

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年4月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（積極成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（積極成長型）

愛称として、「コアラップ（積極成長型）」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ ）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「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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。

確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方からの取得申込み及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）からの取得申込み（以下「確定拠出年金によるお申込み」といいます。）は、申込手数料を無料とします。

**（６）【申込単位】**

販売会社が定める単位とします。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「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「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）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

**（７）【申込期間】**

2020年 4月11日から2020年10月 9日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**（８）【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**（９）【払込期日】**

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

**（１０）【払込取扱場所】**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（１２）【その他】**

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「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。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、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。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< スイッチング >

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

< 受付不可日 > に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
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	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり (部分 ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回	(日本を 含む)	ファンド・		TOPIX	条件付運用型
債券	年4回	日本	オブ・ファ ンズ	なし	その他 ( )	ロング・ ショート型/絶 対収益追求型
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)	北米				その他 ( )
不動産投信	年12回 (毎月)	欧州				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信、その他 資産(バンク ローン、デリバ ティブ、為替予 約取引等))資 産配分変更 型))	日々	アジア				
	その他 ( )	オセアニア				
		中南米				
		アフリカ				
		中近東 (中東)				
		エマージ ング				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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。



いう。

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[ 投資形態による属性区分 ]

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

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[ 特殊型 ]

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

### <ファンドの特色>

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

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

## 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
- 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド<sup>\*1</sup>等に投資し、オルタナティブ運用<sup>\*2</sup>を行います。

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

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

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

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。

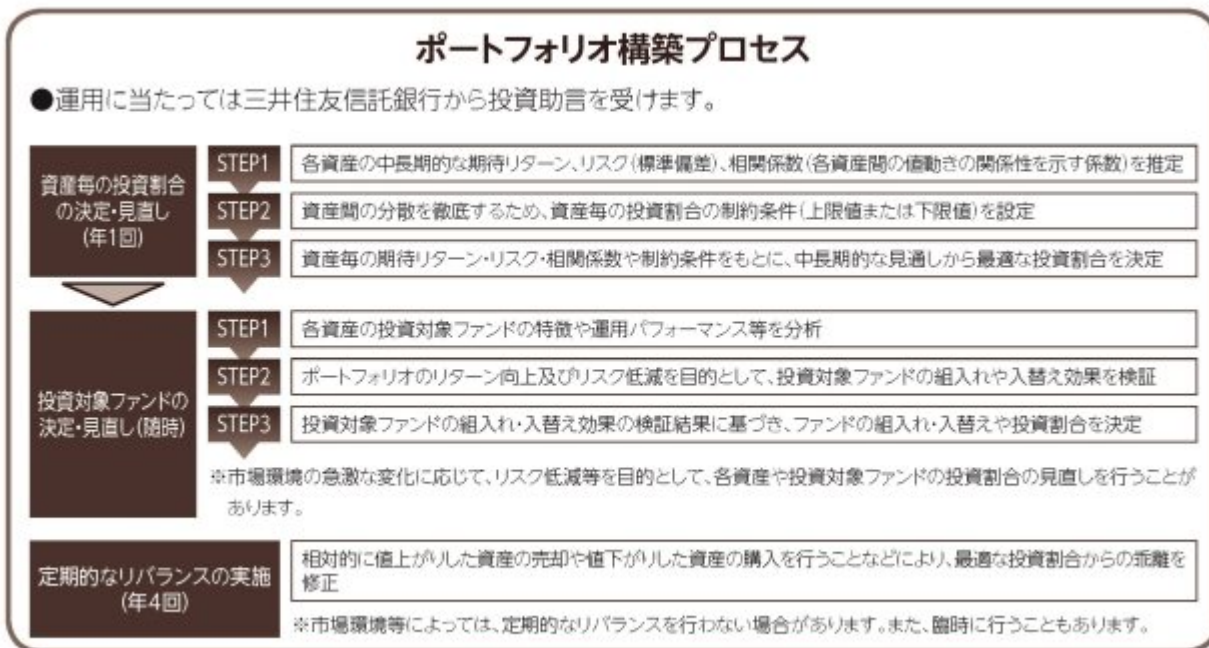
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

## 4. 成長性を重視した運用を行います。

「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。

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

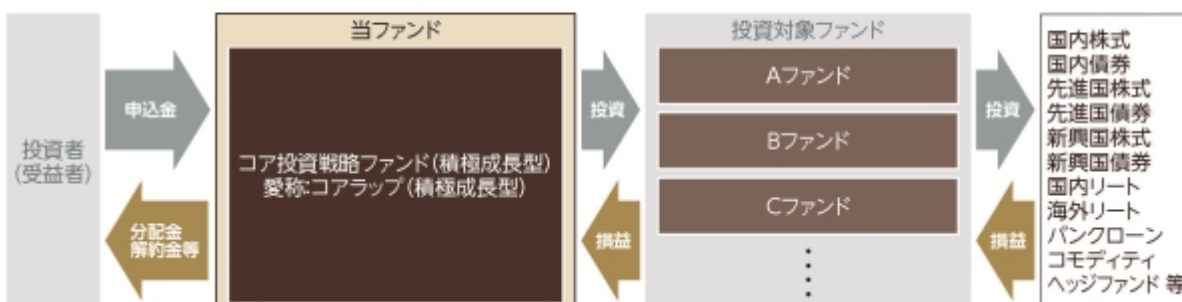
市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

## ？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

### 分配方針

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

### 主な投資制限

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

## 〈ご参考情報〉

### 米国地方債

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

### バンクローン

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

### コモディティ

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

### ヘッジファンド

ヘッジとは元々“回避する”という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引（先物取引、オプション取引等）等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益（絶対収益）を追求するファンド\*などがあります。

※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

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

## （２）【ファンドの沿革】

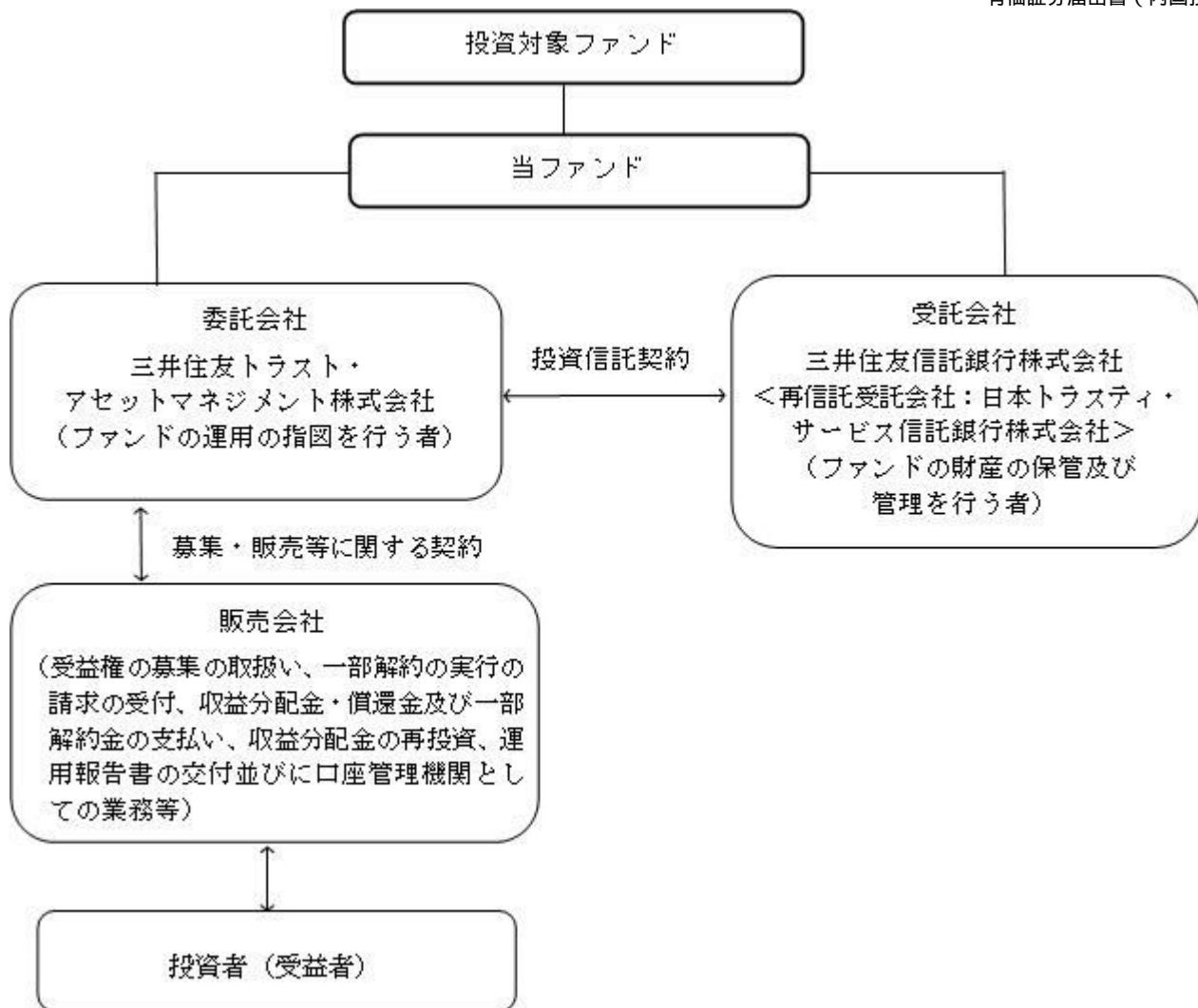
2018年10月26日

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





再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

#### 委託会社の概況（2020年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 基本方針

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

#### 投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

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

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

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。

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

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

### （参考）投資対象ファンドの概要

- ・ 全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・ 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2020年1月31日（（ ）のファンドに関しては2020年3月25日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資するJPX日経インデックス400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>



主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.077%（税抜 0.07%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年2月3日
信託期間	原則として2014年2月3日から2023年10月20日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

算出した株価指数です。

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

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

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

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

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

## 2.FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本株配当マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
投資態度	主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式の中から、予想配当利回りが比較的高いと判断される銘柄及び配当増が予想される銘柄群に投資します。 株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への実質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実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年2月2日
信託期間	原則として2015年2月2日から2025年4月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### 3. F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 4. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式

投資態度	<p>原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

##### 5. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行ないません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

## 6. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限



受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 7. 日本債券ツイン戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	<p>わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（ ）を上回る投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「NOMURA-BPI 総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### 8. FOFs用日本物価連動国債ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の物価連動国債に投資する日本物価連動国債 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の物価連動国債に投資します。なお、物価連動国債以外のわが国の国債に投資する場合があります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、物価・金利の見通し、個別銘柄の割高・割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。</p> <p>債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月14日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>

信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年4月11日
信託期間	原則として2014年4月11日から2024年2月14日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 9.FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ・バークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>ブルームバーグ・パークレイズ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年3月31日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として2017年3月31日から2027年1月18日</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

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

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

#### 10. マニユライフF0Fs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニユライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 NOMURA-BPI総合（ ）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	債券への実質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。 有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）

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

「NOMURA-BPI総合」とは、野村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。

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

投資顧問会社	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。

投資態度	<p>主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債及びレベニュー債）等に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。</p> <p>米国の投資適格地方債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p> <p>一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	毎月
信託報酬	<p>年率0.44%</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等及びデリバティブ取引に要する費用等並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年2月26日



関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Nuveen Asset Management ,LLC</li> <li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 名義書換事務受託会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 保管受託銀行 Sumitomo Mitsui Trust Bank Limited, London Branch</li> </ul>
------	---

## 12. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式
投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

### 13. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）（ ）

運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。

主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券並びに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20%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券並びに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5%以下とします。 同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 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信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 14. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 15. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）

投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 16. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

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

信託報酬	年率0.8%以内 なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l.</li> <li>・ 運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP</li> <li>・ 預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> </ul>

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

#### 17.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券



投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：9月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2014年10月8日
信託期間	原則として、2014年10月8日から2024年9月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 19. 大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。
主要投資対象	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。</p> <p>中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。</p> <p>世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>マザーファンドにおける運用指図の権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約取引、直物為替先渡取引およびデリバティブ取引はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月11日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.759%以内（税抜 0.69%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年5月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 20. LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

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

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日。第1期決算日は2019年10月9日）
収益の分配	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>* 分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜 0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

## 21. J-REITインデックス マザーファンド

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

主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>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、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新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。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

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

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

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

## 22. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	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並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。



<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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&amp;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&amp;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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

### 23.HYFI Loan Fund - JPY-USDクラス

投資顧問会社	Credit Suisse Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として米ドル建の貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）に投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。
投資態度	主として米ドル建のバンクローンに投資します。また、ハイイールド債券等にも投資します。 ポートフォリオの構築は、個別銘柄の信用力、割安度、流動性等に係る評価・分析に基づき行います。 米ドル建以外の資産に投資した場合、当該資産については原則として対米ドルでの為替予約取引等を行いません。 米ドル売り日本円買いの為替予約取引を行います。

<p>主な投資制限</p>	<p>第一順位担保権付のバンクローンへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。</p> <p>組入比率上位3業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の15%を上限とします。その他の業種への投資割合は、1業種あたり投資信託財産の純資産総額の12%を上限とします。</p> <p>組入比率上位10銘柄への投資割合の合計は、投資信託財産の純資産総額の20%を上限とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>投資顧問会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス</p>
<p>決算日</p>	<p>毎年12月31日</p>
<p>収益の分配</p>	<p>収益の分配は行いません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>年率0.65%</p> <p>なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、受託会社・管理事務代行会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。</p> <p>この他、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2013年10月2日</p>
<p>関係法人</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資顧問会社 Credit Suisse Asset Management, LLC</li> <li>・ 受託会社 G.A.S. (Cayman) Limited</li> <li>・ 管理事務代行会社 SMT Fund Services (Ireland) Limited</li> <li>・ 保管受託銀行 State Street Bank and Trust Company</li> </ul>

#### 24. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券
投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

## 25. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2020年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A 金価格（円ヘッジベース）（ ）（2020年1月31日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

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

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

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

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

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

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

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

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

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



管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A.</li> <li>・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP</li> <li>・副投資顧問会社 BlueBay Asset Management USA LLC</li> <li>・管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.</li> </ul>

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

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

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、Kairos Investment Management Ltd. が運用する外国投資信託証券「SuMI-KAIROS MULTI - STRATEGY FUND」（以下「スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドは、様々なヘッジファンド等に分散投資することで広範な運用戦略を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みません。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHLファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

## 31. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.88%（税抜 0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2013年4月2日
信託期間	2013年4月2日から2026年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 32. 米国株式LSマザーファンド

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



運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。</p> <p>米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。</p> <p>米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 33. コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主としてブルームバーグ商品指数（ ）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」 1 といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券 2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。</p> <p>2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。</p>
投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

#### 34. ノムラF0Fs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

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

## 投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

## 35.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。

投資態度	<p>公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。</p> <p>ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。</p> <p>為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p>
主な投資制限	<p>投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>投資信託証券への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	<p>運用報酬：年率0.6%</p> <p>成功報酬：15%</p> <p>月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 運用会社</li> <li style="padding-left: 20px;">UBS O'Connor LLC</li> <li>・ 保管銀行・管理事務代行会社</li> <li style="padding-left: 20px;">MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited</li> </ul>

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

## イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

## ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

## ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

## ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

## ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

## ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

## チ．外国為替予約取引の指図

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

## リ．資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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



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

#### <その他の投資制限>

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 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。

##### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の

金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

#### 信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

#### 米国地方債に関する信用リスク

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

##### <レベニュー債>

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

##### <一般財源保証債>

一般財源保証債は、起債する地方公共団体の課税権を含む全信用力を担保として発行され、発行体が元利償還の全責任を負います。したがって、発行体である地方公共団体が財政難、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、一般財源保証債の価格が下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 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。

#### 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。

#### 資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

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

#### ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引

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

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

#### 仕組み債券に係るリスク

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

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

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

#### ブローカーの信用リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

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

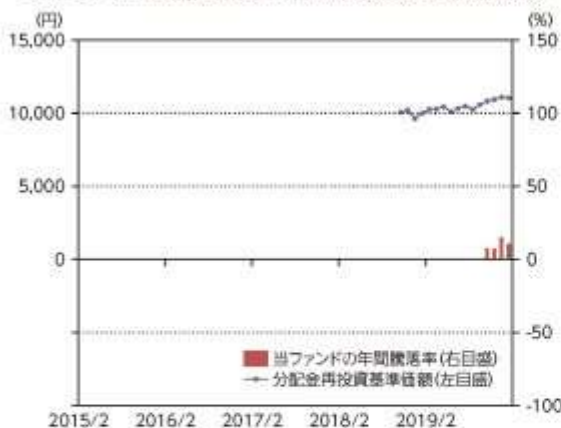
## (2) リスクの管理体制

## 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

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2019年10月～2020年1月の4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年2月～2020年1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主幹株を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設立又は売買に起因するいかなる債権に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社(以下「野村」)が算出、公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場主体の動きを表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当該の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤集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 JPMorgan Global Emerging Markets Index(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なくして本指数を複製・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々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ 1 ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

「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。

確定拠出年金によるお申込みは申込手数料を無料とします。

（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 ）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

## （ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.518%（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.968% (税抜 0.88%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.495% (税抜 0.45%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン （適格機関投資家専用）	年率 0.077% （税抜 0.07%）
F0Fs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.374% （税抜 0.34%）
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適 格機関投資家専用）	年率 0.517% （税抜 0.47%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本債券ツイン戦略マザーファンド	ありません。
F0Fs用日本物価連動国債ファンド（適格機 関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
F0Fs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
マニユライフF0Fs用日本債券ストラテジッ クファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株 式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終 値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の 21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用 するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り 信託報酬 0.5%未満の場合・・・年率 0.264% （税抜 0.24%） 0.5%以上1%未満の場合・・・年率 0.297% （税抜 0.27%） 1%以上の場合・・・年率 0.33% （税抜 0.3%）
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	年率 0.44%
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファン ド（適格機関投資家専用）	年率 0.814% （税抜 0.74%）
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。

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

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の



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

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

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

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

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。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

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

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるスミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドにおいては、運用報酬（スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドの純資産総額に対して年率0.725%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
- ・ スミ・カイロス・マルチ・ストラテジー・ファンドが組み入れるヘッジファンド等は、一般的に固定報酬（各ヘッジファンド等の純資産総額に対して年率1.0%～2.0%程度）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。



これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

- ・ FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）  
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
  - ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
  - ・ 円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
  
- ・ FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）  
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
  - ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
  - ・ 円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
  
- ・ 米国株式LSマザーファンド  
主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
  - ・ 米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
  - ・ マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
  - ・ 米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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。

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

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、2020年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2020年1月31日現在の状況について記載してあります。

## 【コア投資戦略ファンド（積極成長型）】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	269,275,233	30.28
	ルクセンブルク	29,882,711	3.36
	ケイマン	8,634,860	0.97
	小計	307,792,804	34.61
投資証券	ルクセンブルク	15,158,498	1.70
	ケイマン	4,509,893	0.51
	小計	19,668,391	2.21
親投資信託受益証券	日本	526,028,802	59.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		35,789,449	4.02
合計(純資産総額)		889,279,446	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	65,377,187	2.6153	170,986,787	2.8845	188,580,495	21.21
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	33,028,249	1.9603	64,745,655	2.2014	72,708,387	8.18
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	34,816,379	1.9494	67,871,479	2.0467	71,258,682	8.01
日本	投資信託受益証券	F0Fs用JPX日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	40,431,229	1.4431	58,349,500	1.566	63,315,304	7.12
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	47,146,577	1.0268	48,410,106	1.1300	53,275,632	5.99
日本	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	41,232,064	1.1927	49,179,798	1.2878	53,098,652	5.97
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	18,294,857	2.7914	51,068,264	2.8778	52,648,939	5.92
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	26,581,000	1.4370	38,196,897	1.5701	41,734,828	4.69
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリュウファンド(適格機関投資家専用)	34,304,870	0.8853	30,372,417	0.9456	32,438,685	3.65
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	3,025.791	9,491.71	28,719,930	9,876	29,882,711	3.36

日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	20,342,492	1.0686	21,738,070	1.0747	21,862,076	2.46
日本	投資信託受益証券	FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	15,989,519	1.2043	19,256,689	1.3102	20,949,467	2.36
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	17,227,385	1.0659	18,362,670	1.0298	17,740,761	1.99
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	54,817,065	0.2936	16,094,291	0.2849	15,617,381	1.76
日本	投資信託受益証券	FOFs用ピクテマルチストラテジーリンクファンド（適格機関投資家専用）	14,805,713	1.0112	14,972,484	1.0396	15,392,019	1.73
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	1,487.18	10,010.86	14,887,960	10,192.78	15,158,498	1.70
日本	投資信託受益証券	LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	11,115,542	1.0607	11,790,450	1.0959	12,181,522	1.37
日本	投資信託受益証券	ノムラFOFs用日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,711,851	1.0152	9,859,900	1.0251	9,955,618	1.12
日本	投資信託受益証券	FOFs用KIMマルチストラテジーリンクファンド（適格機関投資家専用）	9,804,814	1.0076	9,880,271	0.9653	9,464,586	1.06
日本	投資信託受益証券	FOFs用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	7,106,920	1.1312	8,039,866	1.1272	8,010,920	0.90
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHLダイバーシファイドリンクファンド（適格機関投資家専用）	6,799,807	0.9545	6,490,490	0.9235	6,279,621	0.71
ケイマン	投資信託受益証券	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	5,152.4557	1,131.05	5,827,685	1,150.63	5,928,573	0.67
日本	投資信託受益証券	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド（適格機関投資家専用）	5,439,392	0.9706	5,279,925	0.974	5,297,967	0.60
日本	親投資信託受益証券	コモディティLSアルファ・マザーファンド	5,063,266	0.9875	5,000,000	1.0137	5,132,632	0.58
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	2,567,889	1.7115	4,394,943	1.7799	4,570,585	0.51
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	450	10,000	4,500,000	10,021.98	4,509,893	0.51
日本	投資信託受益証券	マニユライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	3,920,781	0.9946	3,900,000	0.9959	3,904,705	0.44
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	3,430,078	0.9556	3,277,943	0.9693	3,324,774	0.37
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	2,757,998	0.9985	2,753,862	1.0009	2,760,480	0.31
ケイマン	投資信託受益証券	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	291.9124	9,282.4	2,709,647	9,270.88	2,706,287	0.30

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	34.61
投資証券	2.21
親投資信託受益証券	59.15
合計	95.98

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 7月10日)	789,079,859	789,079,859	10,469	10,469
2019年 1月末日	442,615,777		9,988	
2月末日	505,798,622		10,263	
3月末日	599,033,725		10,290	
4月末日	601,510,540		10,438	
5月末日	650,373,224		10,097	
6月末日	770,507,308		10,317	
7月末日	840,491,522		10,474	
8月末日	940,092,171		10,260	
9月末日	981,365,969		10,581	
10月末日	924,343,086		10,820	
11月末日	905,111,778		10,939	
12月末日	878,243,974		11,084	
2020年 1月末日	889,279,446		11,043	

## 【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	2018年10月26日～2019年 7月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	4.7
第2期中間計算期間	2019年 7月11日～2020年 1月10日	6.1

(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	2018年10月26日～2019年7月10日	1,019,524,917	265,772,578	753,752,339
第2期中間計算期間	2019年7月11日～2020年1月10日	400,589,979	380,511,333	773,830,985

(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	315,482,082,220	98.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,147,649,514	1.30
合計(純資産総額)		319,629,731,734	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,079,970,000	1.28

(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	1,483,000	6,663.94	9,882,623,020	7,652.00	11,347,916,000	3.55
日本	株式	ソニー	電気機器	840,300	5,441.39	4,572,400,017	7,718.00	6,485,435,400	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,024,000	510.05	4,602,691,200	568.50	5,130,144,000	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,743,500	2,473.89	4,313,227,215	2,786.50	4,858,262,750	1.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,034,900	5,175.98	5,356,621,702	4,524.00	4,681,887,600	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,105,800	3,836.78	4,242,711,324	4,227.00	4,674,216,600	1.46
日本	株式	キーエンス	電気機器	120,400	31,579.31	3,802,148,924	37,370.00	4,499,348,000	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	909,800	3,602.21	3,277,290,658	4,304.00	3,915,779,200	1.23
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	906,600	3,804.54	3,449,195,964	3,884.00	3,521,234,400	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	81,500	39,129.55	3,189,058,325	40,770.00	3,322,755,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	972,000	2,799.06	2,720,686,320	3,271.00	3,179,412,000	0.99
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	963,500	2,597.11	2,502,315,485	3,107.00	2,993,594,500	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,046,500	2,757.63	2,885,859,795	2,831.00	2,962,641,500	0.93
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,813,000	156.04	2,779,540,520	162.50	2,894,612,500	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	223,500	9,496.79	2,122,532,565	12,715.00	2,841,802,500	0.89
日本	株式	第一三共	医薬品	380,300	5,594.26	2,127,497,078	7,441.00	2,829,812,300	0.89
日本	株式	HOYA	精密機器	265,400	8,019.47	2,128,367,338	10,600.00	2,813,240,000	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	468,800	5,575.47	2,613,780,336	5,985.00	2,805,768,000	0.88
日本	株式	花王	化学	318,200	8,604.62	2,737,990,084	8,782.00	2,794,432,400	0.87
日本	株式	日立製作所	電気機器	638,700	3,833.12	2,448,213,744	4,230.00	2,701,701,000	0.85
日本	株式	ダイキン工業	機械	169,300	13,822.85	2,340,208,505	15,635.00	2,647,005,500	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	918,600	2,831.24	2,600,777,064	2,823.00	2,593,207,800	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	126,300	18,518.15	2,338,842,345	20,320.00	2,566,416,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	390,500	4,726.02	1,845,510,810	6,328.00	2,471,084,000	0.77
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	110,500	22,620.33	2,499,546,465	21,585.00	2,385,142,500	0.75
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	915,600	2,029.91	1,858,585,596	2,568.00	2,351,260,800	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,169,100	1,544.58	1,805,768,478	1,950.50	2,280,329,550	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	233,900	10,392.85	2,430,887,615	9,700.00	2,268,830,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	1,150,600	1,689.79	1,944,272,374	1,960.50	2,255,751,300	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	160,000	13,808.50	2,209,360,000	14,040.00	2,246,400,000	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別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	2.81
		食料品	3.79

繊維製品	0.57
パルプ・紙	0.23
化学	7.04
医薬品	6.03
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.67
ガラス・土石製品	0.81
鉄鋼	0.74
非鉄金属	0.71
金属製品	0.57
機械	5.02
電気機器	14.35
輸送用機器	7.54
精密機器	2.41
その他製品	2.23
電気・ガス業	1.46
陸運業	4.28
海運業	0.16
空運業	0.47
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.71
卸売業	4.99
小売業	4.49
銀行業	5.63
証券、商品先物取引業	0.85
保険業	2.25
その他金融業	1.21
不動産業	2.52
サービス業	5.13
小計	98.70
合計	98.70

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	243円		4,150,990,800	4,079,970,000	1.28



(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。

## 日本債券ツイン戦略マザーファンド

### 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	8,345,849,100	45.28
	フィリピン	299,166,000	1.62
	小計	8,645,015,100	46.90
社債券	日本	8,960,574,680	48.61
	フランス	299,643,000	1.63
	スペイン	199,810,000	1.08
	アメリカ	99,827,000	0.54
	小計	9,559,854,680	51.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		227,051,323	1.23
合計(純資産総額)		18,431,921,103	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	売建	日本	1,987,180,000	10.78

(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(%)
債券オプション	買建	日本	18,418,000	0.10
	売建	日本	5,602,000	0.03

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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147回利付国債 (20年)	1,150,000,000	120.42	1,384,888,000	121.19	1,393,719,500	1.600	2033/12/20	7.56
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	1,250,000,000	102.45	1,280,713,500	101.91	1,273,925,000	0.100	2026/12/20	6.91
日本	国債証券	第155回利付国債 (20年)	1,000,000,000	114.11	1,141,120,000	113.71	1,137,100,000	1.000	2035/12/20	6.17
日本	国債証券	第169回利付国債 (20年)	950,000,000	101.20	961,400,000	101.48	964,117,000	0.300	2039/6/20	5.23
日本	国債証券	第356回利付国債 (10年)	900,000,000	102.23	920,083,000	101.69	915,273,000	0.100	2029/9/20	4.97
日本	社債券	第1回積水ハウス利 払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	700,000,000	101.35	709,450,000	101.13	707,973,000	0.810	2077/8/18	3.84
日本	社債券	第20回みずほフィ ナンシャルグループ 期限前償還(劣後特 約付)	700,000,000	99.61	697,270,000	99.52	696,689,000	0.390	2029/10/30	3.78
日本	国債証券	第41回利付国債 (30年)	450,000,000	131.32	590,971,500	132.52	596,344,500	1.700	2043/12/20	3.24
日本	国債証券	第64回利付国債 (30年)	570,000,000	100.12	570,699,000	100.93	575,329,500	0.400	2049/9/20	3.12
日本	社債券	第1回東京海上日動 火災保険利払繰延・ 期限前償還(劣後特 約付)	500,000,000	100.00	500,000,000	100.79	503,980,000	0.960	2079/12/24	2.73
日本	国債証券	第12回利付国債 (40年)	470,000,000	102.03	479,545,400	103.91	488,377,000	0.500	2059/3/20	2.65
日本	国債証券	第52回利付国債 (30年)	420,000,000	102.97	432,482,400	104.41	438,547,200	0.500	2046/9/20	2.38
日本	社債券	第47回ソフトバン クグループ株式会社 無担保社債	427,000,000	100.41	428,763,510	100.18	427,785,680	1.360	2020/6/18	2.32
日本	社債券	第1回住友化学利払 繰延・期限前償還 (劣後特約付)	400,000,000	100.00	400,000,000	101.83	407,340,000	1.300	2079/12/13	2.21
日本	国債証券	第141回利付国債 (5年)	400,000,000	101.15	404,612,000	101.25	405,036,000	0.100	2024/9/20	2.20
日本	社債券	第1回サントリーHD 利払繰延・期限前 償還(劣後特約付)	400,000,000	101.12	404,505,000	100.67	402,684,000	0.680	2078/4/25	2.18
日本	社債券	第5回三菱商事利払 繰延・期限前償還 (劣後特約付)	400,000,000	100.69	402,784,000	100.46	401,868,000	0.690	2076/9/13	2.18
日本	社債券	第23回芙蓉総合 リース株式会社無担 保社債	400,000,000	99.59	398,360,000	100.36	401,440,000	0.290	2026/12/11	2.18
日本	社債券	第2回三菱商事利払 繰延・期限前償還 (劣後特約付)	400,000,000	100.66	402,676,000	100.28	401,152,000	1.310	2075/6/18	2.18
日本	社債券	第2回住友化学利払 繰延・期限前償還 (劣後特約付)	400,000,000	100.00	400,000,000	100.20	400,812,000	0.840	2079/12/13	2.17
日本	社債券	第1回大和ハウス工 業利払繰延・期限前 償還(劣後特約付)	400,000,000	100.38	401,536,000	99.70	398,824,000	0.500	2054/9/25	2.16
日本	社債券	第1回積水化成成品工 業株式会社無担保社 債	300,000,000	100.00	300,000,000	100.42	301,266,000	0.500	2026/12/11	1.63

日本	社債券	第10回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	300,000,000	100.00	300,000,000	100.15	300,450,000	0.220	2023/7/28	1.63
日本	社債券	第35回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	300,000,000	100.12	300,384,000	100.05	300,153,000	0.302	2020/6/19	1.63
日本	社債券	第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	300,000,000	100.07	300,210,000	99.92	299,766,000	0.290	2024/8/2	1.63
フランス	社債券	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	300,000,000	100.00	300,000,000	99.88	299,643,000	0.499	2024/12/12	1.63
フィリピン	国債証券	第12回フィリピン共和国円貨債券	300,000,000	100.15	300,459,000	99.72	299,166,000	0.180	2022/8/15	1.62
日本	社債券	第5回積水ハウス・リート投資法人無担保投資法人債	300,000,000	100.00	300,000,000	99.51	298,557,000	0.220	2024/11/1	1.62
日本	社債券	第25回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	101.56	203,130,000	102.16	204,324,000	1.020	2029/4/24	1.11
日本	社債券	第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	101.11	202,232,000	101.53	203,074,000	0.850	2027/8/31	1.10

(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	46.90
社債券	51.87
合計	98.77

(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	売建	13円		1,982,295,710	1,987,180,000	10.78

(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	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 (%)
債券オプション	店頭	第141回利付国債(5年)コールオプション	買建	3,000,000円		450,000	1,014,000	0.01

店頭	第141回利付国債（5年）コールオプション	売建	7,000,000円	980,000	2,709,000	0.01
店頭	第356回利付国債（10年）コールオプション	買建	5,000,000円	5,000	2,305,000	0.01
店頭	第65回利付国債（30年）コールオプション	買建	1,000,000円	960,000	2,577,000	0.01
店頭	第64回利付国債（30年）コールオプション	買建	1,000,000円	1,000	3,022,000	0.02
店頭	第405回利付国債（2年）コールオプション	売建	17,000,000円	340,000	306,000	0.00
店頭	第65回利付国債（30年）コールオプション	買建	3,000,000円	3,000,000	8,952,000	0.05
店頭	第141回利付国債（5年）プットオプション	売建	3,000,000円	582,000		
店頭	第141回利付国債（5年）プットオプション	買建	7,000,000円	1,338,000	21,000	0.00
店頭	第356回利付国債（10年）プットオプション	売建	5,000,000円	205,000	755,000	0.00
店頭	第65回利付国債（30年）プットオプション	売建	1,000,000円	1,054,000	390,000	0.00
店頭	第64回利付国債（30年）プットオプション	売建	1,000,000円	93,000	347,000	0.00
店頭	第405回利付国債（2年）プットオプション	買建	17,000,000円	1,145,000	527,000	0.00
店頭	第65回利付国債（30年）プットオプション	売建	3,000,000円	3,279,000	1,095,000	0.01

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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	254,993,766,944	62.78
	イギリス	22,411,614,224	5.52
	スイス	14,647,119,462	3.61
	カナダ	14,626,229,958	3.60
	フランス	14,115,277,180	3.47
	ドイツ	11,959,320,085	2.94
	オーストラリア	8,667,593,827	2.13
	オランダ	7,396,153,754	1.82
	アイルランド	7,285,038,647	1.79
	スペイン	3,934,665,168	0.97
	スウェーデン	3,381,268,710	0.83
	香港	3,203,478,835	0.79
	イタリア	2,724,894,228	0.67
	デンマーク	2,615,496,071	0.64
	シンガポール	1,608,122,339	0.40
	フィンランド	1,579,341,740	0.39

	バミューダ	1,507,574,954	0.37
	ベルギー	1,348,779,558	0.33
	ジャージー	1,025,345,581	0.25
	ノルウェー	852,251,886	0.21
	イスラエル	835,866,354	0.21
	ケイマン	824,901,656	0.20
	キュラソー	456,707,168	0.11
	ニュージーランド	389,148,638	0.10
	ルクセンブルク	355,811,081	0.09
	オーストリア	296,111,354	0.07
	ポルトガル	228,907,437	0.06
	リベリア	199,616,084	0.05
	パナマ	171,430,160	0.04
	パプアニューギニア	62,592,254	0.02
	マン島	53,894,850	0.01
	英ヴァージン諸島	39,517,330	0.01
	小計	383,797,837,517	94.48
投資信託受益証券	オーストラリア	198,447,200	0.05
	香港	85,140,946	0.02
	小計	283,588,146	0.07
投資証券	アメリカ	8,749,391,624	2.15
	オーストラリア	660,773,766	0.16
	フランス	414,787,585	0.10
	イギリス	267,085,761	0.07
	シンガポール	204,779,348	0.05
	香港	199,850,274	0.05
	カナダ	115,178,174	0.03
	小計	10,611,846,532	2.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,507,342,731	2.83
合計(純資産総額)		406,200,614,926	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	7,803,349,333	1.92
	買建	カナダ	465,499,089	0.11
	買建	ドイツ	1,683,681,361	0.41
	買建	イギリス	700,308,736	0.17
	買建	オーストラリア	444,989,396	0.11

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建		1,534,840,000	0.38

(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	19,562.09	7,745,532,158	35,321.26	13,985,312,483	3.44
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	635,320	13,813.53	8,776,017,979	18,843.38	11,971,580,502	2.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,824	199,744.50	7,355,391,649	204,016.36	7,512,698,470	1.85
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	210,848	20,069.13	4,231,537,918	22,851.34	4,818,159,716	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	27,312	124,045.93	3,387,942,566	158,773.91	4,336,433,041	1.07
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	26,286	124,628.84	3,275,993,925	158,600.50	4,168,972,874	1.03
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	279,555	11,860.27	3,315,599,177	14,820.16	4,143,050,779	1.02
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	14,906.32	3,441,198,689	16,398.26	3,785,620,682	0.93
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	150,915	17,912.01	2,703,191,653	22,707.38	3,426,884,645	0.84
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	259,686	11,159.27	2,897,907,072	12,115.26	3,146,165,590	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	220,272	11,500.19	2,533,170,310	13,736.10	3,025,679,761	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	115,181	21,819.44	2,513,185,866	24,852.59	2,862,546,491	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	772,510	3,046.04	2,353,100,841	3,651.32	2,820,688,011	0.69
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	387,248	4,779.00	1,850,661,755	7,249.21	2,807,245,250	0.69

アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	78,756	27,736.13	2,184,387,379	35,385.60	2,786,828,912	0.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	371,576	7,903.06	2,936,590,927	7,065.99	2,625,555,050	0.65
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	641,062	3,507.49	2,248,522,822	4,082.11	2,616,889,319	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	82,721	26,282.36	2,174,103,879	30,643.67	2,534,875,754	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	95,470	21,003.86	2,005,239,029	25,388.07	2,423,799,749	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	158,140	14,459.51	2,286,627,522	15,029.55	2,376,774,397	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	363,367	6,406.16	2,327,787,452	6,473.80	2,352,365,866	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	356,211	5,384.85	1,918,143,555	6,419.27	2,286,615,156	0.56
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	30,316.30	1,875,366,522	36,788.93	2,275,763,643	0.56
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	8,772.78	1,962,910,957	9,433.69	2,110,788,138	0.52
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	167,394	12,897.01	2,158,883,253	12,149.28	2,033,717,246	0.50
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	189,231	9,941.16	1,881,177,158	10,373.10	1,962,913,619	0.48
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	482,431	4,531.44	2,186,108,578	4,042.85	1,950,398,195	0.48
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	376,282	5,867.20	2,207,723,512	5,151.99	1,938,602,757	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	123,268	13,962.90	1,721,178,878	15,686.09	1,933,594,150	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	398,164	4,642.71	1,848,560,007	4,813.90	1,916,725,024	0.47

(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	4.76
		素材	3.99
		資本財	6.79
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.06
		耐久消費財・アパレル	1.83
		消費者サービス	1.71

	メディア・娯楽	5.98
	小売	4.54
	食品・生活必需品小売り	1.44
	食品・飲料・タバコ	4.67
	家庭用品・パーソナル用品	2.01
	ヘルスケア機器・サービス	4.82
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.95
	銀行	7.26
	各種金融	4.36
	保険	3.69
	不動産	0.50
	ソフトウェア・サービス	10.02
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.93
	電気通信サービス	2.20
	公益事業	3.61
	半導体・半導体製造装置	3.32
	小計	94.48
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.61
合計		97.17

(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	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	435	アメリカドル	70,612,270	7,700,974,166	71,550,975	7,803,349,333	1.92
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	27	カナダドル	5,537,109.5	457,420,616	5,634,900	465,499,089	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	36	スイスフラン	3,824,662	430,159,734	3,833,640	431,169,490	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	283	ユーロ	10,618,823.5	1,277,444,467	10,411,570	1,252,511,871	0.31
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	5,911,220	433,233,314	6,071,625	444,989,396	0.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	67	イギリスポンド	5,040,406.25	720,122,841	4,901,720	700,308,736	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	売建	10,400,000.00	1,133,487,000	1,133,997,000	0.28
	カナダドル	売建	600,000.00	49,531,200	49,554,000	0.01
	ユーロ	売建	1,400,000.00	168,057,400	168,420,000	0.04
	イギリスポンド	売建	500,000.00	70,973,000	71,425,000	0.02
	スイスフラン	売建	600,000.00	67,476,000	67,482,000	0.02
	オーストラリアドル	売建	600,000.00	43,960,800	43,962,000	0.01

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	192,731,089,399	47.14
	フランス	38,931,426,933	9.52
	イタリア	35,610,314,194	8.71
	イギリス	26,487,095,488	6.48
	ドイツ	24,839,300,693	6.08
	スペイン	22,132,475,885	5.41
	ベルギー	9,356,740,576	2.29
	オーストラリア	7,694,418,435	1.88
	カナダ	7,640,325,394	1.87
	オランダ	7,318,071,537	1.79
	オーストリア	5,510,677,088	1.35
	メキシコ	3,569,580,877	0.87
	アイルランド	2,777,637,718	0.68
	南アフリカ	2,320,991,118	0.57
	ポーランド	2,274,702,591	0.56
	フィンランド	2,202,344,027	0.54
	デンマーク	1,961,276,875	0.48
	マレーシア	1,921,675,768	0.47
	シンガポール	1,667,601,940	0.41
	スウェーデン	1,119,315,835	0.27

	ノルウェー	927,151,212	0.23
	小計	398,994,213,583	97.59
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,848,798,896	2.41
合計（純資産総額）		408,843,012,479	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,971,954,757	0.48
	買建	ドイツ	2,248,998,274	0.55

(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		5,456,609,700	1.33

(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	11,483.66	2,296,732,711	11,884.98	2,376,996,792	2.625	2029/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,272.00	2,254,401,072	11,390.80	2,278,161,167	2.750	2023/5/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,145.88	2,089,852,864	11,568.02	2,169,005,312	2.375	2027/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	18,760,000	10,053.15	1,885,971,090	11,324.34	2,124,447,571	2.250	2046/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,385.90	2,050,601,727	11,668.56	2,101,509,100	2.375	2029/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,335.69	2,040,425,352	11,637.89	2,094,821,082	2.625	2026/1/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,976.99	2,030,743,891	11,049.56	2,044,169,939	2.125	2021/12/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,738.75	1,757,291,642	13,190.29	1,974,587,286	3.000	2049/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,488.50	1,730,603,273	11,872.20	1,958,913,567	2.500	2046/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,223.80	1,874,375,887	11,631.93	1,942,532,414	2.625	2025/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,776.91	1,885,960,517	11,036.78	1,931,437,694	1.750	2023/5/15	0.47

アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,467.48	1,825,624,192	12,067.31	1,921,117,128	2.875	2028/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,481.68	1,677,070,150	11,879.87	1,900,779,484	2.500	2046/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,315.20	1,799,117,301	11,407.84	1,813,847,586	2.500	2024/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,459.39	1,718,909,148	11,830.87	1,774,631,992	3.000	2025/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,706.05	1,685,672,265	12,313.55	1,773,152,010	3.125	2028/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,464.08	1,634,777,882	12,044.31	1,717,519,141	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,092.49	1,663,873,890	11,290.26	1,693,539,922	2.250	2024/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,925.59	1,600,599,927	11,494.75	1,683,981,409	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,122.04	1,668,307,179	11,225.08	1,683,762,851	2.375	2023/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,218.59	1,637,915,455	11,498.58	1,678,793,813	2.375	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,023.58	1,653,537,047	11,132.21	1,669,832,149	2.500	2022/1/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/47	12,750,000	12,243.69	1,561,071,074	13,076.12	1,667,205,765	3.000	2047/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,877.09	1,637,003,415	10,969.05	1,650,842,072	1.750	2021/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	10,981.83	1,641,784,181	11,015.48	1,646,815,155	2.125	2021/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,847.87	1,627,180,653	10,972.88	1,645,932,664	1.625	2022/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,842.52	1,588,429,721	11,050.41	1,618,886,431	1.875	2022/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,691.89	1,566,362,225	10,957.12	1,605,218,354	1.625	2029/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	13,900,000	11,319.42	1,573,400,674	11,456.41	1,592,441,294	2.750	2023/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,901.36	1,428,163,603	13,165.58	1,579,870,425	3.125	2044/8/15	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.59
合計	97.59

(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

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	64	アメリカドル	7,608,818.56	829,817,752	7,684,000	838,017,040	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	37	アメリカドル	4,779,351.25	521,236,047	4,858,562.5	529,874,826	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	34	アメリカドル	5,368,354.75	585,472,769	5,538,812.5	604,062,891	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	29	ユーロ	3,246,991	390,613,017	3,249,595	390,926,278	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	33	ユーロ	4,426,232	532,475,709	4,447,410	535,023,423	0.13

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	63	ユーロ	10,847,692	1,304,977,348	10,997,910	1,323,048,573	0.32
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	------------	---------------	------------	---------------	------

(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	25,470,000.00	2,786,271,209	2,775,465,900	0.68
	カナダドル	買建	2,670,000.00	223,225,466	220,381,800	0.05
	ユーロ	買建	17,250,000.00	2,096,782,051	2,075,175,000	0.51
	イギリスポンド	買建	2,700,000.00	386,316,802	385,587,000	0.09

(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	6,070,784,764	10.19
	メキシコ	6,022,114,589	10.11
	ブラジル	5,685,236,099	9.54
	タイ	5,437,282,618	9.13
	南アフリカ	5,207,807,703	8.74
	ポーランド	5,118,649,825	8.59
	ロシア	5,091,351,235	8.55
	マレーシア	3,672,653,996	6.17
	コロンビア	3,452,041,593	5.80
	トルコ	2,223,585,835	3.73
	ハンガリー	2,167,742,089	3.64
	チェコ	2,157,211,334	3.62
	ペルー	2,051,168,919	3.44
	チリ	1,527,893,026	2.57
	フィリピン	111,017,850	0.19
	ドミニカ共和国	94,221,284	0.16
	ウルグアイ	90,267,431	0.15
	小計	56,181,030,190	94.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,383,362,723	5.68

合計(純資産総額)	59,564,392,913	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		16,597,981	0.03
	売建		16,535,787	0.03

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	64,500,000,000	4.00	2,583,290,793	4.02	2,595,187,815	9.850	2027/6/28	4.36
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000	2,088.55	1,013,994,440	2,119.92	1,029,221,978	0.000	2023/7/1	1.73
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	31,850,000	2,872.22	914,804,199	2,865.58	912,689,254	10.000	2023/1/1	1.53
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	105,000,000	819.61	860,595,699	835.16	876,918,315	10.500	2026/12/21	1.47
タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	426.33	750,772,854	438.00	771,331,208	3.400	2036/6/17	1.29
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000	3.12	739,942,304	3.12	739,972,481	4.375	2023/3/21	1.24
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	24,450,000	2,975.05	727,400,704	2,969.15	725,958,144	10.000	2025/1/1	1.22
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000	607.95	686,377,686	609.41	688,034,746	8.000	2023/12/7	1.16
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	22,150,000	3,055.46	676,785,781	3,049.15	675,388,496	10.000	2027/1/1	1.13
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	2,305.00	658,080,089	2,338.70	667,699,180	0.000	2022/1/1	1.12
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	2,240.20	617,175,454	2,268.59	624,998,616	0.000	2022/7/1	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	93,300,000	654.81	610,939,627	654.40	610,562,571	8.500	2037/1/31	1.03
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	20,050,000	3,038.45	609,209,453	3,028.63	607,242,274	4.000	2023/10/25	1.02
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000	2,876.37	608,354,177	2,869.87	606,979,292	2.500	2023/1/25	1.02
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	420.33	575,432,796	430.46	589,301,793	3.650	2031/6/20	0.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	83,400,000	684.87	571,188,776	692.30	577,384,038	8.000	2030/1/31	0.97
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	647.07	577,834,225	646.05	576,925,597	8.750	2048/2/28	0.97

メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	603.80	556,405,616	611.33	563,344,290	7.500	2027/6/3	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	662.87	545,214,293	664.39	546,468,708	10.000	2024/12/5	0.92
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	22,550,000	2,381.39	537,005,661	2,407.56	542,906,057	0.000	2021/7/1	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000	648.22	530,251,766	656.20	536,777,772	8.500	2029/5/31	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000	448.51	520,278,850	459.41	532,925,750	4.875	2029/6/22	0.89
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000	0.85	505,164,912	0.87	512,206,800	8.375	2024/3/15	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000	588.22	484,699,369	588.19	484,673,244	7.250	2021/12/9	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	83,000,000	580.00	481,402,975	580.52	481,834,571	6.500	2021/6/10	0.81
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,881.84	474,063,150	2,879.96	473,754,349	2.500	2026/7/25	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	579.97	470,941,681	580.66	471,503,090	6.500	2022/6/9	0.79
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000	0.87	453,463,680	0.88	458,032,640	8.375	2034/3/15	0.77
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	102,400,000	429.01	439,315,568	437.30	447,804,671	3.300	2038/6/17	0.75
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 09/15/26	50,500,000,000	0.87	440,701,380	0.88	447,017,920	8.375	2026/9/15	0.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	94.32
合計	94.32

(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	152,219.20	16,824,202	16,597,981	0.03
	ロシアルーブル	売建	9,613,830.00	16,824,202	16,535,787	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。

#### 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	124,353,925,600	97.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,326,316,228	2.61
合計(純資産総額)		127,680,241,828	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	3,242,084,000	2.54

(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	10,581	798,698.43	8,451,028,087	878,000	9,290,118,000	7.28
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,926	715,811.2	7,820,953,171	791,000	8,642,466,000	6.77
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,273	194,491.94	6,860,314,199	190,800	6,730,088,400	5.27
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,441	293,974.4	4,833,233,185	312,000	5,129,592,000	4.02
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,770	235,887.86	5,135,278,712	229,300	4,991,861,000	3.91
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	20,650	242,866.35	5,015,190,127	231,700	4,784,605,000	3.75
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,533	213,673.58	5,242,053,938	194,300	4,766,761,900	3.73
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,730	300,014.97	4,419,220,508	289,500	4,264,335,000	3.34
日本	投資証券	G L P投資法人	27,213	133,730.36	3,639,204,286	145,300	3,954,048,900	3.10
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,363	347,830.64	3,604,568,922	341,500	3,538,964,500	2.77
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,916	498,914.89	3,450,495,379	501,000	3,464,916,000	2.71
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,475	561,566.51	3,074,576,642	577,000	3,159,075,000	2.47
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,947	95,165.42	3,040,249,672	93,000	2,971,071,000	2.33
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,380	820,481.32	2,773,226,861	870,000	2,940,600,000	2.30
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	47,927	63,622.93	3,049,256,166	54,900	2,631,192,300	2.06
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,631	674,364.15	2,448,616,228	719,000	2,610,689,000	2.04

日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,198	86,827.36	3,056,149,417	73,100	2,572,973,800	2.02
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,071	166,454.48	2,342,180,988	166,800	2,347,042,800	1.84
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,571	172,822	2,172,545,362	181,700	2,284,150,700	1.79
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,522	837,736.45	2,112,771,326	870,000	2,194,140,000	1.72
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,139	274,241.96	1,957,813,352	293,400	2,094,582,600	1.64
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,106	182,406.36	1,843,398,674	196,200	1,982,797,200	1.55
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,292	200,114.3	1,859,462,075	200,900	1,866,762,800	1.46
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,549	471,838.67	1,674,555,439	508,000	1,802,892,000	1.41
日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人	14,018	116,259.11	1,629,720,203	127,500	1,787,295,000	1.40
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	10,159	160,847.68	1,634,051,581	175,000	1,777,825,000	1.39
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,881	476,419.98	1,848,985,942	453,500	1,760,033,500	1.38
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,791	146,211.67	1,723,981,800	147,800	1,742,709,800	1.36
日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェリート投資法人	70,195	20,479.93	1,437,588,686	23,100	1,621,504,500	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	4,542	346,477.53	1,573,700,941	357,000	1,621,494,000	1.27

(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	1,471	円	3,165,297,800	3,242,084,000	2.54

(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	67,366,863,725	73.33
	オーストラリア	5,937,082,483	6.46
	イギリス	4,783,642,294	5.21
	シンガポール	3,689,462,373	4.02
	フランス	3,066,699,906	3.34
	カナダ	1,856,900,482	2.02
	香港	1,636,465,896	1.78
	ベルギー	988,087,274	1.08
	スペイン	602,151,581	0.66
	ニュージーランド	384,351,125	0.42
	ドイツ	259,675,490	0.28
	オランダ	213,402,997	0.23
	ガンジー	176,083,846	0.19
	アイルランド	120,638,653	0.13
	イスラエル	69,627,979	0.08
	マン島	29,426,877	0.03
	イタリア	24,918,064	0.03
	韓国	12,055,890	0.01
	小計	91,217,536,935	99.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		651,027,594	0.71
合計(純資産総額)		91,868,564,529	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		34,892,800	0.04
	売建		164,033,900	0.18

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

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

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	385,940	9,507.85	3,669,459,938	10,492.66	4,049,538,204	4.41
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	52,080	57,957.75	3,018,439,922	65,763.17	3,424,946,414	3.73
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	187,330	16,832.32	3,153,198,580	14,881.23	2,787,702,127	3.03
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	248,820	9,036.99	2,248,585,980	9,313.72	2,317,440,806	2.52
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	92,100	23,053.24	2,123,203,977	24,440.34	2,250,955,867	2.45
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,670	22,885.40	1,960,593,066	23,776.17	2,036,904,535	2.22
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	214,250	9,153.55	1,961,148,292	9,157.76	1,962,051,837	2.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	128,150	12,719.48	1,630,002,632	13,713.20	1,757,347,144	1.91
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	198,470	8,310.37	1,649,359,531	8,613.55	1,709,533,015	1.86
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	229,140	6,489.22	1,486,940,940	6,318.93	1,447,921,087	1.58
香港	投資証券	LINK REIT	1,272,000	1,193.96	1,518,719,155	1,113.37	1,416,209,184	1.54
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	88,450	15,083.86	1,334,168,177	15,659.92	1,385,120,402	1.51
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	40,370	34,345.17	1,386,514,723	34,040.89	1,374,231,044	1.50
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	74,300	16,863.94	1,252,991,322	17,938.18	1,332,807,428	1.45
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	84,610	17,200.84	1,455,363,151	14,971.33	1,266,724,654	1.38
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,010	3,674.23	1,109,654,625	3,981.78	1,202,537,559	1.31
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	331,740	3,230.19	1,071,584,164	3,436.48	1,140,018,074	1.24
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	987,170	1,038.14	1,024,827,618	1,095.68	1,081,627,855	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	68,970	14,607.49	1,007,479,027	14,994.65	1,034,181,659	1.13
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	56,450	16,780.56	947,263,001	17,620.82	994,695,526	1.08
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	105,150	9,211.20	968,558,479	9,221.02	969,590,568	1.06
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	79,200	11,591.98	918,085,402	12,059.85	955,140,500	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	180,720	5,167.27	933,830,012	5,254.51	949,595,192	1.03
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,241,570	283.63	919,413,955	287.29	931,292,688	1.01
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,350	7,296.64	819,777,935	7,974.46	895,931,390	0.98
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	222,230	3,773.47	838,579,572	4,005.77	890,203,112	0.97
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	676,570	1,198.64	810,968,692	1,300.97	880,200,128	0.96
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	278,150	2,651.24	737,444,798	2,926.07	813,889,096	0.89
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	438,560	1,872.56	821,230,001	1,804.94	791,575,802	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	315,470	2,178.23	687,166,364	2,451.66	773,427,956	0.84

(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	99.29
合計	99.29

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	320,000.00	34,873,600	34,892,800	0.04
	アメリカドル	売建	920,000.00	100,307,600	100,307,600	0.11
	イギリスポンド	売建	80,000.00	11,427,200	11,428,000	0.01
	オーストラリアドル	売建	290,000.00	21,247,720	21,248,300	0.02
	香港ドル	売建	900,000.00	12,629,700	12,627,000	0.01
	シンガポールドル	売建	230,000.00	18,421,160	18,423,000	0.02

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

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

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ルクセンブルク	9,256,772,868	42.71
	アイルランド	9,234,502,816	42.61
	イギリス	2,100,041,910	9.69
	アメリカ	344,193,360	1.59
	ジャージー	338,086,000	1.56
	小計	21,273,596,954	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		400,419,373	1.85
合計(純資産総額)		21,674,016,327	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 007 10/30/20	88,000,000	10,906.00	9,597,280,000	10,493.75	9,234,502,816	0.000	2020/10/30	42.61
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 016 07/31/20	33,000,000	10,863.30	3,584,889,448	10,636.62	3,510,085,194	0.000	2020/7/31	16.19
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 015 05/29/20	27,000,000	10,956.32	2,958,208,876	10,555.91	2,850,097,698	0.000	2020/5/29	13.15
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 017 12/30/20	15,000,000	10,675.37	1,601,306,168	10,033.52	1,505,028,000	0.000	2020/12/30	6.94

ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 014 03/31/20	14,000,000	10,277.81	1,438,894,016	9,939.72	1,391,561,976	0.000	2020/3/31	6.42
イギリス	社債券	CS USD COM 016 08/28/20	12,000,000	10,775.12	1,293,015,360	10,517.74	1,262,129,568	0.000	2020/8/28	5.82
イギリス	社債券	BAR USD COM 037 09/30/20	8,000,000	10,775.12	862,010,240	10,473.90	837,912,342	0.000	2020/9/30	3.87
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	2,396.04	359,407,230	2,294.62	344,193,360	0.000	2036/6/12	1.59
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	875.75	350,300,720	845.21	338,086,000	0.000	9999/99/99	1.56

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	98.15
合計	98.15

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	28,194,171,787	100.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		107,793,870	0.38
合計(純資産総額)		28,086,377,917	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建		27,132,110,483	96.60

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	17,154,600	1,467.94	25,182,053,899	1,643.53	28,194,171,787	100.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.38
合計	100.38

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建/売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	248,872,670.00	26,859,100,899	27,132,110,483	96.60

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

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

### 米国株式LSマザーファンド

### 投資状況

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

社債券	アイルランド	26,094,248,316	98.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		417,194,270	1.57
合計(純資産総額)		26,511,442,586	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		26,116,800,000	98.51

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイル ランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	217,000,000	12,268.56	26,622,781,541	12,024.99	26,094,248,316	0.000	2022/10/18	98.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	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

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

為替予約取引	アメリカドル	売建	240,000,000.00	26,100,720,000	26,116,800,000	98.51
--------	--------	----	----------------	----------------	----------------	-------

(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。

## コモディティ L S アルファ・マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	7,437,622,000	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		89,823,963	1.19
合計(純資産総額)		7,527,445,963	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 07/13 / 20	7,340,000,000	99.67	7,316,248,000	101.33	7,437,622,000	0.000	2020/7/13	98.81

(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(%)
社債券	98.81
合計	98.81

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

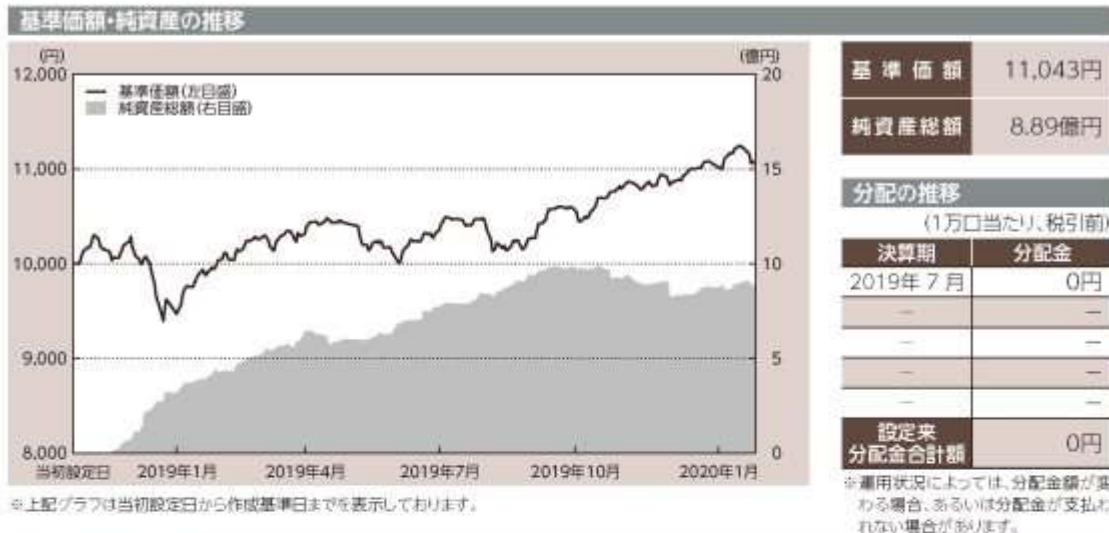
該当事項はありません。

## 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2018年10月26日  
作成基準日：2020年1月31日



**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	21.2%
J-REIT インデックス マザーファンド	8.2%
グローバルREIT インデックス マザーファンド	8.0%
FOFs 用JPX 日経インデックス400・オープン(適格機関投資家専用)	7.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.0%
FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	6.0%
外国債券インデックス マザーファンド	5.9%
国内株式インデックス マザーファンド	4.7%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	3.6%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	3.4%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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。



## 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。

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

### < 申込手数料 >

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

### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむ

を得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### <その他>

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

#### <スイッチング>

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

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

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

#### <一部解約の受付>

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

#### <一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

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

##### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法  
原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

b. 価格情報会社の提供する価額

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。（2018年10月26日設定）

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

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年10月26日から2019年7月10日までとします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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ち、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・ 受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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て）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2018年10月26日から2019年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【コア投資戦略ファンド（積極成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (2019年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		25,698,691
投資信託受益証券		302,207,848
投資証券		21,820,923
親投資信託受益証券		443,477,163
流動資産合計		793,204,625
資産合計		793,204,625
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		2,029,994
未払受託者報酬		75,624
未払委託者報酬		2,011,540
未払利息		70
その他未払費用		7,538
流動負債合計		4,124,766
負債合計		4,124,766
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		753,752,339
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		35,327,520
（分配準備積立金）		25,995,559
元本等合計		789,079,859
純資産合計		789,079,859
負債純資産合計		793,204,625

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第1期 自 2018年10月26日 至 2019年 7月10日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	95,845
受取利息	12
有価証券売買等損益	38,943,347
<b>営業収益合計</b>	<b>39,039,204</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	8,305
受託者報酬	169,171
委託者報酬	4,499,812
その他費用	17,171
<b>営業費用合計</b>	<b>4,694,459</b>
営業利益又は営業損失 ( )	34,344,745
経常利益又は経常損失 ( )	34,344,745
当期純利益又は当期純損失 ( )	34,344,745
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 ( )	8,349,186
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,712,153
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,712,153
剰余金減少額又は欠損金増加額	380,192
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	380,192
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	35,327,520

## ( 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	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 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>
3. その他	<p>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7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2018年10月26日から2019年7月10日までとなっております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第1期 (2019年 7月10日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		753,752,339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)	1.0469円 (10,469円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

## 第1期

自 2018年10月26日

至 2019年 7月10日

## 分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,038,043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	21,957,516円
収益調整金額	C	9,331,961円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,327,520円
当ファンドの期末残存口数	F	753,752,339口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	468円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2018年10月26日 至 2019年 7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2019年 7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	第1期 自 2018年10月26日 至 2019年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,018,524,917円
期中一部解約元本額	265,772,578円

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第1期 (2019年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	6,798,240
投資証券	194,428
親投資信託受益証券	26,884,293
合計	33,876,961

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド(適格機関投資家専用)	11,033,157	11,155,625	
	国内株式アクティブバリューファンド(適格機 関投資家専用)	20,722,663	18,157,197	
	F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	46,901,470	56,333,355	
	F O F s 用 M L P インデックスファンド(適格 機関投資家専用)	16,247,269	10,412,874	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	2,793,981	26,875,303	
	大和住銀/ウエリントン・ワールド・ボンド (適格機関投資家専用)	10,392,778	10,090,348	
	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファン ド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	12,830,296	13,704,039	
	L M ・ウエスタン・グローバル債券ファンド (適格機関投資家専用)	6,814,622	7,113,783	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資 家専用)	5,520,737	5,275,064	
	F O F s 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	12,159,635	13,697,828	
	F O F s 用 J P X 日経インデックス400・オープン(適格 機関投資家専用)	38,212,072	55,258,477	
	F O F s 用日本物価連動国債ファンド(適格機関投資 家専用)	3,350,412	3,294,125	

	F O F s用 K I M マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	12,489,245	12,650,356
	F O F s用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	16,190,649	19,556,684
	F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	13,371,003	13,518,084
	F O F s用FRM ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,526,880	1,436,183
	F O F s用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	6,864,797	6,539,405
	F O F s用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	3,287,598	3,435,539
	HYFI Loan Fund - JPY-USD クラス	6,426.5573	7,266,883
	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	695.1404	6,436,696
	投資信託受益証券合計	237,925,198.6787	302,207,848
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	1,894.403	18,783,441
	Man Numeric Integrated Alpha Market Neutral-Class A	356	3,037,482
	投資証券合計	2,250.403	21,820,923
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	32,880,956	63,828,511
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	26,299,664	51,202,815
	国内株式インデックス マザーファンド	26,476,683	38,330,293
	外国株式インデックス マザーファンド	60,959,003	160,846,425
	外国債券インデックス マザーファンド	17,043,568	47,606,094
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	44,774,527	13,257,737
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,981,020	3,418,844
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	46,984,242	47,923,926
	米国株式L Sマザーファンド	16,003,112	17,062,518
	親投資信託受益証券合計	273,402,775	443,477,163
	合計		767,505,934

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託



受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

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

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2019年 7月10日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	193,616,822,892口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.4477円
	(1万口当たり純資産額) (14,477円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	153,114,791,653円
期中追加設定元本額	51,796,425,233円
期中一部解約元本額	11,294,393,994円
期末元本額	193,616,822,892円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	607,309,081円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,010,214,226円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,932,856円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,894,473,078円
世界経済インデックスファンド	2,031,267,468円
日本株式インデックス・オープン	5,408,278,349円
DCマイセレクション25	6,740,842,210円
DCマイセレクション50	19,184,174,208円
DCマイセレクション75	17,646,289,759円
DC日本株式インデックス・オープン	5,596,262,721円
DCマイセレクションS25	2,732,224,082円
DCマイセレクションS50	7,817,011,631円
DCマイセレクションS75	5,064,510,463円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,398,575,643円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	379,767,295円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	648,559,079円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	426,221,790円
DC世界経済インデックスファンド	1,797,033,494円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,196,840,952円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,342,633円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	42,889,163円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	38,766,263円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	295,062,372円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,717,839円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	101,139,764円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	359,011,799円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	63,720,310円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	529,708,726円

区分	2019年 7月10日現在
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,879,344,444円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	750,531,615円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,341,404,889円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	680,186,721円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	48,210,027円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	828,385,826円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	39,628,784円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	478,704,016円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	599,077,616円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,015,261円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	908,567,624円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,162,966,236円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,371,302,434円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,205,290,370円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	1,047,855,488円
分散投資コア戦略ファンドS	2,245,019,382円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	247,082,853円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	272,414,486円
コア投資戦略ファンド(切替型)	544,973,808円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,734,988円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,169,738円
SMT インデックスバランス・オープン	76,404,482円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,862,104,941円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	673,595,588円
SMT 世界経済インデックス・オープン	13,055,458円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	55,523,004円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	8,215,102円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,323,318円
グローバル経済コア	304,162,092円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,684,464円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	46,743,978円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,827,207円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	148,867,684円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,476,683円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	54,131,150,813円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	657,517,337円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2019年 7月10日現在）

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

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	株式会社エー・ディー・ワークス第2回新株予約権	187,800	-	
合計		187,800	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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



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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<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>

2019年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,683,156,103口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.6386円 (1万口当たり純資産額) (26,386円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	136,908,904,185円
期中追加設定元本額	12,726,818,638円
期中一部解約元本額	12,952,566,720円
期末元本額	136,683,156,103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）	2,441,421,561円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,755,726円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,182,101,024円
世界経済インデックスファンド	7,501,857,508円
外国株式インデックス・オープン	900,618,700円
D C マイセレクション 2 5	1,078,503,868円
D C マイセレクション 5 0	4,824,041,436円
D C マイセレクション 7 5	5,052,579,824円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,469,928,708円

区分	2019年 7月10日現在
DCマイセレクションS25	434,507,995円
DCマイセレクションS50	1,952,170,765円
DCマイセレクションS75	1,452,796,376円
DCターゲット・イヤールファンド2025	111,191,555円
DCターゲット・イヤールファンド2035	189,812,814円
DCターゲット・イヤールファンド2045	124,726,550円
DC世界経済インデックスファンド	6,540,250,813円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,805,592,779円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,691,500円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	10,674,210円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	49,661,715円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	58,082,096円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	204,725,913円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	35,577,292円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	295,789,359円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	735,737,190円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	374,410,938円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,444,334,020円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,889,142,542円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	80,339,769円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	355,942,318円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	9,570,712円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	126,062,031円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,007,272,335円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,119,333,890円
外国株式ファンド・シリーズ1	919,706,355円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,504,660,906円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,581,705,796円
分散投資コア戦略ファンドA	2,320,725,574円
分散投資コア戦略ファンドS	4,791,427,715円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	901,159,759円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,033,182,913円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,138,158,082円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	835,371,562円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,524,052円
SMT インデックスバランス・オープン	275,802,959円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,664,466,869円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,829,621,093円
SMT 世界経済インデックス・オープン	73,556,459円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	312,910,058円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	48,570,503円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,345,090円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	45,046,756円

区分	2019年 7月10日現在
グローバル経済コア	1,019,369,571円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	6,383,901円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	521,935円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	309,189,821円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	60,959,003円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	58,867円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	66,613円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,359円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	81,330円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,382,975,984円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	341,490,970円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	361,835,416円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2019年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	5,533,730,899	-	5,637,036,063	103,305,164
合計		5,533,730,899	-	5,637,036,063	103,305,164

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2019年 7月10日現在)

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

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 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 615銘柄	96.8%			66.7%
	投資証券 39銘柄			3.2%	2.2%



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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

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

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>

2019年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,846,616,975口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7932円 (1万口当たり純資産額) (27,932円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	91,913,518,240円
期中追加設定元本額	53,074,830,579円
期中一部解約元本額	9,141,731,844円
期末元本額	135,846,616,975円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,792,851,111円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	729,450,401円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	488,819,106円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,997,471,529円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,877,704円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,164,396,890円
世界経済インデックスファンド	6,546,760,306円
D C マイセレクション 2 5	1,658,674,411円
D C マイセレクション 5 0	1,263,990,675円
D C マイセレクション 7 5	807,538,077円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,863,602,918円
D C マイセレクション S 2 5	672,702,477円
D C マイセレクション S 5 0	517,747,749円
D C マイセレクション S 7 5	231,304,675円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	50,732,800円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	65,642,344円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	31,315,315円
D C 世界経済インデックスファンド	5,711,615,459円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	617,007,503円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	41,633,723円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,814,559円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,021,753円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	57,968,845円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	117,772,689円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	181,377,774円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	158,048,512円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	437,965,711円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,202,216,092円

区分	2019年 7月10日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	615,775,064円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,186,192,823円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	878,582,701円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	87,177,234円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	623,978,361円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	38,054,503円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	241,562,308円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	298,953,104円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,000,513,871円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	783,713,381円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	843,186,808円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,263,268円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,410,439,035円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,735,282,821円
分散投資コア戦略ファンドA	1,251,239,893円
分散投資コア戦略ファンドS	3,134,446,524円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	258,591,281円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,639,813,752円
コア投資戦略ファンド(切替型)	633,079,220円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	236,730,528円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	110,743,570円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,065,511,385円
SMT インデックスバランス・オープン	236,243,459円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	24,334,812,827円
SMT 世界経済インデックス・オープン	63,549,267円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	90,016,615円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	124,922,878円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,218,175円
グローバル経済コア	943,115,085円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,480,654円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	103,814円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,396,092円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	17,043,568円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	867,152,388円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,430,618,407円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,239,920円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	40,229,452,111円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2019年 7月10日現在）

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

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2019年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	1,737,947,117	-	1,743,245,550	5,298,433
	アメリカドル	836,499,415	-	844,689,350	8,189,935
	カナダドル	77,894,311	-	78,831,000	936,689
	ユーロ	697,266,441	-	694,862,800	2,403,641
	イギリスポンド	126,286,950	-	124,862,400	1,424,550
	合計	1,737,947,117	-	1,743,245,550	5,298,433

## (注)時価の算定方法

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 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%	47.1%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 302銘柄	100.0%	38.6%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <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>

	2019年 7月10日現在

## (貸借対照表に関する注記)

	2019年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,419,157,992口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7258円 (1万口当たり純資産額) (17,258円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2019年 7月10日現在	
2. 時価の算定方法	<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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	27,978,879,253円
期中追加設定元本額	3,100,919,873円
期中一部解約元本額	1,660,641,134円
期末元本額	29,419,157,992円

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2019年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		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	61,672,001	-	61,794,133	122,132
	マレーシアリン ギット	61,672,001	-	61,794,133	122,132
合計		61,672,001	-	61,794,133	122,132

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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



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

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.4%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.6%

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

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

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
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>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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,709,917,953口

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

	2019年 7月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	62,713,895,798円
期中追加設定元本額	6,810,799,768円
期中一部解約元本額	10,814,777,613円
期末元本額	58,709,917,953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）	1,657,865,291円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,594,502円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	11,487,297,960円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	27,611,614,509円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,351,821,401円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,936,596,005円
分散投資コア戦略ファンド A	2,156,317,602円
分散投資コア戦略ファンド S	3,395,232,444円



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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 投資証券関連

(2019年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	2,264,210,100	-	2,355,798,000	91,587,900
	合計	2,264,210,100	-	2,355,798,000	91,587,900

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,147	128,349,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,104	131,376,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,712	2,353,408,000	
	MCUBS MidCity投資法人	12,589	1,353,317,500	
	森ヒルズリート投資法人	12,813	2,066,736,900	
	産業ファンド投資法人	13,711	1,948,333,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,888	3,723,696,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,906	1,358,410,200	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,869	2,737,888,500	
	GLP投資法人	27,683	3,468,679,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,633	1,510,358,000	
	日本プロロジスリート投資法人	16,051	4,105,845,800	
	星野リゾート・リート投資法人	1,700	943,500,000	
	Oneリート投資法人	1,628	488,400,000	
	イオンリート投資法人	11,468	1,626,162,400	
	ヒューリックリート投資法人	9,031	1,730,339,600	
	日本リート投資法人	3,606	1,602,867,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	68,091	1,282,834,440	
	日本ヘルスケア投資法人	512	91,340,800	
	積水ハウス・リート投資法人	32,667	2,698,294,200	
	トーセイ・リート投資法人	2,151	263,282,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,095	1,113,430,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,340	316,602,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,236	268,320,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	34,760	5,836,204,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,954	254,215,400	
	ラサールロジポート投資法人	9,231	1,203,722,400	
	スターアジア不動産投資法人	3,468	418,587,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	961	114,743,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,711	1,047,801,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,803	156,500,400		
さくら総合リート投資法人	2,417	230,581,800		
投資法人みらい	12,035	683,588,000		
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,621	371,657,800		

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

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>

2019年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

2019年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,305,811,872口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9469円 (1万口当たり純資産額) (19,469円)

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	40,908,104,435円
期中追加設定元本額	3,690,183,673円
期中一部解約元本額	4,292,476,236円
期末元本額	40,305,811,872円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	91,264,668円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	144,544,658円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,620,125,450円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,433,133円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,953,815,357円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,917,528,466円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,055,767,143円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,449,414,823円
分散投資コア戦略ファンドA	936,054,009円
分散投資コア戦略ファンドS	2,123,426,961円
コア投資戦略ファンド（切替型）	484,111,071円
SMT インデックスバランス・オープン	186,197,695円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	529,571,646円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,800,222円
グローバル経済コア	334,591,830円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	4,298,422円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	126,822,195円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,299,664円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	720,792,940円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	592,951,519円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

合計	6,800,679,565
----	---------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2019年 7月10日現在)

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

(注)時価の算定方法

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

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	46,910	1,297,999.70	
		AGREE REALTY CORP	21,490	1,415,331.40	
		ALEXANDER'S INC	2,050	797,860.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	9,609,821.20	



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

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

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

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

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

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

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

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

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



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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

### 貸借対照表

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

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

	2019年 7月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	69,810,854,021円
期中追加設定元本額	6,381,170,511円
期中一部解約元本額	3,086,350,425円
期末元本額	73,105,674,107円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	43,266,111,288円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,857,394,473円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,100,972,041円
分散投資コア戦略ファンドA	3,774,797,834円
分散投資コア戦略ファンドS	5,246,151,503円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,038,753,933円
SMTAMコモディティ・オープン	1,179,362,511円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	551,722,299円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,774,527円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	2,980,363,270円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,065,270,428円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

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

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 9銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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> <p>為替予約取引</p>

2019年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。  なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,646,828,989口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0200円 (1万口当たり純資産額) (10,200円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

	2019年 7月10日現在
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	18,217,479,818円
期中追加設定元本額	9,583,275,136円
期中一部解約元本額	1,153,925,965円
期末元本額	26,646,828,989円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,482,658,735円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,422,936,334円
分散投資コア戦略ファンドA	3,950,942,438円
分散投資コア戦略ファンドS	5,527,441,751円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,969,262,226円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,137,684,749円
グローバル経済コア	2,453,663,972円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	130,154,089円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	525,100,453円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	46,984,242円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 7月10日現在）

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

## (注)時価の算定方法

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

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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	18,628,500	248,876,760.00	
	アメリカドル 小計		18,628,500	248,876,760.00 (27,130,055,607)	
合計			18,628,500	27,130,055,607 (27,130,055,607)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 米国株式LSマザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2019年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,568,959,929口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0662円 (1万口当たり純資産額) (10,662円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

	2019年 7月10日現在
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月26日
期首元本額	15,600,034,942円
期中追加設定元本額	13,960,474,550円
期中一部解約元本額	3,991,549,563円
期末元本額	25,568,959,929円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,452,677,413円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,648,762,542円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,088,610,280円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	605,632,502円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	16,949,217,699円
米国株式LSファンド（SMA専用）	576,731,857円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	337,513,201円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	16,003,112円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	893,811,323円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 7月10日現在）

--	--	--	--

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

## (注)時価の算定方法

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

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

## 有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。



**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2019年7月11日から2020年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【コア投資戦略ファンド（積極成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2019年 7月10日現在）	第2期中間計算期間 （2020年 1月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	25,698,691	42,484,728
投資信託受益証券	302,207,848	311,209,423
投資証券	21,820,923	14,698,021
親投資信託受益証券	443,477,163	525,475,427
未収入金	-	9,009,563
流動資産合計	793,204,625	902,877,162
<b>資産合計</b>		
793,204,625		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,029,994	36,749,877
未払受託者報酬	75,624	246,165
未払委託者報酬	2,011,540	6,548,044
未払利息	70	62
その他未払費用	7,538	24,555
流動負債合計	4,124,766	43,568,703
<b>負債合計</b>		
4,124,766		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	753,752,339	773,830,985
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	35,327,520	85,477,474
（分配準備積立金）	25,995,559	16,471,593
元本等合計	789,079,859	859,308,459
<b>純資産合計</b>		
789,079,859		
<b>負債純資産合計</b>		
793,204,625		
902,877,162		

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2018年10月26日 至 2019年 4月25日	第2期中間計算期間 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	60,052	115,845
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	31,567,443	63,927,181
<b>営業収益合計</b>	<b>31,627,496</b>	<b>64,043,026</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,691	8,014
受託者報酬	93,547	246,165
委託者報酬	2,488,272	6,548,044
その他費用	9,628	24,564
<b>営業費用合計</b>	<b>2,596,138</b>	<b>6,826,787</b>
営業利益又は営業損失（ ）	29,031,358	57,216,239
経常利益又は経常損失（ ）	29,031,358	57,216,239
中間純利益又は中間純損失（ ）	29,031,358	57,216,239
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,435,990	12,007,252
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	35,327,520
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,078,368	22,353,350
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,656	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,073,712	22,353,350
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	17,412,383
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	17,412,383
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	25,673,736	85,477,474

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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> <p>(3)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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2019年 7月10日現在)	第2期中間計算期間 (2020年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	753,752,339口	773,830,985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 1.0469円 (1万口当たり純資産額) (10,469円)	1口当たり純資産額 1.1105円 (1万口当たり純資産額) (11,105円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第2期中間計算期間 (2020年 1月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2018年10月26日 至 2019年 7月10日	第2期中間計算期間 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,000,000円	753,752,339円
期中追加設定元本額	1,018,524,917円	400,589,979円
期中一部解約元本額	265,772,578円	380,511,333円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資

信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2020年 1月10日現在
	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	3,121,492,730
株式	326,558,606,736
派生商品評価勘定	21,526,050
未収入金	323,208,000
未収配当金	502,202,770
差入委託証拠金	98,460,000
流動資産合計	330,625,496,286
資産合計	330,625,496,286
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	914,300
前受金	20,621,100
未払解約金	125,178,931
未払利息	4,558
その他未払費用	22
流動負債合計	146,718,911
負債合計	146,718,911
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	204,350,175,798
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	126,128,601,577
元本等合計	330,478,777,375
純資産合計	330,478,777,375
負債純資産合計	330,625,496,286

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2020年 1月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 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 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 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）

2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	204,350,175,798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 1.6172円 (1万口当たり純資産額) (16,172円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 1月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

	2020年 1月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	193,616,822,892円
期中追加設定元本額	30,206,341,119円
期中一部解約元本額	19,472,988,213円
期末元本額	204,350,175,798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）	565,348,898円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,996,209,444円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,357,744円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,146,488,734円
世界経済インデックスファンド	2,084,433,947円
日本株式インデックス・オープン	4,528,546,752円
DCマイセレクション25	6,762,333,566円
DCマイセレクション50	19,077,740,540円
DCマイセレクション75	17,412,924,621円
DC日本株式インデックス・オープン	5,632,172,144円
DCマイセレクションS25	2,701,404,246円
DCマイセレクションS50	7,752,341,442円
DCマイセレクションS75	5,070,537,007円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,647,160,465円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	393,755,699円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	716,132,493円



区分	2020年 1月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	474,070,365円
DC世界経済インデックスファンド	2,772,427,253円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,035,361,110円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,194,356円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	35,380,707円
マイセクション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)	276,362,661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)	75,539,439円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	288,276,565円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	56,048,776円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	388,047,083円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,637,688,685円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	686,722,574円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,985,823,578円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	601,391,671円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	38,428,738円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	752,589,066円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,607,624円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	423,317,624円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	550,647,380円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,230,406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)	819,174,794円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,705,766,199円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,207,340円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,095,776,300円
分散投資コア戦略ファンドA	6,030,497,337円
分散投資コア戦略ファンドS	17,703,162,242円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	283,716,698円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	298,783,070円
コア投資戦略ファンド(切替型)	704,217,606円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	208,810,931円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,717,675円
SMT インデックスバランス・オープン	69,802,497円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	13,344,380,400円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	520,269,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン	17,911,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	63,219,404円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	10,213,205円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,697,378円
グローバル経済コア	266,763,536円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,859,661円

区分	2020年 1月10日現在
i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	40,834,857円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,852,915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）	26,581,000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）	46,700,026,150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）	561,766,976円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	13,474,835円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,475,998,900	-	3,496,620,000	20,621,100
	合計	3,475,998,900	-	3,496,620,000	20,621,100

(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。

#### 日本債券ツイン戦略マザーファンド

#### 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	131,143,873
国債証券	8,257,433,400
社債券	9,541,699,970
コール・オプション(買)	12,989,000
プット・オプション(買)	14,007,000
派生商品評価勘定	1,378,350
未収利息	11,312,656
前払費用	4,468,015
差入委託証拠金	7,040,000

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	17,981,472,264
資産合計	17,981,472,264
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	7,846,000
プット・オプション（売）	14,377,000
派生商品評価勘定	1,321,980
前受金	60,000
未払解約金	50,062,780
未払利息	191
その他未払費用	2
流動負債合計	73,667,953
負債合計	73,667,953
純資産の部	
元本等	
元本	18,028,378,631
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	120,574,320
元本等合計	17,907,804,311
純資産合計	17,907,804,311
負債純資産合計	17,981,472,264

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(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、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> <p>(2) 債券店頭オプション取引</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、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		18,028,378,631口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	120,574,320円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9933円 (9,933円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 10月18日
期首元本額	14,930,999,500円
期中追加設定元本額	3,587,559,002円
期中一部解約元本額	490,179,871円
期末元本額	18,028,378,631円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,602,243,141円
コア投資戦略ファンド（成長型）	901,261,767円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	13,017,500,772円
コア投資戦略ファンド（切替型）	250,350,491円
債券コア戦略ファンド	140,052,307円
債券コア・セレクション	1,411,943,966円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	32,044,863円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	2,757,998円
日本債券ツイン戦略ファンド（SMA専用）	89,953,419円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	113,726,470円
FOFs用 日本債券ツイン戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	466,543,437円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	1,672,060,000	-	1,672,000,000	60,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	3,018,006,000	-	12,989,000	2,532,000
	プット	4,427,162,000	-	14,007,000	3,776,000
	売建				
	コール	4,427,162,000	-	7,846,000	192,000
	プット	3,018,006,000	-	14,377,000	2,458,000

合計	16,562,396,000	-	1,721,219,000	3,718,000
----	----------------	---	---------------	-----------

## (注)1. 時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	14,998,916,178
コール・ローン	722,375,120
株式	386,847,367,883
投資信託受益証券	292,181,867
投資証券	10,304,102,805
派生商品評価勘定	190,302,962
未収入金	14,753,855
未収配当金	415,145,533
差入委託証拠金	1,680,603,895
流動資産合計	415,465,750,098
資産合計	415,465,750,098
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,304,209
前受金	181,731,793
未払解約金	207,795,243
未払利息	1,054
その他未払費用	9
流動負債合計	396,832,308
負債合計	396,832,308
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	142,984,473,346
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	272,084,444,444
元本等合計	415,068,917,790
純資産合計	415,068,917,790
負債純資産合計	415,465,750,098

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2020年 1月10日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,984,473,346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 2.9029円 (1万口当たり純資産額) (29,029円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>



	2020年 1月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	136,683,156,103円
期中追加設定元本額	16,993,488,823円
期中一部解約元本額	10,692,171,580円
期末元本額	142,984,473,346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）	2,395,805,354円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,937,857円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,824,885,171円
世界経済インデックスファンド	7,453,812,560円
外国株式インデックス・オープン	642,743,312円
D C マイセレクション 2 5	1,091,288,182円
D C マイセレクション 5 0	4,806,461,580円
D C マイセレクション 7 5	5,021,547,116円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,795,405,410円
D C マイセレクション S 2 5	437,438,348円
D C マイセレクション S 5 0	1,963,248,794円
D C マイセレクション S 7 5	1,460,157,772円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	110,341,568円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	196,648,612円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	130,215,280円
D C 世界経済インデックスファンド	9,708,858,189円

区分	2020年 1月10日現在
外国株式インデックス・オープン( S M A 専用)	1,885,481,674円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	8,679,784円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	11,144,782円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	38,595,555円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	42,438,496円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	161,992,680円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	31,470,073円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	217,860,206円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	636,541,832円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	340,376,717円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,243,876,481円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,708,307,809円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	65,542,222円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	322,969,848円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	7,999,724円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	109,180,464円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,805,529,064円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,924,079,894円
外国株式ファンド・シリーズ1	999,697,327円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,262,207,614円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,542,778,883円
分散投資コア戦略ファンドA	2,523,069,702円
分散投資コア戦略ファンドS	7,770,479,893円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,010,495,934円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,104,853,251円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,505,453,418円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	753,102,442円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	41,270,739円
S M T インデックスバランス・オープン	248,978,239円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,288,695,822円
外国株式S M T B セレクション( S M A 専用)	31,278,013,968円
S M T 世界経済インデックス・オープン	96,799,992円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	344,335,574円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	58,143,466円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,584,240円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	53,176,358円
グローバル経済コア	888,185,360円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A 対応型)	8,184,082円
D C ターゲット・イヤーフンド2055	799,376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)	65,377,187円
D C ターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	58,867円
D C ターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	66,613円

区分	2020年 1月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)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)	1,190,778,905円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	809,940,315円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,591,104,901円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	70,365,059円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2020年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	17,173,011,422	-	17,354,743,215	181,731,793
合計		17,173,011,422	-	17,354,743,215	181,731,793

## (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

(2020年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	480,968,700	-	482,236,300	1,267,600
	アメリカドル	329,814,200	-	330,810,800	996,600
	カナダドル	20,949,250	-	20,962,500	13,250
	ユーロ	60,687,000	-	60,845,000	158,000
	イギリスポンド	28,634,000	-	28,638,000	4,000
	スイスフラン	16,825,650	-	16,882,500	56,850
	スウェーデンクローナ	5,777,000	-	5,775,000	2,000
	オーストラリアドル	11,259,600	-	11,272,500	12,900
	香港ドル	7,022,000	-	7,050,000	28,000
	売建	158,585,560	-	158,586,200	640

	アメリカドル	139,115,800	-	139,115,800	-
	ユーロ	19,469,760	-	19,470,400	640
	合計	639,554,260	-	640,822,500	1,266,960

## (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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	139,239,981
コール・ローン	5,179,746,253
国債証券	394,856,099,450
派生商品評価勘定	1,172,753
未収入金	20,387,275
未収利息	2,746,698,690
前払金	5,469,853
前払費用	160,943,918
差入委託証拠金	203,729,823
流動資産合計	403,313,487,996
資産合計	403,313,487,996
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,865,822
未払金	82,996,634
未払解約金	55,072,851
未払利息	7,563
その他未払費用	4
流動負債合計	144,942,874
負債合計	144,942,874
純資産の部	
元本等	
元本	141,707,832,171
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	261,460,712,951
元本等合計	403,168,545,122
純資産合計	403,168,545,122
負債純資産合計	403,313,487,996

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2020年 1月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まででは個別法)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> <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)

2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,707,832,171口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8451円 (1万口当たり純資産額) (28,451円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	135,846,616,975円
期中追加設定元本額	13,372,473,613円
期中一部解約元本額	7,511,258,417円
期末元本額	141,707,832,171円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 1月10日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,693,628,229円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	691,273,017円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,001,277,833円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,942,474円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,451,088,268円
世界経済インデックスファンド	6,703,149,118円
DCマイセクション25	1,702,076,585円
DCマイセクション50	1,294,867,794円
DCマイセクション75	831,792,388円
DC外国債券インデックス・オープン	1,934,176,152円
DCマイセクションS25	685,327,844円
DCマイセクションS50	531,262,675円
DCマイセクションS75	242,298,765円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,673,686円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	68,336,245円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	32,695,966円
DC世界経済インデックスファンド	8,979,325,729円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	610,052,857円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	31,992,585円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,670,437円
マイセクション75VA1（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VA1（適格機関投資家専用）	46,636,024円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	92,073,128円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	151,479,749円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	152,774,848円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	352,569,899円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,016,105,589円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	597,425,357円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,127,720,248円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	853,652,256円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	76,391,966円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	601,562,557円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	34,983,381円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	222,572,323円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	292,321,777円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	931,346,094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）	2,056,970,072円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	890,520,865円
外国債券ファンド・シリーズ1	562,106,416円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,211,955,403円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,103,897,420円
分散投資コア戦略ファンドA	1,715,712,713円

区分	2020年 1月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	6,523,939,020円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	296,565,343円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,894,475,377円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,032,487,587円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,067,485円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,250,493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)	1,057,213,284円
SMT インデックスバランス・オープン	214,982,203円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	22,750,321,721円
SMT 世界経済インデックス・オープン	87,309,863円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	101,800,798円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	154,133,612円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,502,163円
グローバル経済コア	813,508,869円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,178,480円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	162,347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)	18,294,857円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	732,712,639円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,921,232,090円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	347,602,690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)	40,081,614,644円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2020年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	3,821,039,132	-	3,815,569,279	5,469,853
合計		3,821,039,132	-	3,815,569,279	5,469,853

(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

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,084,653,516	-	5,084,430,300	223,216
	アメリカドル	2,579,880,247	-	2,579,802,400	77,847
	カナダドル	207,609,232	-	207,600,800	8,432
	ユーロ	1,952,343,888	-	1,952,228,400	115,488
	イギリスポンド	344,820,149	-	344,798,700	21,449
合計		5,084,653,516	-	5,084,430,300	223,216

## (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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,578,102,573
コール・ローン	337,334,558
国債証券	57,107,174,439
未収入金	65,615,604
未収利息	777,649,502
前払費用	56,499,342
流動資産合計	61,922,376,018
資産合計	61,922,376,018
負債の部	
流動負債	
未払金	2,339,631,212
未払解約金	35,219,385
未払利息	492
その他未払費用	1
流動負債合計	2,374,851,090
負債合計	2,374,851,090
純資産の部	
元本等	

項目	2020年 1月10日現在
	金額（円）
元本	33,014,049,846
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,533,475,082
元本等合計	59,547,524,928
純資産合計	59,547,524,928
負債純資産合計	61,922,376,018

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)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>
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)

	2020年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	33,014,049,846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 1.8037円 (1万口当たり純資産額) (18,037円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	29,419,157,992円
期中追加設定元本額	5,152,133,807円
期中一部解約元本額	1,557,241,953円
期末元本額	33,014,049,846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	4,123,509,812円
世界経済インデックスファンド	5,578,460,616円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,378,635,268円
DC世界経済インデックスファンド	7,358,321,292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)	1,824,046,950円
コア投資戦略ファンド(安定型)	138,847,350円

区分	2020年 1月10日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	97,713,802円
分散投資コア戦略ファンドA	238,608,738円
分散投資コア戦略ファンドS	1,162,765,699円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	247,053,029円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,418,719,167円
コア投資戦略ファンド（切替型）	144,618,229円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,459,829円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	88,452,141円
SMT インデックスバランス・オープン	186,630,130円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,229,602,303円
SMT 世界経済インデックス・オープン	103,896,612円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	121,636,073円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	181,482,244円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,366,632円
グローバル経済コア	665,099,019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）	2,567,889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）	97,196,259円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,111,678,378
投資証券	119,640,291,250
未収入金	181,760,463
未収配当金	1,021,162,731
前払金	54,316,800
差入委託証拠金	63,468,000
流動資産合計	123,072,677,622

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	123,072,677,622
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,316,800
未払金	139,656,288
未払解約金	46,563,276
未払利息	3,083
その他未払費用	19
流動負債合計	240,539,466
負債合計	240,539,466
純資産の部	
元本等	
元本	58,122,665,509
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	64,709,472,647
元本等合計	122,832,138,156
純資産合計	122,832,138,156
負債純資産合計	123,072,677,622

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10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>
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>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）

	2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		58,122,665,509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)	2.1133円 (21,133円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	58,709,917,953円
期中追加設定元本額	6,153,393,455円
期中一部解約元本額	6,740,645,899円
期末元本額	58,122,665,509円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,603,729,806円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,349,326円
SMT J-REITインデックス・オープン	13,499,485,392円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,283,632,590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）	3,034,877,469円
分散投資コア戦略ファンドA	2,197,930,512円
分散投資コア戦略ファンドS	4,643,445,332円
コア投資戦略ファンド（切替型）	987,019,160円
SMT インデックスバランス・オープン	29,944,681円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	421,427,316円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,098,798円
グローバル経済コア	288,596,971円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,462,822円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	430,907,904円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	33,028,249円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	848,553,733円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	944,512,591円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	399,933,036円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	325,263,379円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 投資証券関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,176,056,800	-	3,121,740,000	54,316,800
	合計	3,176,056,800	-	3,121,740,000	54,316,800

## (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。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	429,389,212
コール・ローン	25,124,998
投資証券	88,958,762,462
派生商品評価勘定	640
未収入金	1
未収配当金	367,190,716
流動資産合計	89,780,468,029
資産合計	89,780,468,029
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,300
未払金	112,109,443
未払解約金	31,856,687
未払利息	36
流動負債合計	144,002,466
負債合計	144,002,466
純資産の部	
元本等	
元本	44,866,586,864
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,769,878,699
元本等合計	89,636,465,563
純資産合計	89,636,465,563
負債純資産合計	89,780,468,029

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引



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

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		44,866,586,864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)	1.9978円 (19,978円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	40,305,811,872円
期中追加設定元本額	6,979,557,015円
期中一部解約元本額	2,418,782,023円
期末元本額	44,866,586,864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	85,282,821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）	1,613,207,513円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,434,928円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,626,856,001円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,119,339,290円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,437,894,964円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,935,035,804円
分散投資コア戦略ファンドA	1,500,921,448円
分散投資コア戦略ファンドS	4,660,308,448円
コア投資戦略ファンド（切替型）	990,001,611円
SMT インデックスバランス・オープン	170,693,981円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	449,174,157円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,136,093円
グローバル経済コア	290,639,918円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,519,504円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	440,126,558円

コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,816,379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）	772,217,030円
F O F s 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）	594,763,122円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	47,950,160	-	47,950,800	640
	アメリカドル	28,480,400	-	28,480,400	-
	ユーロ	19,469,760	-	19,470,400	640
	売建	12,013,100	-	12,049,400	36,300
	アメリカドル	12,013,100	-	12,049,400	36,300
合計		59,963,260	-	60,000,200	35,660

（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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	229,109,609
コール・ローン	280,108,395
社債券	23,098,712,476
未収入金	220,827,378
流動資産合計	23,828,757,858
資産合計	23,828,757,858

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払金	109,022,150
未払解約金	118,016,000
未払利息	409
その他未払費用	1
流動負債合計	227,038,560
負債合計	227,038,560
純資産の部	
元本等	
元本	77,554,270,530
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,952,551,232
元本等合計	23,601,719,298
純資産合計	23,601,719,298
負債純資産合計	23,828,757,858

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		77,554,270,530口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	53,952,551,232円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.3043円 (3,043円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

## (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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	73,105,674,107円

区分	2020年 1月10日現在
期中追加設定元本額	10,098,602,381円
期中一部解約元本額	5,650,005,958円
期末元本額	77,554,270,530円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	44,291,611,998円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,586,537,299円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,029,237,308円
分散投資コア戦略ファンドA	4,221,371,497円
分散投資コア戦略ファンドS	9,576,470,309円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,038,753,933円
SMTAMコモディティ・オープン	1,266,317,508円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	715,062,330円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,817,065円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	3,022,114,322円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,751,976,961円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	53,693,428
コール・ローン	674,336,252
投資信託受益証券	28,655,682,127
未収入金	130,968,661
流動資産合計	29,514,680,468
資産合計	29,514,680,468
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	380,769,246
未払金	1,940,380
未払解約金	607,009,272
未払利息	984
その他未払費用	1
流動負債合計	989,719,883
負債合計	989,719,883
純資産の部	

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	25,640,412,815
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,884,547,770
元本等合計	28,524,960,585
純資産合計	28,524,960,585
負債純資産合計	29,514,680,468

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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>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)

	2020年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,640,412,815口
2.	1口当たり純資産額 1.1125円

	2020年 1月10日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(11,125円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2019年 7月11日



区分	2020年 1月10日現在
期首元本額	26,646,828,989円
期中追加設定元本額	3,435,202,689円
期中一部解約元本額	4,441,618,863円
期末元本額	25,640,412,815円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,580,849,776円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,992,370,979円
分散投資コア戦略ファンドA	3,892,754,627円
分散投資コア戦略ファンドS	8,017,091,409円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,784,640,977円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	778,233,525円
グローバル経済コア	1,530,952,531円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	374,940,054円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	641,432,360円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	47,146,577円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,678,246,884	-	28,059,016,130	380,769,246
	アメリカドル	27,678,246,884	-	28,059,016,130	380,769,246
合計		27,678,246,884	-	28,059,016,130	380,769,246

#### (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。

#### 米国株式LSマザーファンド

#### 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	251,684,796
社債券	26,152,932,398
流動資産合計	26,404,617,194
資産合計	26,404,617,194
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,286,000
未払金	61,920,000
未払解約金	1,929,997
未払利息	367
その他未払費用	1
流動負債合計	108,136,365
負債合計	108,136,365
純資産の部	
元本等	
元本	25,570,159,597
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	726,321,232
元本等合計	26,296,480,829
純資産合計	26,296,480,829
負債純資産合計	26,404,617,194

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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>

	2020年 1月10日現在
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,570,159,597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 1.0284円 (1万口当たり純資産額) (10,284円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	25,568,959,929円
期中追加設定元本額	1,593,293,493円
期中一部解約元本額	1,592,093,825円
期末元本額	25,570,159,597円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,376,356,499円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,583,151,894円
コア投資戦略ファンド（切替型）	902,382,150円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	586,768,143円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	17,257,206,517円
米国株式LSファンド（SMA専用）	891,257,712円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	235,093,130円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,172,154円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	718,771,398円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	26,423,254,000	-	26,467,540,000	44,286,000
	アメリカドル	26,423,254,000	-	26,467,540,000	44,286,000
合計		26,423,254,000	-	26,467,540,000	44,286,000

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## コモディティ L S アルファ・マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	90,476,451
社債券	7,361,286,000
流動資産合計	7,451,762,451
資産合計	7,451,762,451
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	1,956,197
未払利息	132
流動負債合計	1,956,329
負債合計	1,956,329
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	7,424,451,486
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	25,354,636
元本等合計	7,449,806,122
純資産合計	7,449,806,122
負債純資産合計	7,451,762,451

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 1月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,424,451,486口
2. 1口当たり純資産額	1.0034円

	2020年 1月10日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(10,034円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （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	2020年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月11日
期首元本額	2,500,000,000円
期中追加設定元本額	5,386,962,592円
期中一部解約元本額	462,511,106円
期末元本額	7,424,451,486円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 1月10日現在
コア投資戦略ファンド(安定型)	558,035,715円
コア投資戦略ファンド(成長型)	608,766,234円
コア投資戦略ファンド(切替型)	192,775,975円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	152,098,966円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	5,395,327,079円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	45,657,468円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	5,063,266円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	235,557,338円
F O F s 用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	231,169,445円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【コア投資戦略ファンド（積極成長型）】

## 【純資産額計算書】

（2020年 1月31日現在）

資産総額	898,936,291円
負債総額	9,656,845円
純資産総額（ - ）	889,279,446円
発行済口数	805,282,235口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1043円
（1万口当たり純資産額）	（11,043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

（2020年 1月31日現在）

資産総額	319,810,956,895円
負債総額	181,225,161円
純資産総額（ - ）	319,629,731,734円
発行済口数	203,571,188,854口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5701円
（1万口当たり純資産額）	（15,701円）

## 日本債券ツイン戦略マザーファンド

## 純資産額計算書

（2020年 1月31日現在）

資産総額	18,601,379,017円
負債総額	169,457,914円
純資産総額（ - ）	18,431,921,103円
発行済口数	18,414,503,428口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0009円
（1万口当たり純資産額）	（10,009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

(2020年 1月31日現在)

資産総額	408,115,424,769円
負債総額	1,914,809,843円
純資産総額( - )	406,200,614,926円
発行済口数	140,822,416,034口
1口当たり純資産額( / )	2.8845円
(1万口当たり純資産額)	(28,845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

(2020年 1月31日現在)

資産総額	409,137,630,405円
負債総額	294,617,926円
純資産総額( - )	408,843,012,479円
発行済口数	142,067,712,908口
1口当たり純資産額( / )	2.8778円
(1万口当たり純資産額)	(28,778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

(2020年 1月31日現在)

資産総額	59,574,950,890円
負債総額	10,557,977円
純資産総額( - )	59,564,392,913円
発行済口数	33,464,692,168口
1口当たり純資産額( / )	1.7799円
(1万口当たり純資産額)	(17,799円)

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 1月31日現在)

資産総額	129,305,675,486円
負債総額	1,625,433,658円
純資産総額（ - ）	127,680,241,828円
発行済口数	57,998,487,938口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2014円
（1万口当たり純資産額）	（22,014円）

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 1月31日現在)

資産総額	92,051,881,920円
負債総額	183,317,391円
純資産総額（ - ）	91,868,564,529円
発行済口数	44,886,702,035口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0467円
（1万口当たり純資産額）	（20,467円）

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 1月31日現在)

資産総額	21,709,383,445円
負債総額	35,367,118円
純資産総額（ - ）	21,674,016,327円
発行済口数	76,070,338,525口
1口当たり純資産額（ / ）	0.2849円
（1万口当たり純資産額）	（2,849円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

(2020年 1月31日現在)

資産総額	28,434,913,846円
負債総額	348,535,929円
純資産総額（ - ）	28,086,377,917円

発行済口数	24,854,487,607口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1300円
（1万口当たり純資産額）	（11,300円）

## 米国株式LSマザーファンド

### 純資産額計算書

（2020年 1月31日現在）

資産総額	26,531,044,191円
負債総額	19,601,605円
純資産総額（ - ）	26,511,442,586円
発行済口数	25,743,221,195口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0298円
（1万口当たり純資産額）	（10,298円）

## コモディティLSアルファ・マザーファンド

### 純資産額計算書

（2020年 1月31日現在）

資産総額	7,529,785,815円
負債総額	2,339,852円
純資産総額（ - ）	7,527,445,963円
発行済口数	7,425,887,675口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0137円
（1万口当たり純資産額）	（10,137円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)名義書換等

該当事項はありません。

### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2020年 1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2020年 4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。

2020年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	542	13,032,863
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	88	331,794
単位型公社債投資信託	19	155,114
合計	649	13,519,771

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



負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

## (2)【損益計算書】

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本				
	利益剰余金				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	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 その他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）



	貸借対照表 計上額 (*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 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	-	82,081	

## (注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

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

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

	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	-

## (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4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。

## 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。

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

## 第3【その他】

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

- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
- ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
- ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。
- また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2019年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（積極成長型）の2018年10月26日から2019年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（積極成長型）の2019年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年3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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（積極成長型）の2019年7月11日から2020年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（積極成長型）の2020年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年7月11日から2020年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの2019年7月10日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表について中間監査は実施されていない。

## 利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。