
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,128	222.91	6,492,922.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	50,032	90.47	4,526,395.04
INVESCO LTD	30,943	17.82	551,404.26
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	19.49	501,009.94
KKR & CO INC -A	42,145	29.15	1,228,526.75
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	347.15	1,115,045.80
MOODY'S CORP	14,592	218.13	3,182,952.96
MORGAN STANLEY	111,907	49.15	5,500,229.05
MSCI INC	7,262	245.00	1,779,190.00
NASDAQ INC	9,996	100.66	1,006,197.36
NORTHERN TRUST CORP	17,320	107.65	1,864,498.00
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	119.58	2,399,492.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	89.29	977,011.18
S&P GLOBAL INC	21,802	255.30	5,566,050.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	106,674	43.54	4,644,585.96
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	62.44	674,476.88
STATE STREET CORP	32,349	73.10	2,364,711.90
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	36.94	1,961,329.30
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	40.48	947,393.92
VOYA FINANCIAL INC	12,505	57.42	718,037.10
AFLAC	63,745	54.14	3,451,154.30
ALLEGHANY CORP	1,276	775.30	989,282.80
ALLSTATE CORP	28,490	108.19	3,082,333.10

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	110.52	775,076.76
AMERICAN INT'L GROUP	77,241	55.91	4,318,544.31
AON PLC	21,375	194.57	4,158,933.75
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	40.58	1,402,079.58
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,886	91.15	1,539,158.90
ASSURANT INC	4,769	130.07	620,303.83
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	43.94	586,467.18
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	41.02	427,264.32
CHUBB LTD	40,488	151.51	6,134,336.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	108.70	1,446,362.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	180.10	390,096.60
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	265.35	889,718.55
FNF GROUP	24,961	47.00	1,173,167.00
GLOBE LIFE INC	8,473	98.93	838,233.89
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	61.09	1,937,163.90
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	60.38	1,074,160.20
LOEWS CORP	22,051	51.00	1,124,601.00
MARKEL CORP	1,132	1,165.42	1,319,255.44
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	103.31	4,512,994.04
METLIFE INC	72,012	49.32	3,551,631.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	55.30	1,280,471.50
PROGRESSIVE CORP	51,928	73.67	3,825,535.76
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	92.89	3,226,255.48
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	167.95	912,136.45
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	184.59	705,502.98
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	133.29	2,939,177.79
UNUM GROUP	18,574	30.00	557,220.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	185.10	2,023,143.00
WR BERKLEY CORP	12,637	67.89	857,925.93
CBRE GROUP INC-A	26,855	54.89	1,474,070.95
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.62	554,694.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	161.64	724,793.76
WEYERHAEUSER CO	69,607	29.63	2,062,455.41
ACCENTURE PLC-CL A	56,196	189.70	10,660,381.20
ADOBE INC	42,967	292.46	12,566,128.82
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	84.53	1,198,466.34
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	107.90	433,326.40
ANSYS INC	7,624	224.31	1,710,139.44
AUTODESK INC	18,836	152.96	2,881,154.56
AUTOMATIC DATA PROCESS	38,497	162.73	6,264,616.81
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	119.58	1,153,947.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	67.10	1,617,781.00

CDK GLOBAL INC	10,687	51.78	553,426.29
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	115.42	1,246,651.42
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	110.73	1,257,006.96
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	50,849	62.86	3,196,368.14
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	114.10	353,710.00
DOCUSIGN INC	8,693	66.73	580,083.89
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	19.79	321,609.36
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	30.08	706,819.84
EPAM SYSTEMS INC	4,620	189.23	874,242.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	54,206	130.69	7,084,182.14
FISERV INC	50,943	110.61	5,634,805.23
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	293.45	2,139,837.40
FORTINET INC	12,963	96.23	1,247,429.49
GARTNER INC	7,761	160.36	1,244,553.96
GLOBAL PAYMENTS INC	26,654	170.26	4,538,110.04
GODADDY INC - CLASS A	14,919	69.00	1,029,411.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,100	137.61	10,747,341.00
INTUIT INC	22,935	256.85	5,890,854.75
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	149.51	995,437.58
LEIDOS HOLDINGS	10,999	87.20	959,112.80
MASTERCARD INC-CLASS A	79,856	274.89	21,951,615.84
MICROSOFT CORP	638,320	145.96	93,169,187.20
MONGODB INC	3,652	126.13	460,626.76
NORTONLIFELOCK INC	53,148	24.83	1,319,664.84
OKTA INC	8,635	109.66	946,914.10
ORACLE CORP	210,716	56.49	11,903,346.84
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	236.93	1,910,603.52
PAYCHEX INC	27,697	83.25	2,305,775.25
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	218.42	925,663.96
PAYPAL HOLDINGS INC	98,367	101.42	9,976,381.14
PTC INC	9,984	73.23	731,128.32
SABRE CORP	24,114	22.65	546,182.10
SALESFORCE.COM INC	73,241	161.11	11,799,857.51
SERVICENOW INC	16,409	248.45	4,076,816.05
SPLUNK INC	12,887	125.03	1,611,261.61
SQUARE INC - A	27,989	62.45	1,747,913.05
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	57.84	1,136,266.80
SYNOPSYS INC	13,552	136.21	1,845,917.92
TWILIO INC - A	9,579	93.23	893,050.17
VERISIGN INC	9,194	183.79	1,689,765.26
VISA INC-CLASS A SHARES	152,715	178.97	27,331,403.55
VMWARE INC-CLASS A	6,787	164.95	1,119,515.65

WESTERN UNION CO	38,757	27.87	1,080,157.59
WIX.COM LTD	3,961	128.10	507,404.10
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	162.42	2,251,141.20
AMPHENOL CORPORATION	25,582	102.70	2,627,271.40
APPLE INC	403,446	260.14	104,952,442.44
ARISTA NETWORKS INC	4,940	192.61	951,493.40
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	81.73	544,812.18
CDW CORP/DE	12,482	133.52	1,666,596.64
CISCO SYSTEMS	376,282	48.83	18,373,850.06
COGNEX CORP	16,230	53.34	865,708.20
CORNING	66,228	30.37	2,011,344.36
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	54.31	754,365.90
F5 NETWORKS INC	5,350	148.41	793,993.50
FLEX LTD	40,465	11.84	479,105.60
FLIR SYSTEMS INC	11,686	53.24	622,162.64
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	17.43	1,953,990.15
HP INC	135,146	19.52	2,638,049.92
IPG PHOTONICS CORP	3,207	147.25	472,230.75
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	26.17	819,225.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	105.25	1,668,528.25
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	164.96	2,298,882.56
NETAPP INC	20,586	59.41	1,223,014.26
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	58.79	1,342,528.44
TE CONNECTIVITY LTD	30,145	93.90	2,830,615.50
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	40.79	841,171.38
WESTERN DIGITAL CORP	26,625	52.02	1,385,032.50
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	38.85	649,494.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	241.86	1,112,556.00
AT&T INC	641,062	39.38	25,245,021.56
CENTURYLINK INC	83,301	14.79	1,232,021.79
SPRINT CORP	64,825	6.11	396,080.75
T-MOBILE US INC	30,672	80.94	2,482,591.68
VERIZON COMMUNICATIONS	363,367	59.35	21,565,831.45
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	34.23	698,223.54
AES CORP	61,761	17.64	1,089,464.04
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	51.68	995,150.08
AMEREN CORPORATION	21,002	73.81	1,550,157.62
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,855	89.07	3,906,164.85
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	116.30	1,799,277.30
ATMOS ENERGY CORP	10,759	107.32	1,154,655.88
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	28.78	1,231,553.76
CMS ENERGY CORP	24,527	59.61	1,462,054.47

CONSOLIDATED EDISON INC	29,281	87.92	2,574,385.52
DOMINION ENERGY INC	71,032	80.28	5,702,448.96
DTE ENERGY COMPANY	15,603	120.49	1,880,005.47
DUKE ENERGY CORP	64,402	89.95	5,792,959.90
EDISON INTL	30,299	66.30	2,008,823.70
ENERGY CORP	17,139	114.90	1,969,271.10
EVERGY INC	21,330	63.06	1,345,069.80
EVERSOURCE ENERGY	27,188	79.41	2,158,999.08
EXELON CORP	86,267	44.71	3,856,997.57
FIRSTENERGY CORP	45,526	46.59	2,121,056.34
NEXTERA ENERGY INC	42,221	222.08	9,376,439.68
NISOURCE INC	32,308	26.41	853,254.28
NRG ENERGY INC	23,078	38.44	887,118.32
OGE ENERGY CORP	15,686	42.83	671,831.38
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	86.39	813,448.24
PPL CORPORATION	65,108	33.72	2,195,441.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	61.43	2,657,093.22
SEMPRA ENERGY	24,447	142.12	3,474,407.64
SOUTHERN CO	92,099	61.26	5,641,984.74
UGI CORP	18,019	46.54	838,604.26
VISTRA ENERGY CORP	29,561	26.00	768,586.00
WEC ENERGY GROUP INC	26,996	87.83	2,371,058.68
XCEL ENERGY INC	44,029	60.08	2,645,262.32
ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	36.29	3,190,689.38
ANALOG DEVICES	32,917	113.02	3,720,279.34
APPLIED MATERIALS	80,718	56.03	4,522,629.54
BROADCOM INC	34,898	313.41	10,937,382.18
INTEL CORP	393,448	58.27	22,926,214.96
KLA CORP	13,856	174.21	2,413,853.76
LAM RESEARCH CORP	12,864	272.68	3,507,755.52
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	27.07	1,481,730.59
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	59.55	1,394,839.65
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	96.21	1,995,780.24
MICRON TECHNOLOGY	95,275	47.19	4,496,027.25
NVIDIA CORP	51,023	207.78	10,601,558.94
NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	117.62	2,949,674.36
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.63	778,593.48
QORVO INC	10,609	104.04	1,103,760.36
QUALCOMM	107,281	94.03	10,087,632.43
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	100.44	1,457,384.40
TEXAS INSTRUMENTS	82,668	120.11	9,929,253.48
XILINX INC	21,744	95.50	2,076,552.00

	アメリカドル 小計	26,410,462		2,307,385,497.66 (251,874,200,924)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	12.67	363,743.03
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	36.94	3,816,936.32
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	12.11	1,170,625.26
	ENBRIDGE	179,723	49.55	8,905,274.65
	ENCANA CORP	117,430	6.40	751,552.00
	HUSKY ENERGY INC	31,439	10.54	331,367.06
	IMPERIAL OIL	24,763	35.31	874,381.53
	INTER PIPELINE LTD	35,455	21.70	769,373.50
	KEYERA CORP	18,607	32.33	601,564.31
	PEMBINA PIPELINE CORP	46,962	47.01	2,207,683.62
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	13.36	245,156.00
	SUNCOR ENERGY	140,329	42.66	5,986,435.14
	TC ENERGY CORP	82,858	66.49	5,509,228.42
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	12.79	255,352.35
	VERMILION ENERGY INC	10,067	19.85	199,829.95
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	76.28	1,636,892.52
	BARRICK GOLD CORP	160,347	21.62	3,466,702.14
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	57.11	750,368.29
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	12.61	717,509.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	126.52	2,120,222.16
	KINROSS GOLD CORP	107,615	5.52	594,034.80
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	59.80	1,018,573.40
	LUNDIN MINING CORP	62,243	7.55	469,934.65
	METHANEX CORP	7,099	54.23	384,978.77
	NUTRIEN LTD	51,428	64.90	3,337,677.20
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.45	1,025,448.65
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	57.56	249,062.12
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	34.77	1,280,857.26
	BOMBARDIER B	151,366	2.02	305,759.32
	CAE INC	25,999	34.32	892,285.68
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	26.39	388,276.07
	WSP GLOBAL INC	9,471	86.14	815,831.94
THOMSON REUTERS CORP	18,789	89.01	1,672,408.89	
AIR CANADA	11,591	48.63	563,670.33	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,156	125.10	8,025,915.60	
CP RAILWAY LIMITED	12,636	311.18	3,932,070.48	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	74.74	2,091,075.72	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	36.01	635,900.59	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	88.01	1,880,333.65	
STARS GROUP INC/THE	20,487	28.80	590,025.60	

QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.74	482,448.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	26.73	1,205,175.51
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	153.61	830,876.49
DOLLARAMA INC	26,700	46.75	1,248,225.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	79,408	39.93	3,170,761.44
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.70	529,279.10
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	70.60	1,102,630.80
METRO INC	22,050	55.91	1,232,815.50
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	103.90	715,143.70
SAPUTO INC	20,412	40.39	824,440.68
AURORA CANNABIS INC	53,000	5.03	266,590.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	28.32	464,448.00
CRONOS GROUP INC	15,900	11.26	179,034.00
BANK MONTREAL	57,133	100.68	5,752,150.44
BANK NOVA SCOTIA	108,575	76.50	8,305,987.50
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	114.98	4,368,090.20
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	69.39	1,958,740.92
ROYAL BANK OF CANADA	126,779	108.44	13,747,914.76
TORONTO-DOMINION BANK	161,692	76.55	12,377,522.60
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	75,671	74.59	5,644,299.89
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.84	389,103.64
IGM FINANCIAL INC	7,685	39.70	305,094.50
ONEX CORP	6,603	79.28	523,485.84
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	610.60	1,407,433.00
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	32.71	778,105.48
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	67.69	557,088.70
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	137.21	1,789,630.03
MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	26.13	4,402,173.36
POWER CORP OF CANADA	29,774	32.08	955,149.92
POWER FINANCIAL CORP	20,740	32.48	673,635.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,901	61.19	3,298,202.19
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.45	267,374.25
BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.34	289,196.00
CGI INC - CL A	21,192	106.16	2,249,742.72
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,277.06	2,172,279.06
OPEN TEXT CORP	24,643	54.97	1,354,625.71
SHOPIFY INC - CLASS A	8,973	393.75	3,533,118.75
BCE INC	12,539	63.21	792,590.19
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	62.45	2,004,332.75
TELUS CORP	16,454	49.87	820,560.98
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	19.92	485,948.40
ATCO LTD -CLASS I	5,241	49.56	259,743.96

	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.66	399,125.84	
	EMERA INC	20,611	52.62	1,084,550.82	
	FORTIS INC	38,447	52.72	2,026,925.84	
	HYDRO ONE LTD	32,299	23.63	763,225.37	
	カナダドル 小計	3,539,103		168,823,335.00 (13,931,301,604)	
ユーロ	ENI	217,599	14.19	3,087,729.81	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	14.94	595,612.98	
	NESTE OIL OYJ	36,438	31.69	1,154,720.22	
	OMV AG	12,139	53.98	655,263.22	
	REPSOL SA	129,100	15.04	1,941,664.00	
	TENARIS SA	40,648	10.02	407,292.96	
	TOTAL SA	211,151	49.29	10,408,688.54	
	VOPAK	6,360	48.46	308,205.60	
	AIR LIQUIDE	42,062	119.55	5,028,512.10	
	AKZO NOBEL	19,742	87.10	1,719,528.20	
	ARCELORMITTAL	53,985	15.48	835,795.77	
	ARKEMA	5,335	97.24	518,775.40	
	BASF SE	81,730	70.98	5,801,195.40	
	COVESTRO AG	15,098	46.69	704,925.62	
	CRH PLC	71,124	33.14	2,357,049.36	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	26.22	352,763.88	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	40.86	235,435.32	
	HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	65.10	965,628.30	
	IMERYS SA	3,000	36.80	110,400.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	116.00	1,767,144.00	
	LANXESS	7,293	62.20	453,624.60	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	31.32	612,775.80	
	SOLVAY SA	6,906	99.72	688,666.32	
	STORA ENSO OYJ R	47,237	12.69	599,673.71	
	SYMRISE AG	11,581	85.74	992,954.94	
	THYSSEN KRUPP	33,044	13.60	449,563.62	
	UMICORE	17,605	39.33	692,404.65	
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	30.75	1,352,692.50	
	VOESTALPINE AG	8,140	24.93	202,930.20	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	35.63	772,992.85	
	AIRBUS SE	51,774	132.96	6,883,871.04	
	ALSTOM	18,760	38.55	723,198.00	
	ANDRITZ AG	5,242	42.06	220,478.52	
	BOUYGUES ORD	19,381	38.17	739,772.77	
	BRENTAG AG	15,254	48.25	736,005.50	
	CNH INDUSTRIAL NV	93,026	10.09	939,097.47	

DASSAULT AVIATION SA	213	1,274.00	271,362.00
EIFFAGE	6,079	97.58	593,188.82
FERROVIAL SA	45,344	26.11	1,183,931.84
FERROVIAL SA-RTS	45,344	0.41	18,817.76
GEA GROUP AG	13,382	28.65	383,394.30
HOCHTIEF AG	2,222	113.40	251,974.80
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	46.50	549,304.50
KION GROUP AG	5,887	59.28	348,981.36
KNORR-BREMSE AG	4,123	90.18	371,812.14
KONE OYJ-B	30,120	56.80	1,710,816.00
LEGRAND SA	24,584	70.72	1,738,580.48
LEONARDO SPA	35,425	11.25	398,708.37
METSO OYJ	9,561	35.24	336,929.64
MTU AERO ENGINES AG	4,753	240.10	1,141,195.30
PRYSMIAN SPA	21,155	21.30	450,601.50
SAFRAN SA	29,221	145.50	4,251,655.50
SAINT-GOBAIN	45,357	37.45	1,698,846.43
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,188	87.46	4,301,982.48
SIEMENS	67,838	113.80	7,719,964.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.69	221,960.79
THALES SA	9,665	86.70	837,955.50
VINCI S.A.	45,508	100.15	4,557,626.20
WARTSILA OYJ	34,386	9.69	333,475.42
BUREAU VERITAS SA	25,073	22.79	571,413.67
EDENRED	22,756	46.32	1,054,057.92
RANDSTAD NV	9,588	51.44	493,206.72
SOCIETE BIC SA	2,424	66.95	162,286.80
TELEPERFORMANCE	5,057	211.00	1,067,027.00
WOLTERS KLUWER	25,709	63.70	1,637,663.30
ADP	2,382	172.20	410,180.40
AENA SME SA	5,610	167.50	939,675.00
ATLANTIA SPA	42,039	22.80	958,489.20
BOLLORE	61,805	4.03	249,074.15
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	17.42	405,514.60
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	32.74	2,782,866.57
FRAPORT AG	3,561	74.30	264,582.30
GETLINK	36,478	15.00	547,170.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	75.04	2,172,107.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	59.15	295,217.65
CONTINENTAL AG	9,928	131.40	1,304,539.20
DAIMLER AG	81,382	53.45	4,349,867.90
FAURECIA	5,945	49.16	292,256.20

FERRARI NV	11,268	149.60	1,685,692.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	14.63	1,410,410.28
MICHELIN	14,695	116.15	1,706,824.25
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	27.40	282,000.80
PEUGEOT SA	52,883	24.12	1,275,537.96
PIRELLI & C SPA	39,097	5.44	213,000.45
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	68.96	967,370.88
RENAULT SA	17,362	46.74	811,586.69
VALEO SA	19,350	35.64	689,634.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	181.68	2,906,698.32
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	180.85	469,124.90
ADIDAS AG	16,091	272.00	4,376,752.00
ESSILORLUXOTTICA	24,247	135.05	3,274,557.35
HERMES INTERNATIONAL	2,899	648.60	1,880,291.40
HUGO BOSS AG	4,852	39.50	191,654.00
KERING	6,807	519.60	3,536,917.20
LVMH	24,557	403.00	9,896,471.00
MONCLER SPA	15,736	37.64	592,303.04
PUMA SE	7,720	66.70	514,924.00
SEB SA	2,075	139.00	288,425.00
ACCOR	17,931	39.71	712,040.01
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	93.86	670,441.98
SODEXO	8,135	104.05	846,446.75
AXEL SPRINGER SE-TEND	3,827	63.00	241,101.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	16.66	199,520.16
JC DECAUX SA	4,674	25.80	120,589.20
PUBLICIS GROUPE	17,601	40.13	706,328.13
RTL GROUP	3,513	45.78	160,825.14
SES	31,369	16.89	529,979.25
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.44	217,113.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	50.70	346,281.00
VIVENDI	77,307	24.88	1,923,398.16
DELIVERY HERO SE	8,671	44.13	382,651.23
INDITEX	93,820	27.52	2,581,926.40
PROSUS	41,700	63.17	2,634,189.00
ZALANDO SE	13,985	37.39	522,899.15
CARREFOUR	53,759	15.55	835,952.45
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	48.36	178,303.32
COLRUYT SA	4,160	48.68	202,508.80
JERONIMO MARTINS	20,234	15.41	311,907.11
KONINKLIJKE AHOLD NV	107,149	24.16	2,588,719.84
METRO AG	13,712	14.89	204,240.24

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,662	71.10	4,810,768.20
DANONE (GROUPE)	55,084	73.90	4,070,707.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.27	351,690.02
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	85.25	912,260.25
HEINEKEN NV	22,649	91.00	2,061,059.00
KERRY GROUP PLC-A	14,641	114.70	1,679,322.70
PERNOD-RICARD	18,169	167.40	3,041,490.60
REMY COINTREAU	1,575	122.00	192,150.00
BEIERSDORF AG	9,190	106.75	981,032.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	88.60	763,554.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	95.06	1,495,864.16
LOREAL	22,456	264.30	5,935,120.80
UNILEVER NV	129,135	54.36	7,019,778.60
BIOMERIEUX	3,246	74.70	242,476.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	101.80	349,174.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	68.10	1,225,527.60
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	48.40	1,778,554.80
KONINKLIJKE PHILIPS	82,897	39.93	3,310,077.21
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	182.00	590,772.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	42.20	527,500.00
BAYER	82,883	70.63	5,854,026.29
EUROFINS SCIENTIFIC	971	455.40	442,193.40
GRIFOLS SA	27,685	28.75	795,943.75
IPSEN	2,722	100.00	272,200.00
MERCK KGAA	12,078	109.55	1,323,144.90
ORION OYJ-CLASS B	7,975	40.66	324,263.50
QIAGEN N.V.	21,801	28.60	623,508.60
RECORDATI SPA	7,493	37.48	280,837.64
SANOFI	99,497	83.00	8,258,251.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	136.70	410,646.80
UCB (GROUPE)	10,465	73.48	768,968.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	17.30	574,169.70
AIB GROUP PLC	70,200	2.87	201,614.40
BANCO BILBAO VIZCAYA	600,761	4.95	2,978,573.03
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.04	460,679.44
BANCO SANTANDER SA	1,493,926	3.76	5,620,149.61
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	4.47	375,480.00
BANKIA SA	110,053	1.81	199,471.06
BANKINTER SA	58,881	6.40	377,191.68
BNP PARIBAS	100,335	50.71	5,087,987.85
CAIXABANK	286,347	2.78	797,476.39
COMMERZBANK AG	80,494	5.58	449,237.01

CREDIT AGRICOLE SA	107,463	12.28	1,319,645.64
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	33.56	924,913.60
FINECOBANK SPA	53,120	11.01	584,851.20
ING GROEP NV-CVA	349,585	10.74	3,756,640.41
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.34	3,014,960.68
KBC GROEP NV	21,492	66.16	1,421,910.72
MEDIOBANCA	53,990	10.43	563,385.65
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	23.14	289,018.60
SOCIETE GENERALE	70,347	28.39	1,997,151.33
UNICREDIT SPA	172,440	12.61	2,174,468.40
AMUNDI SA	4,764	69.85	332,765.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.90	1,112,137.55
DEUTSCHE BOERSE	17,199	135.40	2,328,744.60
EURAZEO SA	3,357	62.35	209,308.95
EXOR NV	10,345	70.64	730,770.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	93.06	581,345.82
NATIXIS	69,996	4.02	281,523.91
WENDEL	2,023	123.90	250,649.70
AEGON	166,267	4.21	700,150.33
AGEAS	16,065	52.88	849,517.20
ALLIANZ SE-REG	37,563	219.00	8,226,297.00
ASSICURAZIONI GENERALI	100,566	19.18	1,928,855.88
AXA	173,280	25.38	4,397,846.40
CNP ASSURANCES	11,830	18.24	215,779.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	165.70	959,237.30
MAPFRE SA	90,939	2.56	233,349.47
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	253.40	3,209,311.00
NN GROUP NV	27,631	35.53	981,729.43
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.84	499,019.40
SAMPO OYJ-A SHS	38,075	37.37	1,422,862.75
SCOR SE	13,354	38.04	507,986.16
AROUNDTOWN SA	79,006	7.66	605,501.98
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	33.18	962,518.62
VONOVIA SE	43,528	46.28	2,014,475.84
ADYEN NV	884	635.40	561,693.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,633	71.46	2,832,174.18
ATOS SE	7,634	72.60	554,228.40
CAPGEMINI SA	13,238	105.50	1,396,609.00
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	136.65	1,544,145.00
SAP SE	86,843	123.26	10,704,268.18
WIRECARD AG	9,864	116.05	1,144,717.20
WORLDLINE SA	7,022	55.10	386,912.20

	INGENICO GROUP	4,681	97.80	457,801.80
	NOKIA OYJ	489,813	3.22	1,580,136.73
	1&1 DRILLISCH AG	3,773	24.12	91,004.76
	CELLNEX TELECOM SA	21,365	37.33	797,555.45
	DEUTSCHE TELEKOM	297,100	15.44	4,587,224.00
	ELISA A	11,722	48.75	571,447.50
	ILIAD SA	2,053	94.84	194,706.52
	KPN (KON.)	308,450	2.78	859,033.25
	ORANGE	170,925	14.28	2,441,663.62
	PROXIMUS	13,141	27.61	362,823.01
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.53	458,672.97
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.53	250,306.26
	TELEFONICA	400,024	6.85	2,742,564.54
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.79	187,306.69
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	29.67	282,250.71
	E.ON SE	201,539	8.87	1,788,054.00
	ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	9.18	456,775.42
	ENAGAS	18,299	23.04	421,608.96
	ENDESA	24,774	23.91	592,346.34
	ENEL	724,150	6.86	4,972,013.90
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.68	869,339.40
	ENGIE	156,560	14.18	2,220,803.60
	FORTUM OYJ	38,328	21.18	811,787.04
	IBERDROLA SA	534,398	8.96	4,792,481.26
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	23.93	553,500.90
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.78	704,855.12
	RWE STAMM	47,044	26.18	1,231,611.92
	SNAM SPA	163,694	4.58	750,864.37
	SUEZ	28,043	13.33	373,813.19
	TERNA SPA	130,230	5.95	774,868.50
	UNIPER SE	20,192	28.06	566,587.52
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	22.80	1,042,917.60
	VERBUND AG	7,463	44.86	334,790.18
	ASML HOLDING NV	37,644	242.05	9,111,730.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	18.83	2,020,236.34
	STMICROELECTRONICS	57,598	21.64	1,246,420.72
	ユーロ 小計	16,978,760		361,765,011.14 (43,502,242,589)
イギリスポンド	BP PLC	1,796,256	5.08	9,135,758.01
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	384,364	23.41	8,997,961.24
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	331,137	23.29	7,713,836.41
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	3.78	204,120.00

ANGLO AMERICAN PLC	96,044	20.64	1,982,828.38
ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.32	334,464.76
BHP GROUP PLC	189,010	17.26	3,263,824.68
CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	47.80	477,952.20
EVRAZ PLC	43,000	3.70	159,444.00
FRESNILLO PLC	17,743	6.73	119,481.36
GLENCORE PLC	941,686	2.54	2,395,649.18
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	32.19	542,337.12
MONDI PLC	42,009	17.09	717,933.81
RIO TINTO PLC REG	101,122	42.06	4,253,191.32
ASHTED GROUP PLC	42,021	23.59	991,275.39
BAE SYSTEMS PLC	274,735	5.79	1,592,364.06
BUNZL PLC	27,712	20.90	579,180.80
DCC PLC	9,127	74.96	684,159.92
FERGUSON PLC	19,208	67.42	1,295,003.36
MEGGITT PLC	66,268	6.39	423,850.12
MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	2.25	920,318.95
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.76	1,157,626.20
SMITHS GROUP PLC	37,146	16.59	616,437.87
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	84.40	529,778.80
WEIR GROUP PLC/THE	18,586	15.02	279,254.65
EXPERIAN PLC	77,938	23.88	1,861,159.44
G4S PLC	132,555	2.06	273,063.30
INTERTEK GROUP PLC	15,404	52.50	808,710.00
RELX PLC	174,568	18.50	3,229,508.00
RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.37	690,432.49
EASYJET PLC	11,633	13.03	151,636.15
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.26	604,667.69
BURBERRY GROUP PLC	35,328	20.44	722,104.32
PERSIMMON PLC	26,389	23.58	622,252.62
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.67	454,060.08
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	44.50	471,655.50
CARNIVAL PLC	13,721	32.37	444,148.77
COMPASS GROUP PLC	136,301	20.22	2,756,006.22
GVC HOLDINGS PLC	42,500	8.03	341,360.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	47.84	767,481.64
TUI AG-DI	37,945	10.34	392,351.30
WHITBREAD PLC	11,623	42.44	493,280.12
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.34	427,413.42
INFORMA PLC	117,961	8.00	943,688.00
ITV PLC	295,435	1.34	396,621.48
PEARSON	66,305	7.06	468,113.30

WPP PLC	113,065	10.07	1,138,564.55
KINGFISHER PLC	170,994	2.17	372,424.93
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.86	251,589.18
NEXT PLC	11,202	66.00	739,332.00
OCADO GROUP PLC	38,762	11.89	461,073.99
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.98	416,535.64
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.01	298,153.35
TESCO	856,393	2.37	2,037,358.94
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	24.43	704,683.35
BRITISH AMERICAN TOBACCO	203,330	28.85	5,867,087.15
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.66	424,933.60
DIAGEO	210,292	30.90	6,498,022.80
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	17.74	1,476,766.30
RECKITT BENCKISER PLC	63,097	59.10	3,729,032.70
UNILEVER PLC	98,655	46.75	4,612,121.25
NMC HEALTH PLC	9,509	23.18	220,418.62
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	16.50	1,238,716.75
ASTRAZENECA	115,877	72.77	8,432,369.29
GLAXOSMITHKLINE	441,129	17.37	7,662,410.73
BARCLAYS	1,471,691	1.66	2,449,482.50
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,784,402	5.95	10,627,898.31
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,344,250	0.56	3,570,543.90
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	2.13	842,466.12
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	7.26	1,849,557.60
3I GROUP PLC	79,251	11.39	902,668.89
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	17.52	473,543.02
INVESTEC PLC	54,280	4.40	239,157.68
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,508	69.04	1,968,192.32
M&G PLC	229,107	2.18	499,453.26
SCHRODERS PLC	8,614	32.34	278,576.76
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	10.65	476,811.25
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	3.10	600,789.55
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.80	338,104.00
AVIVA PIC	348,023	4.30	1,498,935.06
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.75	313,512.25
LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.69	1,482,179.53
PRUDENTIAL	229,107	13.68	3,134,183.76
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.47	473,535.93
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	10.77	313,030.05
SAGE GROUP PLC	89,321	7.33	655,437.49
HALMA PLC	32,374	19.07	617,372.18
BT GROUP PLC	730,298	1.87	1,366,679.67

	VODAFONE GROUP PLC	2,384,174	1.62	3,868,083.89	
	CENTRICA PLC	440,558	0.72	321,343.00	
	NATIONAL GRID PLC	291,880	8.89	2,597,440.12	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	22.13	400,818.56	
	SSE PLC	93,277	12.50	1,165,962.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.29	488,433.66	
	イギリスポンド 小計	26,402,476		157,083,534.36	(21,936,715,573)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	20.48	356,311.04	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	628.00	422,016.00	
	GIVAUDAN-REG	813	2,864.00	2,328,432.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,261	51.84	2,294,490.24	
	SIKA AG-BR	11,762	173.30	2,038,354.60	
	ABB LTD	165,849	21.55	3,574,045.95	
	GEBERIT AG-REG	3,423	512.40	1,753,945.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	238.40	352,593.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	245.90	926,551.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	60.22	796,349.28	
	SGS SA	437	2,528.00	1,104,736.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	162.60	823,894.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	74.68	3,341,481.92	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	277.50	689,032.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	53.10	209,107.80	
	DUFREY AG-REG	3,825	97.84	374,238.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	2,056.00	328,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	82,900.00	663,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,380.00	767,520.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	269,186	104.12	28,027,646.32	
	ALCON INC	35,606	58.00	2,065,148.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	229.30	1,170,347.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	887.80	794,581.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	344.30	2,240,360.10	
	NOVARTIS	189,231	87.50	16,557,712.50	
	ROCHE HOLDING GENUSS	61,860	297.40	18,397,164.00	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	159.50	574,359.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	13.04	2,855,054.79	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	47.51	1,006,119.27	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	80.40	273,118.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	774.00	1,244,592.00	
	UBS GROUP AG	345,678	12.35	4,269,123.30	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	185.30	718,408.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	499.00	1,471,551.00	

	SWISS RE LTD	26,239	106.65	2,798,389.35	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,483	390.20	5,261,066.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	102.50	643,392.50	
	TEMENOS AG - REG	5,252	143.35	752,874.20	
	SWISSCOM	2,441	513.60	1,253,697.60	
	スイスフラン 小計	1,546,645		115,519,965.66 (12,637,884,243)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	311.00	4,413,401.00	
	BOLIDEN AB	23,903	272.35	6,509,982.05	
	ALFA LAVAL AB	25,639	237.60	6,091,826.40	
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	226.50	19,474,470.00	
	ATLAS COPCO A	59,675	353.20	21,077,210.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	309.00	11,290,242.00	
	EPIROC AB-A	53,833	109.85	5,913,555.05	
	EPIROC AB-B	29,972	106.05	3,178,530.60	
	SANDVIK AB	100,730	179.60	18,091,108.00	
	SKANSKA B	28,530	215.90	6,159,627.00	
	SKF AB-B	28,335	184.20	5,219,307.00	
	VOLVO B	125,906	150.55	18,955,148.30	
	SECURITAS B	22,844	162.25	3,706,439.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	256.10	4,653,337.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	76.90	2,976,952.80	
	HENNES & MAURITZ B	69,119	193.62	13,382,820.78	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	426.20	3,392,125.80	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	446.60	6,765,543.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	304.30	15,849,465.50	
	NORDEA BANK ABP	295,938	72.66	21,502,855.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	94.96	13,171,901.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	95.84	13,071,234.24	
	SWEDBANK AB-A	80,216	138.85	11,137,991.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	218.60	2,796,331.20	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	509.20	20,591,029.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	263.20	4,764,972.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	372.40	2,711,072.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	87.14	23,419,310.70	
HEXAGON AB-B SHS	21,504	533.00	11,461,632.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	430.00	2,663,420.00		
TELE2 AB-B SHS	50,012	138.55	6,929,162.60		
TELIA CO AB	235,437	42.41	9,984,883.17		
	スウェーデンクローナ 小計	2,149,036		321,306,888.27 (3,614,702,493)	
	AKER BP ASA	10,311	265.40	2,736,539.40	

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,158	178.60	16,459,418.80
	NORSK HYDRO	106,150	35.53	3,771,509.50
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	367.70	6,791,419.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	243.40	1,696,741.40
	MOWI ASA	40,968	225.50	9,238,284.00
	ORKLA	69,804	87.30	6,093,889.20
	DNB ASA	80,217	169.00	13,556,673.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	169.95	3,156,651.30
	TELENOR ASA	60,821	164.45	10,002,013.45
ノルウェークローネ 小計		504,444		73,503,139.05 (876,892,448)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	529.00	4,802,791.00
	NOVOZYMES A/S	17,687	318.00	5,624,466.00
	VESTAS WIND SYSEMS	17,605	624.40	10,992,562.00
	ISS A/S	14,253	151.30	2,156,478.90
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,535.00	2,551,965.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,102.00	4,623,816.00
	DSV PANALPINA A S	18,714	727.60	13,616,306.40
	PANDORA A/S	8,431	290.40	2,448,362.40
	CARLSBERG AS-B	9,692	956.00	9,265,552.00
	COLOPLAST-B	10,223	790.80	8,084,348.40
	DEMANT A/S	7,420	184.75	1,370,845.00
	GENMAB A/S	5,595	1,498.00	8,381,310.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	242.50	1,181,217.50
	NOVO NORDISK A/S-B	156,652	389.00	60,937,628.00
	DANSKE BANK A/S	59,378	95.72	5,683,662.16
	TRYG A/S	9,828	187.00	1,837,836.00
ORSTED A/S	15,908	595.00	9,465,260.00	
デンマーククローネ 小計		366,143		153,024,406.76 (2,462,162,704)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	27.96	576,786.84
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.38	876,603.78
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	8.23	1,362,846.85
	SANTOS	156,437	8.11	1,268,704.07
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	23.09	295,852.17
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	33.63	2,811,131.70
	WORLEY LTD	34,596	14.30	494,722.80
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.42	412,508.36
	BHP GROUP LTD	261,560	37.30	9,756,188.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	14.12	696,511.36
	BORAL LIMITED	81,732	4.98	407,025.36
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	9.58	1,290,196.08

INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.63	546,674.37
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	27.66	1,033,460.58
NEWCREST MINING LIMITED	66,006	29.98	1,978,859.88
ORICA LTD	29,211	24.18	706,321.98
RIO TINTO LTD	32,522	95.23	3,097,070.06
SOUTH32 LTD	408,172	2.74	1,118,391.28
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	34.38	316,983.60
BRAMBLES LTD	129,297	12.03	1,555,442.91
SEEK LTD	26,358	22.48	592,527.84
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.72	912,265.64
TRANSURBAN GROUP	229,164	14.72	3,373,294.08
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	31.65	1,669,600.80
CROWN RESORTS LTD	30,328	12.48	378,493.44
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	39.71	129,573.73
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.79	799,192.34
REA GROUP LTD	3,593	102.85	369,540.05
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.19	189,232.97
WESFARMERS LTD	97,071	40.81	3,961,467.51
COLES GROUP LTD	93,277	15.25	1,422,474.25
WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	37.68	4,060,057.68
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.49	483,903.70
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.77	1,037,323.75
COCHLEAR LIMITED	4,811	213.82	1,028,688.02
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	71.65	877,569.20
SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	29.15	1,136,529.35
CSL LIMITED	40,233	261.34	10,514,492.22
AUST AND NZ BANKING GROUP	252,665	26.25	6,632,456.25
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	8.75	311,500.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.79	457,862.86
COMMONWEALTH BANK OF AUST	156,654	79.17	12,402,297.18
NATIONAL AUSTRALIA BANK	250,533	28.47	7,132,674.51
WESTPAC BANKING	306,284	27.42	8,398,307.28
AMP LTD	244,230	1.94	475,027.35
ASX LTD	15,814	80.40	1,271,445.60
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	8.07	355,628.76
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,283	137.74	4,033,440.42
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	49.33	538,288.96
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.87	1,647,623.85
MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.21	688,583.52
QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.91	1,460,030.63
SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	13.34	1,592,182.36
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.64	738,416.64

	TELSTRA CORP	342,339	3.51	1,201,609.89	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.60	207,735.00	
	AGL ENERGY LTD	51,344	19.92	1,022,772.48	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.85	222,425.50	
	オーストラリアドル 小計	6,002,979		114,328,817.64 (8,554,082,135)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	5.11	391,650.84	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.45	802,777.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	12.39	828,321.06	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	20.49	932,458.92	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.59	493,548.03	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.44	646,520.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.65	514,029.60	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,609,306.75 (318,917,934)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	75.15	17,584,799.40	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	12.12	1,975,560.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	62.65	7,455,350.00	
	MTR CORP	133,000	45.05	5,991,650.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	22.70	1,554,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	55.25	10,331,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.28	825,216.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	40.60	8,233,680.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.31	814,380.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.58	1,132,560.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	17.48	2,461,184.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	104,500	28.55	2,983,475.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	33.70	2,156,800.00	
	WH GROUP LTD	829,500	8.73	7,241,535.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	19.04	2,078,406.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	28.20	8,742,000.00	
	HANG SENG BANK	68,000	170.00	11,560,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	254.00	25,958,800.00	
	AIA GROUP LTD	1,068,000	82.40	88,003,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	55.40	11,966,178.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.18	2,972,140.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	39.50	4,946,506.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	31.25	1,843,750.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	26.25	1,693,125.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.50	5,652,250.00		
SINO LAND CO	315,400	12.14	3,828,956.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	120.70	16,475,550.00		

	SWIRE PACIFIC A	40,500	76.65	3,104,325.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	25.05	2,409,810.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	19.22	1,749,020.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	46.45	4,412,750.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	49.75	3,233,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.72	1,685,040.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	56.70	2,835,000.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	83.75	11,808,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.42	13,839,511.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	56.15	6,232,650.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	103.60	2,455,320.00	
	香港ドル 小計	7,749,684		310,229,677.88 (4,324,601,709)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.92	777,116.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.27	242,890.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	4.12	449,080.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.98	195,902.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.39	397,935.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.32	403,863.56	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.13	262,656.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.94	399,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.34	297,414.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	32.27	319,473.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.21	90,085.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.88	692,968.00	
	DBS GROUP	156,300	26.61	4,159,143.00	
	OCBC BANK	290,600	11.13	3,234,378.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	115,000	26.95	3,099,250.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	9.16	570,668.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.71	829,185.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	10.88	339,456.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.95	377,625.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.60	426,620.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	3.35	2,520,014.05	
	シンガポールドル 小計	3,653,176		20,085,221.61 (1,611,839,034)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	16.26	1,101,712.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	564.40	1,211,202.40	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	28.73	2,824,446.30	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	26.02	3,659,843.10	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.64	1,556,180.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	86.65	1,083,384.95	

	AZRIELI GROUP	4,323	261.00	1,128,303.00	
	NICE LTD	4,894	557.00	2,725,958.00	
	イスラエルシェケル 小計	430,087		15,291,030.31 (477,538,876)	
	合 計	96,299,261		366,123,082,266 (366,123,082,266)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	102,205	1,138,563.70	
		LENDLEASE GROUP	44,009	848,053.43	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	790,768.00	
		オーストラリアドル 小計	236,074	2,777,385.13 (207,803,955)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,726,515.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,582,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,309,015.00 (87,947,669)	
	投資信託受益証券合計	831,574	295,751,624 (295,751,624)		
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	800,760.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,510,472.74	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,995	8,027,900.65	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,142,982.24	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,833	2,693,005.05	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,880,040.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	967,734.56	
		CROWN CASTLE INTL CORP	37,198	4,865,870.38	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,079,375.66	
		DUKE REALTY CORP	29,929	1,035,244.11	
		EQUINIX INC	7,467	3,959,824.77	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,570	973,567.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	33,874	2,844,738.52	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,792,209.72	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,163,981.79	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	792,692.92	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,014	1,381,761.66	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,162,563.53	
		INVITATION HOMES INC	46,500	1,372,215.00	
		IRON MOUNTAIN INC	24,669	802,729.26	

	KIMCO REALTY CORP	35,407	738,235.95	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,322	958,101.40	
	MACERICH CO/THE	10,128	280,950.72	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,371,655.63	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	782,846.40	
	PROLOGIS INC	56,738	4,940,177.66	
	PUBLIC STORAGE	13,426	2,837,585.10	
	REALTY INCOME CORP	27,116	2,069,493.12	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	922,762.86	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,160	2,321,153.60	
	SIMON PROPERTY GROUP	27,453	4,241,213.97	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	693,762.00	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,132,737.00	
	UDR INC	24,799	1,174,728.63	
	VENTAS INC	30,413	1,810,790.02	
	VEREIT INC	105,798	993,443.22	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	1,012,200.30	
	WELLTOWER INC	34,628	2,869,968.64	
	WP CAREY INC	14,644	1,236,832.24	
	アメリカドル 小計	1,075,590	73,638,309.62	(8,038,357,878)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	207,820.90	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	408,936.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	177,489.12	
	カナダドル 小計	30,576	794,246.02	(65,541,181)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	361,020.20	
	GECINA SA	4,459	675,092.60	
	ICADE	2,845	246,946.00	
	KLEPIERRE	17,225	569,458.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,699,984.00	
	ユーロ 小計	39,995	3,552,501.30	(427,188,281)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	455,042.22	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	516,411.00	
	SEGRO PLC	94,451	789,610.36	
	イギリスポンド 小計	232,415	1,761,063.58	(245,932,528)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,081,094.10	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,989,042.78	
	GPT GROUP	167,884	987,157.92	
	MIRVAC GROUP	306,089	976,423.91	

	SCENTRE GROUP	486,663	1,883,385.81	
	STOCKLAND	207,412	1,010,096.44	
	VICINITY CENTERS	291,115	759,810.15	
	オーストラリアドル 小計	1,693,524	8,687,011.11 (649,962,171)	
香港ドル	LINK REIT	179,500	15,275,450.00	
	香港ドル 小計	179,500	15,275,450.00 (212,939,773)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	570,775.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	490,860.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	498,747.00	
	SUNTEC REIT	173,000	316,590.00	
	シンガポールドル 小計	813,800	1,876,972.00 (150,627,003)	
	投資証券合計	4,065,400	9,790,548,815 (9,790,548,815)	
	合計		10,086,300,439 (10,086,300,439)	

(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 610銘柄	96.9%			67.0%
	投資証券 39銘柄			3.1%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	99.0%			11.6%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	98.9%			5.8%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	90.9%			2.3%

	投資信託受 3銘柄 益証券		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			6.9%	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	93.5%			1.1%
	投資信託受 2銘柄 益証券		1.9%		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	91.5%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,550,610,787
コール・ローン	55,345,775
株式	59,921,143,911
投資信託受益証券	201,304,191
投資証券	162,780,354
派生商品評価勘定	97,077,416
未収入金	439,381
未収配当金	45,372,200
差入委託証拠金	443,688,771
流動資産合計	62,477,762,786
資産合計	62,477,762,786
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	120,000
前受金	96,961,916
未払金	1,485
未払解約金	157,719,621
未払利息	123
流動負債合計	254,803,145
負債合計	254,803,145

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	21,641,099,794
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	40,581,859,847
元本等合計	62,222,959,641
純資産合計	62,222,959,641
負債純資産合計	62,477,762,786

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2019年11月11日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年11月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,641,099,794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 2.8752円 (1万口当たり純資産額) (28,752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11月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2019年11月11日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	19,276,223,190円
期中追加設定元本額	2,904,991,344円
期中一部解約元本額	540,114,740円
期末元本額	21,641,099,794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	7,226,018,612円
世界経済インデックスファンド	3,346,340,769円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,234,127,011円
DC 世界経済インデックスファンド	2,974,985,965円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	210,909,297円
分散投資コア戦略ファンドA	343,089,679円
分散投資コア戦略ファンドS	1,121,980,051円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	429,925,000円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	462,186,782円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	352,022,725円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,781,144円
SMT インデックスバランス・オープン	114,889,824円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,807,786円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	219,772,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	32,889,811円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,388,661円
グローバル経済コア	455,493,089円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	18,446,830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

区分	2019年11月11日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	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
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	20,918,752円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	5,049,591,248	
投資信託受益証券	20,145,007	
投資証券	2,138,696	
合計	5,071,874,951	

(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11月11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	1,751,222,769	-	1,848,184,685	96,961,916
	合計	1,751,222,769	-	1,848,184,685	96,961,916

(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11月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	158,259,000	-	158,263,500	4,500

	アメリカドル	158,259,000	-	158,263,500	4,500
	合計	158,259,000	-	158,263,500	4,500

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	523,824	8.27	4,334,119.77	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.88	91,936.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	36,794	94.40	3,473,353.60	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,216	213.40	1,966,694.40	
	ROSNEFT OJSC-GDR	133,544	7.10	948,429.48	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	7.25	1,163,716.51	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	26,141	73.92	1,932,342.72	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	7,348	6.73	49,452.04	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	9.42	146,113.62	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.27	258,521.10	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	28.96	1,925,753.12	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	20.58	319,175.22	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	26,818	12.78	342,734.04	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	56.15	400,012.60	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	14.12	547,474.76	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	37.79	204,141.58	
	51JOB INC-ADR	1,655	81.13	134,270.15	
	DP WORLD PLC	21,152	13.01	275,187.52	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	22.45	672,422.40	
	NIO INC - ADR	53,878	1.98	106,678.44	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	13,921	37.08	516,190.68	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,433	120.43	1,617,736.19	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	38,759	44.59	1,728,263.81	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	43.85	1,460,468.10	
58.COM INC-ADR	9,450	55.25	522,112.50		
AUTOHOME INC-ADR	5,298	73.23	387,972.54		

	BAIDU INC - SPON ADR	26,753	124.56	3,332,353.68
	IQIYI INC-ADR	11,977	19.52	233,791.04
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	38.80	504,283.60
	NETEASE INC-ADR	6,869	299.04	2,054,105.76
	SINA CORP	5,725	42.71	244,514.75
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	14.00	127,022.00
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	54.67	286,962.83
	YY INC-ADR	6,185	65.03	402,210.55
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	137,490	187.16	25,732,628.40
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	42.48	149,019.84
	JD.COM INC-ADR	71,913	33.23	2,389,668.99
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	43.23	766,294.98
	TRIP.COM GROUP LTD	45,465	34.17	1,553,539.05
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	47,488	11.88	564,157.44
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,845	12.08	481,327.60
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	22.40	81,603.20
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	23.60	95,226.00
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	31,254	3.43	107,201.22
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	147,287	5.07	746,745.09
	CREDICORP LTD	6,431	206.75	1,329,609.25
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	8,771	12.41	108,848.11
	SBERBANK-SPONSORED ADR	253,773	15.12	3,838,316.62
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.42	294,253.96
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	33.16	67,016.36
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	1.10	59,875.20
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	42.92	189,062.60
	GLOBANT SA	3,122	99.11	309,421.42
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	9.39	374,229.06
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	6,359	9.04	57,485.36
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	5,650	14.03	79,269.50
	アメリカドル 小計	2,639,853		72,085,316.35 (7,868,833,132)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,455,661	7.29	10,611,768.69
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	381,292	52.82	20,139,843.44
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	236.73	3,432,585.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	43.23	4,186,911.96
	ALFA S.A.B. -A	359,900	17.14	6,168,686.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	67.22	2,520,750.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	321.29	7,487,663.45
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	202.35	6,289,038.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	184.46	3,132,130.80
	ALSEA SAB DE CV	34,300	52.75	1,809,325.00

	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	258,090	44.18	11,402,416.20	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	79.62	2,500,068.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	97.83	1,066,347.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	510,280	56.19	28,672,633.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	106.92	3,600,531.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	177.14	31,732,859.60	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	203.25	5,276,370.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	35.87	4,749,188.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.24	6,952,032.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	247,600	102.95	25,490,420.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	24.69	6,234,225.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,304,240	15.24	50,356,617.60	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	84.38	3,181,126.00	
	メキシコペソ 小計	7,657,055		246,993,535.94 (1,410,333,090)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	59.40	1,092,960.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	292,700	32.91	9,632,757.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	402,440	30.02	12,081,248.80	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	20.48	1,548,288.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	31.25	462,500.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	12.30	774,900.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	15.25	1,326,750.00	
	SUZANO SA	50,679	38.00	1,925,802.00	
	VALE SA	302,478	49.18	14,875,868.04	
	EMBRAER SA	69,700	18.08	1,260,176.00	
	WEG SA	84,872	28.24	2,396,785.28	
	CCR SA	125,600	17.36	2,180,416.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	41.55	2,451,533.10	
	RUMO SA	97,700	23.49	2,294,973.00	
	COGNA EDUCACAO	138,184	9.82	1,356,966.88	
	B2W CIA DIGITAL	26,960	52.08	1,404,076.80	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	19.43	1,238,001.88	
	LOJAS RENNER S.A.	82,907	48.92	4,055,810.44	
	MAGAZINE LUIZA SA	56,800	43.81	2,488,408.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	76,000	27.88	2,118,880.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.87	783,105.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	81.09	1,200,132.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	111.50	2,352,650.00	
	AMBEV SA	462,000	17.30	7,992,600.00	
	BRF SA	52,500	34.45	1,808,625.00	
	JBS SA	118,600	27.59	3,272,174.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	35.93	226,359.00	

	NATURA COSMETICOS SA	41,400	33.58	1,390,212.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	33,600	58.78	1,975,008.00	
	HYPERA SA	35,300	35.14	1,240,442.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	32.03	3,727,074.86	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	383,453	34.24	13,129,430.72	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	47.00	3,811,700.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	466,981	36.27	16,937,400.87	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	443,567	13.76	6,103,481.92	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	48.70	9,277,496.10	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	34.69	2,393,610.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	69,100	35.10	2,425,410.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	56.39	411,647.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,963	15.16	1,303,199.08	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	28.76	1,305,704.00	
	CIELO SA	99,269	7.74	768,342.06	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	54.00	2,613,600.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	12.81	933,849.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	39.55	700,035.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	38.22	921,102.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	98,092	13.09	1,284,024.28	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	53.90	1,870,330.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	45.20	757,100.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13,000	100.25	1,303,250.00	
	ブラジルリアル 小計	5,399,278		161,186,195.11 (4,221,466,449)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,745.00	301,703,850.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,820.00	247,456,300.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	19,800.00	195,168,600.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	32,595	8,300.00	270,538,500.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	3,600.00	255,013,200.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,040.00	143,507,520.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	7,070.00	65,913,610.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,045.00	31,108,540.00	
	BANCO DE CHILE	3,735,628	91.70	342,557,087.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	39,790.00	206,669,260.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	45.70	286,987,819.70	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	4.45	74,533,744.20	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	5,594.90	103,796,584.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	286,233	325.00	93,025,725.00	
	COLBUN SA	475,888	121.30	57,725,214.40	
	ENEL AMERICAS SA	3,990,008	144.00	574,561,152.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	59.84	153,266,875.52	

	チリペソ 小計	34,558,265		3,403,533,583.22 (496,915,903)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,130.00	1,530,504,270.00
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	6,900.00	220,875,900.00
	GRUPO ARGOS SA	17,723	18,300.00	324,330,900.00
	BANCOLOMBIA SA	29,376	42,660.00	1,253,180,160.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	44,820.00	1,715,619,960.00
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,410.00	428,228,280.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	32,820.00	683,312,400.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	28,100.00	352,964,100.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	20,200.00	1,020,322,200.00
	コロンビアペソ 小計	993,967		7,529,338,170.00 (246,209,358)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	21.84	196,560.00
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	18.50	80,623.00
	OPAP SA	17,668	9.70	171,379.60
	JUMBO SA	8,599	18.26	157,017.74
	ALPHA BANK AE	129,138	1.78	229,994.77
	EUROBANK ERGASIAS SA	291,098	0.88	256,166.24
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,130	2.78	148,126.44
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	13.40	271,926.20
	ユーロ 小計	533,284		1,511,793.99 (181,793,227)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	12.10	323,070.00
	イギリスポンド 小計	26,700		323,070.00 (45,116,725)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	127.50	1,479,382.50
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	7.25	846,473.75
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	18.91	450,266.01
	KOC HOLDING AS	62,460	19.85	1,239,831.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.44	191,665.92
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	27.44	269,899.84
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	12.80	796,044.80
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	13,224	67.60	893,942.40
	ARCELIK AS	15,358	18.46	283,508.68
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	47.72	2,043,561.28
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	41,741	20.40	851,516.40
	AKBANK T.A.S.	276,321	7.34	2,028,196.14
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	9.79	2,349,521.68
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	6.15	1,064,023.80
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.60	983,650.80
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	13.13	1,248,610.48

	トルコリラ 小計	1,341,770		17,020,095.48 (322,360,608)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	788.00	5,880,844.00
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	78.30	5,382,968.40
	CEZ AS	13,737	522.50	7,177,582.50
	チェココルナ 小計	89,948		18,441,394.90 (87,043,383)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	3,044.00	100,062,368.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	5,590.00	84,845,020.00
	OTP BANK NYRT	19,549	14,040.00	274,467,960.00
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		459,375,348.00 (165,604,812)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	94.80	1,048,203.60
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	105.50	2,786,677.00
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	5.00	732,485.00
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	20.80	86,756.80
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	96.40	1,265,924.80
	CCC SA	3,138	112.00	351,456.00
	LPP SA	124	8,520.00	1,056,480.00
	CD PROJEKT SA	6,704	260.80	1,748,403.20
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.70	674,507.40
	DINO POLSKA SA	4,430	141.60	627,288.00
	ALIOR BANK SA	8,830	28.46	251,301.80
	BANK MILLENNIUM SA	99,381	5.90	586,347.90
	BANK PEKAO SA	15,510	105.05	1,629,325.50
	M BANK SA	1,663	382.80	636,596.40
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	39.00	2,983,695.00
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	308.80	1,116,312.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	37.97	2,355,810.68
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.33	352,315.14
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	9.52	604,735.90
	ポーランドズロチ 小計	625,871		20,894,622.12 (589,019,397)
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	3.19	312,620.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	11.16	2,142,720.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,557,400	4.70	12,019,780.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	16.14	5,552,160.00
	CNOOC LTD-R	1,712,000	12.70	21,742,400.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.45	296,700.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	3.95	7,805,200.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	8.12	1,153,040.00

ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.56	870,400.00
ANGANG STEEL CO LTD-H	75,400	2.74	206,596.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	49.30	5,423,000.00
BBMG CORPORATION - H	131,000	2.24	293,440.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	4.51	457,765.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	2.72	913,920.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	7.40	2,442,000.00
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	144,000	2.75	396,000.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	9.00	1,890,000.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	3.25	258,700.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.26	768,580.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.03	834,980.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	2.97	867,240.00
MMG LIMITED	168,000	1.86	312,480.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.80	1,006,200.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	2.31	459,690.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	8.61	779,205.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	2.96	2,157,840.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	3.77	467,480.00
BOC AVIATION LTD	32,500	76.60	2,489,500.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	395,000	6.26	2,472,700.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	312,000	5.42	1,691,040.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	31.75	5,064,125.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	9.00	1,723,500.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.94	2,341,560.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	7.20	1,224,000.00
CITIC LTD	585,000	10.42	6,095,700.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	5.56	2,841,438.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	11.12	3,202,560.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	19.08	667,800.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.71	244,530.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.49	418,320.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	15.16	576,080.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	4.73	338,195.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	14.22	604,350.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	13.84	2,931,312.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	9.62	302,221.92
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	30.65	1,909,495.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	6.24	2,402,861.76
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	27.20	3,699,200.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	8.82	1,587,600.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.61	897,980.00

BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	7.94	857,520.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	468,000	4.27	1,998,360.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	13.04	2,158,732.88
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.36	943,360.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	3.16	462,940.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	6.51	679,279.44
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.66	724,880.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	16.96	2,169,557.12
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.51	276,100.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	7.17	630,960.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	5.08	594,360.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	9.32	2,330,000.00
BYD CO LTD-H	68,500	39.45	2,702,325.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	2.31	577,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	8.09	2,151,940.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	24.45	665,040.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	471,000	15.54	7,319,340.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	6.84	2,412,810.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	8.76	2,210,533.44
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	8.05	740,600.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	78.40	8,702,400.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	4.42	857,480.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	23.15	2,685,400.00
LI NING CO LTD	194,000	25.55	4,956,700.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	109.10	7,637,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	11.92	321,840.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	37,000	36.25	1,341,250.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.35	1,957,500.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	31.10	1,001,420.00
TENCENT HOLDINGS LTD	551,700	327.20	180,516,240.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.72	427,649.76
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.12	198,720.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	102,700	94.60	9,715,420.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	28.10	1,180,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	9.08	1,770,600.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.80	288,400.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	30.15	7,748,550.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	41.95	5,956,900.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.40	650,700.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	11.86	2,704,080.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	46,000	47.45	2,182,700.00

UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.86	628,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.71	3,757,600.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	53.95	1,834,300.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	54.10	3,597,650.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	8.26	2,362,360.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	9.23	2,252,120.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.94	1,918,296.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	28.45	2,833,620.00
3SBIO INC	119,000	13.68	1,627,920.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	12.42	1,242,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	20.95	9,469,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	7.23	1,138,725.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.73	619,180.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	19.00	1,558,000.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	6.65	541,975.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	23.50	1,304,250.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.10	353,100.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	726,000	11.80	8,566,800.00
SSY GROUP LTD	114,000	6.79	774,060.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	7.32	270,840.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	27,600	97.95	2,703,420.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	54,500	89.45	4,875,025.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,929,000	3.31	9,694,990.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,726,200	3.31	25,573,722.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.51	5,220,587.25
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.74	4,508,688.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,117,620	6.47	58,991,001.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	685,000	3.75	2,568,750.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	376,423	40.30	15,169,846.90
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.67	3,126,438.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	4.23	638,730.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,262,515	5.86	36,698,337.90
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	5.30	3,869,000.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.70	1,414,400.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.08	1,846,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	13.14	1,760,760.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	4.35	1,428,975.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.23	1,140,210.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	14.88	1,964,160.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	15.44	3,072,560.00
FAR EAST HORIZON LTD	141,000	7.36	1,037,760.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.75	775,250.00

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	12.60	745,920.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	8.46	2,341,728.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	12.64	2,007,232.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	710,000	21.25	15,087,500.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	30.50	8,259,400.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.32	315,480.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	19.62	2,782,586.88
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	115,600	33.30	3,849,480.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.34	2,311,280.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	10.14	6,218,740.32
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	525,500	94.10	49,449,550.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	26.05	1,190,485.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	11.28	1,601,760.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	69,000	11.44	789,360.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	19.96	3,712,560.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	5.56	3,213,680.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	27.10	10,326,184.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	265,111	34.95	9,265,629.45
CHINA VANKE CO LTD-H	174,000	28.55	4,967,700.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.75	1,587,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	770,285	11.56	8,904,494.60
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	8.53	1,091,840.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	13.36	1,806,272.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	3.52	549,120.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	8.48	754,720.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	12.34	1,159,960.00
LONGFOR PROPERTIES	178,500	32.95	5,881,575.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	3.18	1,068,480.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	27.40	3,630,500.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.61	337,295.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	528,591	3.07	1,622,774.37
SOHO CHINA LTD	113,000	2.96	334,480.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	234,000	38.30	8,962,200.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.76	1,017,280.00
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.62	376,791.32
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	8.75	2,117,500.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	19.16	1,264,560.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	18.14	1,433,060.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	51.60	3,689,400.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	14.82	1,259,700.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	4.74	1,118,640.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.70	1,520,900.00

	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	8.36	576,840.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	17.56	370,516.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	5.82	4,260,240.00	
	MEITU INC	143,000	1.68	240,240.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	74,300	130.80	9,718,440.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	823,800	8.84	7,282,392.00	
	ZTE CORP-H	82,908	23.25	1,927,611.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	594,500	64.30	38,226,350.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	3.33	4,515,480.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,156,000	1.69	7,023,640.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	700,000	7.68	5,376,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	36.40	1,419,600.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	4.12	2,513,200.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.08	2,791,360.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	34.75	5,983,950.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	4.50	1,138,500.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	1.69	1,125,540.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	45.65	3,925,900.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.34	1,813,636.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	138,000	1.59	219,420.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	88.50	6,646,350.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	272,000	17.00	4,624,000.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.05	561,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.79	1,402,300.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.99	914,940.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	7.38	1,904,040.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.74	264,040.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	15.18	683,100.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	9.84	2,607,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	224,453	4.55	1,021,261.15	
	香港ドル 小計	88,864,324		928,695,983.90 (12,946,022,015)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.44	1,423,017.92	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	23.72	595,372.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	7.65	1,607,265.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.77	688,311.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.77	524,784.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.90	378,180.00	
	IJM CORP BHD	198,100	2.15	425,915.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.29	382,993.34	
	AIRASIA GROUP BHD	64,800	1.94	125,712.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.49	455,013.06	

	MISC BHD	125,040	8.28	1,035,331.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.25	297,500.00	
	GENTING BHD	205,300	6.21	1,274,913.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	3.25	1,201,525.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	17.70	192,930.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	34.64	294,440.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.12	141,680.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.34	779,637.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	22.52	1,234,096.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	145.70	1,005,330.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.24	960,883.20	
	QL RESOURCES BHD	83,200	7.26	604,032.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.99	1,232,759.54	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	5.35	848,510.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.51	1,263,443.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.35	428,040.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	2.78	196,268.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.14	539,028.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	444,619	5.40	2,400,942.60	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	17.06	1,045,641.52	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	17.28	258,042.24	
	MALAYAN BANKING BHD	359,804	8.83	3,177,069.32	
	PUBLIC BANK BERHAD	298,520	19.94	5,952,488.80	
	RHB BANK BHD	206,419	5.77	1,191,037.63	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	0.73	122,925.81	
	SP SETIA BHD	185,105	1.32	244,338.60	
	AXIATA GROUP BERHAD	281,687	4.37	1,230,972.19	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.70	1,464,990.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.41	1,449,339.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	3.77	265,981.04	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.32	1,232,160.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	13.84	4,075,534.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	0.91	229,652.15	
	マレーシアリングット 小計	6,861,231		44,478,024.76 (1,172,885,512)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	12.20	4,450,560.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	3.68	3,052,560.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	124.50	15,525,150.00	
	PTT PCL-NVDR	1,097,800	45.50	49,949,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	72.75	8,737,275.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	33.00	6,811,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	55.50	12,483,837.00	

	SIAM CEMENT PCL-NVDR	73,400	393.00	28,846,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	80.25	34,355,025.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	10.80	8,823,600.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	471,100	13.60	6,406,960.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	37.25	12,043,297.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,235	16.70	7,869,624.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	65.75	2,288,100.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102,700	49.25	5,057,975.00	
	CP ALL PCL-NVDR	566,800	78.75	44,635,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	26.50	9,028,550.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	14.10	3,384,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	819,600	23.60	19,342,560.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	131.50	4,313,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	178.00	9,238,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	153.50	19,402,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	78,300	152.50	11,940,750.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	16.80	7,369,320.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	147,500	118.50	17,478,750.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	1.46	1,951,290.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	61.25	5,500,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	172,500	66.25	11,428,125.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	10.10	8,807,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	230.00	24,357,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	243,700	67.50	16,449,750.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	63.00	4,158,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	5.20	4,999,326.80	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	346.00	8,027,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	44.75	8,301,125.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	171.00	8,960,400.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	76.00	4,126,800.00	
	タイパーツ 小計	12,695,738		459,900,960.80 (1,655,643,458)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	56.00	13,324,640.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	10.62	6,272,172.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	848.50	18,980,945.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	7.63	2,635,783.50	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	900.00	6,172,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	78.50	18,083,260.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,070.00	24,401,350.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	144,500	123.80	17,889,100.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	228.00	13,910,280.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	151.50	9,602,070.00	

	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	97.50	5,834,887.50	
	BDO UNIBANK INC	173,721	159.50	27,708,499.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	67.55	10,894,936.85	
	SECURITY BANK CORP	30,810	203.00	6,254,430.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	4.65	10,954,005.00	
	AYALA LAND INC	637,000	47.00	29,939,000.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.90	3,126,200.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	26.70	2,483,100.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	40.00	35,502,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	1,900.00	8,911,000.00	
	PLDT INC	6,225	1,110.00	6,909,750.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	39.60	3,544,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	349.80	10,182,678.00	
	フィリピンベソ 小計	6,891,711		293,516,487.35 (633,995,612)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,415.00	2,036,609,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	2,580.00	1,154,034,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,275.00	4,675,947,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	4,134,700	980.00	4,052,006,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,200.00	2,002,440,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	20,550.00	3,904,500,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	11,800.00	1,023,060,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	12,825.00	3,008,745,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,100.00	629,850,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,152,700	6,625.00	14,261,637,500.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,175.00	626,275,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	7,600.00	6,021,480,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	53,500.00	3,188,600,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	2,060.00	1,890,874,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	11,275.00	1,815,275,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,750.00	3,325,525,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	43,150.00	5,117,590,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,585.00	4,368,101,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	915,000	31,400.00	28,731,000,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,100.00	12,908,481,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,675.00	6,218,285,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	1,890.00	1,264,599,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,246,000	3,990.00	20,931,540,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,405.00	960,177,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	580.00	934,032,000.00		
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	4,110.00	18,672,141,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	2,000.00	1,583,000,000.00		

	インドネシアルピア 小計	32,108,096		155,305,805,600.00 (1,211,385,283)
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	50,800.00	214,731,600.00
	S-OIL CORPORATION	5,824	100,500.00	585,312,000.00
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	162,000.00	904,932,000.00
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	17,250.00	184,678,500.00
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	32,950.00	238,623,900.00
	KOREA ZINC CO LTD	783	434,500.00	340,213,500.00
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	76,400.00	80,296,400.00
	LG CHEM LTD	4,436	323,000.00	1,432,828,000.00
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	180,500.00	86,459,500.00
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	227,000.00	317,800,000.00
	OCI COMPANY LTD	1,127	65,100.00	73,367,700.00
	POSCO	7,828	224,000.00	1,753,472,000.00
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,159	47,850.00	55,458,150.00
	CJ CORP	1,230	91,000.00	111,930,000.00
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	4,176	93,300.00	389,620,800.00
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,800.00	39,696,000.00
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	32,850.00	141,517,800.00
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	32,550.00	220,038,000.00
	HANWHA CORPORATION	2,825	24,850.00	70,201,250.00
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	31,050.00	68,341,050.00
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	45,300.00	289,014,000.00
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	348,500.00	282,285,000.00
	KCC CORP	870	237,500.00	206,625,000.00
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	38,700.00	200,311,200.00
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3,318	120,500.00	399,819,000.00
	LG CORP	8,323	72,400.00	602,585,200.00
	LOTTE CORP	2,370	37,050.00	87,808,500.00
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	19,000.00	113,772,000.00
	SAMSUNG C&T CORP	7,702	102,500.00	789,455,000.00
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	19,000.00	351,804,000.00
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,270.00	270,087,770.00
	SK HOLDINGS CO LTD	3,879	268,500.00	1,041,511,500.00
	S-1 CORPORATION	960	96,000.00	92,160,000.00
CJ LOGISTICS	862	157,500.00	135,765,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	152,500.00	221,887,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	26,950.00	148,332,800.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,595.00	136,636,920.00	
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	35,350.00	249,783,100.00	
HANON SYSTEMS	19,000	11,550.00	219,450,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,414	242,000.00	1,552,188,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO	14,394	124,000.00	1,784,856,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	82,800.00	239,457,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	74,600.00	224,023,800.00
KIA MOTORS CORPORATION	25,363	43,100.00	1,093,145,300.00
FILA KOREA LTD	4,080	62,100.00	253,368,000.00
HLB INC	2,398	147,800.00	354,424,400.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	69,400.00	764,718,600.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	5,058	91,600.00	463,312,800.00
KANGWON LAND INC	13,208	30,450.00	402,183,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	24,800.00	125,736,000.00
KAKAO CORP	5,905	152,000.00	897,560,000.00
NAVER CORP	13,191	163,500.00	2,156,728,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	529,000.00	872,850,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	94,000.00	231,710,000.00
PEARL ABYSS CORP	338	199,900.00	67,566,200.00
CJ ENM CO LTD	830	154,800.00	128,484,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	82,900.00	252,927,900.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	77,400.00	94,582,800.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	133,000.00	137,522,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	254,000.00	134,620,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	182,000.00	99,918,000.00
EMART	2,723	128,500.00	349,905,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	39,650.00	51,981,150.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	244,500.00	189,487,500.00
KT&G CORP	10,696	99,400.00	1,063,182,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	107,000.00	213,251,000.00
OTTOGI CORPORATION	68	578,000.00	39,304,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	191,500.00	550,179,500.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	96,100.00	68,231,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,253,000.00	1,160,278,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	761,000.00	102,735,000.00
PACIFIC CORP	2,115	84,100.00	177,871,500.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,078	51,800.00	314,840,400.00
CELLTRION INC	9,173	188,000.00	1,724,524,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	38,600.00	42,923,200.00
HANMI PHARM CO LTD	481	324,500.00	156,084,500.00
HANMI SCIENCE CO LTD	628	41,850.00	26,281,800.00
HELIXMITH CO LTD	1,641	96,200.00	157,864,200.00
MEDY-TOX INC	326	333,800.00	108,818,800.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	390,000.00	609,570,000.00
SILLAJEN INC	5,667	17,550.00	99,455,850.00
YUHAN CORPORATION	630	219,000.00	137,970,000.00

	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	7,230.00	167,851,680.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	33,256	36,000.00	1,197,216,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	12,250.00	347,042,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	43,300.00	1,652,284,700.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,460	43,850.00	1,993,421,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	55,614	12,300.00	684,052,200.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	71,300.00	328,122,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,485.00	214,849,440.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,540.00	234,433,680.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	12,650.00	142,919,700.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	35,000.00	66,465,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	34,900.00	201,582,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	54,200.00	228,127,800.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	83,341	2,415.00	201,268,515.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9,101	28,300.00	257,558,300.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	29,000.00	115,275,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	235,500.00	731,934,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	75,100.00	557,016,700.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	199,500.00	622,639,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	14,500.00	349,029,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	122,500.00	173,337,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	116,000.00	649,948,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	461,089	52,100.00	24,022,736,900.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	79,690	42,600.00	3,394,794,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,221	237,500.00	1,239,987,500.00	
	LG UPLUS CORP	14,194	13,900.00	197,296,600.00	
	SK TELECOM	2,172	242,000.00	525,624,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	27,000.00	660,609,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	4,538	40,950.00	185,831,100.00	
	SK HYNIX INC	52,182	82,300.00	4,294,578,600.00	
	韓国ウォン 小計	1,537,492		78,463,067,855.00 (7,391,220,991)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	98.60	10,771,064.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	43.30	10,139,820.80	
	CHINA STEEL	1,120,261	23.80	26,662,211.80	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	354,061	88.70	31,405,210.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	452,824	97.40	44,105,057.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	72.70	34,005,570.40	
	TAIWAN CEMENT	469,479	40.90	19,201,691.10	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	437.50	5,250,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	30.25	10,527,847.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	264.00	5,606,568.00	

CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.05	1,178,337.15
EVA AIRWAYS CORP	164,159	14.35	2,355,681.65
EVERGREEN MARINE	132,968	12.75	1,695,342.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	36.50	6,460,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	48.35	8,560,899.35
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	392.50	7,825,272.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	204.50	7,404,331.50
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.45	1,378,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	221.50	5,640,276.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	296.50	4,744,000.00
POU CHEN	273,780	41.20	11,279,736.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	75.10	1,660,310.80
TATUNG CO LTD	210,000	18.40	3,864,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	563.00	14,638,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	66,544	309.00	20,562,096.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	62.10	2,220,447.60
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	73.00	32,586,835.00
TAIEMD BIOLOGICS INC	13,000	133.00	1,729,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	420,468	23.20	9,754,857.60
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,871,237	21.85	40,886,528.45
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	978,573	27.60	27,008,614.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	22.80	22,893,343.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	757,945	22.30	16,902,173.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,075,339	30.50	32,797,839.50
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	12.70	14,692,490.30
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	964,768	14.50	13,989,136.00
TAIWAN BUSINESS BANK	476,620	12.70	6,053,074.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	769,621	21.10	16,239,003.10
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	53.00	17,535,633.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	140.50	18,549,091.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	945,153	19.90	18,808,544.70
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	42.70	31,254,307.70
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	10.00	12,567,800.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	307,791	26.10	8,033,345.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	45.60	29,598,139.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,166,470	10.40	12,131,288.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	47.05	1,981,746.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	47.35	1,583,384.00
ACER INC	255,803	18.30	4,681,194.90
ADVANTECH CO LTD	28,402	308.50	8,762,017.00
ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	215.00	13,564,780.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	8.04	7,598,523.60

CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	279.00	16,098,300.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	93.80	2,700,689.60	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	6.97	5,401,750.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	18.80	8,117,088.00	
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	139.50	26,072,968.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	67.00	6,220,950.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,196,248	90.90	108,738,943.20	
INVENTEC CO LTD	280,511	22.75	6,381,625.25	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,040	4,760.00	47,790,400.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	50.40	11,362,780.80	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	89.70	5,382,000.00	
PEGATRON CORP	159,474	67.30	10,732,600.20	
QUANTA COMPUTER INC	242,270	61.80	14,972,286.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	36.50	4,675,650.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	172.00	4,644,000.00	
WISTRON CORP	242,695	28.35	6,880,403.25	
WPG HOLDINGS LTD	143,692	38.05	5,467,480.60	
YAGEO CORPORATION	22,764	307.00	6,988,548.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	75,922	147.50	11,198,495.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	347,315	113.50	39,420,252.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	75.70	11,884,900.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	116.00	17,655,200.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	379,315	78.30	29,700,364.50	
GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	363.00	6,534,000.00	
MEDIATEK INC	138,804	414.00	57,464,856.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	72.40	7,457,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	212.00	11,245,540.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	294.50	3,415,905.50	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	123,770	94.30	11,671,511.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	60,944	225.00	13,712,400.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,378,389	305.50	726,597,839.50	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,210,000	14.25	17,242,500.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	64.90	5,776,100.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	312.50	10,000,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	16.65	3,396,600.00	
新台湾ドル 小計	31,810,805		2,004,327,089.00 (7,195,534,249)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	502.75	33,241,830.00	
COAL INDIA LTD	147,331	209.25	30,829,011.75	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	293.95	17,467,978.75	
INDIAN OIL CORP LTD	193,765	134.05	25,974,198.25	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	138.30	34,949,654.70	

PETRONET LNG LTD	49,423	283.40	14,006,478.20
RELIANCE INDUSTRIES LTD	275,350	1,445.50	398,018,425.00
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	202.25	14,872,049.25
ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,794.85	44,799,456.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	774.00	21,162,708.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	203.85	24,738,624.45
JSW STEEL LTD	80,284	250.00	20,071,000.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,354.15	10,979,448.20
SHREE CEMENT LTD	901	19,985.95	18,007,340.95
TATA STEEL LTD	25,839	397.95	10,282,630.05
ULTRATECH CEMENT LTD	9,271	4,147.25	38,449,154.75
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	555.85	30,129,293.40
VEDANTA LTD	198,772	155.50	30,909,046.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	76.55	10,992,809.65
HAVELLS INDIA LTD	23,476	707.50	16,609,270.00
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,423.00	63,445,878.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	386.15	24,144,414.90
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	570.90	15,103,159.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,530.00	12,790,800.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	3,245.55	27,139,289.10
BHARAT FORGE LTD	30,322	426.65	12,936,881.30
BOSCH LTD	965	15,353.85	14,816,465.25
EICHER MOTORS LTD	1,254	21,689.65	27,198,821.10
HERO MOTOCORP LTD	10,359	2,646.95	27,419,755.05
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	75,669	580.00	43,888,020.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,533	7,200.55	75,843,393.15
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	129.25	9,931,182.25
TATA MOTORS LTD	147,050	169.05	24,858,802.50
PAGE INDUSTRIES LTD	601	24,403.10	14,666,263.10
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,156.75	32,179,628.25
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	79,473	287.50	22,848,487.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,968.85	21,708,540.10
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,108	3,158.00	16,131,064.00
ITC LTD	347,144	260.50	90,431,012.00
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	14,471.30	34,658,763.50
UNITED SPIRITS LTD	32,483	633.05	20,563,363.15
DABUR INDIA LTD	58,111	473.65	27,524,275.15
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	734.50	28,251,808.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	2,086.40	124,537,216.00
MARICO LTD	42,465	370.60	15,737,529.00
AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	439.95	8,946,823.20
CIPLA LTD	31,308	462.50	14,479,950.00

	DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,699.95	15,398,147.10	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,822.10	29,417,570.40	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	286.45	4,593,512.20	
	LUPIN LTD	26,552	718.75	19,084,250.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	1,776.55	11,904,661.55	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	422.10	35,013,195.00	
	AXIS BANK LTD	200,055	725.50	145,139,902.50	
	BANDHAN BANK LTD	36,073	550.80	19,869,008.40	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	158,513	2,233.20	353,991,231.60	
	ICICI BANK LTD	222,300	489.45	108,804,735.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	241.65	6,504,734.70	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	439.55	12,294,653.05	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	316.00	52,907,248.00	
	YES BANK LTD	152,956	68.95	10,546,316.20	
	BAJAJ FINANCE LTD	16,731	4,159.45	69,591,757.95	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	329.00	9,188,641.00	
	REC LTD	48,168	138.75	6,683,310.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	19,022	1,116.35	21,235,209.70	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	8,818.85	27,929,297.95	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	38,897	567.90	22,089,606.30	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,128	1,320.45	12,053,067.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	52,729	1,150.10	60,643,622.90	
	INFOSYS LTD	326,529	708.15	231,231,511.35	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	86,554	2,129.95	184,355,692.30	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	771.35	37,067,224.25	
	WIPRO LTD	118,712	256.40	30,437,756.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	199,402	369.15	73,609,248.30	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	218.30	7,816,013.20	
	IDEA CELLULAR LTD	467,944	3.75	1,754,790.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	127.05	22,204,274.40	
	NTPC LTD	260,019	117.40	30,526,230.60	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,781	191.65	31,963,578.65	
	TATA POWER CO LTD	93,250	59.55	5,553,037.50	
	インドルピー 小計	6,432,998		3,410,075,028.85 (5,251,515,544)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	130.56	9,530,880.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	135.42	9,005,430.00	
	MCB BANK LTD	53,300	192.18	10,243,194.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		28,779,504.00 (20,145,652)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	57,358	22.22	1,274,494.76	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.53	1,123,130.25	

	INDUSTRIES QATAR	159,480	10.38	1,655,402.40	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.43	903,675.70	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.85	1,565,179.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	15.50	1,770,565.00	
	QATAR NATIONAL BANK	432,557	19.36	8,374,303.52	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	3.08	584,091.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.40	705,466.00	
	OORED00 QSC	72,800	7.35	535,080.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.06	1,002,481.26	
	カタールリアル 小計	2,350,431		19,493,869.09 (582,281,869)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	126.25	2,479,297.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,219	1,125.07	5,871,740.33	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,437	283.00	10,877,671.00	
	GOLD FIELDS LTD	83,566	76.45	6,388,620.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	365.14	1,961,532.08	
	SAPPI LIMITED	49,985	37.80	1,889,433.00	
	SASOL LTD	57,030	295.37	16,844,951.10	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	215.00	5,955,930.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	133.50	5,410,621.50	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	161.34	3,436,380.66	
	NASPERS LTD-N SHS	42,439	2,150.00	91,243,850.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	160.35	3,853,531.20	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	50.56	2,394,875.52	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	59.60	4,987,566.40	
	BID CORP LTD	33,071	349.17	11,547,401.07	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	250.00	6,730,250.00	
	PICK N PAY STORES LTD	62,266	68.80	4,283,900.80	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	137.82	6,173,233.44	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	201.48	4,689,245.52	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	234.50	3,053,893.50	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	24.11	3,774,251.73	
	NETCARE LTD	99,170	17.10	1,695,807.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	113.20	4,216,020.80	
	ABSA GROUP LTD	70,978	162.61	11,541,732.58	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,385	1,450.05	6,358,469.25	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	242.65	9,229,678.05	
STANDARD BANK GROUP LTD	126,090	176.66	22,275,059.40		
FIRSTRAND LTD	312,664	68.35	21,370,584.40		
INVESTEC LTD	28,883	85.84	2,479,316.72		
PSG GROUP LTD	18,494	244.29	4,517,899.26		
REINET INVESTMENTS SCA	11,647	275.82	3,212,475.54		

	REMGRO LTD	55,441	180.87	10,027,613.67
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	81.36	6,053,021.28
	DISCOVERY LIMITED	34,996	127.61	4,465,839.56
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	116.34	724,332.84
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	20.50	1,395,599.00
	OLD MUTUAL LTD	489,612	20.37	9,973,396.44
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	136,094	31.22	4,248,854.68
	SANLAM LTD	172,493	82.02	14,147,875.86
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,121	128.00	4,111,488.00
	MTN GROUP LTD	156,559	96.81	15,156,476.79
	TELKOM SA LTD	11,353	62.00	703,886.00
	VODACOM GROUP	58,903	135.00	7,951,905.00
	南アフリカランド 小計	2,950,055		369,705,509.17 (2,713,638,437)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	7.79	2,099,327.10
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.26	676,372.88
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	259,815	15.30	3,975,169.50
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	2.29	1,459,329.98
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	3.60	109,962.00
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.93	346,710.99
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	4.13	1,241,568.86
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	16.60	2,793,298.60
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,974,236		12,701,739.91 (378,130,797)
香港・オフショア 人民元	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	8.44	323,252.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	43.68	1,285,939.20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.61	217,107.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	15.42	572,082.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.32	608,520.00
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	7.06	288,754.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	14,980	30.08	450,598.40
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	47,500	46.46	2,206,850.00
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.05	331,580.00
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.16	277,440.00
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	20.48	233,472.00
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	15.91	270,470.00
	CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	75,820	9.77	740,761.40
	CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	494,300	5.33	2,634,619.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.16	1,088,244.00
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	6,300	75.62	476,406.00
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	48,600	22.51	1,093,986.00
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.42	721,344.00

SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	14.09	590,371.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	7.97	180,122.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.87	258,828.57
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	23.89	754,924.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.87	229,733.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.40	216,000.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	374,600	2.49	932,754.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	122,300	7.75	947,825.00
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.04	192,432.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	77.87	414,190.53
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.80	257,520.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	43.55	361,465.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	22.72	847,456.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	25.66	880,138.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	23.75	1,011,750.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,500	63.61	1,176,785.00
HLA CORP LTD-A	21,400	7.92	169,488.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	59.62	1,228,172.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	18.56	482,560.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	90.50	1,339,400.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	13.67	232,390.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.98	833,612.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	21,060	8.93	188,065.80
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	14.16	240,720.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.77	493,266.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	8.04	325,620.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	11,800	113.81	1,342,958.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	32,400	33.47	1,084,428.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	29.47	1,010,879.94
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	99.58	906,178.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	5,100	1,205.00	6,145,500.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	85.62	839,076.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	8,200	93.02	762,764.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	22.40	600,320.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	6,700	90.77	608,159.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	12.91	407,956.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	63,900	38.88	2,484,432.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	16,400	134.59	2,207,276.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	41.40	570,492.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	26.94	261,856.80
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	57,300	13.68	783,864.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	16.39	407,127.60

CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	30.07	306,714.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	48.62	481,338.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	35.29	783,190.97
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	20,760	91.30	1,895,388.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	85.03	578,204.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	18.92	132,440.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	24.59	276,194.88
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	15.48	301,860.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	32.15	546,550.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	111.07	433,173.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.61	1,276,496.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.64	327,120.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	7.21	416,738.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	8.85	446,925.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	28.35	680,400.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	9.39	427,245.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.35	918,015.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	85,500	37.75	3,227,625.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	6.20	1,696,320.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	7.64	912,216.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	5.87	1,533,244.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	19.88	1,892,576.00
PING AN BANK CO LTD-A	85,100	16.65	1,416,915.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	12.57	1,738,431.00
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.34	138,446.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	6.63	1,223,235.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	56,200	16.25	913,250.00
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	22.42	968,544.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	128,800	15.07	1,941,016.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.50	1,170,700.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.79	835,674.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	95.23	514,242.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.25	271,250.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	10.05	318,585.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.82	998,704.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	36.81	669,942.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	50,400	89.17	4,494,168.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	28.77	402,780.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	25,000	18.71	467,750.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	26.74	1,435,938.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	43,900	14.62	641,818.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	34.01	435,328.00

	IFLYTEK CO LTD - A	10,800	34.50	372,600.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	57,200	29.60	1,693,120.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.63	415,998.00	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	42,400	34.40	1,458,560.00	
	LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	168,332	34.46	5,800,720.72	
	CHINA UNITED NETWORK-A	749,200	5.96	4,465,232.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.03	874,214.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	104,000	18.00	1,872,000.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	4.13	1,231,979.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.81	871,500.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	22.55	367,565.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	15.02	609,812.00	
	香港・オフショア人民元 小計	8,390,689		109,550,269.81 (1,710,079,711)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	20.58	484,844.22	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	47.50	465,690.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.44	397,184.32	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	16.26	524,921.58	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	14,573	77.50	1,129,407.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	36,841	41.75	1,538,111.75	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	73,481	91.50	6,723,511.50	
	SAUDI CEMENT	7,489	67.00	501,763.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	21.54	453,610.86	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	10.54	696,841.56	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,804	52.80	1,045,651.20	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	4,432	89.30	395,777.60	
	JARIR MARKETING CO	5,046	159.80	806,350.80	
	ALMARAI CO	22,935	50.90	1,167,391.50	
	SAVOLA	25,336	30.95	784,149.20	
	AL RAJHI BANK	120,466	62.40	7,517,078.40	
	ALINMA BANK	82,467	21.72	1,791,183.24	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	13.34	477,745.42	
	BANK ALBILAD	32,374	25.95	840,105.30	
	BANQUE SAUDI FRANSI	48,323	35.20	1,700,969.60	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	119,460	45.10	5,387,646.00	
	RIYAD BANK	106,583	21.50	2,291,534.50	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	101,683	29.05	2,953,891.15	
	SAUDI BRITISH BANK	32,217	33.00	1,063,161.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	106.00	170,554.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	68.00	449,684.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	12.02	566,045.84	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.36	432,310.32	

	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	21.94	755,043.16	
	SAUDI TELECOM CO	39,344	95.90	3,773,089.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	74,768	20.70	1,547,697.60	
	サウジアラビアリアル 小計	1,324,097		48,832,945.72	(1,423,968,697)
	合 計	258,318,293		59,921,143,911	(59,921,143,911)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	4,795,042.00	
		メキシコペソ 小計	43,300	4,795,042.00	(27,379,689)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,709,420.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	1,858,941.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	775,500.00	
		KLABIN SA-UNIT	83,000	1,459,970.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	837,043.48	
ブラジルリアル 小計	181,362	6,640,874.48	(173,924,502)		
投資信託受益証券合計			224,662	201,304,191	(201,304,191)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	8,937,432.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	8,937,432.00	(51,032,736)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	189,245	3,945,758.25	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	6,812,635.23	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	4,466,077.75	
南アフリカランド 小計	1,032,277	15,224,471.23	(111,747,618)		
投資証券合計			1,340,677	162,780,354	(162,780,354)
合計				364,084,545	(364,084,545)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 56銘柄	100.0%			13.1%
メキシコペソ	株式 23銘柄	94.7%			2.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.4%	0.1%
ブラジルレアル	株式 50銘柄	96.0%			7.0%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.0%		0.3%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 19銘柄	100.0%			1.0%
香港ドル	株式 207銘柄	100.0%			21.5%
マレーシアリングギット	株式 43銘柄	100.0%			1.9%
タイバーツ	株式 37銘柄	100.0%			2.7%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアルピア	株式 27銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式 112銘柄	100.0%			12.3%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			11.9%
インドルピー	株式 80銘柄	100.0%			8.7%
パキスタンルピー	株式 3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式 43銘柄	96.0%			4.5%
	投資証券 3銘柄			4.0%	0.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 8銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人 民元	株式 114銘柄	100.0%			2.8%
サウジアラビアリアル	株式 31銘柄	100.0%			2.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	463,584,390
国債証券	454,389,855,700
地方債証券	28,980,144,518
特殊債券	37,656,629,556
社債券	22,426,856,690
未収利息	963,441,888
前払費用	67,756,218
流動資産合計	544,948,268,960
資産合計	544,948,268,960
負債の部	
流動負債	
未払解約金	170,039,306
未払利息	1,033
流動負債合計	170,040,339
負債合計	170,040,339
純資産の部	
元本等	
元本	383,388,386,551
剰余金	
剰余金又は欠損金()	161,389,842,070
元本等合計	544,778,228,621
純資産合計	544,778,228,621
負債純資産合計	544,948,268,960

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

	2019年11月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	383,388,386,551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 102,114,000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 1.4210円 (1万口当たり純資産額) (14,210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11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。

	2019年11月11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11月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	323,053,631,511円
期中追加設定元本額	69,145,686,993円
期中一部解約元本額	8,810,931,953円
期末元本額	383,388,386,551円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,886,598,375円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,094,623円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,217,635,612円
世界経済インデックスファンド	1,871,612,724円
D C マイセレクション 2 5	20,652,257,059円
D C マイセレクション 5 0	22,450,147,202円
D C マイセレクション 7 5	6,037,032,858円
D C 日本債券インデックス・オープン	466,191,154円
D C 日本債券インデックス・オープン S	87,425,895,071円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,859,727,453円
D C マイセレクション S 2 5	8,432,614,464円
D C マイセレクション S 5 0	9,169,496,432円
D C マイセレクション S 7 5	1,748,875,442円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,098,557,870円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,321,004,045円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	444,595,437円
D C 世界経済インデックスファンド	1,678,420,933円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	68,600,655円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,467,901円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	43,537,426円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	14,180,873円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	936,306円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	163,688,329円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	277,388,058円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	60,737,829円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	136,848,775円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	4,160,349,363円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	929,797,421円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,518,017,394円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	813,639,053円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	98,686,012円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,213,168,528円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	27,939,515円

区分	2019年11月11日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,388,530,116円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,775,491,885円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	162,640,095円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,283,800,135円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,750,577,904円
分散投資コア戦略ファンドA	11,119,221,758円
分散投資コア戦略ファンドS	9,240,772,765円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	69,591,922円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	824,595,419円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	49,018,766円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,613,846円
SMT インデックスバランス・オープン	62,178,364円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,147,720円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	12,350,425円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	25,389,893円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,478,881円
グローバル経済コア	207,827,251円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,115,043円
DCターゲット・イヤーフンド2055	811,672円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
DCターゲット・イヤーフンド(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)	78,046,213,867円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,533,160,400
地方債証券	75,960,781
特殊債券	152,921,391
社債券	56,889,520
合計	2,818,932,092

(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395回利付国債(2年)	560,000,000	561,708,000	
	第396回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,715,643,000	
	第397回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,605,680,000	
	第398回利付国債(2年)	3,460,000,000	3,473,286,400	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,112,679,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	632,683,800	
	第401回利付国債(2年)	3,460,000,000	3,475,327,800	
	第402回利付国債(2年)	620,000,000	622,889,200	
	第403回利付国債(2年)	3,770,000,000	3,788,510,700	
	第404回利付国債(2年)	360,000,000	361,886,400	
	第405回利付国債(2年)	100,000,000	100,558,000	
	第406回利付国債(2年)	120,000,000	120,699,600	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,969,472,000	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,798,737,600	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,617,373,800	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,357,702,000	
	第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,179,686,800	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,579,223,200	
	第132回利付国債(5年)	4,870,000,000	4,908,180,800	
	第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,417,711,800	
	第134回利付国債(5年)	5,970,000,000	6,025,938,900	
	第135回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,737,424,800	
	第136回利付国債(5年)	5,900,000,000	5,964,192,000	
	第137回利付国債(5年)	6,830,000,000	6,909,569,500	
	第138回利付国債(5年)	9,710,000,000	9,830,501,100	
	第139回利付国債(5年)	4,870,000,000	4,934,089,200	
	第140回利付国債(5年)	7,340,000,000	7,440,558,000	
	第141回利付国債(5年)	1,050,000,000	1,065,172,500	
	第1回利付国債(40年)	400,000,000	609,916,000	
	第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,675,258,900	
	第3回利付国債(40年)	550,000,000	822,393,000	

第4回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,509,840,000	
第5回利付国債(40年)	890,000,000	1,301,616,100	
第6回利付国債(40年)	1,620,000,000	2,338,470,000	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,154,123,300	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	1,041,312,000	
第9回利付国債(40年)	1,170,000,000	1,141,019,100	
第10回利付国債(40年)	1,920,000,000	2,196,268,800	
第11回利付国債(40年)	1,730,000,000	1,924,884,500	
第12回利付国債(40年)	820,000,000	825,420,200	
第312回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,868,559,700	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,377,229,500	
第314回利付国債(10年)	470,000,000	478,206,200	
第315回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,209,896,400	
第316回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,194,160,500	
第317回利付国債(10年)	890,000,000	911,279,900	
第318回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,003,218,000	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,756,597,500	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,684,844,100	
第321回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,539,703,400	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	769,387,500	
第323回利付国債(10年)	970,000,000	997,780,800	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,811,294,800	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,003,395,200	
第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,706,397,000	
第327回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,660,022,700	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,844,263,700	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,330,797,500	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,755,301,600	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,422,600,600	
第332回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,356,892,500	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,411,270,400	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,893,006,800	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,743,297,200	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	528,405,900	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,467,136,400	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,529,502,500	
第339回利付国債(10年)	5,890,000,000	6,090,201,100	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,544,612,800	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,534,855,100	
第342回利付国債(10年)	5,760,000,000	5,867,366,400	
第343回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,262,048,000	
第344回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,692,906,800	

第345回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,336,967,900	
第346回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,430,056,000	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,318,078,600	
第348回利付国債(10年)	4,110,000,000	4,198,323,900	
第349回利付国債(10年)	3,090,000,000	3,157,238,400	
第350回利付国債(10年)	6,550,000,000	6,688,467,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,910,008,700	
第352回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,988,484,600	
第353回利付国債(10年)	4,490,000,000	4,576,701,900	
第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,012,456,600	
第355回利付国債(10年)	7,040,000,000	7,162,566,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	141,187,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	200,377,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	149,578,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	145,319,900	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,633,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	244,085,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	230,524,200	
第8回利付国債(30年)	100,000,000	122,491,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	281,630,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	181,676,800	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	109,619,100	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	242,259,500	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	366,887,700	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	397,617,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	456,783,200	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	498,519,500	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	762,232,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	457,673,550	
第19回利付国債(30年)	380,000,000	505,327,800	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	654,686,400	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	667,985,000	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	548,700,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	591,297,300	
第24回利付国債(30年)	380,000,000	524,213,800	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	472,335,500	
第26回利付国債(30年)	530,000,000	725,522,300	
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,406,818,900	
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,295,491,600	
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,943,718,000	
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,435,236,800	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,502,897,000	

第32回利付国債(30年)	1,700,000,000	2,367,998,000
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,235,979,700
第34回利付国債(30年)	1,585,000,000	2,195,874,850
第35回利付国債(30年)	2,190,000,000	2,956,609,500
第36回利付国債(30年)	1,980,000,000	2,685,038,400
第37回利付国債(30年)	1,830,000,000	2,450,992,200
第38回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,653,737,500
第39回利付国債(30年)	900,000,000	1,213,389,000
第40回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,713,132,900
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,215,835,500
第42回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,609,811,700
第43回利付国債(30年)	910,000,000	1,192,327,500
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,418,245,200
第45回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,532,876,400
第46回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,954,645,000
第47回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,994,654,200
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	2,133,156,600
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,822,313,600
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,176,229,600
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,791,442,400
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,575,420,000
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,174,768,000
第54回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,034,926,000
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,143,407,200
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,384,576,200
第57回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,493,660,800
第58回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,558,663,000
第59回利付国債(30年)	170,000,000	182,153,300
第60回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,846,174,100
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,390,792,000
第62回利付国債(30年)	480,000,000	487,483,200
第63回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,324,214,800
第64回利付国債(30年)	350,000,000	345,394,000
第48回利付国債(20年)	130,000,000	133,877,900
第49回利付国債(20年)	140,000,000	144,358,200
第50回利付国債(20年)	220,000,000	226,250,200
第51回利付国債(20年)	100,000,000	103,518,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	114,673,900
第53回利付国債(20年)	80,000,000	83,869,600
第54回利付国債(20年)	200,000,000	210,098,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	147,264,600
第56回利付国債(20年)	150,000,000	158,613,000
第57回利付国債(20年)	240,000,000	253,152,000

第58回利付国債(20年)	300,000,000	318,042,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	211,836,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	367,433,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	249,672,000	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	331,491,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	214,398,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	345,968,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	239,019,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	357,162,300	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	141,918,400	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	209,919,600	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	429,179,400	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	448,000,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	222,142,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	700,515,900	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	400,737,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	223,662,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	146,131,700	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	300,582,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	324,417,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	190,173,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	303,569,100	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	248,600,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	440,567,400	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	681,348,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	330,910,300	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	533,398,300	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	332,473,400	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	243,455,100	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	634,089,500	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	489,598,200	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	405,660,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	734,063,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	527,454,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,024,012,000	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	476,223,200	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	713,071,700	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	725,765,800	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,867,264,200	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	475,092,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	519,098,800	
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,362,830,500	

第100回利付国債(20年)	480,000,000	575,145,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	868,810,800
第102回利付国債(20年)	410,000,000	500,245,100
第103回利付国債(20年)	400,000,000	484,564,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	429,843,600
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,414,442,400
第106回利付国債(20年)	380,000,000	458,899,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	312,696,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	781,631,400
第109回利付国債(20年)	520,000,000	617,578,000
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,146,184,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,183,438,800
第112回利付国債(20年)	790,000,000	956,192,300
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,762,228,500
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,840,176,800
第115回利付国債(20年)	700,000,000	860,384,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,306,778,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,320,213,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	802,507,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	633,159,200
第120回利付国債(20年)	790,000,000	926,962,300
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,813,290,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	527,111,200
第123回利付国債(20年)	830,000,000	1,024,676,500
第124回利付国債(20年)	610,000,000	746,298,400
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,024,762,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	895,717,300
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,239,973,200
第128回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,535,977,800
第129回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,630,044,000
第130回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,349,718,650
第131回利付国債(20年)	870,000,000	1,042,851,600
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,009,176,000
第133回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,444,017,400
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,374,419,000
第135回利付国債(20年)	590,000,000	710,365,900
第136回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,751,828,400
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,351,436,800
第138回利付国債(20年)	620,000,000	732,585,800
第139回利付国債(20年)	550,000,000	656,760,500
第140回利付国債(20年)	1,840,000,000	2,226,344,800
第141回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,921,980,400
第142回利付国債(20年)	540,000,000	661,732,200

第143回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,357,774,100	
第144回利付国債(20年)	1,740,000,000	2,067,746,400	
第145回利付国債(20年)	2,155,000,000	2,624,768,450	
第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,562,651,000	
第147回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,888,577,900	
第148回利付国債(20年)	2,130,000,000	2,550,078,600	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,045,206,000	
第150回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,692,083,800	
第151回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,661,213,400	
第152回利付国債(20年)	2,910,000,000	3,373,533,900	
第153回利付国債(20年)	2,650,000,000	3,114,598,000	
第154回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,298,403,800	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,441,016,000	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,026,875,200	
第157回利付国債(20年)	2,910,000,000	2,910,000,000	
第158回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,211,406,600	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,203,287,300	
第160回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,516,912,600	
第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,859,532,500	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,176,341,500	
第163回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,556,094,200	
第164回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,792,291,600	
第165回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,706,813,600	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	968,562,000	
第167回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,545,427,500	
第168回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,814,211,600	
第169回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,070,000,000	
第170回利付国債(20年)	30,000,000	30,027,900	
国債証券合計	414,860,000,000	454,389,855,700	
地方債証券			
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,853,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,727,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	137,853,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	135,899,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,121,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,649,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,597,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,765,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	238,430,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	238,418,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	101,633,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	101,920,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	101,904,000	

第702回東京都公募公債	200,000,000	204,422,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	102,424,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,149,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	103,154,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	102,689,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	102,288,000	
第764回東京都公募公債	150,000,000	152,235,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	101,468,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	101,252,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,018,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,657,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,384,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,549,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	304,578,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	140,966,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,796,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	117,027,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,666,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,220,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,716,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,252,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	238,612,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,422,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,025,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,445,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,033,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,189,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,659,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	154,625,510	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,098,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,011,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,956,280	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,878,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	120,691,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	119,022,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,104,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,125,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	100,747,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	105,474,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	105,110,000	

第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,317,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,065,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,688,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,712,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	400,000,000	408,400,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,107,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,462,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	104,242,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	124,717,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	107,724,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,195,700	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,021,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,313,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,328,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,479,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,527,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,197,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,028,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,881,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,084,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,192,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,993,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,390,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,860,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,760,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,078,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	315,966,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	106,687,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,249,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,500,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,869,183	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,406,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,251,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	111,040,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	239,388,000	

第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	201,656,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,540,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,209,590	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,602,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,754,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,883,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,900,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,550,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,740,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,330,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,354,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,234,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,095,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	121,128,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	203,872,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,460,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	135,450,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,224,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,870,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	106,687,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,649,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	120,699,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	119,060,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,199,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,297,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,061,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,549,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,913,600	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,430,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,505,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,663,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	363,152,040	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,825,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,914,500	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	818,688,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,414,000	

第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,600,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,281,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,297,000	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,350,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,273,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,332,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,123,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,708,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,684,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,430,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,712,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,898,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,730,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,572,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,480,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,168,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,391,482	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,026,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,668,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,548,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,287,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,602,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,865,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,316,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,223,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,586,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,206,083	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,507,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,921,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,980,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	204,792,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	102,150,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,150,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,644,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,238,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	303,384,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	105,971,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,514,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	140,175,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,416,000	

第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	129,745,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,344,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,582,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,274,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,388,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,785,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,672,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	140,074,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	240,116,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	121,634,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,189,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,913,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,260,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,186,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,448,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,429,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,248,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,748,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,518,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,226,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	118,495,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	101,100,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,310,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,984,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	201,026,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,384,750	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,190,000	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,980,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,400,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,133,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	101,892,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,336,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,365,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,194,900	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,971,600	
平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,360,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,502,000	

	第 1 1 3 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	117,250,000	
	地方債証券合計	27,414,220,000	28,980,144,518	
特殊債券	第 1 4 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,013,000	
	第 1 9 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,507,000	
	第 2 2 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,217,000	
	第 3 7 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,960,000	
	第 7 5 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,146,000	
	第 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,562,000	
	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	205,428,000	
	第 1 4 回道路債券	100,000,000	105,949,000	
	第 1 7 回道路債券	100,000,000	104,800,000	
	第 1 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	462,960,000	
	第 2 1 回道路債券	100,000,000	132,988,000	
	第 2 8 回道路債券	200,000,000	271,028,000	
	第 3 3 回道路債券	200,000,000	275,522,000	
	第 3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,246,000	
	第 3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	159,124,000	
	第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,097,000	
	第 4 2 回道路債券	100,000,000	111,529,000	
	第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,708,000	
	第 8 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,190,000	
	第 8 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,608,000	
	第 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,009,000	
	第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,010,000	
	第 9 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,625,000	
	第 1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,417,000	
	第 1 0 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,499,000	
	第 1 0 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,989,000	
	第 1 1 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,847,000	
	第 1 2 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,890,000	

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	122,338,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,558,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,424,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,024,000	
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	102,026,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,278,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,372,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	138,668,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	307,564,810	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,514,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,960,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,016,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,573,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,476,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,662,000	
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	119,443,000	
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	102,954,000	
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	308,886,000	
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	205,022,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	626,088,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,296,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,275,000	
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	206,970,000	
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	153,048,280	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,823,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,162,000	
	200,000,000	236,136,000	

第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	105,400,680	
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	103,342,000	
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	103,202,000	
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	103,064,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,708,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,976,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,090,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	229,998,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,614,000	
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	101,231,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,070,000	
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	107,415,160	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	319,049,400	
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	207,447,700	
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	101,444,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,269,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,605,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	529,999,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,086,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,857,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,594,580	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,519,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	388,512,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	310,431,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,825,800	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,066,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	405,576,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,595,000	

第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	136,233,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	43,935,200	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	134,007,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	240,356,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,396,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,535,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	239,404,000	
第21回地方公共団体金融機構債券(5年)	400,000,000	400,200,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,856,380	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,990,710	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,085,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	118,929,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,091,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,330,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,455,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,455,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,934,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,138,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,400,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,428,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,288,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,233,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,662,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,085,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,388,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,617,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,444,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,575,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,205,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,960,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,189,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,551,650	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,617,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,594,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,112,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,343,080	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,182,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,695,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,048,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,142,000	

F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,078,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,652,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	111,286,000	
第 1 9 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,063,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	122,602,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,559,440	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,619,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,320,500	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,960,660	
第 8 1 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,021,000	
第 1 2 7 回都市再生債券	400,000,000	400,816,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	180,778,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,051,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	105,305,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,766,000	
第 5 9 回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	511,620,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,774,000	14,304,023	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,253,000	14,872,007	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,520,000	15,282,735	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	239,175,000	239,758,587	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	168,342,000	168,631,548	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,458,000	15,152,851	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,468,000	16,281,771	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	12,546,000	12,857,893	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	26,052,000	27,057,346	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,147,000	15,843,762	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,285,000	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,683,000	14,257,275	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,986,000	16,929,014	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,659,000	14,255,351	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,839,000	16,686,069	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,889,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,997,000	14,246,146	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,279,000	14,530,024	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,076,000	22,707,493	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,465,000	23,183,487	

第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,051,000	26,149,930
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,528,000	28,545,454
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,649,000	30,930,892
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,572,000	31,860,872
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,258,000	68,141,517
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,971,000	14,497,846
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,372,000	33,412,121
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,113,000	14,686,693
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,885,000	14,604,659
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,090,000	36,452,096
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,778,000	13,303,175
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,732,000	36,093,914
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,731,000	33,915,996
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,890,000	15,736,496
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,924,000	67,944,819
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,718,000	36,921,204
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,363,000	15,024,272
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,684,000	48,492,652
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,441,000	46,096,113
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,443,000	46,141,679
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,588,000	97,957,178
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,474,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,506,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,878,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,312,000	104,188,219
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,641,000	53,065,691
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,586,000	53,440,567
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,472,000	54,448,111
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,182,000	47,597,429
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,093,000	47,163,670
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,916,000	53,896,113
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	182,532,000
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,154,000	143,420,566
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,648,000	195,179,680
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,252,000	54,579,304
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,729,000	56,165,610
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,709,000	57,035,226
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,141,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,737,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,082,000	180,420,676
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,104,000	61,368,865
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,870,000	126,776,037
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	409,016,000

第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,778,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,407,000	71,869,560	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,210,000	75,598,842	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,324,000	75,052,784	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,231,000	231,580,258	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,888,000	155,090,674	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,053,000	75,923,252	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,489,000	80,629,629	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,952,000	83,718,476	
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,998,000	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,987,000	88,051,720	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,178,000	88,055,010	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,862,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,335,000	88,603,104	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,809,000	89,492,298	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,307,000	89,868,267	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,589,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,175,000	91,604,273	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,899,000	92,457,008	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,788,000	92,088,992	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,190,000	92,494,017	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,756,000	93,127,752	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,460,000	186,878,270	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,959,000	93,299,762	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,740,000	189,023,883	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,788,000	94,164,973	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,786,000	189,255,310	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,960,000	95,343,091	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,850,000	192,188,952	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,120,000	192,454,673	

第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	134,406,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,875,000	97,623,760	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,399,000	98,374,215	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,544,000	97,678,392	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,992,000	196,360,843	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,714,000	98,307,123	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,906,000	98,652,043	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,088,000	198,237,023	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,866,000	98,646,517	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,413,000	296,162,965	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,676,000	198,140,491	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,018,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,692,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,374,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,465,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,207,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,119,000	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	100,032,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,214,000	
い第795号商工債	200,000,000	200,106,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,198,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,131,000	
い第804号商工債	300,000,000	300,420,000	
い第795号農林債	100,000,000	100,000,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,998,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,160,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,329,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,339,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,698,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,359,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,294,000	
第218号商工債（3年）	300,000,000	300,492,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	200,352,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,697,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	120,127,000	
第38回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,073,000	

	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,044,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,671,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,013,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,827,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,004,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,636,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,101,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,758,000	
	特殊債券合計	35,583,364,000	37,656,629,556	
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	99,944,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,436,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	200,000,000	200,052,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,881,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,596,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,858,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,101,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,642,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,728,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,614,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,916,000	
	第1回H S B C・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	100,000,000	100,431,000	
	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	200,000,000	209,326,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	300,471,000	
	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	400,000,000	401,628,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,823,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,445,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,395,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
	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	100,057,000	
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	100,189,000		

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	102,095,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,352,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,609,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,059,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,338,000	
第7回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
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	102,759,000	
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	99,964,000	
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	99,833,000	
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	100,791,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,072,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,210,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,619,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,216,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,142,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,848,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,493,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,053,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,485,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,833,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,075,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,878,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,874,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,354,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,876,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,765,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,348,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,008,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,300,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,444,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,558,000	

第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,123,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,080,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,058,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,908,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,197,000	
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	100,299,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,654,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,794,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,906,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,620,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,263,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第2回ユニ・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	100,090,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,431,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,228,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,818,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,831,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,771,000	
第11回株式会社りそなホールディングス無担保社債	700,000,000	699,167,000	
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	123,790,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,415,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,705,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,478,000	
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	102,626,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,940,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	308,307,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,549,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,236,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,824,000	
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	100,472,000	
第66回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	302,646,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	300,000,000	300,825,000	

第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,487,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,961,000	
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	199,808,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,788,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,452,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,758,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
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	199,892,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,384,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,334,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,224,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,046,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,749,000	
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	103,130,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,157,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,491,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,994,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,971,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,955,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,345,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,701,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	239,038,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,369,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,392,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,062,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,013,650	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,521,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,782,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,265,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,083,800	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,855,000	

第7 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,732,000	
第7 2 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,380,000	
第3 1 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,363,000	
第3 7 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,840,000	
第6 回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,722,000	
第1 6 回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,060,000	
第6 3 回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	203,880,000	
第2 0 回K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	102,649,000	
第2 5 回K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	100,572,000	
第2 0 回株式会社N T T ドコモ無担保社債	100,000,000	102,404,000	
第4 9 9 回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,976,000	
第5 0 3 回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,283,000	
第5 0 7 回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,511,000	
第5 1 1 回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,033,000	
第5 1 9 回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,476,000	
第4 9 6 回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,301,000	
第5 0 5 回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,283,000	
第5 0 8 回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,398,000	
第5 1 0 回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,194,000	
第5 1 1 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,963,000	
第3 8 5 回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,123,000	
第3 9 8 回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,130,000	
第4 0 0 回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,462,000	
第4 0 2 回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,493,000	
第3 0 7 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,412,000	
第3 2 2 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,934,000	
第3 3 0 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,417,000	
第4 7 1 回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,358,780	
第4 8 1 回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,429,000	
第4 8 7 回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,194,000	
第4 9 6 回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,423,000	
第2 5 3 回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,258,000	
第4 2 6 回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,846,000	
第4 4 9 回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,894,000	
第4 6 5 回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,423,000	
第4 6 8 回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,810,000	
第3 2 0 回北海道電力株式会社社債	201,000,000	203,102,460	
第3 2 6 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,186,000	
第3 4 0 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,127,000	
第3 4 4 回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,376,000	
第3 5 1 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,037,000	

第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,267,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,511,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,792,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,942,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,425,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,652,000	
第6回SCK株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
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	101,004,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	201,338,000	
社債券合計	21,966,000,000	22,426,856,690	
合計		543,453,486,464	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年11月11日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	204,536,297
コール・ローン	3,091,783,943
国債証券	385,197,167,803
派生商品評価勘定	32,231,135
未収入金	59,575,203
未収利息	2,655,818,890
前払金	32,558,655
前払費用	219,312,162
差入委託証拠金	217,722,453
流動資産合計	391,710,706,541
資産合計	
391,710,706,541	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,225,161
未払解約金	375,211,841
未払利息	6,891
流動負債合計	410,443,893

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
負債合計	410,443,893
純資産の部	
元本等	
元本	139,217,550,317
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	252,082,712,331
元本等合計	391,300,262,648
純資産合計	391,300,262,648
負債純資産合計	391,710,706,541

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p>

	2019年11月11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11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,217,550,317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 2.8107円 (1万口当たり純資産額) (28,107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11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年11月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	113,477,031,083円
期中追加設定元本額	32,366,056,192円
期中一部解約元本額	6,625,536,958円

区分	2019年11月11日現在
期末元本額	139,217,550,317円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,723,131,024円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	701,799,732円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,015,133,399円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,285,114円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,151,116,553円
世界経済インデックスファンド	6,698,754,699円
D C マイセレクション 2 5	1,702,076,585円
D C マイセレクション 5 0	1,294,867,794円
D C マイセレクション 7 5	828,980,633円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,900,827,088円
D C マイセレクション S 2 5	685,915,980円
D C マイセレクション S 5 0	531,262,675円
D C マイセレクション S 7 5	239,904,065円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	48,096,907円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	67,106,262円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	31,988,147円
D C 世界経済インデックスファンド	5,942,702,314円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	628,924,629円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	32,216,898円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,758,571円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,138,242円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	48,116,342円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	94,089,537円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	166,363,327円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	153,081,868円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	394,163,118円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	2,061,051,488円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	597,663,118円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,130,635,290円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	854,420,859円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	79,141,244円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	602,186,480円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	35,691,063円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	224,415,056円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	292,272,453円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	945,417,524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）	2,058,002,228円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	845,689,534円
外国債券ファンド・シリーズ 1	562,366,708円

区分	2019年11月11日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,286,405,334円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,262,757,947円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,587,483円
分散投資コア戦略ファンドS	5,824,566,680円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	277,006,157円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,747,932,163円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,092,821,361円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	227,389,215円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	110,917,236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）	1,045,091,904円
SMT インデックスバランス・オープン	225,885,466円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	23,408,593,607円
SMT 世界経済インデックス・オープン	78,856,981円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	99,256,216円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	138,664,380円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,433,772円
グローバル経済コア	902,211,760円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,572,127円
DCターゲット・イヤーフンド2055	99,871円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,287,581円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,994,731円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	16,800円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	22,219円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	27,638円
DCターゲット・イヤーフンド（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）	793,199,196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）	11,200,456,386円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	347,707,203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）	40,333,736,961円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,342,572,782
合計	7,342,572,782

(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11月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,187,365,804	-	2,154,807,149	32,558,655
	合計	2,187,365,804	-	2,154,807,149	32,558,655

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年11月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,539,597,112	-	2,568,853,500	29,256,388
	アメリカドル	1,326,735,155	-	1,343,390,300	16,655,145
	カナダドル	86,587,085	-	87,450,000	862,915
	ユーロ	971,334,130	-	978,835,000	7,500,870
	イギリスポンド	154,940,742	-	159,178,200	4,237,458
	売建	77,691,544	-	77,383,303	308,241
	マレーシアリン ギット	77,691,544	-	77,383,303	308,241
	合計	2,617,288,656	-	2,646,236,803	29,564,629

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,451,884.79	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,707,933.60	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,951,171.90	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,770,085.94	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,478,330.06	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,473,396.47	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,913,671.90	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,959,824.26	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,454,540.98	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,660,447.25	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,939,453.15	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,468,261.72	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,894,062.48	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,983,828.14	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,482,597.64	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,746,984.41	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,971,875.00	
		T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	12,905,062.50	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,999,066.38	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,488,652.33	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,158,225.82	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	4,983,398.45	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,495,312.50	
		T 1.625% 08/15/29	4,000,000.00	3,887,187.52	
		T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	14,968,359.45	
		T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	8,964,492.21	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,121,998.01	
		T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,048,987.30	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,556,783.22	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,502,734.37	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,562,683.64	
		T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,214,875.05	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,805,492.17	
		T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,517,089.80	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,561,564.47			
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,011,210.92			
T 1.75% 06/30/24	12,600,000.00	12,599,015.68			

T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,336,650.00	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,164,273.43	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,208,984.35	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,068,224.64	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,207,687.50	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,046,875.00	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,509,863.27	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,523,417.95	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,493,677.76	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,039,726.54	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,199,325.80	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,019,218.76	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,719,816.47	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,420,460.92	
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,023,828.10	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,015,820.32	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,242,898.48	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,517,070.29	
T 2.125% 05/15/22	10,000,000.00	10,103,125.00	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,205,312.56	
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	8,748,484.41	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,551,269.55	
T 2.125% 06/30/22	11,600,000.00	11,728,234.39	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,879,312.51	
T 2.125% 08/15/21	14,950,000.00	15,056,577.20	
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,379,865.27	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,135,625.04	
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,869,704.71	
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,665,488.23	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,387,123.45	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,082,187.52	
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,371,040.64	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,188,433.63	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,072,398.43	
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,129,296.90	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,527,480.46	
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,322,265.70	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,027,128.91	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,783,121.13	
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	18,523,500.09	
T 2.25% 08/15/49	5,200,000.00	5,012,312.50	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,446,179.71	

T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,384,322.29
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,506,046.86
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,049,441.47
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,733,144.56
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,596,546.89
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,306,445.35
T 2.375% 03/15/21	10,000,000.00	10,088,476.60
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,606,914.12
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,075,070.27
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	19,426,757.81
T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	18,686,782.10
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,852,050.75
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,086,581.99
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,258,398.40
T 2.5% 01/31/21	10,000,000.00	10,097,265.60
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,492,199.20
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,179,882.80
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,938,023.41
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	7,404,937.50
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	16,737,187.50
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,153,939.44
T 2.5% 05/15/24	15,900,000.00	16,416,128.94
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	16,230,000.00
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,677,435.53
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,093,554.70
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	18,836,015.58
T 2.625% 02/15/29	20,000,000.00	21,170,312.60
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,440,414.06
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,560,957.06
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,722,788.63
T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,142,578.10
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,397,140.65
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,400,577.16
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,105,273.41
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,904,296.87
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,469,113.32
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,124,218.75
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,080,062.55
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,860,656.28
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,702,343.80
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,031,152.37
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,219,375.00
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,197,656.25

T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,186,093.75	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	10,609,187.50	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,254,164.09	
T 2.75% 11/15/23	13,900,000.00	14,443,511.68	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,458,562.50	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	9,654,511.76	
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,562,890.60	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,343,982.88	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	12,469,414.12	
T 2.875% 05/15/49	3,800,000.00	4,166,343.75	
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,356,226.53	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,005,797.63	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,146,337.50	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	11,851,195.36	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,953,544.91	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,521,079.14	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,151,074.17	
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,477,382.84	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,542,767.59	
T 2% 01/15/21	8,000,000.00	8,030,312.48	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,517,382.82	
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,108,281.28	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,491,875.00	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,015,312.52	
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,108,203.10	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,816,773.42	
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,091,562.48	
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,614,433.62	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,023,906.25	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,425,402.31	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,835,460.91	
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,682,774.40	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,415,093.74	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,321,401.61	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,519,335.96	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,016,875.00	
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,214,007.81	
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,654,398.43	
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,644,140.65	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,411,072.25	
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,384,070.33	
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	13,590,000.00	

T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	15,825,375.07	
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,671,484.37	
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	7,788,439.06	
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	9,967,132.85	
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	4,699,113.30	
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,363,408.21	
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	9,178,125.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,442,968.76	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,473,281.26	
T 3.75% 11/15/43	8,500,000.00	10,592,460.98	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	3,959,402.35	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,978,437.50	
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	16,795,638.35	
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,264,589.85	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,890,195.33	
T 3% 05/15/47	12,750,000.00	14,239,160.22	
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	13,388,668.02	
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	15,984,375.00	
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,662,500.00	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,712,664.06	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,183,429.69	
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	5,744,378.92	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,328,750.00	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,546,000.00	
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,562,179.68	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,611,671.87	
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,096,100.01	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,159,625.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,305,359.37	
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,010,078.12	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,150,972.67	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,558,304.69	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,603,222.66	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,658,515.62	
T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,433,601.57	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,546,875.00	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,119,421.87	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,908,222.66	
T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,675,882.82	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,920,638.67	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,910,308.59	
アメリカドル 小計	1,644,710,000.00	1,709,053,399.21	(186,560,269,057)

カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,024,422.00	
	CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,624,394.30	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,659,999.50	
	CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	444,498.00	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,868,052.60	
	CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,193,392.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,290,915.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	598,464.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,021,540.00	
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,703,105.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,889,279.25	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,476,300.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,365,101.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	3,939,612.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,029,698.10	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,748,350.80	
	CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,053,151.05	
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,534,677.65	
	CAN 2.75% 12/01/64	1,150,000.00	1,521,369.50	
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,211,336.90	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,143,760.00	
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,115,865.80	
	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,014,851.75	
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,770,215.15	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,548,047.40	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	3,828,456.45	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	2,961,388.15	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,280,000.00	3,408,839.40	
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,465,302.80	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,689,789.00	
カナダドル 小計		80,170,000.00	88,144,175.05 (7,273,657,325)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,695,067.75	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,313,332.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	36,130,904.55	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,617,808.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	77,190,000.00	77,057,619.15	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,575,659.80	
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	56,192,247.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,717,136.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,917,264.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,829,491.15	

	MBONO 8.5% 05/31/29	44,000,000.00	49,045,920.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	27,259,368.75
	MBONO 8% 09/05/24	20,270,000.00	21,342,992.45
	MBONO 8% 11/07/47	26,770,000.00	29,028,852.60
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,868,922.00
	メキシコペソ 小計	552,070,000.00	581,592,587.00 (3,320,893,671)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,257,574.00
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,366,997.10
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,293,579.50
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,331,556.40
	BGB 0.8% 06/22/28	3,910,000.00	4,199,457.30
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,212,839.00
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	963,322.00
	BGB 1.45% 06/22/37	980,000.00	1,140,195.70
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,738,204.70
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,539,700.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,610,000.00	2,007,154.80
	BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,168,502.00
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,635,789.05
	BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,406,775.00
	BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,928,128.00
	BGB 2.25% 06/22/57	820,000.00	1,152,399.30
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,780,868.00
	BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,750,592.00
	BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,081,815.10
	BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	5,830,521.25
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,565,859.25
	BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,749,070.15
	BGB 4.5% 03/28/26	1,610,000.00	2,101,404.20
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,440,969.00
	BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,324,511.80
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,094,703.70
	BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,074,311.30
	BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,984,760.40
	BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,666,254.80
	BTPS 0.05% 04/15/21	4,910,000.00	4,922,127.70
	BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,598,653.40
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,412,117.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,265,788.40
	BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,562,810.75
	BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,248,719.80
	BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,581,672.50

BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,653,790.00	
BTPS 1.2% 04/01/22	4,010,000.00	4,120,555.70	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,003,829.75	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,989,769.50	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,397,152.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,089,684.75	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,358,578.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	4,210,000.00	4,398,755.35	
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,789,108.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	6,650,000.00	6,819,408.75	
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,227,060.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,124,680.00	
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,687,084.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,160,521.75	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,612,750.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,876,828.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,832,638.00	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,820,447.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,767,850.00	
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,279,968.00	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,253,245.25	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	7,016,544.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,350,970.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,032,428.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,533,995.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,319,301.70	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,781,282.25	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,387,966.75	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,259,973.15	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,272,205.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,740,000.00	3,331,113.90	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,840,000.00	3,585,883.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,805,087.65	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	3,994,503.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,774,525.30	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,513,065.35	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,475,295.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,043,695.45	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,448,642.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,454,682.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,582,559.60	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,468,678.50	

BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,890,039.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,290,095.00
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,572,214.10
BTPS 4.75% 09/01/44	3,650,000.00	5,450,599.75
BTPS 4% 02/01/37	5,220,000.00	6,853,729.50
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,418,223.00
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,554,067.80
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,914,046.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,994,185.75
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,889,930.30
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,358,637.00
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,940,318.75
BTPS 5% 08/01/34	4,240,000.00	6,066,825.20
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,006,523.20
BTPS 6.5% 11/01/27	7,520,000.00	10,685,769.60
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,154,784.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,003,960.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,073,432.00
DBR 0.25% 02/15/27	5,690,000.00	5,980,019.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,691,905.75
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,378,275.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	3,998,089.95
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,314,225.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,249,516.00
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	4,984,939.50
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,117,678.40
DBR 0% 08/15/29	2,400,000.00	2,462,712.00
DBR 0% 08/15/50	900,000.00	829,480.50
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	3,972,247.00
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,639,795.90
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,171,500.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,506,210.35
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,970,744.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,815,627.00
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,543,507.75
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,439,504.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,354,460.60
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,052,677.25
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,007,300.00
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,007,270.40
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	8,305,310.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,490,459.50
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,231,900.75

DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,844,452.75
DBR 3.25% 07/04/42	2,840,000.00	4,839,473.60
DBR 4.0% 01/04/37	4,360,000.00	7,384,357.60
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	4,931,334.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,692,820.75
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,105,148.75
DBR 4.75% 07/04/40	2,960,000.00	5,818,723.60
DBR 5.5% 01/04/31	3,460,000.00	5,712,684.90
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,685,141.50
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,574,550.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,093,800.00
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	998,907.00
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,044,575.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,048,900.00
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,220,823.35
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	10,928,944.00
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,347,655.00
FRTR 0.75% 05/25/28	9,010,000.00	9,676,334.55
FRTR 0.75% 11/25/28	6,360,000.00	6,829,876.80
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,046,380.00
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,206,965.00
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,469,352.20
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,577,766.40
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,137,310.00
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,634,221.25
FRTR 0% 11/25/29	1,600,000.00	1,596,536.00
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,496,482.50
FRTR 1.25% 05/25/36	5,950,000.00	6,773,301.50
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,232,964.00
FRTR 1.5% 05/25/50	3,640,000.00	4,319,515.20
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,966,219.35
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,407,007.40
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	4,990,672.60
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,661,567.50
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,251,326.25
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,774,992.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,608,113.00
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,223,795.90
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,024,227.00
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,177,450.00
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,382,943.60
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,134,485.45

FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,670,639.75
FRTR 3.5% 04/25/26	7,550,000.00	9,421,796.00
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,091,710.75
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,277,768.80
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,442,156.25
FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000.00	12,398,798.30
FRTR 4.75% 04/25/35	5,730,000.00	9,590,988.60
FRTR 4% 04/25/55	3,480,000.00	6,812,952.60
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,017,367.25
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,047,974.00
FRTR 5.5% 04/25/29	5,150,000.00	7,866,676.50
FRTR 5.75% 10/25/32	6,340,000.00	10,905,972.90
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,621,715.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,316,375.00
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	844,354.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,835,727.75
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,357,044.80
IRISH 1.1% 05/15/29	1,220,000.00	1,333,557.60
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	871,501.80
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	998,152.80
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	992,195.85
IRISH 1.7% 05/15/37	1,050,000.00	1,237,703.25
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,185,350.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,990,000.00	2,448,466.15
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,882,700.60
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,709,499.75
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,477,656.30
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,080,490.45
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	2,989,108.80
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,660,328.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,348,211.20
NETHER 0.5% 07/15/26	3,070,000.00	3,245,650.05
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	4,884,970.80
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,753,499.70
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,545,972.50
NETHER 0% 01/15/24	2,830,000.00	2,890,123.35
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,204,762.00
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,789,031.80
NETHER 2.5% 01/15/33	2,670,000.00	3,549,231.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,750,000.00	4,537,335.00
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,363,720.15
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,121,519.45
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,614,814.40

NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,136,407.50	
NETHER 4% 01/15/37	3,000,000.00	4,982,565.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,034,954.90	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	252,106.00	
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,046,821.50	
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,690,743.75	
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,490,027.75	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,267,952.00	
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,555,001.25	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,631,668.00	
OBL 0% 10/13/23	3,710,000.00	3,798,483.50	
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	985,564.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,190,000.00	1,250,505.55	
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,208,433.50	
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,079,251.70	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,040,000.00	3,249,851.20	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,527,525.00	
RAGB 0% 07/15/24	370,000.00	377,237.20	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,117,391.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,865,806.65	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,230,000.00	1,528,022.85	
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	829,078.40	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,060,412.75	
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,537,148.65	
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,645,835.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,032,995.50	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,270,000.00	2,066,956.75	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,857,211.25	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,333,878.40	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,550,309.30	
RAGB 3.8% 01/26/62	680,000.00	1,450,494.40	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,361,438.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,817,649.60	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	194,740.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,228,698.90	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,105,403.25	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	705,995.75	
RFGB 0.5% 09/15/29	580,000.00	610,357.20	
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	937,890.45	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	738,638.10	
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	861,972.25	
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,487,455.30	

RFGB 0% 09/15/24	750,000.00	764,550.00
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	870,808.40
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	678,139.00
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	695,756.75
RFGB 1.625% 09/15/22	1,260,000.00	1,339,065.00
RFGB 2.625% 07/04/42	870,000.00	1,298,505.45
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,149,599.80
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	665,592.00
RFGB 3.5% 04/15/21	990,000.00	1,048,449.60
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,412,940.70
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,621,582.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,740,866.50
SPGB 0.25% 07/30/24	1,790,000.00	1,821,360.80
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,879,280.60
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,342,779.20
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,915,478.75
SPGB 0.6% 10/31/29	2,330,000.00	2,379,430.95
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,244,418.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,507,125.50
SPGB 1.4% 04/30/28	5,830,000.00	6,390,846.00
SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,469,143.50
SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,207,014.60
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,855,047.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,350,608.00
SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,350,746.15
SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,787,779.55
SPGB 1.95% 04/30/26	4,020,000.00	4,507,505.40
SPGB 1.95% 07/30/30	4,580,000.00	5,301,693.50
SPGB 2.15% 10/31/25	4,570,000.00	5,150,412.85
SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,329,154.50
SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,128,728.80
SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,026,010.00
SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	4,756,140.90
SPGB 3.45% 07/30/66	2,040,000.00	3,283,247.40
SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,891,931.10
SPGB 4.2% 01/31/37	3,490,000.00	5,398,401.80
SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,024,583.75
SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,023,776.95
SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	6,823,968.70
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,689,188.50
SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,155,400.00
SPGB 4.9% 07/30/40	3,490,000.00	6,056,615.80
SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,631,839.20

	SPGB 5.15% 10/31/44	2,590,000.00	4,852,818.25	
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,751,056.70	
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,502,382.90	
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,063,868.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,876,332.40	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,830,222.60	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,593,186.00	
	ユーロ 小計	1,005,440,000.00	1,198,742,471.40 (144,148,782,185)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,729,885.40	
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	5,979,456.20	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,430,000.00	1,441,790.35	
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,135,543.00	
	UKT 1.5% 01/22/21	7,380,000.00	7,452,213.30	
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,357,828.50	
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,270,378.40	
	UKT 1.625% 10/22/28	6,650,000.00	7,181,767.25	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,950,000.00	2,148,285.75	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,407,060.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,790,000.00	1,982,165.45	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,184,898.75	
	UKT 1.75% 09/07/22	4,170,000.00	4,314,553.05	
	UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,357,683.20	
	UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,133,743.75	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,664,025.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,055,924.20	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,709,442.75	
	UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,358,171.55	
	UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,560,742.90	
	UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	4,947,516.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	6,748,689.60	
	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,458,280.80	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	3,988,396.10	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,300,465.60	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,183,695.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	2,990,000.00	4,594,538.65	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	862,115.80	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,750,222.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	3,400,000.00	5,689,781.00	
UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,762,693.20		
UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,138,404.20		
UKT 4.5% 09/07/34	2,820,000.00	4,162,009.80		

	UKT 4.5% 12/07/42	3,600,000.00	5,926,428.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,841,235.30	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,062,980.50	
	UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,558,906.25	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,106,984.75	
	UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,084,887.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,834,750.00	
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	825,814.10	
イギリスポンド 小計		135,740,000.00	173,254,353.40	(24,194,970,452)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	7,996,735.95	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,112,951.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	17,858,790.00	
	SGB 1% 11/12/26	13,470,000.00	14,541,269.10	
	SGB 2.5% 05/12/25	12,740,000.00	14,659,854.30	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,580,000.00	13,534,821.30	
	SGB 3.5% 06/01/22	16,620,000.00	18,277,097.10	
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	19,981,251.50	
スウェーデンクローナ 小計		102,050,000.00	114,962,770.25	(1,293,331,165)
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,480,925.30	
	NGB 1.75% 02/17/27	8,210,000.00	8,347,969.05	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,906,111.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	5,502,140.10	
	NGB 2% 04/26/28	6,190,000.00	6,411,602.00	
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,752,345.60	
	NGB 3.75% 05/25/21	16,540,000.00	17,157,769.00	
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,638,042.50	
ノルウェークローネ 小計		73,010,000.00	75,196,904.55	(897,099,071)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,500,674.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	18,723,056.40	
	DGB 0.5% 11/15/29	7,700,000.00	8,281,388.50	
	DGB 1.5% 11/15/23	13,440,000.00	14,600,544.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	12,766,376.30	
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	13,940,100.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	46,712,470.90	
デンマーククローネ 小計		96,680,000.00	124,524,610.10	(2,003,600,976)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,560,000.00	7,608,081.60	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,792,472.10	
	POLGB 2.25% 10/25/24	560,000.00	570,707.20	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,015,553.70	

	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,014,129.75	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,621,444.35	
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	6,958,612.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,520,000.00	6,817,246.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,540,000.00	3,722,327.70	
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,627,535.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,655,415.55	
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,768,813.10	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	794,541.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,750,000.00	5,300,525.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,681,401.00	
	ポーランドズロチ 小計	75,670,000.00	78,948,806.25	(2,225,566,848)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	2,470,000.00	2,513,904.25	
	ACGB 1.75% 11/21/20	5,660,000.00	5,709,383.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,255,689.70	
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,050,878.35	
	ACGB 2.5% 05/21/30	4,390,000.00	4,906,000.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,538,315.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	938,616.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,674,437.05	
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,422,088.75	
	ACGB 2.75% 11/21/28	5,410,000.00	6,088,468.10	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,070,908.50	
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,783,498.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,568,536.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,803,459.60	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,890,000.00	2,380,795.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,076,041.60	
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,067,747.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,617,309.70	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,653,793.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,100,922.80	
ACGB 5.5% 04/21/23	4,130,000.00	4,773,846.35		
ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,215,612.75		
ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,016,130.90		
	オーストラリアドル 小計	90,740,000.00	103,226,385.40	(7,723,398,155)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	985,356.90	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	805,268.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	1,150,000.00	1,156,825.25	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	873,532.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,935.20	

	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	730,079.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	654,336.90
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	276,071.90
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,121,872.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,486,980.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	1,060,000.00	1,191,047.80
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,667,304.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	670,000.00	734,159.20
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	738,386.90
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	416,701.45
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,554.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,140,000.00	1,344,259.50
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,336,149.85
	SIGB 3% 09/01/24	1,570,000.00	1,669,742.10
	シンガポールドル 小計	18,750,000.00	19,944,562.70 (1,600,551,156)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,519,500.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,725,164.00
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,719,295.30
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,720,787.05
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	1,972,469.65
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	356,450.50
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,487.50
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,226,296.80
	MGS 3.844% 04/15/33	2,810,000.00	2,856,112.10
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,863.75
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,061,780.65
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,163,154.20
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,033,108.95
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,681,235.80
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,786,265.00
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,086,941.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,964,248.50
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,142,844.50
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,766,859.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,610,496.50
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,117,620.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,472,282.00
	MGS 4.392% 04/15/26	3,530,000.00	3,734,740.00
MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,287,440.80	
MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,649,790.00	
MGS 4.736% 03/15/46	2,270,000.00	2,533,024.90	

	MGS 4.762% 04/07/37	3,370,000.00	3,828,421.10	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	915,064.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,781,973.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,648,764.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	679,482.00	
	マレーシアリングット 小計	64,240,000.00	67,332,962.55 (1,775,570,222)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	46,150,000.00	51,084,127.25	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,871,530.90	
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,205,151.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,715,461.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,744,320.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,675,721.80	
	SAGB 8.25% 03/31/32	33,120,000.00	30,139,200.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	23,929,029.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,810,057.70	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	39,261,458.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	19,752,300.00	
	SAGB 8% 01/31/30	31,310,000.00	28,914,785.00	
	SAGB 9% 01/31/40	19,620,000.00	17,828,399.70	
	南アフリカランド 小計	323,890,000.00	296,931,542.35 (2,179,477,520)	
	合計		385,197,167,803 (385,197,167,803)	

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 205銘柄	100.0%	48.4%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 298銘柄	100.0%	37.4%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%

シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	31銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年11月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	671,081,439
コール・ローン	603,107,236
国債証券	51,954,916,112
派生商品評価勘定	516,270
未収入金	60,670,799
未収利息	871,155,065
前払費用	53,339,299
流動資産合計	54,214,786,220
資産合計	54,214,786,220
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,006,755
未払金	242,654,584
未払解約金	236,159,803
未払利息	1,344
流動負債合計	479,822,486
負債合計	479,822,486
純資産の部	
元本等	
元本	30,670,496,451
剰余金	
剰余金又は欠損金()	23,064,467,283
元本等合計	53,734,963,734
純資産合計	53,734,963,734
負債純資産合計	54,214,786,220

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2019年11月11日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2019年11月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	30,670,496,451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 1.7520円 (1万口当たり純資産額) (17,520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11月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2019年11月11日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年11月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	28,933,282,533円
期中追加設定元本額	2,840,286,280円
期中一部解約元本額	1,103,072,362円
期末元本額	30,670,496,451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	4,230,866,916円
世界経済インデックスファンド	5,575,416,336円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,312,618,230円
DC世界経済インデックスファンド	4,951,233,458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）	1,825,167,644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）	99,071,438円
分散投資コア戦略ファンドA	235,054,582円
分散投資コア戦略ファンドS	1,045,456,060円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	231,433,752円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,301,888,058円
コア投資戦略ファンド（切替型）	167,723,590円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	194,347,018円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,196,041円
SMT インデックスバランス・オープン	195,470,156円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,321,887,990円
SMT 世界経済インデックス・オープン	94,273,848円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	118,728,986円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	163,952,016円

区分	2019年11月11日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,258,348円
グローバル経済コア	736,830,328円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	28,048,658円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	3,336,327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)	112,053,216円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,911,294,695
合計	2,911,294,695

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2019年11月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	176,112,142	-	175,842,363	269,779
	アメリカドル	61,618,200	-	62,134,470	516,270
	ロシアルーブル	114,493,942	-	113,707,893	786,049
	売建	176,112,142	-	176,332,848	220,706
	アメリカドル	114,493,942	-	114,714,648	220,706
	ロシアルーブル	61,618,200	-	61,618,200	-
	合計	352,224,284	-	352,175,211	490,485

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	22,700,000.00	29,054,751.50		
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	93,840,670.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	51,600,000.00	48,971,754.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	81,057,088.00		
		MBONO 6.5% 06/10/21	83,000,000.00	82,857,655.00		
		MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000.00	65,142,973.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000.00	95,766,887.50		
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	52,937,898.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	64,793,325.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	25,466,520.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	68,500,000.00	76,355,580.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	54,665,718.75		
		MBONO 8% 09/05/24	39,800,000.00	41,906,813.00		
		MBONO 8% 11/07/47	36,400,000.00	39,471,432.00		
		MBONO 8% 12/07/23	79,600,000.00	83,377,816.00		
	メキシコペソ 小計			885,150,000.00	935,666,881.75 (5,342,657,894)	
	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000.00	25,646,145.24		
		BLTN 0% 07/01/21	16,250,000.00	15,066,350.00		
		BLTN 0% 07/01/22	13,250,000.00	11,534,237.62		
		BLTN 0% 07/01/23	23,250,000.00	18,886,577.17		
		BNTNF 10% 01/01/21	23,750,000.00	25,109,117.39		
		BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000.00	35,650,982.05		
		BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000.00	28,347,650.18		
		BNTNF 10% 01/01/27	19,350,000.00	23,068,605.51		
		BNTNF 10% 01/01/29	8,150,000.00	9,922,070.75		
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,740,375.00		
BRAZIL 12.5% 01/05/22		450,000.00	520,593.75			
BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,086,437.50				
ブラジルリアル 小計			192,600,000.00	197,579,142.16 (5,174,597,733)		

チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/21	945,000,000.00	979,923,963.37
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,955,000,000.00	2,152,761,104.12
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,545,000,000.00	1,755,904,140.03
	BTPCL 4% 03/01/23	1,260,000,000.00	1,334,679,164.28
	BTPCL 5% 03/01/35	2,170,000,000.00	2,581,050,021.41
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	2,390,491,485.78
チリペソ 小計		9,605,000,000.00	11,194,809,878.99 (1,634,442,242)
コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	23,195,683,500.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	9,500,000,000.00	9,859,432,500.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	59,100,000,000.00	74,139,768,000.00
コロンビアペソ 小計		92,250,000,000.00	107,194,884,000.00 (3,505,272,706)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.4% 08/12/34	4,000,000.00	4,266,680.00
	PERUGB 5.7% 08/12/24	6,050,000.00	6,712,354.00
	PERUGB 5.94% 02/12/29	7,150,000.00	8,057,978.50
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	7,983,815.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,800,000.00	9,034,077.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,500,000.00	9,180,937.50
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,950,000.00	9,659,210.25
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	8,188,992.50
ペルーヌエボソル 小計		53,950,000.00	63,084,044.75 (2,050,862,294)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	13,442,910.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,009,679.75
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	30,452,589.75 (88,617,036)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,478,030.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	25,514,250.00
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	45,992,280.00 (94,744,096)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	3,252,608.25
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,050,000.00	7,340,553.50
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	9,052,338.75
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,700,000.00	6,623,821.00
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	10,480,228.75
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	8,701,545.00
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,523,112.00
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,988,209.00
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	5,202,028.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,406,834.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	6,021,405.00
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	5,119,364.00

	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	10,429,074.25	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,872,860.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	6,445,938.75	
	トルコリラ 小計	108,600,000.00	102,459,920.25 (1,940,590,889)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	38,200,000.00	34,979,358.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	29,000,000.00	28,018,350.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,400,000.00	43,510,208.00	
	CZGB 1% 06/26/26	47,900,000.00	46,357,859.50	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	54,353,615.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	51,600,000.00	55,707,360.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	48,700,000.00	53,890,446.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	39,698,923.50	
	CZGB 4.7% 09/12/22	39,000,000.00	42,680,235.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	45,319,735.50	
		チェココルナ 小計	427,900,000.00	444,516,090.50 (2,098,115,947)
ハンガリーフォリント	HGB 0.5% 04/21/21	170,000,000.00	171,150,050.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	555,000,000.00	576,733,800.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	588,595,840.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	357,657,850.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	462,500,000.00	500,043,437.50	
	HGB 3% 06/26/24	512,500,000.00	562,350,875.00	
	HGB 3% 08/21/30	315,000,000.00	343,379,925.00	
	HGB 3% 10/27/27	626,000,000.00	688,002,170.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	636,000,000.00	786,137,340.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	531,000,000.00	645,154,380.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	467,862,700.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	560,381,505.00	
	ハンガリーフォリント 小計	5,504,500,000.00	6,247,449,872.50 (2,252,205,679)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,724,094.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,210,120.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	4,000,000.00	4,076,480.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,711,426.75	
	POLGB 2.5% 04/25/24	11,550,000.00	11,896,211.25	
	POLGB 2.5% 07/25/26	15,600,000.00	16,045,146.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,300,000.00	14,698,398.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	11,800,000.00	12,337,962.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	8,450,000.00	8,885,217.25	
	POLGB 2% 04/25/21	10,050,000.00	10,153,464.75	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,567,219.50	

	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,754,271.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	12,107,515.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,350,000.00	5,792,792.75	
ポーランドズロチ 小計		159,350,000.00	165,960,318.25	(4,678,421,371)
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	135,100,000.00	137,551,389.50	
	RFLB 6.9% 05/23/29	138,000,000.00	144,218,970.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	186,348,255.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	171,293,323.50	
	RFLB 7.15% 11/12/25	47,500,000.00	49,908,012.50	
	RFLB 7.25% 05/10/34	128,000,000.00	136,707,840.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	129,200,000.00	136,398,378.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	180,490,310.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	126,701,685.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	64,500,000.00	66,400,170.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	138,700,000.00	144,743,852.50	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	192,706,137.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	177,047,000.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	161,450,835.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	100,275,894.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	110,915,552.00	
	RFLB 7% 12/15/21	138,000,000.00	141,474,840.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	173,759,820.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	144,315,790.50	
ロシアルーブル 小計		2,523,250,000.00	2,682,708,054.50	(4,587,430,773)
マレーシアリンギット	MGS 3.62% 11/30/21	10,200,000.00	10,316,739.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,475,551.25	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,939,385.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,831,477.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	11,550,000.00	11,999,179.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	13,500,000.00	13,932,472.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,324,142.75	
	MGS 3.906% 07/15/26	9,350,000.00	9,666,310.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,557,840.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,805,303.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	11,850,000.00	12,064,129.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,450,000.00	9,818,833.50	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,900,000.00	7,838,607.00	
マレーシアリンギット 小計		123,350,000.00	127,569,971.25	(3,364,020,141)
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	96,500,000.00	97,827,357.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	94,500,000.00	97,956,810.00	

	THAIGB 2.4% 12/17/23	78,500,000.00	81,565,425.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	65,400,000.00	72,016,518.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	84,500,000.00	86,134,652.50	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	78,000,000.00	95,108,130.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	214,506,529.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,506,640.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	164,409,370.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	64,100,000.00	67,170,069.50	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	64,400,000.00	79,018,800.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	76,000,000.00	86,224,280.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000.00	148,651,100.00	
	タイバーツ 小計	1,214,900,000.00	1,381,095,682.50 (4,971,944,457)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	25,005,750.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	25,000,000.00	25,261,625.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	24,216,300.00	
	フィリピンペソ 小計	70,000,000.00	74,483,675.00 (160,884,738)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,089,339,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,943,469,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,518,318,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	40,800,000,000.00	40,069,272,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	34,277,940,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	27,355,555,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	23,336,235,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	25,000,000,000.00	25,450,500,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	33,700,000,000.00	34,458,755,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	44,300,000,000.00	44,894,506,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	12,100,000,000.00	12,075,376,500.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	31,591,636,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	33,800,000,000.00	36,827,466,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	35,522,340,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	20,293,024,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	33,019,371,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000.00	63,145,614,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	38,500,000,000.00	42,136,710,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	16,100,000,000.00	17,488,786,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000.00	55,087,672,500.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	36,505,953,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,371,573,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	36,991,500,000.00		
	インドネシアルピア 小計	656,900,000,000.00	693,450,912,500.00 (5,408,917,117)	

南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	98,900,000.00	109,473,893.50
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,786,036.50
	SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	36,442,577.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	22,950,000.00	22,983,162.75
	SAGB 7.75% 02/28/23	42,500,000.00	42,848,500.00
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	35,005,828.00
	SAGB 8.25% 03/31/32	50,250,000.00	45,727,500.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	55,100,000.00	48,652,749.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	59,832,201.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000.00	78,085,706.00
	SAGB 8.875% 02/28/35	35,250,000.00	32,765,580.00
	SAGB 8% 01/31/30	63,300,000.00	58,457,550.00
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	31,803,975.00
	南アフリカランド 小計	689,950,000.00	626,865,258.75 (4,601,190,999)
合計		51,954,916,112 (51,954,916,112)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.0%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	3.1%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	6.7%
ペルーヌエボソル	国債証券 8銘柄	100.0%	3.9%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	3.7%
チェココルナ	国債証券 10銘柄	100.0%	4.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	4.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.0%
ロシアルーブル	国債証券 19銘柄	100.0%	8.8%
マレーシアリンギット	国債証券 13銘柄	100.0%	6.5%
タイバーツ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.6%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 23銘柄	100.0%	10.4%

南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	8.9%
----------	-----------	--------	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年11月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,341,378,839
投資証券	120,252,277,720
派生商品評価勘定	50,404,500
未収入金	236,409,086
未収配当金	1,037,501,274
差入委託証拠金	39,447,000
流動資産合計	123,957,418,419
資産合計	123,957,418,419
負債の部	
流動負債	
前受金	50,404,500
未払解約金	465,190,831
未払利息	5,219
流動負債合計	515,600,550
負債合計	515,600,550
純資産の部	
元本等	
元本	57,851,231,573
剰余金	
剰余金又は欠損金()	65,590,586,296
元本等合計	123,441,817,869
純資産合計	123,441,817,869
負債純資産合計	123,957,418,419

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年11月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2019年11月11日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年11月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,851,231,573口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1338円 (21,338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11月11日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2019年11月11日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年11月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	61,170,885,363円
期中追加設定元本額	5,308,052,215円
期中一部解約元本額	8,627,706,005円
期末元本額	57,851,231,573円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,622,711,311円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,878,777円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	12,898,051,942円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,918,521,534円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,137,466,442円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,160,312,300円
分散投資コア戦略ファンド A	2,149,549,811円
分散投資コア戦略ファンド S	4,118,772,153円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,012,857,622円
S M T インデックスバランス・オープン	31,179,172円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	475,108,807円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	2,007,905円
グローバル経済コア	317,728,010円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	5,061,320円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	393,249,007円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,904,149円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	899,407,062円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	944,939,813円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	400,113,931円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	325,410,505円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		19,372,568,628
合計		19,372,568,628

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2019年11月11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	不動産投信指数先物 取引 買建	3,109,738,500	-	3,160,143,000	50,404,500
	合計	3,109,738,500	-	3,160,143,000	50,404,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,120	137,872,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,581	191,933,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,625	2,443,250,000	
	MCUBS MidCity投資法人	12,941	1,501,156,000	
	森ヒルズリート投資法人	12,552	2,166,475,200	

産業ファンド投資法人	13,423	2,237,614,100	
アドバンス・レジデンス投資法人	10,348	3,601,104,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,790	1,427,258,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,467	3,072,454,000	
G L P 投資法人	27,173	3,630,312,800	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,543	1,574,149,500	
日本プロロジスリート投資法人	15,675	4,602,180,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,660	951,180,000	
O n e リート投資法人	1,701	563,881,500	
イオンリート投資法人	11,774	1,720,181,400	
ヒューリックリート投資法人	9,278	1,857,455,600	
日本リート投資法人	3,544	1,670,996,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	70,091	1,431,258,220	
日本ヘルスケア投資法人	529	106,276,100	
積水ハウス・リート投資法人	31,900	3,040,070,000	
トーセイ・リート投資法人	2,375	313,025,000	
ケネディクス商業リート投資法人	4,214	1,166,856,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,327	307,629,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,184	255,309,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	34,024	6,638,082,400	
いちごホテルリート投資法人	1,807	236,355,600	
ラサールロジポート投資法人	10,144	1,631,155,200	
スターアジア不動産投資法人	3,621	408,448,800	
マリモ地方創生リート投資法人	938	120,251,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,687	1,184,967,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,854	177,427,800	
さくら総合リート投資法人	2,360	220,660,000	
投資法人みらい	11,834	693,472,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,560	361,472,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,148	749,652,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,531	206,685,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,584	207,028,800	
タカラレーベン不動産投資法人	3,096	366,876,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,688	200,703,200	
日本ビルファンド投資法人	10,565	8,430,870,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,910	7,800,650,000	
日本リートファンド投資法人	20,620	5,012,722,000	
オリックス不動産投資法人	21,738	5,127,994,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,906	3,449,547,000	
プレミア投資法人	9,854	1,544,121,800	
東急リアル・エステート投資法人	7,315	1,444,712,500	

グローバル・ワン不動産投資法人	7,576	1,047,760,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,496	5,242,144,000	
森トラスト総合リート投資法人	7,797	1,486,887,900	
インヴィンシブル投資法人	47,856	3,048,427,200	
フロンティア不動産投資法人	3,875	1,848,375,000	
平和不動産リート投資法人	6,794	949,121,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,128	1,953,784,800	
福岡リート投資法人	5,642	1,024,023,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,375	2,767,500,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,448	919,142,400	
大和証券オフィス投資法人	2,518	2,110,084,000	
阪急阪神リート投資法人	4,928	864,864,000	
スターツプロシード投資法人	1,699	337,931,100	
大和ハウスリート投資法人	14,709	4,420,054,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,146	3,057,702,000	
日本賃貸住宅投資法人	12,271	1,208,693,500	
ジャパンエクセレント投資法人	9,770	1,782,048,000	
合計	630,627	120,252,277,720	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	292,519,565
コール・ローン	58,620,125
投資証券	88,151,437,762
派生商品評価勘定	48,300
未収入金	196,678,450
未収配当金	127,535,244
流動資産合計	88,826,839,446
資産合計	88,826,839,446
負債の部	
流動負債	

	2019年11月11日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	179,000
未払金	35,984
未払解約金	163,174,505
未払利息	130
流動負債合計	163,389,619
負債合計	163,389,619
純資産の部	
元本等	
元本	44,803,032,363
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	43,860,417,464
元本等合計	88,663,449,827
純資産合計	88,663,449,827
負債純資産合計	88,826,839,446

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p>

	2019年11月11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11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,803,032,363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 1.9790円 (1万口当たり純資産額) (19,790円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年11月11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11月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月11日
期首元本額	40,519,425,507円
期中追加設定元本額	6,613,288,981円
期中一部解約元本額	2,329,682,125円

区分	2019年11月11日現在
期末元本額	44,803,032,363円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	86,801,518円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	132,217,294円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,633,465,008円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,000,562円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,316,558,703円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,610,098,734円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,497,952,414円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,115,336,983円
分散投資コア戦略ファンドA	1,458,601,362円
分散投資コア戦略ファンドS	4,084,607,660円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,010,068,837円
SMT インデックスバランス・オープン	178,671,285円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	519,579,140円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,039,066円
グローバル経済コア	321,704,195円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,089,449円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	429,967,569円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,758,321円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	718,168,241円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	640,346,022円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,710,156,016
合計	6,710,156,016

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年11月11日現在）

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

市場取引以外の取引	売建	283,844,120	-	283,974,820	130,700
	アメリカドル	252,279,820	-	252,447,820	168,000
	ユーロ	12,054,100	-	12,025,000	29,100
	香港ドル	19,510,200	-	19,502,000	8,200
合計		283,844,120	-	283,974,820	130,700

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	54,390	1,491,373.80	
		AGREE REALTY CORP	25,220	1,879,142.20	
		ALEXANDER'S INC	1,490	480,271.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	69,760	10,736,761.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,910	1,445,351.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	84,080	3,961,008.80	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	880,144.30	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	156,030	4,011,531.30	
		AMERICOLD REALTY TRUST	117,100	4,139,485.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	92,400	4,912,908.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	133,463	2,184,789.31	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	242,937.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	131,185.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,620	17,967,357.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	104,490.00	
		BOSTON PROPERTIES	88,380	12,226,489.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	133,545.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	102,778	1,567,364.50	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	178,620	3,852,833.40	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	42,700	812,794.50	

BRT APARTMENTS CORP	5,000	87,050.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	59,830	6,588,479.60	
CARETRUST REIT INC	57,290	1,175,017.90	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	154,752.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	143,901.50	
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	434,729.20	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	492,765.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	74,460.00	
COLONY CAPITAL INC	283,360	1,416,800.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,020	1,476,505.80	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	438,246.00	
CORECIVIC INC	78,130	1,261,799.50	
COREPOINT LODGING INC	22,000	215,600.00	
CORESITE REALTY CORP	23,310	2,648,715.30	
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,720	1,951,560.00	
COUSINS PROPERTIES INC	91,803	3,654,677.43	
CUBESMART	120,490	3,732,780.20	
CYRUSONE INC	68,960	4,523,776.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	1,243,210.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	127,790	14,896,480.30	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	100,710	4,354,700.40	
DUKE REALTY CORP	223,080	7,716,337.20	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	45,300	1,034,652.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	23,570	3,085,784.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	95,920	1,388,921.60	
EPR PROPERTIES	47,560	3,474,733.60	
EQUINIX INC	51,900	27,523,089.00	
EQUITY COMMONWEALTH	72,100	2,299,990.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,360	7,507,895.20	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	213,740	17,949,885.20	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,510	1,175,068.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	40,370	12,713,320.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	79,200	8,418,168.00	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	128,630.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,060	5,530,048.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,500	3,127,210.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,190	1,143,770.90	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	466,984.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	301,860.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	126,630	5,320,992.60	
GEO GROUP INC/THE	79,390	1,204,346.30	
GETTY REALTY CORP	19,000	626,810.00	

GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	341,250.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	60,500.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,500	287,405.00	
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	1,022,949.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,340	2,617,521.20	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	127,970	3,722,647.30	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,010	10,174,716.90	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	253,470.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	65,190	3,029,379.30	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	450,520	7,735,428.40	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	95,020	3,361,807.60	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	715,500.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	797,825.20	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,040	599,948.80	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	459,880.22	
INVITATION HOMES INC	296,260	8,742,632.60	
IRON MOUNTAIN INC	174,690	5,684,412.60	
JBG SMITH PROPERTIES	74,160	2,942,668.80	
KILROY REALTY CORPORATION	56,750	4,693,225.00	
KIMCO REALTY CORP	257,130	5,361,160.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	898,740.00	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	156,266	1,675,171.52	
LIBERTY PROPERTY TRUST	96,240	5,649,288.00	
LIFE STORAGE INC	29,250	3,159,585.00	
LTC PROPERTIES INC	23,290	1,080,423.10	
MACERICH CO/THE	66,650	1,848,871.00	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	1,205,360.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	856,564	796,604.52	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	271,770	5,421,811.50	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,220	9,408,777.80	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	816,371.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	103,650	5,721,480.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	36,700	1,186,144.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	27,450	2,175,961.50	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	300,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	597,740.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	922,274.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	131,726	5,409,986.82	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	211,840.00	
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	1,663,317.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	149,874	3,450,099.48	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,960	2,064,380.80	

PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	184,147.20	
PHYSICIANS REALTY TRUST	115,670	2,098,253.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	76,840	1,678,954.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,400	77,264.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	299,920.00	
PROLOGIS INC	385,530	33,568,097.10	
PS BUSINESS PARKS INC	11,950	2,100,571.00	
PUBLIC STORAGE	91,770	19,395,589.50	
QTS REALTY TRUST INC	33,350	1,690,178.00	
REALTY INCOME CORP	195,300	14,905,296.00	
REGENCY CENTERS CORP	103,470	6,690,370.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	70,630	1,279,109.30	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	129,080	1,773,559.20	
RETAIL VALUE	8,630	316,030.60	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	68,780	3,181,762.80	
RLJ LODGING TRUST	100,640	1,703,835.20	
RPT REALTY	51,580	744,815.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31,240	2,804,102.40	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	119,750	2,719,522.50	
SAFEHOLD INC	4,700	158,625.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	354,631.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	143,800	1,197,854.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	20,200	879,306.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	101,860	2,443,621.40	
SIMON PROPERTY GROUP	188,510	29,122,909.90	
SITE CENTERS CORP	84,059	1,241,551.43	
SL GREEN REALTY CORP	50,430	4,336,980.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	56,690	2,797,084.60	
STAG INDUSTRIAL INC	80,320	2,411,206.40	
STORE CAPITAL CORP	128,230	4,977,888.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	788,258.80	
SUN COMMUNITIES INC	56,160	8,637,408.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	135,100	1,887,347.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	874,996.20	
TAUBMAN CENTERS INC	39,650	1,395,283.50	
TERRENO REALTY CORP	41,570	2,309,213.50	
UDR INC	181,320	8,589,128.40	
UMH PROPERTIES INC	20,000	301,400.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	907,253.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	1,429,885.90	
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	393,195.00	

	VENTAS INC	228,590	13,610,248.60	
	VEREIT INC	652,720	6,129,040.80	
	VICI PROPERTIES INC	279,550	6,787,474.00	
	VORNADO REALTY TRUST	95,930	6,309,316.10	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	455,732.50	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	1,448,651.60	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	72,920	2,272,187.20	
	WELLTOWER INC	247,760	20,534,348.80	
	WHITESTONE REIT	22,610	310,209.20	
	WP CAREY INC	105,150	8,880,969.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	1,445,294.20	
	アメリカドル 小計	14,537,882	597,365,502.13 (65,208,418,212)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,850	1,961,157.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	507,551.40	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	612,875.40	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,890	2,647,882.40	
	CHOICE PROPERTIES REIT	95,660	1,279,930.80	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	731,930.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,367	415,543.92	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	41,000	616,640.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	57,280	956,003.20	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	452,244.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	546,532.80	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,450	1,084,219.50	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	90,460	1,988,310.80	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,000	541,960.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	495,465.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	104,512.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	148,332.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	458,599.33	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	39,000	460,590.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	95,250	2,514,600.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	102,170.00	
	SLATE RETAIL REIT	10,300	132,458.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	44,930	1,416,193.60	
		33,000	409,860.00	

	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT			
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	103,950.00	
	カナダドル 小計	918,800	20,689,511.15 (1,707,298,460)	
ユーロ	AEDIFICA	14,966	1,670,205.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	97,000	1,624,750.00	
	ALTAREA	2,000	384,000.00	
	BEFIMMO S.C.A.	13,310	770,649.00	
	COFINIMMO	15,330	2,063,418.00	
	COVIVIO(FP)	27,990	2,824,191.00	
	EUROCOMMERCIAL	25,340	693,809.20	
	GECINA SA	33,970	5,143,058.00	
	GREEN REIT PLC	440,770	841,870.70	
	HAMBORNER REIT AG	44,000	427,152.00	
	HIBERNIA REIT PLC	402,550	574,036.30	
	ICADE	16,960	1,472,128.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	200,374.70	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	155,240	1,802,336.40	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	391,820.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	225,021	384,785.91	
	KLEPIERRE	126,050	4,167,213.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	279,300.00	
	MERCIALYS	10,970	135,369.80	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	225,270	2,917,246.50	
	MONTEA	5,900	473,180.00	
	NSI NV	9,300	383,625.00	
	RETAIL ESTATES	4,200	370,860.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	84,560	12,092,080.00	
	VASTNED RETAIL	10,950	326,857.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,140	1,829,188.00	
	WERELDHAVE NV	24,970	532,859.80	
	ユーロ 小計	2,110,847	44,776,364.41 (5,384,357,820)	
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	72,000	68,256.00	
	ASSURA PLC	1,540,150	1,122,769.35	
	BIG YELLOW GROUP PLC	94,570	1,088,500.70	
	BRITISH LAND CO PLC	574,790	3,293,546.70	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	76,270.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	368,000	320,160.00	
	DERWENT LONDON PLC	64,880	2,279,883.20	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	370,000	353,350.00	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	168,540	1,309,555.80
	HAMMERSON PLC	470,100	1,323,801.60
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	265,688.64
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	184,147.48
	LAND SECURITIES GROUP PLC	467,800	4,125,996.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	504,110	1,167,518.76
	LXI REIT PLC	297,000	376,002.00
	NEWRIVER REIT PL	173,000	338,388.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	320,000	291,520.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	785,700	1,099,980.00
	RDI REIT PLC	154,400	203,190.40
	REGIONAL REIT LTD	232,000	246,384.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	864,900.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	197,750.00
	SEGRO PLC	656,550	5,488,758.00
	SHAFTESBURY PLC	141,730	1,289,034.35
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	196,491.68
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,065,610	1,566,446.70
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	469,000	405,685.00
	UNITE GROUP PLC	175,240	1,978,459.60
	WORKSPACE GROUP PLC	78,220	827,567.60
	イギリス債券 小計	11,016,216	32,350,001.56 (4,517,677,717)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	214,440	823,449.60
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	222,750.00
	ARENA REIT	141,000	407,490.00
	BWP TRUST	298,560	1,236,038.40
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	151,000	465,080.00
	CHARTER HALL GROUP	292,530	3,112,519.20
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	189,846	1,015,676.10
	CHARTER HALL RETAIL REIT	218,380	956,504.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	130,800	465,648.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,242,633	1,602,996.57
	DEXUS	674,060	7,744,949.40
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	444,075.00
	GOODMAN GROUP	986,690	13,991,264.20
	GPT GROUP	1,203,310	7,075,462.80
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	172,860	732,926.40
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	250,380.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	138,588	587,613.12
	MIRVAC GROUP	2,451,490	7,820,253.10
	NATIONAL STORAGE REIT	480,000	907,200.00
	RURAL FUNDS GROUP	189,816	324,585.36

	SCENTRE GROUP	3,281,570	12,699,675.90	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	542,230	1,453,176.40	
	STOCKLAND	1,485,780	7,235,748.60	
	VICINITY CENTERS	1,973,650	5,151,226.50	
	VIVA ENERGY REIT	290,000	791,700.00	
	オーストラリアドル 小計	17,188,733	77,518,389.05 (5,799,925,868)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	702,900.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	700,300	1,470,630.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	921,030	1,441,411.95	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	615,000	1,107,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	487,396.00	
	ニュージーランドドル 小計	2,918,790	5,209,337.95 (360,434,092)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,223,000	6,396,290.00	
	FORTUNE REIT	813,000	7,642,200.00	
	LINK REIT	1,285,000	109,353,500.00	
	PROSPERITY REIT	782,000	2,416,380.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	3,434,400.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	860,000	4,558,000.00	
	香港ドル 小計	5,599,000	133,800,770.00 (1,865,182,733)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	245,000	343,000.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	474,150.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,583,966	4,577,661.74	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	734,000	983,560.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	591,000	416,655.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,765,228	3,565,760.56	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,744,900	4,344,801.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	399,429	611,126.37	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	733,280.00	
	ESR REIT	1,163,365	610,766.62	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	340,800.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	348,140.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	484,329	1,268,941.98	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	412,300	663,803.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	326,600.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	977,820	1,192,940.40	
	KEPPEL DC REIT	804,003	1,527,605.70	
	KEPPEL REIT	1,241,400	1,489,680.00	

	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	233,730.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,362,873	3,093,721.71	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	972,460	2,401,976.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,830,952	3,021,070.80	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,390,800	1,766,316.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,363,644	729,549.54	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	815,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	217,735.70	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	250,000	201,250.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	379,016	185,717.84	
	SPH REIT	462,300	522,399.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	519,130.50	
	SUNTEC REIT	1,451,400	2,656,062.00	
	シンガポールドル 小計	26,170,325	40,182,931.66 (3,224,680,265)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	155,750,000.00	
	韓国ウォン 小計	17,500	155,750,000.00 (14,671,650)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	104,000	2,202,720.00	
	イスラエルシェケル 小計	104,000	2,202,720.00 (68,790,945)	
	合計	80,582,093	88,151,437,762 (88,151,437,762)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 156銘柄	100.0%	74.0%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.1%
イギリスポンド	投資証券 29銘柄	100.0%	5.1%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.1%

シンガポールドル	投資証券	31銘柄	100.0%	3.7%
韓国ウォン	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【SMT 8資産インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

(2019年11月29日現在)

資産総額	34,163,076円
負債総額	9,156円
純資産総額(-)	34,153,920円
発行済口数	30,292,666口
1口当たり純資産額(/)	1.1275円
(1万口当たり純資産額)	(11,275円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年11月29日現在)

資産総額	325,909,328,011円
負債総額	878,019,589円
純資産総額(-)	325,031,308,422円
発行済口数	205,511,140,335口
1口当たり純資産額(/)	1.5816円
(1万口当たり純資産額)	(15,816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11月29日現在)

資産総額	396,721,536,150円
負債総額	2,937,868,544円
純資産総額(-)	393,783,667,606円
発行済口数	140,822,679,861口
1口当たり純資産額(/)	2.7963円
(1万口当たり純資産額)	(27,963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11月29日現在)

資産総額	62,108,727,815円
負債総額	171,984,889円
純資産総額（ - ）	61,936,742,926円
発行済口数	21,694,517,802口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8549円
（1万口当たり純資産額）	（28,549円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年11月29日現在)

資産総額	561,029,442,871円
負債総額	12,331,507,977円
純資産総額（ - ）	548,697,934,894円
発行済口数	385,021,315,509口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4251円
（1万口当たり純資産額）	（14,251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11月29日現在)

資産総額	395,693,196,356円
負債総額	181,998,306円
純資産総額（ - ）	395,511,198,050円
発行済口数	139,094,083,041口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8435円
（1万口当たり純資産額）	（28,435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11月29日現在)

資産総額	53,198,195,965円
負債総額	19,346,975円
純資産総額（ - ）	53,178,848,990円
発行済口数	30,604,891,723口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7376円
（1万口当たり純資産額）	（17,376円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年11月29日現在)

資産総額	126,841,166,960円
負債総額	715,901,014円
純資産総額（ - ）	126,125,265,946円
発行済口数	57,604,632,792口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1895円
（1万口当たり純資産額）	（21,895円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年11月29日現在)

資産総額	91,720,619,734円
負債総額	453,050,276円
純資産総額（ - ）	91,267,569,458円
発行済口数	44,900,149,847口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0327円
（1万口当たり純資産額）	（20,327円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

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、）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年11月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[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2020年 2月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年11月29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	538	12,742,439
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	311,227
単位型公社債投資信託	15	127,121
合計	640	13,180,787

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。

また、委託者の中間財務諸表は、「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条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 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、第33期事業年度（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。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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	282,407
器具備品	1	79,655	564,981
その他	1	1,912	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 (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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		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 - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと

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

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

(*) 負債に計上されているものについては、() で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

（*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

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

（4）有価証券及び投資有価証券

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

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

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

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位：千円）

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

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

(単位:千円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

合計	13,602,178	13,035,220	566,957
----	------------	------------	---------

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建 ユーロ		6,313	-	86
			合計		8,643,951

(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主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	
有価証券評価差額	-		173,602	"
繰延ヘッジ損益	-		58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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

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

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

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

(2)実施した会計処理の概要

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料 等	9,571,581	未払 手数料	1,568,277
							投資助言費 用	4,809,206	その他 未払金	424,421

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

(1株当たり情報)

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

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

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 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)
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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		305
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		30,860
利益剰余金合計		33,266
株主資本合計		52,505
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		120
繰延ヘッジ損益		286
評価・換算差額等合計		165
純資産合計		52,671
負債・純資産合計		62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	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	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間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．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．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、中間会計期間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。

6．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。

7．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。

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	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	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(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	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法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

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)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。

(6)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、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) 非上場株式(貸借対照表計上額:投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)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ため、「（５）投資有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

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	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）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。

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

（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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(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。

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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

(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。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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中間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中間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中間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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(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)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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

2020年 2月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三重銀行	15,295	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
a u カブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から

再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 8月 9日	有価証券届出書
2019年 8月 9日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 8資産インデックスバランス・オープンの2019年5月11日から2019年11月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 8資産インデックスバランス・オープンの2019年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月2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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績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

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。