

【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5月20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】	グローバル経済コア
【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】

グローバル経済コア

（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。

（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。

(7) 【申込期間】

2020年 5月21日から2020年11月20日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

「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17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク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】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式	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・ オブ・ファ ンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	年4回	日本			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(商品)) 資産配分変更 型))	日々	アジア				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型	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				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

〔投資対象資産による属性区分〕

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界*の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
※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こともあります。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)*への連動を目指す運用を行います。

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)マザーファンドの概要」をご覧ください。

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的な指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) ^{*1, *2}	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 ^{*2}
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ^{*3}
		外国株式インデックス マザーファンド	
		新興国株式インデックス マザーファンド	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
		外国債券インデックス マザーファンド	
		新興国債券インデックス マザーファンド	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0%~20.0%）の通り。 ^{*4}

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャルペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

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



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更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。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

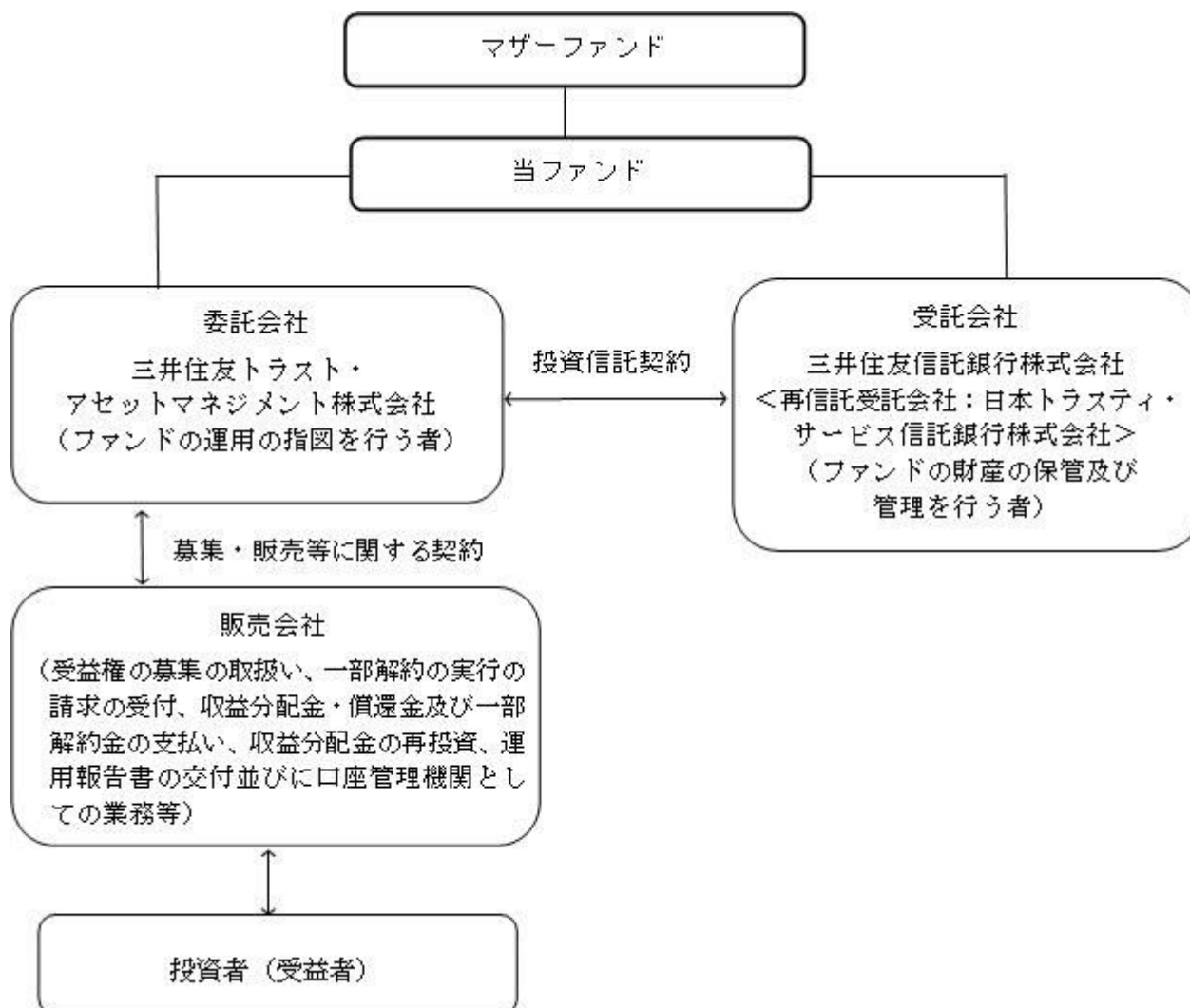
（2）【ファンドの沿革】

2017年11月30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 3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

八．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、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こともあります。

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 (変動幅) ^{1 2}	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 ²
<株式> 37.5% (35.0~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ³
	外国株式インデックス マザーファンド	
	新興国株式インデックス マザーファンド	
<債券> 37.5% (35.0~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
	外国債券インデックス マザーファンド	
	新興国債券インデックス マザーファンド	

< REIT > 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
< 金 > 15.0% (10.0 ~ 20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0～20.0%）の通り。 ⁴

1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ハ．「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

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

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）¹と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）に

ついて、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合²と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）³ に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）⁴と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

調整を行うこととします。

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）⁵に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）⁶ に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）⁷の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、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。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

※7 「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）⁸の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

※8 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)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SPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJ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、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 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。

2. 運用方法

(1)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 3月31日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)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）⁹（「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、委託会社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。

3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、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（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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

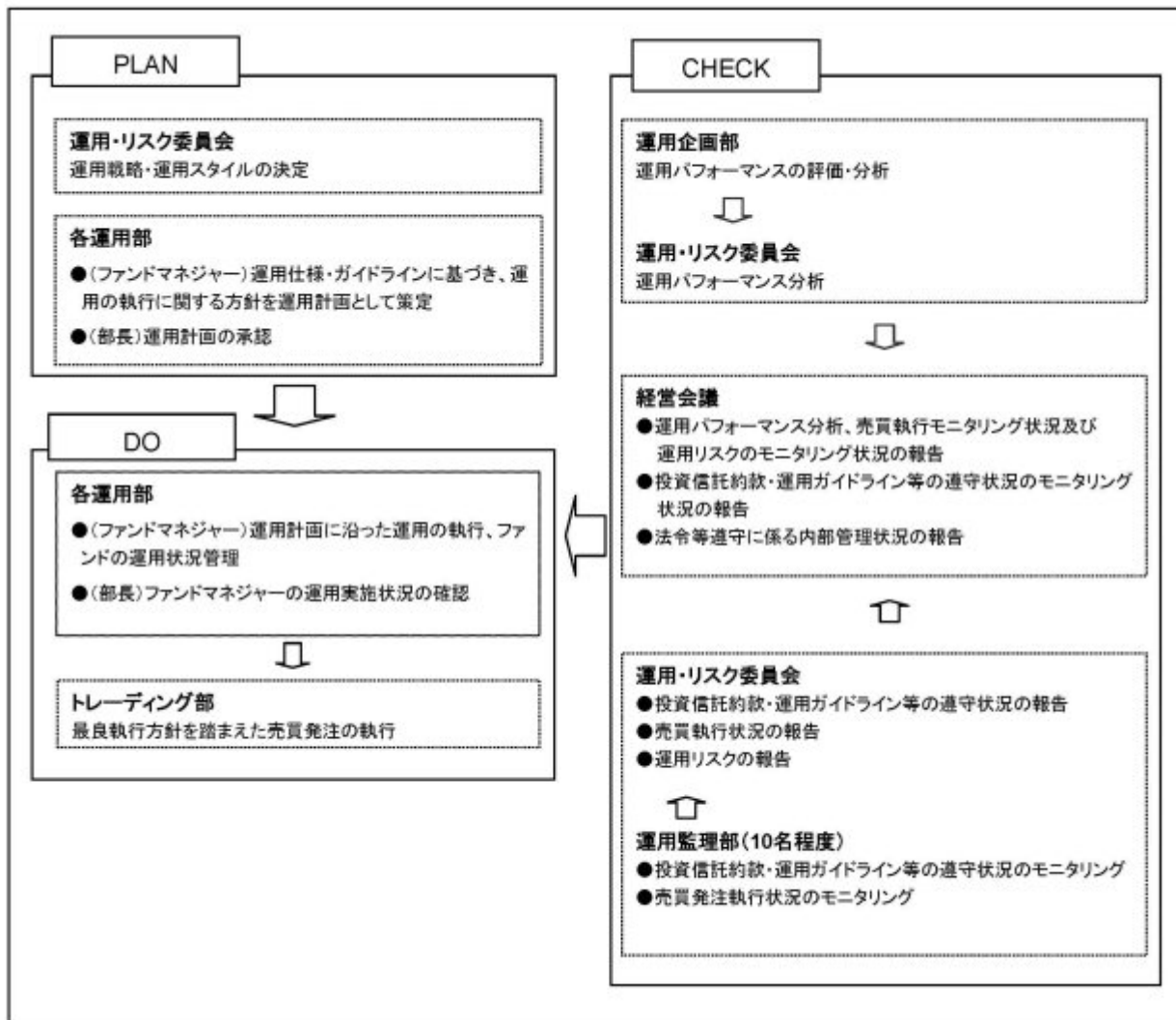
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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。

※9 金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)とはLBMA金価格(円ヘッジベース)です(2020年3月31日現在)。LBMA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、LBMA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、LBMA金価格及びLBMA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。

(3) 【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ. 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の

借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

なお、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」における外貨建資産については、原則とし

て為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

金利変動リスク

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

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。

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。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超え

て支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

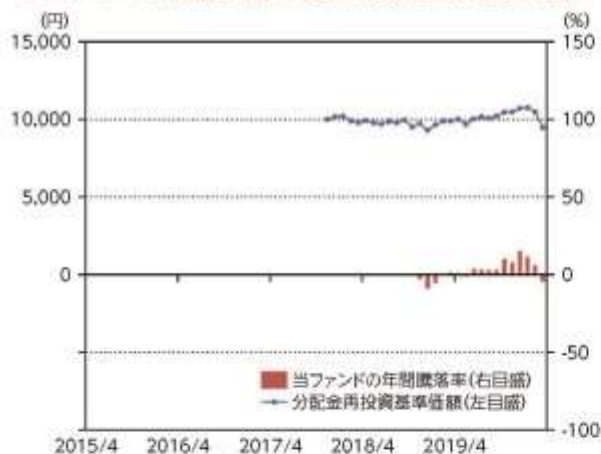
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年11月～2020年3月の1年5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年4月～2020年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式を総対象とした株価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、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、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index Emerging Markets (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しに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

同じ。)。

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

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

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2) 【換金 (解約) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.935% (税抜 0.85%) 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 0.44% (税抜 0.4%)	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 0.44% (税抜 0.4%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」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。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2020年3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3月31日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	10,036,457,716	98.84
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		118,239,058	1.16
合計（純資産総額）		10,154,696,774	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	外国債券インデックス マザーファンド	825,420,266	2.7989	2,310,298,803	2.9120	2,403,623,814	23.67
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	996,742,522	2.4847	2,476,677,322	2.2580	2,250,644,614	22.16
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）	1,509,018,772	1.0894	1,643,925,051	1.1575	1,746,689,228	17.20
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	720,078,174	1.6761	1,206,949,664	1.5028	1,082,133,479	10.66
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	447,207,689	2.5691	1,148,925,307	2.2550	1,008,453,338	9.93
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	284,800,686	2.0148	573,817,716	1.5949	454,228,614	4.47
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	291,409,738	1.8960	552,539,663	1.4415	420,067,137	4.14
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	268,425,313	1.3919	373,644,534	1.3248	355,609,854	3.50
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	222,635,973	1.4399	320,594,091	1.4149	315,007,638	3.10

(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、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.84
合計	98.84

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末 (2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
2019年 3月末日	12,854,346,989		9,894	
4月末日	12,483,931,722		10,013	
5月末日	12,189,316,882		9,677	
6月末日	12,537,878,410		10,029	
7月末日	12,656,868,942		10,166	
8月末日	13,106,030,663		10,061	
9月末日	13,128,114,575		10,216	
10月末日	12,978,200,665		10,460	
11月末日	11,976,985,598		10,473	
12月末日	11,491,290,069		10,711	
2020年 1月末日	11,429,373,827		10,758	
2月末日	10,927,226,150		10,466	
3月末日	10,154,696,774		9,474	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期中間計算期間	2019年 8月21日～2020年 2月20日	10.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期中間計算期間	2019年 8月21日～2020年 2月20日	2,496,625,579	4,720,809,159	10,495,313,529

(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	278,084,056,570	97.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,648,235,212	2.68
合計(純資産総額)		285,732,291,782	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	7,477,990,000	2.62

(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	1,571,200	6,650.70	10,449,579,840	6,501.00	10,214,371,200	3.57
日本	株式	ソニー	電気機器	890,500	5,494.43	4,892,789,915	6,421.00	5,717,900,500	2.00
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,847,200	2,469.50	4,561,660,400	2,575.50	4,757,463,600	1.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	127,600	31,622.65	4,035,050,140	34,830.00	4,444,308,000	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,096,400	5,096.40	5,587,692,960	3,788.00	4,153,163,200	1.45
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,171,600	3,805.68	4,458,734,688	3,308.00	3,875,652,800	1.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,500,600	504.58	4,793,812,748	403.00	3,828,741,800	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	86,300	38,840.11	3,351,901,493	41,610.00	3,590,943,000	1.26
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,020,800	2,623.13	2,677,691,104	3,377.00	3,447,241,600	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,029,800	2,814.39	2,898,258,822	3,190.00	3,285,062,000	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	403,000	5,633.61	2,270,344,830	7,434.00	2,995,902,000	1.05
日本	株式	花王	化学	337,200	8,539.28	2,879,445,216	8,830.00	2,977,476,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	963,900	3,573.79	3,444,776,181	2,796.00	2,695,064,400	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,108,700	2,734.61	3,031,862,107	2,430.00	2,694,141,000	0.94
日本	株式	HOYA	精密機器	281,200	8,092.48	2,275,605,376	9,200.00	2,587,040,000	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	236,800	9,568.33	2,265,780,544	10,730.00	2,540,864,000	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	960,500	3,739.17	3,591,472,785	2,623.00	2,519,391,500	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	496,600	5,526.64	2,744,529,424	4,950.00	2,458,170,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	179,400	13,758.71	2,468,312,574	13,170.00	2,362,698,000	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,872,100	153.62	2,899,132,002	123.60	2,332,591,560	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	413,700	4,762.05	1,970,060,085	5,472.00	2,263,766,400	0.79
日本	株式	三菱商事	卸売業	973,200	2,800.53	2,725,475,796	2,291.50	2,230,087,800	0.78

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	970,000	2,040.89	1,979,663,300	2,242.50	2,175,225,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	676,600	3,785.66	2,561,377,556	3,143.00	2,126,553,800	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,220,900	1,547.95	1,889,892,155	1,671.00	2,040,123,900	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	117,100	22,186.70	2,598,062,570	17,320.00	2,028,172,000	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	247,800	10,209.92	2,530,018,176	8,176.00	2,026,012,800	0.71
日本	株式	S M C	機械	44,200	38,249.11	1,690,610,662	45,750.00	2,022,150,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	143,100	13,585.88	1,944,139,428	13,820.00	1,977,642,000	0.69
日本	株式	ファナック	電気機器	133,800	18,297.92	2,448,261,696	14,655.00	1,960,839,000	0.69

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別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	0.19
		建設業	2.63
		食料品	4.10
		繊維製品	0.52
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.35
		医薬品	6.38
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.64
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.57
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.54
		機械	4.77
		電気機器	13.81
		輸送用機器	7.11
精密機器	2.49		
その他製品	2.40		
電気・ガス業	1.74		

	陸運業	4.39
	海運業	0.13
	空運業	0.39
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.41
	卸売業	4.83
	小売業	4.67
	銀行業	5.03
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.15
	その他金融業	1.09
	不動産業	2.10
	サービス業	4.77
	小計	97.32
合計		97.32

(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	533	円	7,561,960,150	7,477,990,000	2.62

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	448,050,550,450	83.43
地方債証券	日本	29,119,683,915	5.42

特殊債券	日本	35,698,139,810	6.65
社債券	日本	20,853,907,600	3.88
	フランス	1,889,078,000	0.35
	オーストラリア	396,840,000	0.07
	アメリカ	202,478,000	0.04
	イギリス	99,511,000	0.02
	小計	23,441,814,600	4.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		710,303,838	0.13
合計(純資産総額)		537,020,492,613	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,510,000,000	101.37	9,640,287,000	100.82	9,588,172,200	0.100	2023/12/20	1.79
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	101.97	7,444,538,800	100.93	7,368,036,000	0.100	2024/6/20	1.37
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	102.47	7,111,793,200	101.50	7,044,169,400	0.100	2026/9/20	1.31
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	101.57	7,008,870,600	100.80	6,955,338,000	0.100	2023/9/20	1.30
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	6,460,000,000	102.39	6,614,812,400	101.35	6,547,339,200	0.100	2026/3/20	1.22
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	102.92	6,504,544,000	0.400	2025/9/20	1.21
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.33	6,131,015,300	101.02	6,111,710,000	0.100	2024/12/20	1.14
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	6,050,000,000	101.27	6,127,353,300	100.68	6,091,261,000	0.100	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	6,020,000,000	101.36	6,101,914,500	100.98	6,079,477,600	0.100	2024/9/20	1.13
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	102.64	5,943,420,000	101.64	5,885,361,300	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,230,000,000	103.97	5,437,631,000	102.78	5,375,655,500	0.400	2025/6/20	1.00
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,040,000,000	100.81	5,080,824,000	100.47	5,063,839,200	0.100	2022/3/20	0.94
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	4,940,000,000	102.98	5,087,243,100	101.81	5,029,512,800	0.100	2027/9/20	0.94
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	4,940,000,000	103.04	5,090,176,000	101.15	4,997,057,000	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	100.89	4,812,641,300	100.54	4,795,996,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	101.94	4,659,023,600	1.000	2021/12/20	0.87
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,490,000,000	102.03	4,581,457,900	101.40	4,552,949,800	0.100	2028/12/20	0.85

日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	4,380,000,000	101.50	4,445,702,600	100.87	4,418,368,800	0.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.62	4,407,156,000	0.100	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	4,280,000,000	101.20	4,331,360,000	100.77	4,313,212,800	0.100	2023/6/20	0.80
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	4,190,000,000	102.48	4,294,243,000	101.49	4,252,472,900	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	4,080,000,000	101.13	4,126,104,000	100.74	4,110,396,000	0.100	2023/3/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,820,000,000	102.09	3,900,215,000	101.25	3,868,093,800	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第403回利付国債（2年）	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.31	3,781,837,800	0.100	2021/8/1	0.70
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	101.57	3,646,470,700	0.100	2028/6/20	0.68
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,540,000,000	102.29	3,621,295,200	101.68	3,599,755,200	0.100	2027/3/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,960,000,000	120.54	3,568,124,400	117.48	3,477,585,600	1.500	2034/6/20	0.65
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	3,400,000,000	102.92	3,499,313,600	102.20	3,474,936,000	0.600	2023/3/20	0.65
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,380,000,000	102.78	3,473,997,800	102.01	3,448,208,400	0.300	2024/12/20	0.64
日本	国債証券	第154回利付国債（20年）	2,950,000,000	116.93	3,449,463,500	113.98	3,362,410,000	1.200	2035/9/20	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.43
地方債証券	5.42
特殊債券	6.65
社債券	4.37
合計	99.87

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	212,241,778,568	62.89
	イギリス	16,611,555,588	4.92
	スイス	12,921,551,041	3.83
	フランス	11,304,752,274	3.35
	カナダ	10,769,930,601	3.19
	ドイツ	9,147,597,493	2.71
	オーストラリア	6,212,762,905	1.84
	アイルランド	5,997,130,960	1.78
	オランダ	5,855,969,721	1.74
	香港	2,909,645,630	0.86
	スペイン	2,891,937,163	0.86
	スウェーデン	2,775,178,294	0.82
	デンマーク	2,435,404,760	0.72
	イタリア	2,003,882,637	0.59
	シンガポール	1,234,361,264	0.37
	フィンランド	1,229,406,260	0.36
	バミューダ	1,094,706,875	0.32
	ベルギー	956,414,465	0.28
	ケイマン	712,532,640	0.21
	イスラエル	637,646,508	0.19
	ジャージー	632,027,509	0.19
	ノルウェー	594,774,172	0.18
	ニュージーランド	339,802,042	0.10
	ルクセンブルク	230,717,834	0.07
	ポルトガル	186,222,118	0.06
	キュラソー	177,799,071	0.05
	オーストリア	176,913,821	0.05
	パナマ	64,254,625	0.02
	リベリア	49,540,838	0.01
	マン島	28,330,500	0.01
パプアニューギニア	18,291,050	0.01	
英ヴァージン諸島	14,137,425	0.00	
	小計	312,456,956,652	92.59
投資信託受益証券	オーストラリア	135,494,637	0.04
	香港	78,370,999	0.02
	小計	213,865,636	0.06
投資証券	アメリカ	7,300,609,413	2.16
	オーストラリア	373,209,888	0.11
	フランス	219,438,888	0.07
	香港	180,210,420	0.05
	イギリス	171,545,031	0.05

	シンガポール	148,797,475	0.04
	カナダ	64,349,512	0.02
	小計	8,458,160,627	2.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,342,892,222	4.84
合計(純資産総額)		337,471,875,137	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	11,523,373,132	3.41
	買建	カナダ	594,838,832	0.18
	買建	ドイツ	2,480,267,010	0.73
	買建	イギリス	1,007,115,278	0.30
	買建	オーストラリア	668,992,720	0.20

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

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

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		1,278,299,150	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	664,066	13,889.58	9,223,602,295	17,437.83	11,579,870,614	3.43
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	407,243	19,801.95	8,064,206,656	27,730.97	11,293,244,352	3.35
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	38,664	199,603.82	7,717,482,430	213,736.67	8,263,914,938	2.45

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	220,562	19,930.80	4,395,979,227	18,060.33	3,983,424,380	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,342	123,646.61	3,504,392,258	124,808.42	3,537,320,257	1.05
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	241,260	14,801.24	3,570,948,501	14,475.47	3,492,353,895	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	27,466	124,362.49	3,415,740,204	124,752.91	3,426,463,627	1.02
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	273,000	11,220.78	3,063,275,008	11,298.35	3,084,451,734	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	288,543	11,758.26	3,392,765,491	10,175.60	2,936,099,594	0.87
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	228,573	11,458.07	2,619,007,144	12,515.45	2,860,693,953	0.85
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	157,050	17,863.84	2,805,516,515	18,018.98	2,829,881,296	0.84
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	399,059	4,801.84	1,916,218,785	6,038.97	2,409,908,003	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	120,861	21,689.12	2,621,368,915	19,935.47	2,409,421,976	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	86,917	26,213.41	2,278,391,082	27,346.80	2,376,902,024	0.70
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	82,362	27,722.85	2,283,310,130	27,561.19	2,269,995,349	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	379,353	6,353.97	2,410,398,889	5,960.61	2,261,178,737	0.67
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	64,487	30,634.87	1,975,551,341	34,959.24	2,254,417,026	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	670,087	3,489.02	2,337,952,528	3,289.93	2,204,539,927	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	100,194	20,931.91	2,097,251,989	21,341.56	2,138,296,563	0.63
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	233,609	8,698.18	2,031,974,889	8,374.46	1,956,351,212	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	786,173	3,009.37	2,365,889,396	2,398.61	1,885,724,935	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	373,610	5,343.64	1,996,438,355	4,897.35	1,829,698,934	0.54
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	507,939	4,461.98	2,266,413,689	3,555.47	1,805,964,975	0.54
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	165,445	14,284.90	2,363,366,415	10,861.23	1,796,936,859	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	128,521	13,864.42	1,781,869,268	13,655.98	1,755,081,285	0.52
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	197,657	9,939.86	1,964,684,165	8,807.73	1,740,911,070	0.52
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	389,430	5,795.58	2,256,974,311	4,388.02	1,708,828,809	0.51
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	130,425	11,235.96	1,465,451,291	12,536.12	1,635,024,455	0.48

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	40,234	38,168.26	1,535,661,922	40,371.57	1,624,310,021	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	416,741	4,593.40	1,914,262,113	3,862.37	1,609,610,728	0.48

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.34
		素材	3.78
		資本財	5.96
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.72
		自動車・自動車部品	0.89
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.40
		メディア・娯楽	5.94
		小売	5.07
		食品・生活必需品小売り	1.62
		食品・飲料・タバコ	4.85
		家庭用品・パーソナル用品	2.25
		ヘルスケア機器・サービス	5.08
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
		銀行	5.85
		各種金融	4.06
		保険	3.26
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	10.70
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.83		
電気通信サービス	2.29		
公益事業	3.78		
半導体・半導体製造装置	3.49		
	小計	92.59	
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.51
合計			95.16

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	811	アメリカドル	97,237,629.5	10,582,371,218	105,884,160	11,523,373,132	3.41
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	49	カナダドル	7,253,476.5	555,616,300	7,765,520	594,838,832	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	59	スイスフラン	4,967,543	562,375,543	5,285,810	598,406,550	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	580	ユーロ	14,504,790	1,734,047,644	15,741,200	1,881,860,460	0.56
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	78	オーストラリアドル	9,701,871	641,196,654	10,122,450	668,992,720	0.20
	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	136	イギリスポンド	7,129,505	950,505,606	7,554,120	1,007,115,278	0.30

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,564,000.00	922,981,780	931,925,870	0.28
	カナダドル	買建	548,000.00	41,952,232	41,971,320	0.01
	ユーロ	買建	1,192,000.00	142,330,998	142,491,680	0.04
	イギリスポンド	買建	291,000.00	38,863,870	38,792,000	0.01
	スイスフラン	買建	359,000.00	40,492,687	40,638,800	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	1,201,000.00	12,993,619	12,970,800	0.00
	ノルウェークローネ	買建	564,000.00	5,711,064	5,781,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	820,000.00	13,116,720	13,120,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	596,000.00	39,376,924	39,383,680	0.01
	香港ドル	買建	800,000.00	11,109,600	11,224,000	0.00

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

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

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	194,820,053,689	49.62
	フランス	36,656,239,096	9.34
	イタリア	33,324,628,131	8.49
	イギリス	24,243,670,537	6.17
	ドイツ	23,618,040,455	6.02
	スペイン	20,613,657,386	5.25
	ベルギー	8,914,736,414	2.27
	カナダ	7,074,135,095	1.80
	オランダ	6,936,231,850	1.77
	オーストラリア	6,750,946,793	1.72
	オーストリア	5,285,486,321	1.35
	アイルランド	2,684,951,997	0.68
	メキシコ	2,677,982,857	0.68
	ポーランド	2,163,558,213	0.55
	フィンランド	2,121,247,877	0.54
	デンマーク	1,870,366,901	0.48
	マレーシア	1,734,122,509	0.44
	シンガポール	1,578,047,247	0.40
	南アフリカ	1,572,457,171	0.40
	スウェーデン	1,039,901,281	0.26
ノルウェー	842,587,030	0.21	
	小計	386,523,048,850	98.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,117,008,372	1.56
合計(純資産総額)		392,640,057,222	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	1,454,660,904	0.37
	買建	ドイツ	1,413,141,970	0.36

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,812,473,000	0.72

(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 2.25% 08/15/46	18,760,000	10,031.94	1,881,993,707	13,165.87	2,469,918,965	2.250	2046/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,122.37	2,085,445,509	12,263.78	2,299,458,867	2.375	2027/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,466.38	1,726,953,550	13,780.59	2,273,798,794	2.500	2046/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,361.89	2,046,277,150	12,500.14	2,251,276,254	2.375	2029/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,459.58	1,673,533,325	13,762.74	2,202,039,021	2.500	2046/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	18,900,000	11,024.26	2,083,585,393	11,644.81	2,200,869,090	1.625	2026/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,311.79	2,036,122,236	12,215.74	2,198,833,634	2.625	2026/1/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,953.84	2,026,461,193	11,243.07	2,079,968,743	2.125	2021/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,443.30	1,821,774,076	12,854.69	2,046,467,215	2.875	2028/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	15,990,000	11,458.71	1,832,247,841	12,704.20	2,031,401,905	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	16,980,000	11,137.35	1,891,123,183	11,711.12	1,988,549,582	2.000	2025/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,681.37	1,682,117,299	13,119.96	1,889,275,204	3.125	2028/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,291.34	1,795,323,087	11,831.86	1,881,265,988	2.500	2024/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	12,200,000	11,713.37	1,429,031,494	15,211.54	1,855,808,277	3.000	2049/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,439.90	1,631,330,248	12,813.03	1,827,138,367	2.875	2028/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,716.39	1,400,109,107	15,171.58	1,813,004,071	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,902.55	1,597,224,373	12,233.17	1,792,159,725	2.250	2027/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,194.93	1,634,461,205	12,096.70	1,766,119,601	2.375	2026/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,069.09	1,660,364,895	11,712.40	1,756,860,549	2.250	2024/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,669.34	1,563,058,875	11,800.40	1,728,759,031	1.625	2029/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,098.59	1,664,788,834	11,524.92	1,728,739,051	2.375	2023/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	15,000,000	11,087.27	1,663,091,086	11,366.78	1,705,017,512	2.000	2022/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,000.33	1,650,049,851	11,325.12	1,698,768,281	2.500	2022/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	15,000,000	10,935.34	1,640,302,084	11,205.23	1,680,785,832	1.500	2022/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,854.16	1,633,551,088	11,160.38	1,679,638,537	1.750	2021/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	10,958.67	1,638,321,771	11,172.07	1,670,225,913	2.125	2021/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,819.65	1,585,079,832	11,332.77	1,660,251,396	1.875	2022/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	11,272.40	1,296,326,844	14,409.77	1,657,123,802	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/29/24	13,760,000	11,379.67	1,565,843,949	11,737.91	1,615,136,510	2.375	2024/2/29	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	11,258.80	1,227,209,591	14,616.37	1,593,185,332	2.875	2045/8/15	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.44
合計	98.44

(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	40	アメリカドル	4,945,035.09	538,168,168	5,016,250	545,918,487	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカドル	3,370,896.98	366,854,719	3,470,703.25	377,716,635	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	27	アメリカドル	4,600,170.5	500,636,555	4,879,406.25	531,025,782	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,683,740	201,291,117	1,683,600	201,274,380	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,817,104	336,784,783	2,845,710	340,204,630	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	42	ユーロ	7,099,088	848,695,970	7,291,200	871,662,960	0.22

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,720,000.00	1,386,720,274	1,382,918,400	0.35
	カナダドル	買建	1,520,000.00	114,568,045	116,340,800	0.03
	ユーロ	買建	9,250,000.00	1,103,343,807	1,105,375,000	0.28
	イギリスポンド	買建	1,560,000.00	198,839,940	207,838,800	0.05

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ケイマン	11,481,745,926	20.69
	中国	7,464,985,165	13.45
	台湾	6,312,042,567	11.37
	韓国	6,111,995,215	11.01
	インド	3,961,937,316	7.14
	ブラジル	2,522,252,070	4.54
	南アフリカ	1,752,387,925	3.16
	ロシア	1,589,262,537	2.86
	香港	1,571,385,562	2.83
	サウジアラビア	1,327,275,441	2.39
	タイ	1,115,186,653	2.01
	マレーシア	980,600,608	1.77
	メキシコ	939,473,643	1.69
	インドネシア	772,693,562	1.39
	カタール	514,627,613	0.93
	バミューダ	460,882,092	0.83
	フィリピン	416,336,657	0.75
	ポーランド	364,812,671	0.66
	チリ	310,173,682	0.56
	アラブ首長国連邦	294,927,891	0.53
	トルコ	228,124,101	0.41
	アメリカ	186,264,167	0.34
	コロンビア	124,309,595	0.22
	ハンガリー	122,217,110	0.22
	ギリシャ	109,131,860	0.20
	チェコ	62,558,891	0.11
	エジプト	57,464,840	0.10
	ルクセンブルク	49,549,029	0.09
	ジャージー	48,998,499	0.09
	アルゼンチン	38,983,647	0.07
	シンガポール	22,313,070	0.04
	マン島	13,943,325	0.03
	パキスタン	12,944,022	0.02
ペルー	12,676,344	0.02	
スペイン	3,842,796	0.01	
	小計	51,358,306,092	92.54
投資信託受益証券	ブラジル	97,282,828	0.18
	メキシコ	25,375,711	0.05
	小計	122,658,539	0.22
投資証券	南アフリカ	40,583,554	0.07

	メキシコ	26,130,053	0.05
	小計	66,713,607	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,952,036,379	7.12
合計(純資産総額)		55,499,714,617	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,900,321,367	7.03

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

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

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		125,137,800	0.23

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	175,717	20,730.65	3,642,729,382	20,815.91	3,657,709,978	6.59
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	579,300	4,658.44	2,698,635,140	5,287.46	3,063,027,895	5.52
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,490,389	1,103.30	2,747,658,082	960.32	2,391,582,816	4.31
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	482,085	4,684.75	2,258,448,662	4,268.22	2,057,644,839	3.71
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,664,620	90.97	879,246,076	87.60	846,713,492	1.53
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	44,706	13,136.49	587,280,026	15,178.72	678,580,035	1.22
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	573,000	1,324.15	758,743,138	1,058.61	606,586,968	1.09

香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	620,000	903.44	560,138,938	784.83	486,598,320	0.88
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,600,515	82.17	542,427,491	73.28	483,743,824	0.87
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	287,855	2,111.32	607,754,249	1,504.45	433,065,470	0.78
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	55,172	7,416.43	409,179,765	7,466.04	411,916,359	0.74
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	165,864	3,268.36	542,104,219	2,275.77	377,469,145	0.68
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,289,200	46.42	384,860,299	40.71	337,503,067	0.61
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	74,199	3,634.79	269,697,969	4,395.64	326,152,367	0.59
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,265,248	325.19	411,458,387	251.29	317,956,822	0.57
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	343,971	1,038.89	357,351,269	914.98	314,727,274	0.57
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	84,303	3,846.57	324,277,730	3,608.13	304,177,026	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	28,000	13,618.07	381,306,018	10,768.72	301,524,398	0.54
ブラジル	株式	VALE SA	素材	318,878	1,030.09	328,475,210	873.82	278,644,653	0.50
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	565,091	890.53	503,233,535	476.89	269,487,976	0.49
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	269,966	1,643.44	443,675,121	988.17	266,774,030	0.48
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	44,045	10,316.68	454,398,592	6,040.06	266,034,663	0.48
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	500,681	753.83	377,433,174	504.38	252,534,084	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	7,138	32,648.16	233,042,582	33,401.01	238,416,447	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	89,479	3,114.22	278,657,782	2,596.60	232,342,066	0.42
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	448,872	576.56	258,802,622	512.15	229,890,917	0.41
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,422,040	69.63	238,302,366	65.07	222,695,413	0.40
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	479,851	727.53	349,109,122	457.56	219,562,543	0.40
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	38,559	4,901.09	188,981,277	5,659.15	218,211,550	0.39
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	66,516	3,046.99	202,673,799	3,189.15	212,129,568	0.38

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.32
		素材	6.12
		資本財	2.80
		商業・専門サービス	0.32
		運輸	1.49
		自動車・自動車部品	1.70

	耐久消費財・アパレル	1.13
	消費者サービス	1.43
	メディア・娯楽	8.16
	小売	10.06
	食品・生活必需品小売り	1.49
	食品・飲料・タバコ	3.42
	家庭用品・パーソナル用品	1.13
	ヘルスケア機器・サービス	0.98
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.29
	銀行	14.67
	各種金融	2.00
	保険	3.43
	不動産	2.53
	ソフトウェア・サービス	1.77
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
	電気通信サービス	4.06
	公益事業	2.24
	半導体・半導体製造装置	6.26
	小計	92.54
投資信託受益証券		0.22
投資証券		0.12
合計		92.88

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	858	アメリカドル	33,306,636	3,624,761,195	35,838,660	3,900,321,367	7.03

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

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

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	1,150,000.00	124,401,800	125,137,800	0.23

(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	タイ	5,415,790,011	10.59
	ポーランド	5,066,513,966	9.90
	ブラジル	5,012,842,479	9.80
	インドネシア	4,823,213,466	9.43
	メキシコ	4,710,825,960	9.21
	ロシア	4,250,538,791	8.31
	マレーシア	3,649,199,823	7.13
	南アフリカ	3,632,295,047	7.10
	コロンビア	2,609,465,339	5.10
	チェコ	2,309,393,548	4.51
	ペルー	2,047,240,318	4.00
	ハンガリー	2,017,297,111	3.94
	トルコ	1,734,096,918	3.39
	チリ	1,286,639,942	2.52
	フィリピン	110,267,437	0.22
	ドミニカ共和国	82,933,703	0.16
	ウルグアイ	70,077,923	0.14
	小計	48,828,631,782	95.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,324,585,307	4.54
合計(純資産総額)		51,153,217,089	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	81,900,000,000	3.36	2,758,131,137	2.94	2,414,609,133	9.850	2027/6/28	4.72
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	48,550,000	1,702.75	826,686,037	1,737.22	843,421,031	0.000	2023/7/1	1.65
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	35,100,000	2,341.38	821,825,637	2,326.67	816,661,194	10.000	2023/1/1	1.60

タイ	国債証券	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000	406.84	716,451,809	409.41	720,974,867	3.400	2036/6/17	1.41
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	109,850,000	670.77	736,850,930	606.28	666,008,082	10.500	2026/12/21	1.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	27,300,000	2,428.70	663,036,493	2,356.25	643,258,509	10.000	2025/1/1	1.26
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	20,050,000	2,854.10	572,248,137	2,912.38	583,933,585	4.000	2023/10/25	1.14
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	23,950,000	2,492.75	597,015,913	2,368.01	567,140,670	10.000	2027/1/1	1.11
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/22	28,550,000	1,879.22	536,517,357	1,944.89	555,267,508	0.000	2022/1/1	1.09
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000	401.11	549,127,298	403.15	551,923,357	3.650	2031/6/20	1.08
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000	2,701.74	537,647,852	2,749.54	547,159,479	2.500	2023/1/25	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	112,900,000	478.19	539,887,440	480.99	543,037,953	8.000	2023/12/7	1.06
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/22	27,550,000	1,826.38	503,168,764	1,882.05	518,505,990	0.000	2022/7/1	1.01
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	116,000,000	428.01	496,494,674	434.04	503,489,903	4.875	2029/6/22	0.98
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/21	24,650,000	1,945.52	479,570,885	1,998.02	492,512,352	0.000	2021/7/1	0.96
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	16,450,000	2,706.99	445,301,289	2,796.61	460,043,733	2.500	2026/7/25	0.90
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/27	16,350,000	2,705.76	442,392,812	2,787.97	455,833,475	2.500	2027/7/25	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 3.3% 06/17/38	111,800,000	410.50	458,945,391	407.11	455,159,354	3.300	2038/6/17	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	92,150,000	474.93	437,654,675	465.20	428,686,808	7.500	2027/6/3	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	82,250,000	521.40	428,851,861	517.22	425,414,416	10.000	2024/12/5	0.83
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	14,950,000	2,710.87	405,275,551	2,787.01	416,658,241	2.500	2024/4/25	0.81
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	58,800,000,000	0.71	423,075,614	0.69	406,850,371	8.375	2024/3/15	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	81,800,000	509.88	417,082,715	494.56	404,552,628	8.500	2029/5/31	0.79
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	88,000,000	535.30	471,067,520	441.13	388,196,798	8.500	2037/1/31	0.76
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	89,300,000	529.02	472,418,521	434.32	387,853,542	8.750	2048/2/28	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000	2,811.89	372,576,366	2,896.16	383,741,290	3.250	2025/7/25	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 7.25% 12/09/21	82,400,000	462.68	381,252,344	464.67	382,888,694	7.250	2021/12/9	0.75
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	79,050,000	559.92	442,622,689	479.73	379,230,320	8.000	2030/1/31	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000	456.19	370,430,892	458.63	372,414,336	6.500	2022/6/9	0.73
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	95,800,000	380.81	364,825,035	383.77	367,659,027	3.850	2025/12/12	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.46
合計	95.46

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	91,962,115,840	96.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,507,391,401	3.67
合計(純資産総額)		95,469,507,241	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	3,498,716,000	3.66

(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	10,803	797,461.07	8,614,971,948	724,000	7,821,372,000	8.19
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,155	714,463.76	7,969,843,246	633,000	7,061,115,000	7.40
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,013	192,188.37	6,921,279,903	136,600	4,919,375,800	5.15
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,786	293,472.32	4,926,226,454	271,200	4,552,363,200	4.77
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,916	297,433.04	4,733,944,272	263,700	4,197,049,200	4.40

日本	投資証券	G L P 投資法人	27,784	133,525.89	3,709,883,350	121,600	3,378,534,400	3.54
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,581	346,108.87	3,662,178,013	313,500	3,317,143,500	3.47
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,227	232,896.9	5,176,599,508	142,000	3,156,234,000	3.31
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,048	209,695.93	5,252,463,734	107,500	2,692,660,000	2.82
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	21,084	238,951.31	5,038,049,522	122,200	2,576,464,800	2.70
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,331	491,714.17	3,604,756,652	325,000	2,382,575,000	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	32,618	94,127.03	3,070,235,578	69,200	2,257,165,600	2.36
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,707	671,608.03	2,489,650,978	584,000	2,164,888,000	2.27
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,366	165,897.99	2,383,290,528	146,200	2,100,309,200	2.20
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,452	812,732.53	2,805,552,726	569,000	1,964,188,000	2.06
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,590	553,310.61	3,093,006,316	349,000	1,950,910,000	2.04
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,834	171,778.46	2,204,604,872	143,500	1,841,679,000	1.93
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,290	273,064.65	1,990,641,320	239,900	1,748,871,000	1.83
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,575	829,587.06	2,136,186,680	596,000	1,534,700,000	1.61
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	10,372	160,206.45	1,661,661,352	145,800	1,512,237,600	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,858	345,180.16	1,676,885,237	307,500	1,493,835,000	1.56
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,175	452,122.08	1,435,487,610	456,000	1,447,800,000	1.52
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,319	180,453.75	1,862,102,249	124,200	1,281,619,800	1.34
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,040	144,669.3	1,741,818,445	103,500	1,246,140,000	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,279	207,924.43	1,513,481,938	168,300	1,225,055,700	1.28
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,962	470,084.58	1,862,475,136	304,500	1,206,429,000	1.26
日本	投資証券	プレミア投資法人	10,075	155,048.52	1,562,113,855	119,100	1,199,932,500	1.26
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,487	197,397.78	1,872,712,825	125,200	1,187,772,400	1.24
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	48,933	62,126.2	3,040,021,368	24,230	1,185,646,590	1.24
日本	投資証券	日本リート投資法人	3,623	466,518.78	1,690,197,572	319,000	1,155,737,000	1.21

(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	96.33
合計	96.33

(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	2,206円	3,929,312,260	3,498,716,000	3.66
-------------	-------	------------	----	--------	---------------	---------------	------

(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	54,596,574,611	76.36
	オーストラリア	3,587,729,162	5.02
	イギリス	3,467,825,566	4.85
	シンガポール	2,901,140,435	4.06
	フランス	1,811,533,690	2.53
	香港	1,498,212,471	2.10
	カナダ	1,320,472,034	1.85
	ベルギー	883,638,464	1.24
	スペイン	383,924,555	0.54
	ニュージーランド	303,778,948	0.42
	ドイツ	213,486,974	0.30
	ガーンジー	126,307,101	0.18
	オランダ	115,477,930	0.16
	アイルランド	95,400,057	0.13
	イスラエル	55,215,451	0.08
	イタリア	14,582,936	0.02
	マン島	14,038,703	0.02
	韓国	10,646,020	0.01
	小計	71,399,985,108	99.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		103,149,819	0.14
合計(純資産総額)		71,503,134,927	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		606,131,220	0.85

(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	503,332	9,431.57	4,747,212,397	9,019.83	4,539,969,275	6.35
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	58,160	58,582.51	3,407,158,998	70,181.20	4,081,738,714	5.71
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	179,420	13,217.60	2,371,501,935	15,215.52	2,729,969,011	3.82
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	102,590	22,904.92	2,349,816,405	21,943.39	2,251,172,678	3.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	238,660	8,964.52	2,139,474,449	6,810.58	1,625,413,357	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	95,490	22,446.53	2,143,420,007	16,553.04	1,580,650,076	2.21
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	277,420	8,760.15	2,430,240,865	5,134.59	1,424,440,566	1.99
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	234,400	8,038.52	1,884,229,696	5,782.13	1,355,333,124	1.90
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	83,860	16,772.82	1,406,569,012	15,742.25	1,320,145,882	1.85
香港	投資証券	LINK REIT	1,434,900	1,172.06	1,681,802,496	905.58	1,299,416,742	1.82
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	209,900	16,012.40	3,361,002,990	6,123.86	1,285,399,075	1.80
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	44,860	33,621.22	1,508,248,201	24,542.25	1,100,965,483	1.54
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	97,630	14,769.68	1,441,964,704	10,116.83	987,706,777	1.38
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	87,390	11,478.09	1,003,070,406	10,529.30	920,155,745	1.29
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	77,540	14,396.98	1,116,342,182	11,658.95	904,035,596	1.26
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	250,000	3,754.08	938,521,359	3,596.83	899,207,875	1.26
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	339,240	3,598.21	1,220,659,378	2,650.01	898,989,562	1.26
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,089,440	934.53	1,018,122,663	788.45	858,972,999	1.20
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	369,340	3,182.04	1,175,254,910	2,306.10	851,737,818	1.19
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,050	16,560.69	1,044,151,844	13,312.08	839,326,997	1.17
アメリカ	投資証券	UDR INC	199,460	5,082.42	1,013,739,685	4,105.06	818,796,784	1.15
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	255,720	6,286.52	1,607,588,981	3,133.21	801,225,919	1.12
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	124,000	7,221.03	895,408,062	6,159.77	763,812,472	1.07
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	117,230	9,025.70	1,058,083,328	6,454.70	756,685,337	1.06
イギリス	投資証券	SEGO PLC	746,080	1,117.03	833,396,514	999.63	745,806,457	1.04
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	355,560	2,162.49	768,898,203	1,914.31	680,655,513	0.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	488,630	1,832.98	895,651,630	1,242.83	607,288,225	0.85
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	65,610	11,924.44	782,362,526	9,069.89	595,075,627	0.83
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	317,510	2,593.62	823,502,083	1,745.63	554,255,997	0.78
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	93,780	16,258.28	1,524,702,145	5,865.12	550,031,235	0.77

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	99.86
合計	99.86

(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	4,400,000.00	478,753,880	478,808,000	0.67
	カナダドル	買建	400,000.00	30,637,520	30,636,000	0.04
	ユーロ	買建	150,000.00	17,928,540	17,931,000	0.03
	イギリスポンド	買建	150,000.00	19,993,425	19,996,500	0.03
	オーストラリアドル	買建	309,000.00	20,422,088	20,418,720	0.03
	香港ドル	買建	1,100,000.00	15,436,190	15,433,000	0.02
	シンガポールドル	買建	300,000.00	22,903,560	22,908,000	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。

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	26,634,597,549	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		353,031,184	1.31
合計(純資産総額)		26,987,628,733	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		27,191,614,106	100.76

(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	15,799,600	1,464.85	23,144,072,499	1,685.77	26,634,597,549	98.69

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.69
合計	98.69

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


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	249,964,921.00	26,867,712,249	27,191,614,106	100.76

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2017年11月30日
 作成基準日：2020年3月31日

基準価額・純資産の推移


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	9,474円
純資産総額	101.55億円

分配の推移
 (1万口当たり、税引前)

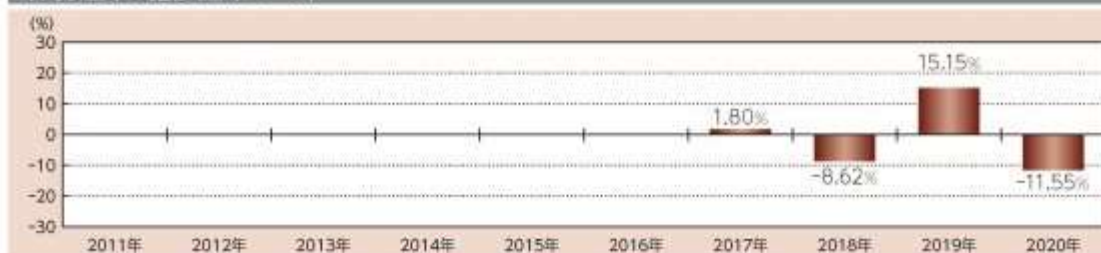
決算期	分配金
2018年8月	0円
2019年8月	0円
-	-
-	-
-	-
設定後 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券インデックス マザーファンド	23.7%	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.1%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.1%
外国株式インデックス マザーファンド	22.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	0.7%
ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	17.2%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	17.0%
		-	-	-	-	-	-	-
新興国債券インデックス マザーファンド	10.7%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
		BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	国債	-	0.000%	2023/07/01	0.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	9.9%	ALBASA GROUP HOLDING SP ADR	ケイマン島	株式	小売	-	-	0.7%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.5%
J-REITインデックス マザーファンド	4.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.4%
		ジャパリアリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%
国内株式インデックス マザーファンド	3.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックス マザーファンド	3.1%	第138日利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.1%
		第140日利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

 ※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020年は年初から作成基準日までの収益率です。
 ※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2017年11月30日（設定日）から2027年 8月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8月20日までとします。

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

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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2期計算期間(2018年8月21日から2019年8月20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】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2018年 8月20日現在)	第2期 (2019年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	212,814,175	169,064,818
親投資信託受益証券	13,507,669,384	12,651,925,042
未収入金	28,091,481	10,660,686
流動資産合計	13,748,575,040	12,831,650,546
資産合計	13,748,575,040	12,831,650,546
負債の部		
流動負債		
未払解約金	76,129,192	28,148,466
未払受託者報酬	1,697,234	3,370,986
未払委託者報酬	27,155,654	53,935,681
未払利息	543	364
その他未払費用	169,720	337,041
流動負債合計	105,152,343	85,792,538
負債合計	105,152,343	85,792,538
純資産の部		
元本等		
元本	14,165,027,817	12,719,497,109
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	521,605,120	26,360,899
(分配準備積立金)	138,554,922	337,823,036
元本等合計	13,643,422,697	12,745,858,008
純資産合計	13,643,422,697	12,745,858,008
負債純資産合計	13,748,575,040	12,831,650,546

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年11月30日	自	2018年 8月21日
	至	2018年 8月20日	至	2019年 8月20日
営業収益				
受取利息		29		76
有価証券売買等損益		577,316,250		644,793,864
営業収益合計		577,316,221		644,793,940
営業費用				
支払利息		87,056		121,114
受託者報酬		4,440,238		6,870,878
委託者報酬		71,043,695		109,933,834
その他費用		449,273		692,701
営業費用合計		76,020,262		117,618,527
営業利益又は営業損失（ ）		653,336,483		527,175,413
経常利益又は経常損失（ ）		653,336,483		527,175,413
当期純利益又は当期純損失（ ）		653,336,483		527,175,413
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（ ）		52,375,515		112,039,470
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		521,605,120
剰余金増加額又は欠損金減少額		109,660,076		193,999,234
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		193,999,234
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		109,660,076		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,304,228		61,169,158
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,304,228		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		61,169,158
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		521,605,120		26,360,899

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年 8月20日現在)	第2期 (2019年 8月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,165,027,817口	12,719,497,109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 521,605,120円	元本の欠損 - 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 0.9632円 (1万口当たり純資産額) (9,632円)	1口当たり純資産額 1.0021円 (1万口当たり純資産額) (10,021円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日			第2期 自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	138,554,922円	費用控除後の配当等収益額	A	245,108,236円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	20,165,811円	収益調整金額	C	55,865,657円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	92,714,800円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	158,720,733円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	393,688,693円
当ファンドの期末残存口数	F	14,165,027,817口	当ファンドの期末残存口数	F	12,719,497,109口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	112円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	309円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第2期 (2019年 8月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期	第2期
	自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日	自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	386,432,484円	14,165,027,817円
期中追加設定元本額	16,923,630,441円	3,975,335,196円
期中一部解約元本額	3,145,035,108円	5,420,865,904円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	(2018年 8月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	530,020,874	550,335,861
合計	530,020,874	550,335,861

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	336,788,024	685,700,416	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	341,587,060	647,000,050	
	新興国株式インデックス マザーファンド	482,930,100	1,239,874,738	
	国内株式インデックス マザーファンド	310,664,916	431,327,169	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,041,062,604	2,617,127,280	
	国内債券インデックス マザーファンド	222,249,455	321,439,386	
	外国債券インデックス マザーファンド	962,705,130	2,683,251,738	
	新興国債券インデックス マザーファンド	785,260,021	1,304,709,524	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,501,143,959	2,721,494,741	
合計		6,984,391,269	12,651,925,042	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年 8月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,743,537,953
株式	281,196,060,920
派生商品評価勘定	5,939,520
未収配当金	427,391,028
前払金	67,033,370
差入委託証拠金	124,200,000
流動資産合計	284,564,162,791
資産合計	284,564,162,791
負債の部	

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	73,016,630
未払解約金	42,062,102
未払利息	5,919
その他未払費用	9
流動負債合計	115,084,660
負債合計	115,084,660
純資産の部	
元本等	
元本	204,872,395,529
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,576,682,602
元本等合計	284,449,078,131
純資産合計	284,449,078,131
負債純資産合計	284,564,162,791

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	204,872,395,529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 1.3884円 (1万口当たり純資産額) (13,884円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2019年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	139,526,478,825円
期中追加設定元本額	81,691,488,611円
期中一部解約元本額	16,345,571,907円
期末元本額	204,872,395,529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）	598,049,802円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,050,078,750円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,947,918円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,023,073,816円
世界経済インデックスファンド	2,062,961,877円
日本株式インデックス・オープン	5,373,187,097円

区分	2019年 8月20日現在
DCマイセレクション25	6,767,531,462円
DCマイセレクション50	19,289,136,226円
DCマイセレクション75	17,768,297,850円
DC日本株式インデックス・オープン	5,656,440,957円
DCマイセレクションS25	2,743,333,218円
DCマイセレクションS50	7,842,348,803円
DCマイセレクションS75	5,104,196,493円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,482,108,839円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	381,485,397円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	656,356,649円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	431,235,500円
DC世界経済インデックスファンド	1,819,305,498円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,208,034,657円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	17,160,289円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	39,491,701円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	38,766,263円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	290,338,960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）	88,141,636円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	345,599,619円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	63,345,357円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	502,837,586円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,839,771,996円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	741,208,011円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,295,237,633円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	674,073,258円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	47,417,537円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	817,041,419円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,105,366円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	470,869,288円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	593,316,643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）	908,333,579円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,999,477,195円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,515,565,724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	3,951,974,915円
分散投資コア戦略ファンドS	7,755,835,135円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,037,740円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	275,162,747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）	221,962,865円

区分	2019年 8月20日現在
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,352,158円
SMT インデックスバランス・オープン	75,700,931円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,216,190,385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	14,137,727円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	57,670,540円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	8,415,462円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,474,740円
グローバル経済コア	310,664,916円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,272,839円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	48,316,928円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,304,518円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	176,900,240円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	30,486,375円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	56,104,758,507円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	646,512,493円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	6,303,752円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,506,003,275
合計	5,506,003,275

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 8月20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	3,302,783,370	-	3,235,750,000	67,033,370
	合計	3,302,783,370	-	3,235,750,000	67,033,370

(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	5,700	2,871.00	16,364,700	
日本水産	177,000	601.00	106,377,000	
マルハニチロ	25,600	2,647.00	67,763,200	
カネコ種苗	5,400	1,137.00	6,139,800	
サカタのタネ	21,500	3,480.00	74,820,000	
ホクト	14,800	1,827.00	27,039,600	
ホクリヨウ	2,400	603.00	1,447,200	
住石ホールディングス	38,100	129.00	4,914,900	
日鉄鉱業	4,100	4,090.00	16,769,000	
三井松島ホールディングス	7,400	1,179.00	8,724,600	
国際石油開発帝石	710,000	925.20	656,892,000	
石油資源開発	25,400	2,615.00	66,421,000	
K&Oエナジーグループ	8,600	1,406.00	12,091,600	
ヒノキヤグループ	4,800	1,947.00	9,345,600	
ショーボンドホールディングス	25,300	3,865.00	97,784,500	
ミライト・ホールディングス	49,800	1,532.00	76,293,600	
タマホーム	8,500	1,473.00	12,520,500	
サンヨーホームズ	2,600	628.00	1,632,800	
日本アクア	7,000	528.00	3,696,000	
ファーストコーポレーション	5,400	608.00	3,283,200	
ベステラ	3,400	1,286.00	4,372,400	
T A T E R U	35,900	168.00	6,031,200	
スペースバリューホールディングス	21,600	470.00	10,152,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	702.00	2,386,800	
第一カッター興業	2,200	1,637.00	3,601,400	
安藤・間	113,500	691.00	78,428,500	
東急建設	51,800	718.00	37,192,400	
コムシスホールディングス	62,800	2,867.00	180,047,600	
ミサワホーム	14,200	1,054.00	14,966,800	

ビーアールホールディングス	19,300	313.00	6,040,900
高松コンストラクショングループ	11,000	2,282.00	25,102,000
東建コーポレーション	5,500	6,150.00	33,825,000
ソネック	1,800	824.00	1,483,200
ヤマウラ	7,500	831.00	6,232,500
大成建設	145,400	3,680.00	535,072,000
大林組	437,900	954.00	417,756,600
清水建設	446,600	875.00	390,775,000
飛鳥建設	12,700	1,129.00	14,338,300
長谷工コーポレーション	182,500	1,119.00	204,217,500
松井建設	16,700	696.00	11,623,200
銭高組	1,800	3,965.00	7,137,000
鹿島建設	342,200	1,243.00	425,354,600
不動テトラ	10,300	1,141.00	11,752,300
大末建設	5,800	906.00	5,254,800
鉄建建設	8,900	2,625.00	23,362,500
西松建設	31,500	1,869.00	58,873,500
三井住友建設	105,300	527.00	55,493,100
大豊建設	9,900	2,638.00	26,116,200
前田建設工業	104,100	851.00	88,589,100
佐田建設	11,100	395.00	4,384,500
ナカノフドー建設	12,500	416.00	5,200,000
奥村組	24,000	2,798.00	67,152,000
東鉄工業	17,500	3,065.00	53,637,500
イチケン	3,000	1,607.00	4,821,000
富士ピー・エス	6,000	455.00	2,730,000
浅沼組	5,000	3,545.00	17,725,000
戸田建設	169,700	578.00	98,086,600
熊谷組	20,800	2,853.00	59,342,400
青木あすなろ建設	7,800	1,208.00	9,422,400
北野建設	3,200	2,261.00	7,235,200
植木組	2,100	2,356.00	4,947,600
矢作建設工業	19,900	690.00	13,731,000
ピーエス三菱	16,100	671.00	10,803,100
日本ハウスホールディングス	27,900	426.00	11,885,400
大東建託	52,000	13,940.00	724,880,000
新日本建設	17,700	760.00	13,452,000
N I P P O	38,600	1,875.00	72,375,000
東亜道路工業	2,700	3,170.00	8,559,000
前田道路	45,700	2,361.00	107,897,700
日本道路	3,900	6,070.00	23,673,000
東亜建設工業	12,700	1,251.00	15,887,700

日本国土開発	23,900	510.00	12,189,000
若築建設	7,300	1,471.00	10,738,300
東洋建設	53,500	428.00	22,898,000
五洋建設	173,600	539.00	93,570,400
世紀東急工業	21,300	688.00	14,654,400
福田組	4,700	3,890.00	18,283,000
住友林業	103,500	1,295.00	134,032,500
日本基礎技術	15,000	321.00	4,815,000
巴コーポレーション	19,400	347.00	6,731,800
大和ハウス工業	404,300	3,285.00	1,328,125,500
ライト工業	28,100	1,363.00	38,300,300
積水ハウス	447,100	1,859.50	831,382,450
日特建設	12,400	646.00	8,010,400
北陸電気工事	7,100	933.00	6,624,300
ユアテック	23,400	661.00	15,467,400
四電工	2,200	2,737.00	6,021,400
中電工	18,800	2,246.00	42,224,800
関電工	66,400	897.00	59,560,800
きんでん	97,100	1,555.00	150,990,500
東京エネシス	15,100	906.00	13,680,600
トーエネック	4,100	3,185.00	13,058,500
住友電設	10,100	1,876.00	18,947,600
日本電設工業	24,900	2,056.00	51,194,400
協和エクシオ	57,200	2,390.00	136,708,000
新日本空調	11,800	1,768.00	20,862,400
九電工	28,800	3,200.00	92,160,000
三機工業	33,000	1,265.00	41,745,000
日揮	125,800	1,267.00	159,388,600
中外炉工業	4,400	1,549.00	6,815,600
ヤマト	14,000	664.00	9,296,000
太平電業	9,900	2,330.00	23,067,000
高砂熱学工業	35,500	1,610.00	57,155,000
三晃金属工業	2,000	2,351.00	4,702,000
朝日工業社	3,200	2,758.00	8,825,600
明星工業	26,400	720.00	19,008,000
大気社	19,900	3,080.00	61,292,000
ダイダン	9,800	2,127.00	20,844,600
日比谷総合設備	13,200	1,849.00	24,406,800
東芝プラントシステム	31,600	1,747.00	55,205,200
OSJBホールディングス	64,400	233.00	15,005,200
東洋エンジニアリング	17,200	575.00	9,890,000
レイズネクスト	26,200	1,171.00	30,680,200

日本製粉	41,500	1,636.00	67,894,000
日清製粉グループ本社	147,800	1,968.00	290,870,400
日東富士製粉	900	6,400.00	5,760,000
昭和産業	12,000	3,060.00	36,720,000
鳥越製粉	11,600	807.00	9,361,200
中部飼料	16,000	1,166.00	18,656,000
フィード・ワン	87,800	157.00	13,784,600
東洋精糖	2,000	1,023.00	2,046,000
日本甜菜製糖	7,400	1,872.00	13,852,800
三井製糖	10,300	2,153.00	22,175,900
塩水港精糖	14,200	210.00	2,982,000
日新製糖	6,200	1,856.00	11,507,200
森永製菓	32,900	5,220.00	171,738,000
中村屋	3,400	4,190.00	14,246,000
江崎グリコ	39,300	4,625.00	181,762,500
名糖産業	6,300	1,284.00	8,089,200
井村屋グループ	5,600	2,021.00	11,317,600
不二家	7,300	1,984.00	14,483,200
山崎製パン	98,000	1,950.00	191,100,000
第一屋製パン	2,200	966.00	2,125,200
モロゾフ	2,200	4,835.00	10,637,000
亀田製菓	8,100	4,680.00	37,908,000
寿スピリッツ	13,900	6,950.00	96,605,000
カルビー	59,600	3,170.00	188,932,000
森永乳業	26,200	4,310.00	112,922,000
六甲バター	9,300	1,642.00	15,270,600
ヤクルト本社	96,900	6,010.00	582,369,000
明治ホールディングス	92,700	7,640.00	708,228,000
雪印メグミルク	31,500	2,484.00	78,246,000
プリマハム	18,400	2,085.00	38,364,000
日本ハム	54,200	3,925.00	212,735,000
林兼産業	4,300	561.00	2,412,300
丸大食品	13,900	2,129.00	29,593,100
S Foods	11,700	3,145.00	36,796,500
伊藤ハム米久ホールディングス	84,200	644.00	54,224,800
サッポロホールディングス	44,600	2,507.00	111,812,200
アサヒグループホールディングス	273,900	4,791.00	1,312,254,900
キリンホールディングス	554,700	2,074.00	1,150,447,800
宝ホールディングス	97,900	1,011.00	98,976,900
オエノンホールディングス	36,000	362.00	13,032,000
養命酒製造	4,000	1,956.00	7,824,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	91,800	2,321.00	213,067,800

サントリー食品インターナショナル	87,500	4,580.00	400,750,000
ダイドグループホールディングス	7,400	4,240.00	31,376,000
伊藤園	39,700	4,790.00	190,163,000
キーコーヒー	12,900	2,119.00	27,335,100
ユニカフェ	3,500	979.00	3,426,500
ジャパンフーズ	1,900	1,201.00	2,281,900
日清オイリオグループ	16,800	3,105.00	52,164,000
不二製油グループ本社	31,900	2,806.00	89,511,400
かどや製油	1,400	3,800.00	5,320,000
J - オイルミルズ	6,800	4,020.00	27,336,000
キッコーマン	86,300	4,985.00	430,205,500
味の素	288,800	1,907.50	550,886,000
キューピー	72,800	2,467.00	179,597,600
ハウス食品グループ本社	48,900	4,055.00	198,289,500
カゴメ	52,400	2,622.00	137,392,800
焼津水産化学工業	6,300	1,038.00	6,539,400
アリアケジャパン	11,900	7,940.00	94,486,000
ピエトロ	1,700	1,600.00	2,720,000
エバラ食品工業	3,200	2,039.00	6,524,800
やまみ	600	1,988.00	1,192,800
ニチレイ	67,900	2,381.00	161,669,900
東洋水産	67,300	4,370.00	294,101,000
イトアンド	4,500	1,684.00	7,578,000
大冷	1,500	1,992.00	2,988,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,600	785.00	2,826,000
日清食品ホールディングス	55,600	7,000.00	389,200,000
永谷園ホールディングス	7,000	2,018.00	14,126,000
一正蒲鉾	5,100	1,069.00	5,451,900
フジッコ	14,200	1,920.00	27,264,000
ロック・フィールド	14,100	1,372.00	19,345,200
日本たばこ産業	755,200	2,262.00	1,708,262,400
ケンコーマヨネーズ	7,300	2,189.00	15,979,700
わらべや日洋ホールディングス	8,600	1,598.00	13,742,800
なとり	7,300	1,598.00	11,665,400
イフジ産業	2,300	698.00	1,605,400
ピククルスコーポレーション	3,100	2,312.00	7,167,200
北の達人コーポレーション	51,400	764.00	39,269,600
ユーグレナ	55,800	914.00	51,001,200
ミヨシ油脂	5,000	1,093.00	5,465,000
理研ビタミン	6,200	3,330.00	20,646,000
片倉工業	18,900	1,268.00	23,965,200
ゲンゼ	8,700	4,495.00	39,106,500

東洋紡	54,400	1,366.00	74,310,400
ユニチカ	38,700	327.00	12,654,900
富士紡ホールディングス	6,800	2,574.00	17,503,200
倉敷紡績	12,400	1,909.00	23,671,600
シキボウ	6,700	925.00	6,197,500
日本毛織	42,500	888.00	37,740,000
トーア紡コーポレーション	5,300	454.00	2,406,200
帝国繊維	14,600	1,780.00	25,988,000
帝人	104,400	1,859.00	194,079,600
東レ	990,700	768.90	761,749,230
サカイオーベックス	3,400	1,607.00	5,463,800
住江織物	3,700	2,945.00	10,896,500
日本フェルト	8,200	453.00	3,714,600
イチカワ	2,100	1,434.00	3,011,400
日東製網	1,500	1,382.00	2,073,000
アツギ	10,600	856.00	9,073,600
ダイニック	5,200	694.00	3,608,800
セーレン	31,700	1,227.00	38,895,900
ソトー	5,200	974.00	5,064,800
東海染工	1,900	1,135.00	2,156,500
小松マテーレ	21,100	747.00	15,761,700
ワコールホールディングス	36,100	2,483.00	89,636,300
ホギメディカル	15,900	2,928.00	46,555,200
レナウン	36,900	112.00	4,132,800
クラウディアホールディングス	3,400	534.00	1,815,600
T S Iホールディングス	47,300	549.00	25,967,700
マツオカコーポレーション	4,100	2,197.00	9,007,700
ワールド	16,700	2,308.00	38,543,600
三陽商会	7,500	1,379.00	10,342,500
ナイガイ	4,900	399.00	1,955,100
オンワードホールディングス	76,900	523.00	40,218,700
ルックホールディングス	4,600	1,061.00	4,880,600
ゴールドウイン	11,600	14,940.00	173,304,000
デサント	31,200	1,503.00	46,893,600
キング	7,000	540.00	3,780,000
ヤマトインターナショナル	8,000	427.00	3,416,000
特種東海製紙	8,100	3,595.00	29,119,500
王子ホールディングス	574,600	485.00	278,681,000
日本製紙	61,100	1,739.00	106,252,900
三菱製紙	20,800	517.00	10,753,600
北越コーポレーション	84,700	514.00	43,535,800
中越パルプ工業	5,400	1,509.00	8,148,600

巴川製紙所	4,200	872.00	3,662,400
大王製紙	62,200	1,171.00	72,836,200
阿波製紙	3,300	405.00	1,336,500
レンゴー	131,600	777.00	102,253,200
トーモク	7,800	1,531.00	11,941,800
ザ・パック	9,700	3,360.00	32,592,000
クラレ	201,000	1,235.00	248,235,000
旭化成	908,000	952.20	864,597,600
共和レザー	7,900	740.00	5,846,000
昭和電工	90,900	2,734.00	248,520,600
住友化学	1,004,700	468.00	470,199,600
住友精化	6,200	3,015.00	18,693,000
日産化学	77,800	4,895.00	380,831,000
ラサ工業	4,500	1,216.00	5,472,000
クレハ	11,800	6,070.00	71,626,000
多木化学	3,700	4,365.00	16,150,500
テイカ	10,400	1,951.00	20,290,400
石原産業	24,500	899.00	22,025,500
片倉コープアグリ	3,700	1,068.00	3,951,600
日本曹達	20,100	2,429.00	48,822,900
東ソー	197,300	1,348.00	265,960,400
トクヤマ	36,800	2,225.00	81,880,000
セントラル硝子	27,800	2,175.00	60,465,000
東亜合成	80,100	1,065.00	85,306,500
大阪ソーダ	13,800	2,436.00	33,616,800
関東電化工業	30,300	674.00	20,422,200
デンカ	50,200	2,844.00	142,768,800
信越化学工業	224,900	10,540.00	2,370,446,000
日本カーバイド工業	4,300	1,231.00	5,293,300
堺化学工業	8,500	2,423.00	20,595,500
第一稀元素化学工業	13,800	805.00	11,109,000
エア・ウォーター	104,500	1,773.00	185,278,500
大陽日酸	105,100	2,300.00	241,730,000
日本化学工業	4,300	2,208.00	9,494,400
東邦アセチレン	1,900	1,223.00	2,323,700
日本パーカラライジング	69,700	1,140.00	79,458,000
高压ガス工業	20,200	809.00	16,341,800
チタン工業	1,600	2,783.00	4,452,800
四国化成工業	21,500	1,074.00	23,091,000
戸田工業	2,700	2,159.00	5,829,300
ステラ ケミファ	7,500	2,644.00	19,830,000
保土谷化学工業	4,400	2,793.00	12,289,200

日本触媒	21,500	6,080.00	130,720,000
大日精化工業	10,500	2,813.00	29,536,500
カネカ	33,000	3,245.00	107,085,000
三菱瓦斯化学	129,700	1,239.00	160,698,300
三井化学	115,800	2,317.00	268,308,600
J S R	128,100	1,719.00	220,203,900
東京応化工業	21,900	3,480.00	76,212,000
大阪有機化学工業	11,800	961.00	11,339,800
三菱ケミカルホールディングス	853,200	728.90	621,897,480
K Hネオケム	22,400	2,143.00	48,003,200
ダイセル	188,000	817.00	153,596,000
住友ベークライト	22,100	3,685.00	81,438,500
積水化学工業	274,400	1,556.00	426,966,400
日本ゼオン	115,100	1,178.00	135,587,800
アイカ工業	38,300	3,040.00	116,432,000
宇部興産	64,500	2,030.00	130,935,000
積水樹脂	21,100	1,917.00	40,448,700
タキロンシーアイ	27,600	628.00	17,332,800
旭有機材	8,800	1,261.00	11,096,800
日立化成	59,000	3,285.00	193,815,000
ニチバン	6,700	1,544.00	10,344,800
リケンテクノス	34,800	493.00	17,156,400
大倉工業	6,300	1,569.00	9,884,700
積水化成品工業	19,000	718.00	13,642,000
群栄化学工業	3,300	2,364.00	7,801,200
タイガースポリマー	6,700	530.00	3,551,000
ミライアル	3,700	1,260.00	4,662,000
ダイキアクシス	4,500	743.00	3,343,500
ダイキョーニシカワ	26,900	752.00	20,228,800
竹本容器	4,600	914.00	4,204,400
森六ホールディングス	6,900	2,219.00	15,311,100
日本化薬	79,000	1,180.00	93,220,000
カーリットホールディングス	13,600	570.00	7,752,000
日本精化	10,300	1,081.00	11,134,300
扶桑化学工業	12,900	2,257.00	29,115,300
トリケミカル研究所	2,800	5,140.00	14,392,000
A D E K A	62,900	1,306.00	82,147,400
日油	48,100	3,410.00	164,021,000
新日本理化	23,100	190.00	4,389,000
ハリマ化成グループ	10,600	1,143.00	12,115,800
花王	316,400	7,767.00	2,457,478,800
第一工業製薬	4,800	2,944.00	14,131,200

石原ケミカル	3,200	1,579.00	5,052,800
日華化学	4,300	804.00	3,457,200
ニイタカ	2,000	1,450.00	2,900,000
三洋化成工業	8,600	4,680.00	40,248,000
有機合成薬品工業	9,800	230.00	2,254,000
大日本塗料	14,400	966.00	13,910,400
日本ペイントホールディングス	105,300	4,835.00	509,125,500
関西ペイント	143,400	2,142.00	307,162,800
神東塗料	10,000	157.00	1,570,000
中国塗料	41,900	832.00	34,860,800
日本特殊塗料	9,600	1,087.00	10,435,200
藤倉化成	17,200	560.00	9,632,000
太陽ホールディングス	10,500	3,210.00	33,705,000
D I C	53,900	2,726.00	146,931,400
サカタインクス	27,900	918.00	25,612,200
東洋インキＳＣホールディングス	27,000	2,169.00	58,563,000
T & K T O K A	9,900	898.00	8,890,200
富士フィルムホールディングス	270,700	4,592.00	1,243,054,400
資生堂	258,900	8,099.00	2,096,831,100
ライオン	169,400	2,130.00	360,822,000
高砂香料工業	9,000	2,672.00	24,048,000
マンダム	29,300	2,558.00	74,949,400
ミルボン	17,400	5,200.00	90,480,000
ファンケル	58,000	2,539.00	147,262,000
コーセー	22,100	17,570.00	388,297,000
コタ	6,800	1,186.00	8,064,800
シーボン	1,600	2,348.00	3,756,800
ポーラ・オルビスホールディングス	55,600	2,585.00	143,726,000
ノエビアホールディングス	12,400	5,210.00	64,604,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	925.00	2,682,500
エステー	9,300	1,509.00	14,033,700
アグロ カネショウ	5,100	1,459.00	7,440,900
コニシ	23,100	1,431.00	33,056,100
長谷川香料	17,300	2,042.00	35,326,600
星光P M C	8,400	766.00	6,434,400
小林製薬	36,500	7,780.00	283,970,000
荒川化学工業	11,700	1,368.00	16,005,600
メック	8,900	1,205.00	10,724,500
日本高純度化学	3,600	2,410.00	8,676,000
タカラバイオ	34,100	2,281.00	77,782,100
J C U	16,900	1,891.00	31,957,900
新田ゼラチン	8,200	652.00	5,346,400

O A Tアグリオ	2,200	1,402.00	3,084,400
デクセリアルズ	33,600	725.00	24,360,000
アース製薬	9,800	5,100.00	49,980,000
北興化学工業	13,300	455.00	6,051,500
大成ラミック	4,300	2,812.00	12,091,600
クミアイ化学工業	53,900	906.00	48,833,400
日本農薬	23,200	443.00	10,277,600
アキレス	9,500	1,750.00	16,625,000
有沢製作所	20,500	904.00	18,532,000
日東電工	89,900	4,915.00	441,858,500
レック	13,900	993.00	13,802,700
三光合成	14,900	344.00	5,125,600
きもと	22,200	172.00	3,818,400
藤森工業	11,700	2,874.00	33,625,800
前澤化成工業	8,900	1,107.00	9,852,300
未来工業	7,000	1,947.00	13,629,000
ウェーブロックホールディングス	3,600	765.00	2,754,000
J S P	7,600	1,741.00	13,231,600
エフピコ	14,300	6,850.00	97,955,000
天馬	8,700	1,936.00	16,843,200
信越ポリマー	23,400	679.00	15,888,600
東リ	32,400	244.00	7,905,600
ニフコ	52,200	2,437.00	127,211,400
バルカー	10,600	2,067.00	21,910,200
ユニ・チャーム	251,200	3,156.00	792,787,200
ショーエイコーポレーション	1,000	792.00	792,000
協和キリン	131,100	1,868.00	244,894,800
武田薬品工業	1,137,700	3,584.00	4,077,516,800
アステラス製薬	1,146,300	1,454.00	1,666,720,200
大日本住友製薬	96,600	1,933.00	186,727,800
塩野義製薬	166,600	5,831.00	971,444,600
田辺三菱製薬	136,300	1,178.00	160,561,400
わかもと製薬	15,500	257.00	3,983,500
あすか製薬	16,100	1,044.00	16,808,400
日本新薬	34,100	8,950.00	305,195,000
バイオフェルミン製薬	2,200	2,149.00	4,727,800
中外製薬	135,900	7,470.00	1,015,173,000
科研製薬	22,300	4,960.00	110,608,000
エーザイ	156,000	5,497.00	857,532,000
ロート製薬	66,800	2,597.00	173,479,600
小野薬品工業	307,800	2,028.00	624,218,400
久光製薬	38,500	4,360.00	167,860,000

持田製薬	19,700	4,255.00	83,823,500
参天製薬	242,700	1,829.00	443,898,300
扶桑薬品工業	4,600	1,980.00	9,108,000
日本ケミファ	1,700	2,897.00	4,924,900
ツムラ	40,400	2,948.00	119,099,200
日医工	34,300	1,180.00	40,474,000
キッセイ薬品工業	23,100	2,520.00	58,212,000
生化学工業	25,300	1,189.00	30,081,700
栄研化学	22,900	1,639.00	37,533,100
日水製薬	5,500	1,216.00	6,688,000
鳥居薬品	8,200	2,618.00	21,467,600
JCRファーマ	9,200	7,820.00	71,944,000
東和薬品	18,800	2,433.00	45,740,400
富士製薬工業	8,900	1,337.00	11,899,300
沢井製薬	26,700	5,670.00	151,389,000
ゼリア新薬工業	25,800	1,878.00	48,452,400
第一三共	372,900	7,242.00	2,700,541,800
キョーリン製薬ホールディングス	28,800	1,783.00	51,350,400
大幸薬品	5,800	2,308.00	13,386,400
ダイト	7,600	3,140.00	23,864,000
大塚ホールディングス	248,300	4,360.00	1,082,588,000
大正製薬ホールディングス	27,600	7,660.00	211,416,000
ペプチドリーム	65,900	5,790.00	381,561,000
日本コークス工業	110,100	87.00	9,578,700
ニチレキ	16,700	1,030.00	17,201,000
ユシロ化学工業	6,700	1,337.00	8,957,900
ビーピー・カストロール	4,600	1,319.00	6,067,400
富士石油	31,600	237.00	7,489,200
MORESCO	4,700	1,356.00	6,373,200
出光興産	150,400	2,832.00	425,932,800
JXTGホールディングス	2,191,900	443.70	972,546,030
コスモエネルギーホールディングス	37,700	1,894.00	71,403,800
横浜ゴム	75,500	1,968.00	148,584,000
TOYO TIRE	74,800	1,227.00	91,779,600
ブリヂストン	400,500	3,938.00	1,577,169,000
住友ゴム工業	117,100	1,162.00	136,070,200
藤倉コンポジット	11,400	400.00	4,560,000
オカモト	8,700	4,200.00	36,540,000
フコク	5,700	693.00	3,950,100
ニッタ	14,700	2,800.00	41,160,000
住友理工	25,300	772.00	19,531,600
三ツ星ベルト	17,100	1,773.00	30,318,300

バンドー化学	24,800	823.00	20,410,400
日東紡績	19,400	2,830.00	54,902,000
A G C	128,800	3,060.00	394,128,000
日本板硝子	62,300	618.00	38,501,400
石塚硝子	2,200	1,861.00	4,094,200
日本山村硝子	5,400	1,300.00	7,020,000
日本電気硝子	52,400	2,234.00	117,061,600
オハラ	5,200	1,305.00	6,786,000
住友大阪セメント	26,300	4,540.00	119,402,000
太平洋セメント	82,300	2,666.00	219,411,800
日本ヒューム	13,100	675.00	8,842,500
日本コンクリート工業	28,200	249.00	7,021,800
三谷セキサン	6,100	2,974.00	18,141,400
アジアパイルホールディングス	18,500	488.00	9,028,000
東海カーボン	136,600	990.00	135,234,000
日本カーボン	6,700	3,550.00	23,785,000
東洋炭素	7,700	1,972.00	15,184,400
ノリタケカンパニーリミテド	7,800	3,935.00	30,693,000
T O T O	100,300	4,120.00	413,236,000
日本碍子	159,100	1,479.00	235,308,900
日本特殊陶業	109,900	1,799.00	197,710,100
M A R U W A	4,500	6,110.00	27,495,000
品川リフラクトリーズ	3,400	2,649.00	9,006,600
黒崎播磨	2,600	5,090.00	13,234,000
ヨータイ	11,500	536.00	6,164,000
イソライト工業	6,800	415.00	2,822,000
東京窯業	16,700	286.00	4,776,200
ニッカトー	6,000	634.00	3,804,000
フジインコーポレーテッド	11,600	2,389.00	27,712,400
クニミネ工業	5,900	879.00	5,186,100
エーアンドエーマテリアル	2,500	980.00	2,450,000
ニチアス	35,700	1,720.00	61,404,000
ニチハ	18,100	2,647.00	47,910,700
日本製鉄	598,800	1,459.00	873,649,200
神戸製鋼所	235,900	561.00	132,339,900
中山製鋼所	18,000	448.00	8,064,000
合同製鐵	6,300	2,019.00	12,719,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	348,100	1,235.00	429,903,500
東京製鐵	69,100	804.00	55,556,400
共英製鋼	14,600	1,828.00	26,688,800
大和工業	27,400	2,689.00	73,678,600
東京鐵鋼	5,300	1,203.00	6,375,900

大阪製鐵	8,600	1,403.00	12,065,800
淀川製鋼所	17,400	1,826.00	31,772,400
丸一鋼管	45,700	2,708.00	123,755,600
モリ工業	3,900	1,865.00	7,273,500
大同特殊鋼	21,100	3,815.00	80,496,500
日本高周波鋼業	4,900	433.00	2,121,700
日本冶金工業	106,800	200.00	21,360,000
山陽特殊製鋼	16,300	1,406.00	22,917,800
愛知製鋼	7,300	3,035.00	22,155,500
日立金属	138,900	1,152.00	160,012,800
日本金属	3,000	791.00	2,373,000
大平洋金属	8,700	2,047.00	17,808,900
新日本電工	83,300	161.00	13,411,300
栗本鐵工所	6,500	1,360.00	8,840,000
虹技	1,900	1,236.00	2,348,400
三菱製鋼	9,600	1,088.00	10,444,800
日亜鋼業	19,000	298.00	5,662,000
日本精線	1,900	2,488.00	4,727,200
エンビプロ・ホールディングス	4,900	650.00	3,185,000
シンニッタン	20,100	390.00	7,839,000
新家工業	3,000	1,379.00	4,137,000
大紀アルミニウム工業所	21,400	696.00	14,894,400
日本軽金属ホールディングス	351,900	184.00	64,749,600
三井金属鉱業	34,800	2,190.00	76,212,000
東邦亜鉛	7,200	1,851.00	13,327,200
三菱マテリアル	85,200	2,640.00	224,928,000
住友金属鉱山	176,500	3,076.00	542,914,000
D O W A ホールディングス	30,100	3,515.00	105,801,500
古河機械金属	21,400	1,288.00	27,563,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,000	1,557.00	23,355,000
東邦チタニウム	23,300	772.00	17,987,600
U A C J	19,600	1,524.00	29,870,400
C K サンエツ	2,500	2,935.00	7,337,500
古河電気工業	37,200	2,355.00	87,606,000
住友電気工業	481,900	1,225.00	590,327,500
フジクラ	156,000	332.00	51,792,000
昭和電線ホールディングス	15,000	754.00	11,310,000
東京特殊電線	1,700	1,726.00	2,934,200
タツタ電線	25,900	444.00	11,499,600
カナレ電気	2,200	1,780.00	3,916,000
平河ヒューテック	5,500	1,068.00	5,874,000
リョービ	15,900	1,576.00	25,058,400

アーレスティ	16,100	541.00	8,710,100
アサヒホールディングス	24,300	2,209.00	53,678,700
稲葉製作所	7,300	1,387.00	10,125,100
宮地エンジニアリンググループ	3,900	1,464.00	5,709,600
トーカロ	33,300	770.00	25,641,000
アルファC o	4,600	1,214.00	5,584,400
SUMCO	154,300	1,304.00	201,207,200
川田テクノロジーズ	2,900	6,660.00	19,314,000
RS Technologies	3,600	2,935.00	10,566,000
信和	6,800	910.00	6,188,000
東洋製罐グループホールディングス	82,100	1,592.00	130,703,200
ホッカンホールディングス	6,600	1,539.00	10,157,400
コロナ	7,200	1,000.00	7,200,000
横河ブリッジホールディングス	24,000	1,523.00	36,552,000
駒井ハルテック	2,400	1,438.00	3,451,200
高田機工	1,200	2,431.00	2,917,200
三和ホールディングス	133,100	1,187.00	157,989,700
文化シャッター	38,000	848.00	32,224,000
三協立山	17,900	1,168.00	20,907,200
アルインコ	10,200	941.00	9,598,200
東洋シャッター	3,100	677.00	2,098,700
LIXILグループ	190,200	1,805.00	343,311,000
日本フィルコン	9,900	486.00	4,811,400
ノーリツ	27,900	1,144.00	31,917,600
長府製作所	13,100	2,174.00	28,479,400
リンナイ	23,000	6,720.00	154,560,000
ダイニチ工業	7,000	618.00	4,326,000
日東精工	17,800	543.00	9,665,400
三洋工業	1,700	1,786.00	3,036,200
岡部	26,100	802.00	20,932,200
ジーテクト	14,200	1,456.00	20,675,200
東プレ	24,100	1,613.00	38,873,300
高周波熱錬	24,800	780.00	19,344,000
東京製綱	7,900	911.00	7,196,900
サンコール	7,300	452.00	3,299,600
モリテック スチール	10,100	333.00	3,363,300
パイオラックス	20,700	1,783.00	36,908,100
エイチワン	12,700	614.00	7,797,800
日本発條	128,400	721.00	92,576,400
中央発條	1,600	2,768.00	4,428,800
アドバネクス	1,700	1,607.00	2,731,900
立川ブラインド工業	5,700	1,406.00	8,014,200

三益半導体工業	11,500	1,782.00	20,493,000
日本ドライケミカル	3,600	1,155.00	4,158,000
日本製鋼所	39,200	1,697.00	66,522,400
三浦工業	55,800	2,841.00	158,527,800
タクマ	47,100	1,169.00	55,059,900
ツガミ	29,100	831.00	24,182,100
オークマ	16,400	5,120.00	83,968,000
東芝機械	14,600	2,015.00	29,419,000
アマダホールディングス	193,700	1,064.00	206,096,800
アイダエンジニアリング	34,900	805.00	28,094,500
滝澤鉄工所	4,100	1,263.00	5,178,300
F U J I	51,500	1,401.00	72,151,500
牧野フライス製作所	15,100	4,245.00	64,099,500
オーエスジー	59,600	2,028.00	120,868,800
ダイジェット工業	1,500	1,434.00	2,151,000
旭ダイヤモンド工業	34,000	608.00	20,672,000
D M G 森精機	81,600	1,426.00	116,361,600
ソディック	30,400	776.00	23,590,400
ディスコ	17,400	19,470.00	338,778,000
日東工器	7,100	2,096.00	14,881,600
日進工具	3,800	1,942.00	7,379,600
パンチ工業	9,100	458.00	4,167,800
富士ダイス	5,800	572.00	3,317,600
豊和工業	7,300	747.00	5,453,100
O K K	5,400	734.00	3,963,600
東洋機械金属	9,400	564.00	5,301,600
津田駒工業	2,800	1,274.00	3,567,200
エンシュウ	3,500	1,069.00	3,741,500
島精機製作所	17,800	2,596.00	46,208,800
オプトラン	14,400	2,873.00	41,371,200
N C ホールディングス	4,400	497.00	2,186,800
イワキポンプ	5,600	939.00	5,258,400
フリュー	10,400	981.00	10,202,400
ヤマシンフィルタ	22,500	621.00	13,972,500
日阪製作所	16,000	824.00	13,184,000
やまびこ	25,100	972.00	24,397,200
平田機工	6,100	7,100.00	43,310,000
ペガサスミシン製造	12,200	493.00	6,014,600
マルマエ	5,400	860.00	4,644,000
タツモ	6,100	797.00	4,861,700
ナブテスコ	76,000	3,020.00	229,520,000
三井海洋開発	13,700	2,464.00	33,756,800

レオン自動機	12,700	1,515.00	19,240,500
S M C	38,200	39,470.00	1,507,754,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,900	419.00	4,148,100
ホソカワミクロン	4,600	3,790.00	17,434,000
ユニオンツール	5,500	3,125.00	17,187,500
オイレス工業	18,100	1,554.00	28,127,400
日精エー・エス・ビー機械	4,400	3,015.00	13,266,000
サトーホールディングス	15,600	2,572.00	40,123,200
技研製作所	11,300	3,335.00	37,685,500
日本エアーテック	4,200	582.00	2,444,400
カワタ	3,600	936.00	3,369,600
日精樹脂工業	10,900	924.00	10,071,600
オカダアイヨン	4,500	1,143.00	5,143,500
ワイエイシイホールディングス	5,100	705.00	3,595,500
小松製作所	590,100	2,274.00	1,341,887,400
住友重機械工業	74,600	3,090.00	230,514,000
日立建機	52,300	2,274.00	118,930,200
日工	3,600	3,335.00	12,006,000
巴工業	5,600	2,323.00	13,008,800
井関農機	13,100	1,374.00	17,999,400
T O W A	11,300	712.00	8,045,600
丸山製作所	3,000	1,145.00	3,435,000
北川鉄工所	5,900	1,868.00	11,021,200
ローツェ	5,700	2,365.00	13,480,500
タカキタ	4,700	532.00	2,500,400
クボタ	698,200	1,543.00	1,077,322,600
荏原実業	3,700	1,883.00	6,967,100
三菱化工機	4,600	1,628.00	7,488,800
月島機械	25,900	1,325.00	34,317,500
帝国電機製作所	9,200	1,159.00	10,662,800
新東工業	31,100	902.00	28,052,200
澁谷工業	11,400	2,767.00	31,543,800
アイチ コーポレーション	22,700	622.00	14,119,400
小森コーポレーション	33,100	1,050.00	34,755,000
鶴見製作所	10,200	1,858.00	18,951,600
住友精密工業	2,200	2,968.00	6,529,600
日本ギア工業	4,100	474.00	1,943,400
酒井重工業	2,500	2,947.00	7,367,500
荏原製作所	57,800	2,421.00	139,933,800
石井鐵工所	2,100	1,996.00	4,191,600
西島製作所	13,400	1,017.00	13,627,800
北越工業	13,500	1,171.00	15,808,500

ダイキン工業	177,900	13,350.00	2,374,965,000
オルガノ	4,700	4,035.00	18,964,500
トーヨーカネツ	5,000	1,803.00	9,015,000
栗田工業	70,600	2,801.00	197,750,600
椿本チエイン	17,100	3,250.00	55,575,000
大同工業	6,300	787.00	4,958,100
木村化工機	11,200	355.00	3,976,000
アネスト岩田	20,400	891.00	18,176,400
ダイフク	71,700	5,020.00	359,934,000
サムコ	3,700	785.00	2,904,500
加藤製作所	6,700	1,661.00	11,128,700
油研工業	2,300	1,597.00	3,673,100
タダノ	63,000	910.00	57,330,000
フジテック	47,400	1,251.00	59,297,400
C K D	36,300	1,095.00	39,748,500
キトー	9,900	1,428.00	14,137,200
平和	36,400	2,080.00	75,712,000
理想科学工業	11,600	1,743.00	20,218,800
S A N K Y O	32,600	3,630.00	118,338,000
日本金銭機械	14,500	964.00	13,978,000
マースグループホールディングス	8,300	1,941.00	16,110,300
福島工業	8,100	2,990.00	24,219,000
オーイズミ	5,700	377.00	2,148,900
ダイコク電機	6,000	1,508.00	9,048,000
竹内製作所	21,900	1,576.00	34,514,400
アマノ	37,200	3,175.00	118,110,000
J U K I	18,100	826.00	14,950,600
蛇の目マシン工業	12,100	407.00	4,924,700
マックス	19,900	1,671.00	33,252,900
グローリー	36,100	2,870.00	103,607,000
新晃工業	12,200	1,680.00	20,496,000
大和冷機工業	18,900	1,073.00	20,279,700
セガサミーホールディングス	129,300	1,361.00	175,977,300
日本ピストンリング	4,800	1,229.00	5,899,200
リケン	6,100	3,730.00	22,753,000
T P R	17,600	1,592.00	28,019,200
ツバキ・ナカシマ	26,600	1,575.00	41,895,000
ホシザキ	38,100	7,510.00	286,131,000
大豊工業	10,700	751.00	8,035,700
日本精工	267,800	844.00	226,023,200
N T N	280,400	275.00	77,110,000
ジェイテクト	125,100	1,137.00	142,238,700

不二越	12,100	4,170.00	50,457,000
日本トムソン	38,900	436.00	16,960,400
T H K	75,900	2,451.00	186,030,900
ユーシン精機	10,200	947.00	9,659,400
前澤給装工業	5,100	1,979.00	10,092,900
イーグル工業	16,200	961.00	15,568,200
前澤工業	9,000	315.00	2,835,000
日本ピラー工業	13,300	1,053.00	14,004,900
キッツ	52,900	670.00	35,443,000
マキタ	158,600	3,155.00	500,383,000
日立造船	103,700	350.00	36,295,000
三菱重工業	218,400	4,012.00	876,220,800
I H I	100,200	2,073.00	207,714,600
スター精密	21,600	1,379.00	29,786,400
日清紡ホールディングス	87,000	792.00	68,904,000
イビデン	80,000	2,113.00	169,040,000
コニカミノルタ	285,200	744.00	212,188,800
ブラザー工業	169,900	1,850.00	314,315,000
ミネベアミツミ	242,100	1,600.00	387,360,000
日立製作所	586,700	3,694.00	2,167,269,800
三菱電機	1,303,200	1,270.50	1,655,715,600
富士電機	84,600	3,090.00	261,414,000
東洋電機製造	5,200	1,597.00	8,304,400
安川電機	151,100	3,475.00	525,072,500
シンフォニアテクノロジー	18,200	1,071.00	19,492,200
明電舎	25,900	1,622.00	42,009,800
オリジン	3,600	1,388.00	4,996,800
山洋電気	6,400	4,180.00	26,752,000
デンヨー	12,100	1,540.00	18,634,000
東芝テック	16,400	3,240.00	53,136,000
芝浦メカトロニクス	2,400	2,864.00	6,873,600
マブチモーター	36,200	3,690.00	133,578,000
日本電産	156,800	14,030.00	2,199,904,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,500	780.00	5,850,000
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,149.00	7,123,800
東光高岳	6,900	1,139.00	7,859,100
ダブル・スコープ	18,500	871.00	16,113,500
ダイヘン	14,300	2,988.00	42,728,400
ヤーマン	19,300	813.00	15,690,900
J V C ケンウッド	100,900	278.00	28,050,200
ミマキエンジニアリング	12,400	533.00	6,609,200
第一精工	5,500	1,566.00	8,613,000

日新電機	30,700	1,205.00	36,993,500
大崎電気工業	26,100	659.00	17,199,900
オムロン	138,500	5,150.00	713,275,000
日東工業	20,900	2,084.00	43,555,600
I D E C	17,600	1,814.00	31,926,400
正興電機製作所	3,600	729.00	2,624,400
不二電機工業	1,700	1,207.00	2,051,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,000	1,861.00	87,467,000
サクサホールディングス	3,400	1,848.00	6,283,200
メルコホールディングス	5,500	2,838.00	15,609,000
テクノメディカ	3,100	2,145.00	6,649,500
日本電気	168,600	4,670.00	787,362,000
富士通	125,600	8,528.00	1,071,116,800
沖電気工業	56,600	1,481.00	83,824,600
岩崎通信機	6,100	778.00	4,745,800
電気興業	6,900	2,902.00	20,023,800
サンケン電気	15,300	1,819.00	27,830,700
ナカヨ	2,600	1,696.00	4,409,600
アイホン	7,500	1,686.00	12,645,000
ルネサスエレクトロニクス	619,800	637.00	394,812,600
セイコーエプソン	161,800	1,406.00	227,490,800
ワコム	95,300	358.00	34,117,400
アルバック	26,000	4,300.00	111,800,000
アクセル	6,000	635.00	3,810,000
E I Z O	12,000	3,680.00	44,160,000
日本信号	33,300	1,149.00	38,261,700
京三製作所	28,400	353.00	10,025,200
能美防災	17,400	2,178.00	37,897,200
ホーチキ	8,600	1,331.00	11,446,600
星和電機	7,700	517.00	3,980,900
エレコム	12,400	4,250.00	52,700,000
パナソニック	1,488,900	817.70	1,217,473,530
シャープ	129,400	1,133.00	146,610,200
アンリツ	83,900	1,982.00	166,289,800
富士通ゼネラル	39,900	1,651.00	65,874,900
ソニー	874,600	5,965.00	5,216,989,000
T D K	68,200	8,460.00	576,972,000
帝国通信工業	6,100	1,094.00	6,673,400
タムラ製作所	50,500	562.00	28,381,000
アルプスアルパイン	135,900	1,766.00	239,999,400
池上通信機	4,100	1,078.00	4,419,800
鈴木	7,600	607.00	4,613,200

日本トリム	2,500	4,755.00	11,887,500
ローランド ディー・ジー	7,400	2,058.00	15,229,200
フォスター電機	14,800	1,762.00	26,077,600
SMK	3,700	2,710.00	10,027,000
ヨコオ	9,400	2,620.00	24,628,000
ホシデン	38,700	1,005.00	38,893,500
ヒロセ電機	18,600	11,870.00	220,782,000
日本航空電子工業	30,000	1,425.00	42,750,000
TOA	14,100	1,269.00	17,892,900
マクセルホールディングス	28,300	1,394.00	39,450,200
古野電気	17,200	896.00	15,411,200
ユニデンホールディングス	3,900	1,710.00	6,669,000
スミダコーポレーション	11,100	1,008.00	11,188,800
アイコム	7,300	2,394.00	17,476,200
リオン	6,100	2,470.00	15,067,000
本多通信工業	12,000	454.00	5,448,000
横河電機	130,500	2,012.00	262,566,000
新電元工業	4,600	3,240.00	14,904,000
アズビル	82,300	2,741.00	225,584,300
東亜ディーケーケー	6,900	789.00	5,444,100
日本光電工業	57,600	3,085.00	177,696,000
チノー	4,600	1,293.00	5,947,800
共和電業	14,000	414.00	5,796,000
日本電子材料	5,400	486.00	2,624,400
堀場製作所	25,800	5,500.00	141,900,000
アドバンテスト	88,800	4,055.00	360,084,000
小野測器	6,500	504.00	3,276,000
エスベック	11,700	1,906.00	22,300,200
キーエンス	64,000	61,120.00	3,911,680,000
日置電機	6,900	3,395.00	23,425,500
シスメックス	101,600	6,680.00	678,688,000
日本マイクロニクス	23,200	768.00	17,817,600
メガチップス	10,500	1,640.00	17,220,000
OBARA GROUP	6,900	3,285.00	22,666,500
澤藤電機	1,800	1,744.00	3,139,200
原田工業	5,700	835.00	4,759,500
コーセル	16,900	1,020.00	17,238,000
イリソ電子工業	12,000	5,180.00	62,160,000
オブテックスグループ	22,500	1,392.00	31,320,000
千代田インテグレ	6,200	1,922.00	11,916,400
アイ・オー・データ機器	5,200	909.00	4,726,800
レーザーテック	26,800	6,270.00	168,036,000

スタンレー電気	92,100	2,558.00	235,591,800
岩崎電気	5,400	1,218.00	6,577,200
ウシオ電機	76,000	1,331.00	101,156,000
岡谷電機産業	10,300	375.00	3,862,500
ハリオス テクノ ホールディング	12,700	544.00	6,908,800
エノモト	4,100	883.00	3,620,300
日本セラミック	13,400	2,685.00	35,979,000
遠藤照明	7,100	659.00	4,678,900
古河電池	9,900	605.00	5,989,500
双信電機	7,200	460.00	3,312,000
山一電機	9,800	1,149.00	11,260,200
図研	8,700	1,881.00	16,364,700
日本電子	25,900	2,397.00	62,082,300
カシオ計算機	115,400	1,440.00	166,176,000
ファナック	123,800	18,180.00	2,250,684,000
日本シイエムケイ	33,900	521.00	17,661,900
エンプラス	6,000	3,155.00	18,930,000
大真空	5,100	1,007.00	5,135,700
ローム	62,400	7,760.00	484,224,000
浜松ホトニクス	93,600	3,745.00	350,532,000
三井ハイテック	14,700	1,230.00	18,081,000
新光電気工業	44,200	838.00	37,039,600
京セラ	198,700	6,425.00	1,276,647,500
太陽誘電	58,100	2,119.00	123,113,900
村田製作所	410,200	4,553.00	1,867,640,600
双葉電子工業	20,900	1,369.00	28,612,100
北陸電気工業	5,300	969.00	5,135,700
ニチコン	41,400	881.00	36,473,400
日本ケミコン	9,200	1,399.00	12,870,800
K O A	19,900	1,270.00	25,273,000
市光工業	20,000	680.00	13,600,000
小糸製作所	78,100	4,945.00	386,204,500
ミツバ	24,600	550.00	13,530,000
S C R E E Nホールディングス	22,600	6,100.00	137,860,000
キャノン電子	13,900	1,790.00	24,881,000
キャノン	701,600	2,766.50	1,940,976,400
リコー	391,900	952.00	373,088,800
象印マホービン	38,500	1,254.00	48,279,000
M U T O Hホールディングス	2,000	1,652.00	3,304,000
東京エレクトロン	86,900	18,930.00	1,645,017,000
トヨタ紡織	45,800	1,399.00	64,074,200
芦森工業	2,900	1,346.00	3,903,400

ユニプレス	25,400	1,617.00	41,071,800
豊田自動織機	105,500	5,480.00	578,140,000
モリタホールディングス	23,000	1,610.00	37,030,000
三櫻工業	17,200	453.00	7,791,600
デンソー	287,000	4,272.00	1,226,064,000
東海理化電機製作所	34,500	1,618.00	55,821,000
三井E & Sホールディングス	47,100	838.00	39,469,800
川崎重工業	101,400	2,042.00	207,058,800
名村造船所	39,100	228.00	8,914,800
日本車輛製造	4,700	2,243.00	10,542,100
三菱ロジスネクスト	15,500	1,056.00	16,368,000
近畿車輛	2,000	1,359.00	2,718,000
日産自動車	1,536,900	669.30	1,028,647,170
いすゞ自動車	411,900	1,098.00	452,266,200
トヨタ自動車	1,452,200	6,909.00	10,033,249,800
日野自動車	162,700	851.00	138,457,700
三菱自動車工業	482,400	431.00	207,914,400
エフテック	9,500	718.00	6,821,000
レシップホールディングス	4,700	801.00	3,764,700
G M B	3,000	760.00	2,280,000
ファルテック	2,700	726.00	1,960,200
武蔵精密工業	31,900	1,147.00	36,589,300
日産車体	25,400	912.00	23,164,800
新明和工業	54,600	1,241.00	67,758,600
極東開発工業	25,900	1,199.00	31,054,100
日信工業	24,100	1,384.00	33,354,400
トピー工業	10,900	1,797.00	19,587,300
ティラド	4,900	1,783.00	8,736,700
タチエス	21,600	1,243.00	26,848,800
N O K	70,300	1,427.00	100,318,100
フタバ産業	36,700	698.00	25,616,600
K Y B	13,500	2,881.00	38,893,500
大同メタル工業	21,700	603.00	13,085,100
プレス工業	65,300	429.00	28,013,700
ミクニ	17,500	311.00	5,442,500
太平洋工業	27,500	1,406.00	38,665,000
ケーヒン	30,200	1,336.00	40,347,200
河西工業	16,400	723.00	11,857,200
アイシン精機	107,400	3,005.00	322,737,000
マツダ	409,000	891.60	364,664,400
今仙電機製作所	12,500	841.00	10,512,500
本田技研工業	1,099,300	2,495.00	2,742,753,500

スズキ	238,400	3,886.00	926,422,400
S U B A R U	404,600	2,725.50	1,102,737,300
安永	6,500	1,280.00	8,320,000
ヤマハ発動機	169,900	1,752.00	297,664,800
ショーワ	31,000	1,295.00	40,145,000
T B K	16,300	386.00	6,291,800
エクセディ	17,900	1,948.00	34,869,200
豊田合成	42,200	1,937.00	81,741,400
愛三工業	20,800	693.00	14,414,400
盟和産業	2,300	1,009.00	2,320,700
日本プラスト	10,700	673.00	7,201,100
ヨロズ	12,400	1,247.00	15,462,800
エフ・シー・シー	23,600	1,874.00	44,226,400
シマノ	48,800	15,300.00	746,640,000
テイ・エス テック	30,400	2,790.00	84,816,000
ジャムコ	6,700	1,501.00	10,056,700
テルモ	368,800	3,276.00	1,208,188,800
クリエートメディック	4,300	909.00	3,908,700
日機装	40,800	1,129.00	46,063,200
島津製作所	167,700	2,538.00	425,622,600
J M S	12,100	661.00	7,998,100
長野計器	10,300	678.00	6,983,400
ブイ・テクノロジー	6,100	5,690.00	34,709,000
東京計器	8,300	873.00	7,245,900
愛知時計電機	1,700	4,030.00	6,851,000
インターアクション	7,000	1,993.00	13,951,000
オーバル	12,900	226.00	2,915,400
東京精密	23,600	2,790.00	65,844,000
マニー	17,300	7,610.00	131,653,000
ニコン	227,100	1,331.00	302,270,100
トプコン	70,000	1,194.00	83,580,000
オリンパス	776,500	1,287.00	999,355,500
理研計器	11,500	1,816.00	20,884,000
タムロン	11,200	2,327.00	26,062,400
H O Y A	262,400	8,550.00	2,243,520,000
シード	5,600	952.00	5,331,200
ノーリツ鋼機	10,300	1,868.00	19,240,400
エー・アンド・デイ	11,900	705.00	8,389,500
朝日インテック	110,600	2,615.00	289,219,000
シチズン時計	142,600	494.00	70,444,400
リズム時計工業	4,400	1,058.00	4,655,200
大研医器	10,400	576.00	5,990,400

メニコン	17,900	4,035.00	72,226,500
シンシア	1,900	635.00	1,206,500
松風	6,400	1,570.00	10,048,000
セイコーホールディングス	20,100	2,241.00	45,044,100
ニプロ	90,200	1,171.00	105,624,200
中本パックス	3,600	1,438.00	5,176,800
スノーピーク	5,800	1,215.00	7,047,000
パラマウントベッドホールディングス	15,000	3,950.00	59,250,000
トランザクション	8,300	1,082.00	8,980,600
S H O - B I	3,800	348.00	1,322,400
ニホンフラッシュ	5,600	2,714.00	15,198,400
前田工織	14,400	1,496.00	21,542,400
永大産業	17,000	316.00	5,372,000
アートネイチャー	13,900	640.00	8,896,000
バンダイナムコホールディングス	134,700	6,260.00	843,222,000
アイフィスジャパン	3,300	665.00	2,194,500
共立印刷	21,700	147.00	3,189,900
S H O E I	6,300	4,470.00	28,161,000
フランスベッドホールディングス	18,400	1,020.00	18,768,000
パイロットコーポレーション	22,700	3,640.00	82,628,000
萩原工業	7,200	1,367.00	9,842,400
トッパン・フォームズ	27,900	885.00	24,691,500
フジシールインターナショナル	29,200	2,831.00	82,665,200
タカラトミー	54,500	1,141.00	62,184,500
廣済堂	12,100	699.00	8,457,900
エステールホールディングス	3,500	617.00	2,159,500
アーク	49,700	95.00	4,721,500
タカノ	5,100	729.00	3,717,900
プロネクサス	11,200	1,035.00	11,592,000
ホクシン	8,000	135.00	1,080,000
ウッドワン	4,400	1,035.00	4,554,000
大建工業	9,900	1,906.00	18,869,400
凸版印刷	193,700	1,635.00	316,699,500
大日本印刷	183,700	2,304.00	423,244,800
共同印刷	4,000	2,783.00	11,132,000
N I S S H A	26,700	982.00	26,219,400
光村印刷	1,100	1,689.00	1,857,900
宝印刷	6,300	1,631.00	10,275,300
アシックス	107,500	1,384.00	148,780,000
ツツミ	4,100	2,112.00	8,659,200
小松ウオール工業	4,000	1,878.00	7,512,000
ヤマハ	77,500	4,785.00	370,837,500

河合楽器製作所	4,000	2,980.00	11,920,000
クリナップ	12,100	544.00	6,582,400
ピジョン	78,800	3,850.00	303,380,000
兼松サステック	800	1,713.00	1,370,400
キングジム	10,800	848.00	9,158,400
リンテック	31,000	2,042.00	63,302,000
イトーキ	27,700	431.00	11,938,700
任天堂	74,600	40,010.00	2,984,746,000
三菱鉛筆	21,500	1,575.00	33,862,500
タカラスタANDARD	26,900	1,685.00	45,326,500
コクヨ	62,500	1,429.00	89,312,500
ナカバヤシ	12,800	520.00	6,656,000
グローブライド	6,300	3,060.00	19,278,000
オカムラ	45,500	1,063.00	48,366,500
美津濃	12,900	2,795.00	36,055,500
東京電力ホールディングス	1,040,300	497.00	517,029,100
中部電力	398,700	1,561.50	622,570,050
関西電力	531,700	1,277.00	678,980,900
中国電力	180,100	1,347.00	242,594,700
北陸電力	127,600	649.00	82,812,400
東北電力	305,200	1,037.00	316,492,400
四国電力	117,300	983.00	115,305,900
九州電力	268,600	1,041.00	279,612,600
北海道電力	121,900	535.00	65,216,500
沖縄電力	24,100	1,591.00	38,343,100
電源開発	103,700	2,338.00	242,450,600
エフオン	6,100	727.00	4,434,700
イーレックス	22,600	1,251.00	28,272,600
レノバ	21,400	842.00	18,018,800
東京瓦斯	255,700	2,721.50	695,887,550
大阪瓦斯	252,900	1,941.00	490,878,900
東邦瓦斯	64,500	4,085.00	263,482,500
北海道瓦斯	7,000	1,475.00	10,325,000
広島ガス	26,800	331.00	8,870,800
西部瓦斯	14,700	2,124.00	31,222,800
静岡ガス	38,900	837.00	32,559,300
メタウォーター	6,300	3,850.00	24,255,000
SBSホールディングス	12,500	1,476.00	18,450,000
東武鉄道	137,400	3,220.00	442,428,000
相鉄ホールディングス	44,700	2,792.00	124,802,400
東京急行電鉄	353,900	1,898.00	671,702,200
京浜急行電鉄	178,500	1,996.00	356,286,000

小田急電鉄	208,700	2,459.00	513,193,300
京王電鉄	72,800	6,910.00	503,048,000
京成電鉄	97,700	4,165.00	406,920,500
富士急行	17,800	4,460.00	79,388,000
新京成電鉄	3,300	2,049.00	6,761,700
東日本旅客鉄道	231,700	10,130.00	2,347,121,000
西日本旅客鉄道	116,800	8,828.00	1,031,110,400
東海旅客鉄道	116,700	20,975.00	2,447,782,500
西武ホールディングス	161,400	1,788.00	288,583,200
鴻池運輸	20,700	1,656.00	34,279,200
西日本鉄道	36,100	2,273.00	82,055,300
ハマキョウレックス	10,000	3,620.00	36,200,000
サカイ引越センター	6,800	6,190.00	42,092,000
近鉄グループホールディングス	123,400	5,260.00	649,084,000
阪急阪神ホールディングス	164,600	3,985.00	655,931,000
南海電気鉄道	55,100	2,703.00	148,935,300
京阪ホールディングス	55,000	4,445.00	244,475,000
神戸電鉄	3,200	3,965.00	12,688,000
名古屋鉄道	101,400	3,185.00	322,959,000
山陽電気鉄道	9,500	2,114.00	20,083,000
日本通運	47,600	5,410.00	257,516,000
ヤマトホールディングス	216,300	1,831.50	396,153,450
山九	34,300	5,580.00	191,394,000
丸運	7,000	263.00	1,841,000
丸全昭和運輸	10,000	3,255.00	32,550,000
センコーグループホールディングス	68,000	825.00	56,100,000
トナミホールディングス	3,000	4,625.00	13,875,000
ニッコンホールディングス	46,900	2,428.00	113,873,200
日本石油輸送	1,500	2,915.00	4,372,500
福山通運	15,800	3,765.00	59,487,000
セイノーホールディングス	92,400	1,361.00	125,756,400
エスライン	3,700	829.00	3,067,300
神奈川中央交通	3,100	3,780.00	11,718,000
日立物流	27,100	3,360.00	91,056,000
丸和運輸機関	6,500	4,925.00	32,012,500
C & F ロジホールディングス	12,500	1,216.00	15,200,000
九州旅客鉄道	103,600	3,220.00	333,592,000
S Gホールディングス	116,600	2,738.00	319,250,800
日本郵船	103,700	1,607.00	166,645,900
商船三井	73,500	2,471.00	181,618,500
川崎汽船	38,000	1,121.00	42,598,000
N S ユナイテッド海運	7,200	2,078.00	14,961,600

飯野海運	60,800	330.00	20,064,000	
共栄タンカー	1,700	1,323.00	2,249,100	
乾汽船	11,100	932.00	10,345,200	
日本航空	225,900	3,300.00	745,470,000	
A N Aホールディングス	225,600	3,605.00	813,288,000	
パスコ	2,400	869.00	2,085,600	
トランコム	3,400	6,300.00	21,420,000	
日新	10,700	1,518.00	16,242,600	
三菱倉庫	42,700	2,653.00	113,283,100	
三井倉庫ホールディングス	15,100	1,603.00	24,205,300	
住友倉庫	45,400	1,398.00	63,469,200	
澁澤倉庫	6,800	1,844.00	12,539,200	
東陽倉庫	22,300	296.00	6,600,800	
日本トランスシティ	27,200	468.00	12,729,600	
ケイヒン	2,400	1,198.00	2,875,200	
中央倉庫	7,500	1,030.00	7,725,000	
川西倉庫	2,500	1,038.00	2,595,000	
安田倉庫	10,100	910.00	9,191,000	
ファイズ	2,200	679.00	1,493,800	
東洋埠頭	3,800	1,329.00	5,050,200	
宇徳	10,500	523.00	5,491,500	
上組	76,100	2,482.00	188,880,200	
サンリツ	2,900	650.00	1,885,000	
キムラユニティー	3,300	1,001.00	3,303,300	
キューソー流通システム	3,100	1,830.00	5,673,000	
近鉄エクスプレス	23,300	1,409.00	32,829,700	
東海運	7,000	304.00	2,128,000	
エーアイティー	8,000	940.00	7,520,000	
内外トランスライン	4,300	1,200.00	5,160,000	
日本コンセプト	4,400	1,310.00	5,764,000	
N E C ネットエスアイ	14,200	2,763.00	39,234,600	
クロスキャット	3,600	986.00	3,549,600	
システナ	45,800	1,751.00	80,195,800	
デジタルアーツ	6,900	7,880.00	54,372,000	
日鉄ソリューションズ	19,200	3,575.00	68,640,000	
キューブシステム	7,200	774.00	5,572,800	
エイジア	2,700	1,316.00	3,553,200	
コア	5,600	1,333.00	7,464,800	
ソリトンシステムズ	7,200	972.00	6,998,400	
ソフトクリエイイトホールディングス	5,700	1,668.00	9,507,600	
T I S	42,700	6,170.00	263,459,000	
ネオス	5,100	750.00	3,825,000	

電算システム	5,000	2,961.00	14,805,000
グリー	88,800	469.00	41,647,200
コーエーテクモホールディングス	26,300	2,132.00	56,071,600
三菱総合研究所	5,600	3,725.00	20,860,000
電算	1,600	2,028.00	3,244,800
A G S	7,600	654.00	4,970,400
ファインデックス	11,000	1,147.00	12,617,000
ブレインパッド	2,500	6,550.00	16,375,000
K L a b	24,400	1,050.00	25,620,000
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,200	1,168.00	20,089,600
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,799.00	3,957,800
ネクソン	362,900	1,350.00	489,915,000
アイスタイル	33,200	632.00	20,982,400
エムアップ	4,500	2,066.00	9,297,000
エイチーム	9,000	1,114.00	10,026,000
エニグモ	9,300	1,166.00	10,843,800
テクノスジャパン	11,200	524.00	5,868,800
コロプラ	42,300	677.00	28,637,100
ブロードリーフ	63,900	564.00	36,039,600
クロス・マーケティンググループ	6,400	324.00	2,073,600
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,024.00	6,246,400
システム情報	6,700	1,217.00	8,153,900
メディアドゥホールディングス	4,500	3,320.00	14,940,000
じげん	18,500	641.00	11,858,500
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	752.00	1,579,200
サイバーリンクス	2,200	1,093.00	2,404,600
フィックスターズ	13,800	1,566.00	21,610,800
C A R T A H O L D I N G S	6,400	978.00	6,259,200
オブティム	5,700	2,730.00	15,561,000
セレス	4,300	1,327.00	5,706,100
ティーガイア	9,200	2,118.00	19,485,600
セック	2,200	3,280.00	7,216,000
日本アジアグループ	13,500	335.00	4,522,500
豆蔵ホールディングス	8,900	1,698.00	15,112,200
テクマトリックス	9,100	2,421.00	22,031,100
プロシップ	3,900	1,247.00	4,863,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,900	2,421.00	74,808,900
G M O ペイメントゲートウェイ	21,100	8,400.00	177,240,000
ザッパラス	7,400	325.00	2,405,000
システムリサーチ	1,800	3,900.00	7,020,000
インターネットイニシアティブ	20,900	2,385.00	49,846,500
さくらインターネット	15,600	624.00	9,734,400

ヴィンクス	4,400	1,216.00	5,350,400
GMOクラウド	2,800	2,575.00	7,210,000
SRAホールディングス	6,900	2,516.00	17,360,400
Minorisoソリューションズ	2,600	1,894.00	4,924,400
システムインテグレータ	4,000	740.00	2,960,000
朝日ネット	10,700	711.00	7,607,700
eBASE	7,900	962.00	7,599,800
アバント	4,700	2,040.00	9,588,000
アドソル日進	4,600	2,101.00	9,664,600
フリービット	7,800	1,047.00	8,166,600
コムチュア	7,200	4,225.00	30,420,000
サイバーコム	2,400	1,770.00	4,248,000
アステリア	8,900	644.00	5,731,600
マークラインズ	6,500	1,801.00	11,706,500
メディカル・データ・ビジョン	11,200	1,084.00	12,140,800
ショーケース	3,500	700.00	2,450,000
モバイルファクトリー	3,600	1,619.00	5,828,400
テラスカイ	2,200	1,900.00	4,180,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,800	1,675.00	9,715,000
PCIホールディングス	2,700	2,043.00	5,516,100
パイプドHD	2,200	1,195.00	2,629,000
アイビーシー	2,600	1,071.00	2,784,600
ネオジャパン	2,700	1,005.00	2,713,500
PR TIMES	1,200	2,772.00	3,326,400
ランドコンピュータ	2,200	1,023.00	2,250,600
ダブルスタンダード	1,200	5,120.00	6,144,000
オープンドア	6,500	2,211.00	14,371,500
マイネット	4,600	481.00	2,212,600
アカツキ	4,500	7,140.00	32,130,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,443.00	1,731,600
Ubicomホールディングス	2,500	1,790.00	4,475,000
LINE	29,300	3,615.00	105,919,500
カナミックネットワーク	2,700	2,220.00	5,994,000
ノムラシステムコーポレーション	3,400	392.00	1,332,800
チェンジ	2,700	1,843.00	4,976,100
シンクロ・フード	6,000	492.00	2,952,000
オークネット	8,100	1,195.00	9,679,500
セグエグループ	1,200	1,364.00	1,636,800
エイトレッド	1,500	2,059.00	3,088,500
AOI TYO Holdings	13,900	667.00	9,271,300
マクロミル	22,900	914.00	20,930,600
ビーグリー	3,400	896.00	3,046,400

オロ	3,500	2,402.00	8,407,000
テモナ	2,200	539.00	1,185,800
ニーズウェル	1,900	735.00	1,396,500
サインポスト	2,100	2,301.00	4,832,100
ソルクシーズ	5,700	934.00	5,323,800
フェイス	5,400	694.00	3,747,600
プロトコーポレーション	11,700	1,200.00	14,040,000
ハイマックス	1,700	1,749.00	2,973,300
野村総合研究所	244,100	2,017.00	492,349,700
サイバネットシステム	10,400	593.00	6,167,200
C Eホールディングス	3,900	1,160.00	4,524,000
日本システム技術	2,200	1,336.00	2,939,200
インタージホールディングス	16,300	839.00	13,675,700
東邦システムサイエンス	4,100	920.00	3,772,000
ソースネクスト	50,200	443.00	22,238,600
インフォコム	14,100	2,849.00	40,170,900
F I G	14,700	301.00	4,424,700
アルテリア・ネットワークス	14,400	1,417.00	20,404,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,689.00	5,235,900
フォーカスシステムズ	8,900	829.00	7,378,100
クレスコ	4,000	3,495.00	13,980,000
フジ・メディア・ホールディングス	132,900	1,371.00	182,205,900
オービック	44,300	12,060.00	534,258,000
ジャストシステム	18,300	4,050.00	74,115,000
T D Cソフト	11,500	759.00	8,728,500
ヤフー	834,700	273.00	227,873,100
トレンドマイクロ	56,900	5,090.00	289,621,000
I Dホールディングス	5,100	1,219.00	6,216,900
日本オラクル	25,900	9,150.00	236,985,000
アルファシステムズ	4,100	2,788.00	11,430,800
フューチャー	17,000	1,841.00	31,297,000
C A C Holdings	9,100	1,151.00	10,474,100
ソフトバンク・テクノロジー	5,600	2,108.00	11,804,800
トーセ	3,800	832.00	3,161,600
オービックビジネスコンサルタント	13,100	4,655.00	60,980,500
伊藤忠テクノソリューションズ	58,400	2,910.00	169,944,000
アイティフォー	15,800	931.00	14,709,800
東計電算	2,000	2,977.00	5,954,000
エクスネット	2,600	933.00	2,425,800
大塚商会	69,300	3,895.00	269,923,500
サイボウズ	15,200	1,150.00	17,480,000
ソフトブレーン	10,200	580.00	5,916,000

電通国際情報サービス	8,000	3,415.00	27,320,000
デジタルガレージ	25,000	3,380.00	84,500,000
E Mシステムズ	10,600	1,681.00	17,818,600
ウェザーニューズ	4,400	3,040.00	13,376,000
C I J	9,900	836.00	8,276,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	2,671.00	3,739,400
日本エンタープライズ	14,700	175.00	2,572,500
WOWOW	6,200	2,509.00	15,555,800
スカラ	9,200	1,160.00	10,672,000
インテリジェント ウェイブ	5,100	909.00	4,635,900
I M A G I C A G R O U P	11,400	463.00	5,278,200
ネットワンシステムズ	45,300	3,075.00	139,297,500
システムソフト	32,700	110.00	3,597,000
アルゴグラフィックス	11,000	2,773.00	30,503,000
マーベラス	19,900	754.00	15,004,600
エイベックス	22,100	1,290.00	28,509,000
日本ユニシス	40,000	3,410.00	136,400,000
兼松エレクトロニクス	7,000	3,030.00	21,210,000
東京放送ホールディングス	85,000	1,702.00	144,670,000
日本テレビホールディングス	117,600	1,397.00	164,287,200
朝日放送グループホールディングス	13,100	705.00	9,235,500
テレビ朝日ホールディングス	35,300	1,725.00	60,892,500
スカパーJ S A Tホールディングス	84,800	422.00	35,785,600
テレビ東京ホールディングス	10,600	2,197.00	23,288,200
日本BS放送	4,600	1,080.00	4,968,000
ビジョン	4,000	4,835.00	19,340,000
スマートバリュー	4,100	677.00	2,775,700
ワイヤレスゲート	6,500	665.00	4,322,500
コネクシオ	9,200	1,359.00	12,502,800
クロップス	2,800	615.00	1,722,000
日本電信電話	874,700	5,013.00	4,384,871,100
K D D I	1,048,300	2,754.50	2,887,542,350
ソフトバンク	1,355,900	1,506.00	2,041,985,400
光通信	15,100	25,210.00	380,671,000
N T T ドコモ	809,700	2,644.50	2,141,251,650
エムティーアイ	12,700	735.00	9,334,500
G M Oインターネット	51,400	1,799.00	92,468,600
ファイバーゲート	1,300	3,325.00	4,322,500
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	560.00	1,792,000
K A D O K A W A	37,500	1,540.00	57,750,000
学研ホールディングス	4,300	5,270.00	22,661,000
ゼンリン	25,600	1,875.00	48,000,000

昭文社	6,600	345.00	2,277,000
インプレスホールディングス	10,600	149.00	1,579,400
アイネット	7,400	1,387.00	10,263,800
松竹	8,500	12,290.00	104,465,000
東宝	84,200	4,505.00	379,321,000
東映	5,400	14,850.00	80,190,000
エヌ・ティ・ティ・データ	340,700	1,396.00	475,617,200
ピー・シー・エー	1,700	4,285.00	7,284,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,509.00	5,770,700
D T S	28,700	2,266.00	65,034,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	59,600	4,270.00	254,492,000
シーイーシー	13,800	2,389.00	32,968,200
カブコン	54,900	2,897.00	159,045,300
アイ・エス・ピー	2,700	1,426.00	3,850,200
ジャステック	8,400	1,080.00	9,072,000
S C S K	33,800	5,140.00	173,732,000
日本システムウエア	4,300	2,475.00	10,642,500
アイネス	16,400	1,127.00	18,482,800
T K C	10,900	4,550.00	49,595,000
富士ソフト	16,400	4,845.00	79,458,000
N S D	21,100	2,927.00	61,759,700
コナミホールディングス	52,300	4,585.00	239,795,500
福井コンピュータホールディングス	4,300	2,178.00	9,365,400
J B C Cホールディングス	10,200	1,507.00	15,371,400
ミロク情報サービス	12,800	2,808.00	35,942,400
ソフトバンクグループ	1,014,700	4,937.00	5,009,573,900
ハウスイ	1,000	819.00	819,000
高千穂交易	5,000	1,095.00	5,475,000
伊藤忠食品	3,200	4,375.00	14,000,000
エレマテック	12,000	1,026.00	12,312,000
J A L U X	3,600	2,332.00	8,395,200
あらた	9,500	3,500.00	33,250,000
トーメンデバイス	1,900	2,279.00	4,330,100
東京エレクトロン デバイス	4,700	1,930.00	9,071,000
フィールズ	11,200	497.00	5,566,400
双日	708,900	326.00	231,101,400
アルフレッサ ホールディングス	142,600	2,479.00	353,505,400
横浜冷凍	36,000	1,022.00	36,792,000
神栄	1,800	847.00	1,524,600
ラサ商事	6,800	810.00	5,508,000
ラクーンホールディングス	6,200	622.00	3,856,400
アルコニックス	13,600	1,163.00	15,816,800

神戸物産	22,100	5,560.00	122,876,000
あい ホールディングス	18,300	1,660.00	30,378,000
ディーブイエックス	5,100	784.00	3,998,400
ダイワボウホールディングス	11,700	4,460.00	52,182,000
マクニカ・富士エレホールディングス	35,600	1,403.00	49,946,800
ラクト・ジャパン	5,400	3,940.00	21,276,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,200	1,057.00	25,579,400
八洲電機	9,900	894.00	8,850,600
メディアスホールディングス	7,300	695.00	5,073,500
レスターホールディングス	14,100	1,680.00	23,688,000
ジューテックホールディングス	2,900	944.00	2,737,600
大光	5,500	662.00	3,641,000
O C H Iホールディングス	3,700	1,131.00	4,184,700
T O K A Iホールディングス	67,800	997.00	67,596,600
黒谷	3,000	465.00	1,395,000
C o m i n i x	2,300	775.00	1,782,500
三洋貿易	6,500	2,216.00	14,404,000
ビューティガレージ	2,100	1,715.00	3,601,500
ウイン・パートナーズ	8,400	1,023.00	8,593,200
ミタチ産業	3,900	653.00	2,546,700
シップヘルスケアホールディングス	26,700	5,000.00	133,500,000
明治電機工業	4,000	1,329.00	5,316,000
デリカフーズホールディングス	2,300	1,450.00	3,335,000
スターティアホールディングス	2,500	508.00	1,270,000
コメダホールディングス	29,700	2,026.00	60,172,200
富士興産	5,000	742.00	3,710,000
協栄産業	1,600	1,318.00	2,108,800
小野建	11,500	1,307.00	15,030,500
南陽	2,600	1,499.00	3,897,400
佐島電機	9,500	809.00	7,685,500
エコートレーディング	3,000	520.00	1,560,000
伯東	8,800	1,121.00	9,864,800
コンドーテック	10,000	900.00	9,000,000
中山福	7,400	496.00	3,670,400
ナガイレーベン	18,600	2,297.00	42,724,200
三菱食品	14,100	2,584.00	36,434,400
松田産業	9,400	1,446.00	13,592,400
第一興商	19,100	4,730.00	90,343,000
メディバルホールディングス	138,500	2,271.00	314,533,500
S P K	2,800	2,555.00	7,154,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,818.00	13,526,400
アズワン	9,200	9,370.00	86,204,000

スズデン	4,500	1,341.00	6,034,500
尾家産業	4,100	1,170.00	4,797,000
シモジマ	7,900	1,031.00	8,144,900
ドウシシャ	12,100	1,723.00	20,848,300
小津産業	2,800	1,696.00	4,748,800
高速	7,700	1,240.00	9,548,000
たけびし	4,500	1,271.00	5,719,500
リックス	2,900	1,497.00	4,341,300
丸文	11,400	547.00	6,235,800
ハピネット	10,700	1,258.00	13,460,600
橋本総業ホールディングス	2,600	1,550.00	4,030,000
日本ライフライン	38,000	1,764.00	67,032,000
タカショー	6,300	457.00	2,879,100
エクセル	4,800	1,222.00	5,865,600
マルカ	4,500	1,868.00	8,406,000
I D O M	43,300	375.00	16,237,500
日本エム・ディ・エム	7,500	1,742.00	13,065,000
進和	7,600	2,222.00	16,887,200
エスケイジャパン	3,100	415.00	1,286,500
ダイトロン	5,700	1,213.00	6,914,100
シークス	16,300	1,292.00	21,059,600
田中商事	4,300	623.00	2,678,900
オーハシテクニカ	7,200	1,430.00	10,296,000
白銅	4,100	1,289.00	5,284,900
伊藤忠商事	897,700	2,093.50	1,879,334,950
丸紅	1,265,700	679.80	860,422,860
高島	2,000	1,610.00	3,220,000
長瀬産業	72,200	1,437.00	103,751,400
蝶理	8,200	1,597.00	13,095,400
豊田通商	143,300	3,230.00	462,859,000
三共生興	21,900	474.00	10,380,600
兼松	51,300	1,132.00	58,071,600
ツカモトコーポレーション	2,300	1,036.00	2,382,800
三井物産	1,057,500	1,655.50	1,750,691,250
日本紙パルプ商事	7,300	3,525.00	25,732,500
日立ハイテクノロジーズ	39,000	5,680.00	221,520,000
カメイ	16,800	1,000.00	16,800,000
東都水産	1,800	2,620.00	4,716,000
O U Gホールディングス	2,000	2,632.00	5,264,000
スターゼン	4,700	3,930.00	18,471,000
山善	50,200	926.00	46,485,200
椿本興業	2,900	3,305.00	9,584,500

住友商事	759,100	1,551.00	1,177,364,100
内田洋行	5,500	3,285.00	18,067,500
三菱商事	900,700	2,600.50	2,342,270,350
第一実業	5,800	2,777.00	16,106,600
キャノンマーケティングジャパン	36,700	2,113.00	77,547,100
西華産業	7,300	1,269.00	9,263,700
佐藤商事	11,500	781.00	8,981,500
菱洋エレクトロ	13,000	1,776.00	23,088,000
東京産業	12,800	491.00	6,284,800
ユアサ商事	13,100	2,896.00	37,937,600
神鋼商事	2,900	2,207.00	6,400,300
小林産業	7,700	260.00	2,002,000
阪和興業	22,300	2,823.00	62,952,900
正栄食品工業	8,700	3,025.00	26,317,500
カナデン	11,600	1,270.00	14,732,000
菱電商事	10,200	1,632.00	16,646,400
フルサト工業	7,100	1,393.00	9,890,300
岩谷産業	28,500	3,540.00	100,890,000
すてきナイスグループ	5,500	637.00	3,503,500
昭光通商	4,400	615.00	2,706,000
ニチモウ	2,000	1,704.00	3,408,000
極東貿易	4,000	1,758.00	7,032,000
イワキ	16,900	494.00	8,348,600
三愛石油	34,500	944.00	32,568,000
稲畑産業	30,800	1,245.00	38,346,000
G S Iクレオス	3,400	1,033.00	3,512,200
明和産業	11,900	516.00	6,140,400
クワザワ	4,600	408.00	1,876,800
ワキタ	27,400	1,013.00	27,756,200
東邦ホールディングス	38,000	2,549.00	96,862,000
サンゲツ	38,200	1,957.00	74,757,400
ミツウロコグループホールディングス	17,000	903.00	15,351,000
シナネンホールディングス	5,300	1,784.00	9,455,200
伊藤忠エネクス	28,400	800.00	22,720,000
サンリオ	39,600	2,061.00	81,615,600
サンワテクノス	7,800	776.00	6,052,800
リョーサン	14,200	2,659.00	37,757,800
新光商事	12,100	1,921.00	23,244,100
トーホー	5,800	1,837.00	10,654,600
三信電気	8,900	1,626.00	14,471,400
東陽テクニカ	14,800	1,079.00	15,969,200
モスフードサービス	16,800	2,339.00	39,295,200

加賀電子	12,800	1,643.00	21,030,400
ソーダニッカ	13,300	517.00	6,876,100
立花エレテック	9,500	1,528.00	14,516,000
フォーバル	5,600	901.00	5,045,600
PALTAC	23,100	5,210.00	120,351,000
三谷産業	15,100	274.00	4,137,400
西本Wismettacホールディングス	2,800	3,565.00	9,982,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,223.00	1,345,300
国際紙パルプ商事	30,000	313.00	9,390,000
ヤマタネ	6,400	1,319.00	8,441,600
丸紅建材リース	1,300	1,596.00	2,074,800
日鉄物産	9,200	4,050.00	37,260,000
泉州電業	4,100	2,625.00	10,762,500
トラスコ中山	26,700	2,402.00	64,133,400
オートボックスセブン	51,000	1,737.00	88,587,000
モリト	9,400	799.00	7,510,600
加藤産業	20,100	3,120.00	62,712,000
北恵	2,500	866.00	2,165,000
イノテック	7,600	865.00	6,574,000
イエローハット	24,300	1,546.00	37,567,800
J Kホールディングス	11,600	489.00	5,672,400
日伝	10,700	1,912.00	20,458,400
北沢産業	9,700	236.00	2,289,200
杉本商事	6,900	1,929.00	13,310,100
因幡電機産業	18,300	4,670.00	85,461,000
東テク	4,300	2,130.00	9,159,000
ミスミグループ本社	160,800	2,323.00	373,538,400
アルテック	10,300	203.00	2,090,900
タキヒヨー	3,900	1,795.00	7,000,500
蔵王産業	2,100	1,351.00	2,837,100
スズケン	58,500	5,830.00	341,055,000
ジェコス	8,900	854.00	7,600,600
グローセル	11,800	404.00	4,767,200
ローソン	32,500	5,440.00	176,800,000
サンエー	9,700	4,480.00	43,456,000
カワチ薬品	10,000	1,995.00	19,950,000
エービーシー・マート	20,100	6,590.00	132,459,000
ハードオフコーポレーション	5,300	712.00	3,773,600
アスクル	13,500	2,764.00	37,314,000
ゲオホールディングス	19,700	1,305.00	25,708,500
アダストリア	17,800	2,038.00	36,276,400
ジーフット	8,000	651.00	5,208,000

くら寿司	7,300	4,135.00	30,185,500
キャンドウ	6,200	1,635.00	10,137,000
パルグループホールディングス	6,600	3,220.00	21,252,000
エディオン	54,500	1,005.00	54,772,500
サーラコーポレーション	26,300	585.00	15,385,500
ワッツ	5,900	668.00	3,941,200
ハローズ	4,900	2,184.00	10,701,600
フジオフードシステム	5,500	2,664.00	14,652,000
あみやき亭	2,800	3,370.00	9,436,000
ひらまつ	26,000	342.00	8,892,000
大黒天物産	3,100	3,205.00	9,935,500
ハニーズホールディングス	11,400	1,371.00	15,629,400
ファーマライズホールディングス	3,300	545.00	1,798,500
アルペン	9,900	1,542.00	15,265,800
ハブ	4,200	1,134.00	4,762,800
クオールホールディングス	19,000	1,412.00	26,828,000
ジinzホールディングス	6,800	5,670.00	38,556,000
ビックカメラ	76,300	1,069.00	81,564,700
D C Mホールディングス	69,400	1,049.00	72,800,600
ペッパーフードサービス	10,300	1,521.00	15,666,300
MonotaRO	91,300	2,480.00	226,424,000
東京一番フーズ	3,500	608.00	2,128,000
DDホールディングス	2,800	2,875.00	8,050,000
きちりホールディングス	3,600	719.00	2,588,400
アークランドサービスホールディングス	9,400	1,937.00	18,207,800
J．フロント リテイリング	164,300	1,212.00	199,131,600
ドトール・日レスホールディングス	22,600	2,040.00	46,104,000
マツモトキヨシホールディングス	53,100	3,680.00	195,408,000
ブロンコビリー	6,800	2,238.00	15,218,400
Z O Z O	138,800	2,201.00	305,498,800
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,181.00	4,605,900
物語コーポレーション	3,200	9,740.00	31,168,000
ココカラファイン	14,500	5,560.00	80,620,000
三越伊勢丹ホールディングス	240,400	782.00	187,992,800
H a m e e	4,100	720.00	2,952,000
ウエルシアホールディングス	34,000	5,370.00	182,580,000
クリエイトSDホールディングス	19,000	2,325.00	44,175,000
丸善C H Iホールディングス	15,000	376.00	5,640,000
ティーライフ	1,900	850.00	1,615,000
エー・ピーカンパニー	2,700	556.00	1,501,200
チムニー	4,000	2,396.00	9,584,000
シュッピン	8,900	1,022.00	9,095,800

ネクステージ	20,800	1,215.00	25,272,000
ジョイフル本田	37,700	1,299.00	48,972,300
鳥貴族	4,300	2,198.00	9,451,400
キリン堂ホールディングス	5,100	1,749.00	8,919,900
ホットランド	7,600	1,407.00	10,693,200
すかいらーくホールディングス	143,900	1,831.00	263,480,900
SFPホールディングス	5,500	2,192.00	12,056,000
綿半ホールディングス	4,900	2,252.00	11,034,800
ヨシックス	2,100	3,045.00	6,394,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,400	941.00	35,193,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	640.00	3,968,000
B E E N O S	4,600	1,342.00	6,173,200
あさひ	10,700	1,244.00	13,310,800
日本調剤	4,600	3,845.00	17,687,000
コスモス薬品	5,700	20,700.00	117,990,000
トーエル	6,400	677.00	4,332,800
オンリー	2,300	881.00	2,026,300
セブン&アイ・ホールディングス	538,000	3,772.00	2,029,336,000
薬王堂	5,700	2,345.00	13,366,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	34,600	1,640.00	56,744,000
ツルハホールディングス	27,900	11,050.00	308,295,000
サンマルクホールディングス	10,200	2,485.00	25,347,000
フェリシモ	3,000	1,012.00	3,036,000
トリドールホールディングス	15,900	2,342.00	37,237,800
T O K Y O B A S E	11,800	786.00	9,274,800
ウイルプラスホールディングス	2,200	825.00	1,815,000
ジャパンミート	6,600	1,922.00	12,685,200
サツドラホールディングス	2,000	1,762.00	3,524,000
デファクトスタンダード	1,600	312.00	499,200
アレンザホールディングス	7,100	776.00	5,509,600
串カツ田中ホールディングス	2,000	2,002.00	4,004,000
パロックジャパンリミテッド	10,500	1,037.00	10,888,500
クスリのアオキホールディングス	12,800	7,580.00	97,024,000
力の源ホールディングス	5,000	896.00	4,480,000
スシローグローバルホールディングス	14,100	6,320.00	89,112,000
L I X I L ビバ	11,000	1,363.00	14,993,000
メディカルシステムネットワーク	13,900	547.00	7,603,300
はるやまホールディングス	6,200	781.00	4,842,200
ノジマ	22,900	1,727.00	39,548,300
カップ・クリエイト	18,000	1,418.00	25,524,000
ライトオン	9,600	734.00	7,046,400

良品計画	18,200	18,140.00	330,148,000
三城ホールディングス	16,400	296.00	4,854,400
アドヴァン	19,700	1,150.00	22,655,000
アルビス	4,900	2,408.00	11,799,200
コナカ	15,500	411.00	6,370,500
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,605.00	2,728,500
G - 7ホールディングス	3,800	2,982.00	11,331,600
イオン北海道	13,100	728.00	9,536,800
コジマ	22,400	466.00	10,438,400
ヒマラヤ	4,700	838.00	3,938,600
コーナン商事	16,900	2,329.00	39,360,100
エコス	4,800	1,480.00	7,104,000
ワタミ	17,000	1,479.00	25,143,000
マルシェ	3,600	773.00	2,782,800
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	76,900	6,590.00	506,771,000
西松屋チェーン	28,300	869.00	24,592,700
ゼンショーホールディングス	62,400	2,340.00	146,016,000
幸楽苑ホールディングス	8,200	2,687.00	22,033,400
ハークスレイ	2,800	1,029.00	2,881,200
サイゼリヤ	21,200	2,594.00	54,992,800
V Tホールディングス	58,300	457.00	26,643,100
魚力	3,600	1,545.00	5,562,000
フジ・コーポレーション	3,500	2,070.00	7,245,000
ユナイテッドアローズ	14,700	3,130.00	46,011,000
ハイデイ日高	18,600	2,127.00	39,562,200
京都きもの友禅	8,600	330.00	2,838,000
コロナイド	42,700	2,090.00	89,243,000
ピーシーデポコーポレーション	17,300	485.00	8,390,500
壱番屋	9,100	5,210.00	47,411,000
P L A N T	3,500	717.00	2,509,500
スギホールディングス	28,200	5,400.00	152,280,000
スクロール	20,200	335.00	6,767,000
ヨンドシーホールディングス	14,300	2,511.00	35,907,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	143,600	2,280.00	327,408,000
木曽路	15,800	2,635.00	41,633,000
S R Sホールディングス	15,300	1,026.00	15,697,800
タカキュー	10,700	176.00	1,883,200
ケーヨー	24,100	477.00	11,495,700
上新電機	15,200	2,039.00	30,992,800
日本瓦斯	20,300	2,951.00	59,905,300
ロイヤルホールディングス	22,500	2,617.00	58,882,500
いなげや	14,400	1,459.00	21,009,600

島忠	27,200	2,364.00	64,300,800
チヨダ	13,600	1,557.00	21,175,200
ライフコーポレーション	9,800	2,151.00	21,079,800
リンガーハット	15,900	2,560.00	40,704,000
MrMaxHD	18,000	439.00	7,902,000
テンアライド	11,800	422.00	4,979,600
AOKIホールディングス	25,800	1,028.00	26,522,400
オークワ	18,400	1,092.00	20,092,800
コメリ	19,900	2,113.00	42,048,700
青山商事	22,500	1,876.00	42,210,000
しまむら	15,000	8,090.00	121,350,000
はせがわ	7,200	400.00	2,880,000
高島屋	100,800	1,231.00	124,084,800
松屋	26,100	738.00	19,261,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,000	1,113.00	73,458,000
近鉄百貨店	5,000	3,125.00	15,625,000
パルコ	12,400	1,193.00	14,793,200
丸井グループ	108,700	2,009.00	218,378,300
アクシアル リテイリング	10,700	3,875.00	41,462,500
イオン	494,000	1,921.00	948,974,000
イズミ	26,100	3,915.00	102,181,500
平和堂	26,100	1,991.00	51,965,100
フジ	15,600	1,825.00	28,470,000
ヤオコー	14,600	4,800.00	70,080,000
ゼビオホールディングス	15,600	1,138.00	17,752,800
ケーズホールディングス	133,500	1,052.00	140,442,000
Olympicグループ	7,800	617.00	4,812,600
日産東京販売ホールディングス	19,400	277.00	5,373,800
Genky DrugStores	6,300	2,106.00	13,267,800
総合メディカルホールディングス	11,300	1,515.00	17,119,500
ブックオフグループホールディングス	6,700	1,467.00	9,828,900
アインホールディングス	17,200	5,530.00	95,116,000
元気寿司	3,600	2,869.00	10,328,400
ヤマダ電機	391,300	483.00	188,997,900
アークランドサカモト	21,900	1,249.00	27,353,100
ニトリホールディングス	55,600	15,130.00	841,228,000
グルメ杵屋	9,300	1,163.00	10,815,900
愛眼	10,200	240.00	2,448,000
ケーユーホールディングス	6,900	784.00	5,409,600
吉野家ホールディングス	44,900	2,270.00	101,923,000
松屋フーズホールディングス	6,200	3,790.00	23,498,000
サガミホールディングス	17,300	1,343.00	23,233,900

関西スーパーマーケット	9,800	1,110.00	10,878,000
王将フードサービス	9,400	7,210.00	67,774,000
プレナス	14,500	1,732.00	25,114,000
ミニストップ	9,600	1,463.00	14,044,800
アークス	24,100	2,242.00	54,032,200
パローホールディングス	27,800	1,764.00	49,039,200
ベルク	6,400	5,250.00	33,600,000
大庄	7,000	1,624.00	11,368,000
ファーストリテイリング	17,200	62,710.00	1,078,612,000
サンドラッグ	48,300	3,065.00	148,039,500
サックスパー ホールディングス	11,000	898.00	9,878,000
ヤマザワ	2,800	1,670.00	4,676,000
やまや	2,300	2,220.00	5,106,000
ベルーナ	31,700	625.00	19,812,500
島根銀行	3,800	667.00	2,534,600
じもとホールディングス	86,800	92.00	7,985,600
めぶきフィナンシャルグループ	670,900	236.00	158,332,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,900	1,277.00	22,858,300
九州フィナンシャルグループ	212,800	403.00	85,758,400
ゆうちょ銀行	364,900	991.00	361,615,900
富山第一銀行	33,300	279.00	9,290,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	808,400	354.00	286,173,600
西日本フィナンシャルホールディングス	82,000	660.00	54,120,000
関西みらいフィナンシャルグループ	61,400	699.00	42,918,600
三十三フィナンシャルグループ	11,600	1,552.00	18,003,200
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	2,512.00	56,771,200
新生銀行	94,300	1,430.00	134,849,000
あおぞら銀行	71,800	2,528.00	181,510,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,847,700	507.10	4,486,668,670
りそなホールディングス	1,410,500	410.80	579,433,400
三井住友トラスト・ホールディングス	252,800	3,443.00	870,390,400
三井住友フィナンシャルグループ	905,800	3,495.00	3,165,771,000
千葉銀行	443,500	518.00	229,733,000
群馬銀行	259,200	348.00	90,201,600
武蔵野銀行	19,600	1,783.00	34,946,800
千葉興業銀行	37,800	282.00	10,659,600
筑波銀行	53,400	154.00	8,223,600
七十七銀行	40,900	1,356.00	55,460,400
青森銀行	10,300	2,566.00	26,429,800
秋田銀行	8,600	1,991.00	17,122,600
山形銀行	15,000	1,470.00	22,050,000
岩手銀行	9,300	2,429.00	22,589,700

東邦銀行	114,900	242.00	27,805,800
東北銀行	6,500	961.00	6,246,500
みちのく銀行	8,300	1,566.00	12,997,800
ふくおかフィナンシャルグループ	113,600	1,761.00	200,049,600
静岡銀行	319,300	701.00	223,829,300
十六銀行	17,600	2,125.00	37,400,000
八十二銀行	312,100	382.00	119,222,200
山梨中央銀行	16,200	974.00	15,778,800
大垣共立銀行	27,400	2,183.00	59,814,200
福井銀行	11,500	1,356.00	15,594,000
北國銀行	13,500	2,537.00	34,249,500
清水銀行	5,700	1,768.00	10,077,600
富山銀行	2,800	2,546.00	7,128,800
滋賀銀行	26,100	2,271.00	59,273,100
南都銀行	20,400	2,222.00	45,328,800
百五銀行	118,000	322.00	37,996,000
京都銀行	46,200	3,720.00	171,864,000
紀陽銀行	46,100	1,379.00	63,571,900
ほくほくフィナンシャルグループ	86,300	961.00	82,934,300
広島銀行	191,300	478.00	91,441,400
山陰合同銀行	77,500	585.00	45,337,500
中国銀行	111,500	874.00	97,451,000
鳥取銀行	4,900	1,404.00	6,879,600
伊予銀行	171,800	509.00	87,446,200
百十四銀行	14,000	1,993.00	27,902,000
四国銀行	19,100	900.00	17,190,000
阿波銀行	20,000	2,290.00	45,800,000
大分銀行	8,100	2,995.00	24,259,500
宮崎銀行	8,900	2,254.00	20,060,600
佐賀銀行	8,300	1,462.00	12,134,600
沖縄銀行	12,000	3,065.00	36,780,000
琉球銀行	30,400	1,035.00	31,464,000
セブン銀行	437,000	280.00	122,360,000
みずほフィナンシャルグループ	17,464,900	156.00	2,724,524,400
高知銀行	4,700	735.00	3,454,500
山口フィナンシャルグループ	161,500	673.00	108,689,500
長野銀行	4,700	1,635.00	7,684,500
名古屋銀行	10,600	3,210.00	34,026,000
北洋銀行	197,200	205.00	40,426,000
愛知銀行	4,900	3,370.00	16,513,000
中京銀行	5,600	2,154.00	12,062,400
大光銀行	4,800	1,694.00	8,131,200

愛媛銀行	18,600	1,078.00	20,050,800
トマト銀行	5,700	1,009.00	5,751,300
京葉銀行	56,000	602.00	33,712,000
栃木銀行	70,900	164.00	11,627,600
北日本銀行	4,500	1,722.00	7,749,000
東和銀行	22,600	707.00	15,978,200
福島銀行	11,200	205.00	2,296,000
大東銀行	6,200	556.00	3,447,200
トモニホールディングス	101,700	319.00	32,442,300
フィデアホールディングス	124,800	112.00	13,977,600
池田泉州ホールディングス	140,500	181.00	25,430,500
F P G	40,500	1,008.00	40,824,000
マーキュリアインベストメント	5,900	702.00	4,141,800
S B Iホールディングス	153,200	2,205.00	337,806,000
ジャフコ	21,100	3,720.00	78,492,000
大和証券グループ本社	1,031,700	451.00	465,296,700
野村ホールディングス	2,262,000	400.80	906,609,600
岡三証券グループ	110,000	352.00	38,720,000
丸三証券	38,500	520.00	20,020,000
東洋証券	47,400	127.00	6,019,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,900	281.00	43,245,900
光世証券	3,400	585.00	1,989,000
水戸証券	38,100	196.00	7,467,600
いちよし証券	26,400	671.00	17,714,400
松井証券	63,100	875.00	55,212,500
だいこう証券ビジネス	5,500	532.00	2,926,000
マネックスグループ	119,100	307.00	36,563,700
極東証券	17,400	850.00	14,790,000
岩井コスモホールディングス	13,300	1,078.00	14,337,400
藍澤證券	23,300	684.00	15,937,200
マネーパートナーズグループ	15,700	265.00	4,160,500
スパークス・グループ	51,700	227.00	11,735,900
かんぽ生命保険	45,500	1,561.00	71,025,500
S O M P Oホールディングス	226,600	4,191.00	949,680,600
アニコム ホールディングス	10,600	4,160.00	44,096,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	336,100	3,480.00	1,169,628,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	105,600	2,445.00	258,192,000
第一生命ホールディングス	727,200	1,388.00	1,009,353,600
東京海上ホールディングス	459,600	5,541.00	2,546,643,600
T & Dホールディングス	397,500	1,009.00	401,077,500
アドバンスクリエイト	3,000	1,771.00	5,313,000
全国保証	36,200	3,995.00	144,619,000

ジェイリース	3,600	331.00	1,191,600
イントラスト	3,600	755.00	2,718,000
日本モーゲージサービス	2,300	1,084.00	2,493,200
C a s a	5,800	1,129.00	6,548,200
アルヒ	11,700	2,054.00	24,031,800
プレミアグループ	7,400	1,845.00	13,653,000
クレディセゾン	90,000	1,170.00	105,300,000
芙蓉総合リース	14,700	6,330.00	93,051,000
興銀リース	24,200	2,619.00	63,379,800
東京センチュリー	25,900	4,160.00	107,744,000
日本証券金融	56,600	488.00	27,620,800
アイフル	196,100	217.00	42,553,700
リコーリース	10,100	3,265.00	32,976,500
イオンフィナンシャルサービス	82,100	1,597.00	131,113,700
アコム	258,300	373.00	96,345,900
ジャックス	14,200	2,208.00	31,353,600
オリエントコーポレーション	347,600	124.00	43,102,400
日立キャピタル	30,300	2,103.00	63,720,900
アプラスフィナンシャル	61,700	67.00	4,133,900
オリックス	857,500	1,511.00	1,295,682,500
三菱UFJリース	290,000	582.00	168,780,000
九州リースサービス	6,300	600.00	3,780,000
日本取引所グループ	347,200	1,611.00	559,339,200
イー・ギャランティ	12,000	1,273.00	15,276,000
アサックス	5,300	587.00	3,111,100
NECキャピタルソリューション	5,200	2,011.00	10,457,200
いちご	166,000	415.00	68,890,000
日本駐車場開発	146,700	160.00	23,472,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,200	1,798.00	12,945,600
ヒューリック	269,300	1,010.00	271,993,000
三栄建築設計	5,800	1,478.00	8,572,400
野村不動産ホールディングス	86,100	2,207.00	190,022,700
三重交通グループホールディングス	27,800	553.00	15,373,400
サムティ	18,800	1,839.00	34,573,200
ディア・ライフ	18,400	520.00	9,568,000
コーセーアールイー	5,200	680.00	3,536,000
エー・ディー・ワークス	395,900	33.00	13,064,700
日本商業開発	8,700	1,501.00	13,058,700
プレサンスコーポレーション	21,000	1,582.00	33,222,000
ユニゾホールディングス	18,800	4,305.00	80,934,000
日本管理センター	9,300	1,245.00	11,578,500
サンセイランディック	5,000	770.00	3,850,000

エストラスト	1,700	694.00	1,179,800
フージャースホールディングス	27,900	622.00	17,353,800
オープンハウス	18,800	5,180.00	97,384,000
東急不動産ホールディングス	347,300	639.00	221,924,700
飯田グループホールディングス	107,800	1,605.00	173,019,000
イーランド	3,200	681.00	2,179,200
ムゲンエステート	10,500	589.00	6,184,500
ハウスドゥ	7,100	1,605.00	11,395,500
シーアールイー	4,000	1,163.00	4,652,000
ケイアイスター不動産	4,000	1,789.00	7,156,000
グッドコムアセット	3,600	1,720.00	6,192,000
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,360.00	6,976,000
テンポイノベーション	2,000	1,859.00	3,718,000
パーク24	69,400	2,471.00	171,487,400
パラカ	3,800	2,033.00	7,725,400
三井不動産	682,300	2,449.50	1,671,293,850
三菱地所	900,900	2,032.50	1,831,079,250
平和不動産	24,000	2,487.00	59,688,000
東京建物	141,200	1,348.00	190,337,600
ダイビル	38,800	1,021.00	39,614,800
京阪神ビルディング	23,200	1,243.00	28,837,600
住友不動産	289,200	4,018.00	1,162,005,600
テーオーシー	30,700	791.00	24,283,700
東京楽天地	2,000	5,290.00	10,580,000
スターツコーポレーション	17,900	2,346.00	41,993,400
フジ住宅	17,800	703.00	12,513,400
空港施設	16,900	514.00	8,686,600
明和地所	8,900	540.00	4,806,000
ゴールドクレスト	10,600	2,031.00	21,528,600
日本エスリード	5,600	1,666.00	9,329,600
日神不動産	21,100	458.00	9,663,800
日本エスコン	24,600	746.00	18,351,600
タカラレーベン	61,400	375.00	23,025,000
サンヨーハウジング名古屋	8,300	960.00	7,968,000
イオンモール	65,000	1,706.00	110,890,000
毎日コムネット	4,000	748.00	2,992,000
ファースト住建	6,300	1,222.00	7,698,600
カチタス	14,500	4,220.00	61,190,000
トーセイ	18,500	1,209.00	22,366,500
穴吹興産	1,700	2,818.00	4,790,600
サンフロンティア不動産	18,600	1,258.00	23,398,800
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	1,040.00	12,584,000

インテリックス	4,900	736.00	3,606,400
ランドビジネス	5,400	772.00	4,168,800
日本社宅サービス	4,200	1,010.00	4,242,000
グランディハウス	13,400	444.00	5,949,600
日本空港ビルデング	41,200	4,245.00	174,894,000
日本工営	8,400	2,553.00	21,445,200
L I F U L L	43,700	660.00	28,842,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,800	2,072.00	20,305,600
日本M&Aセンター	92,900	2,983.00	277,120,700
メンバーズ	4,300	1,786.00	7,679,800
中広	1,500	583.00	874,500
アイティメディア	2,700	769.00	2,076,300
タケエイ	13,100	963.00	12,615,300
E・Jホールディングス	1,700	1,200.00	2,040,000
トラスト・テック	13,800	1,308.00	18,050,400
コシダカホールディングス	30,100	1,654.00	49,785,400
アルトナー	3,200	710.00	2,272,000
パソナグループ	15,300	1,485.00	22,720,500
C D S	3,200	1,306.00	4,179,200
リンクアンドモチベーション	27,800	489.00	13,594,200
G C A	14,900	707.00	10,534,300
エス・エム・エス	45,800	2,478.00	113,492,400
サニーサイドアップ	2,900	1,008.00	2,923,200
パーソルホールディングス	124,600	2,129.00	265,273,400
リニカル	7,200	1,067.00	7,682,400
クックパッド	44,000	284.00	12,496,000
エスクリ	3,600	863.00	3,106,800
アイ・ケイ・ケイ	6,300	718.00	4,523,400
学情	5,000	1,162.00	5,810,000
スタジオアリス	6,300	2,113.00	13,311,900
シミックホールディングス	7,000	1,777.00	12,439,000
N J S	2,800	1,589.00	4,449,200
総合警備保障	49,600	5,260.00	260,896,000
カカクコム	93,300	2,645.00	246,778,500
アイロムグループ	4,700	1,665.00	7,825,500
セントケア・ホールディング	9,300	490.00	4,557,000
サイネックス	2,300	636.00	1,462,800
ルネサンス	7,000	1,611.00	11,277,000
ディップ	20,100	2,349.00	47,214,900
オプトホールディング	7,500	1,626.00	12,195,000
ツクイ	29,700	452.00	13,424,400
キャリアデザインセンター	3,200	1,441.00	4,611,200

ベネフィット・ワン	34,600	1,812.00	62,695,200
エムスリー	262,200	2,335.00	612,237,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	585.00	4,797,000
プラス	1,600	609.00	974,400
アウトソーシング	71,300	1,030.00	73,439,000
ウェルネット	12,000	752.00	9,024,000
ワールドホールディングス	4,200	1,648.00	6,921,600
ディー・エヌ・エー	67,200	2,109.00	141,724,800
博報堂D Yホールディングス	173,200	1,557.00	269,672,400
ぐるなび	17,900	721.00	12,905,900
タカミヤ	13,100	758.00	9,929,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,400	1,188.00	9,979,200
ファンコミュニケーションズ	34,500	549.00	18,940,500
ライク	5,000	1,832.00	9,160,000
ビジネス・ブレークスルー	5,600	358.00	2,004,800
WDBホールディングス	5,700	2,463.00	14,039,100
ティア	7,500	638.00	4,785,000
C D G	1,200	1,400.00	1,680,000
バリューコマース	8,200	1,735.00	14,227,000
インフォマート	68,300	1,619.00	110,577,700
J Pホールディングス	36,100	275.00	9,927,500
エコナックホールディングス	23,600	124.00	2,926,400
E P Sホールディングス	18,800	1,369.00	25,737,200
レグス	3,200	1,779.00	5,692,800
プレステージ・インターナショナル	23,400	1,819.00	42,564,600
アミューズ	7,600	2,556.00	19,425,600
ドリームインキュベータ	3,900	1,296.00	5,054,400
クイック	7,800	1,360.00	10,608,000
T A C	7,500	193.00	1,447,500
ケネディクス	118,800	530.00	62,964,000
電通	128,400	3,725.00	478,290,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,206.00	5,909,400
ぴあ	3,600	4,335.00	15,606,000
イオンファンタジー	4,000	2,938.00	11,752,000
シーティーエス	14,300	720.00	10,296,000
ネクシィーズグループ	4,400	1,698.00	7,471,200
みらかホールディングス	34,900	2,332.00	81,386,800
アルプス技研	11,700	1,405.00	16,438,500
ダイオーズ	3,000	1,454.00	4,362,000
日本空調サービス	14,300	704.00	10,067,200
オリエンタルランド	147,200	15,225.00	2,241,120,000
ダスキン	32,000	2,767.00	88,544,000

明光ネットワークジャパン	14,800	957.00	14,163,600
ファルコホールディングス	6,900	1,629.00	11,240,100
ラウンドワン	38,700	1,633.00	63,197,100
リゾートトラスト	52,800	1,650.00	87,120,000
ビー・エム・エル	16,100	3,010.00	48,461,000
ワタベウェディング	2,200	635.00	1,397,000
りらいあコミュニケーションズ	22,600	1,313.00	29,673,800
リソー教育	63,500	501.00	31,813,500
早稲田アカデミー	3,700	843.00	3,119,100
ユー・エス・エス	152,200	1,961.00	298,464,200
東京個別指導学院	4,600	836.00	3,845,600
サイバーエージェント	71,600	4,475.00	320,410,000
楽天	580,500	1,025.00	595,012,500
クリーク・アンド・リバー社	7,400	1,234.00	9,131,600
テー・オー・ダブリュー	11,100	790.00	8,769,000
山田コンサルティンググループ	6,100	1,712.00	10,443,200
セントラルスポーツ	4,700	3,035.00	14,264,500
フルキャストホールディングス	12,500	1,966.00	24,575,000
エン・ジャパン	18,100	3,980.00	72,038,000
リソルホールディングス	1,400	3,920.00	5,488,000
テクノプロ・ホールディングス	25,000	6,210.00	155,250,000
アトラ	3,500	235.00	822,500
インターワークス	2,600	556.00	1,445,600
アイ・アールジャパンホールディングス	5,100	3,920.00	19,992,000
Keeper 技研	4,700	1,345.00	6,321,500
ファーストロジック	3,100	633.00	1,962,300
三機サービス	2,800	892.00	2,497,600
Gunosy	8,800	1,404.00	12,355,200
デザインワン・ジャパン	2,900	294.00	852,600
イー・ガーディアン	6,400	1,855.00	11,872,000
リブセンス	8,500	262.00	2,227,000
ジャパンマテリアル	34,200	1,154.00	39,466,800
ベクトル	15,700	918.00	14,412,600
ウチヤマホールディングス	6,400	493.00	3,155,200
チャーム・ケア・コーポレーション	4,000	2,141.00	8,564,000
ライクキッズネクスト	3,100	980.00	3,038,000
キャリアリンク	4,800	580.00	2,784,000
I B J	8,500	1,155.00	9,817,500
アサンテ	5,100	2,003.00	10,215,300
N・フィールド	8,800	655.00	5,764,000
バリューHR	2,700	3,160.00	8,532,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,400	6,580.00	28,952,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,669.00	8,845,700
E R Iホールディングス	3,700	775.00	2,867,500
アビスト	2,000	2,616.00	5,232,000
シグマクシス	6,000	1,410.00	8,460,000
ウィルグループ	8,300	840.00	6,972,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	17,800	222.00	3,951,600
日本ビューホテル	4,000	1,580.00	6,320,000
リクルートホールディングス	892,100	3,364.00	3,001,024,400
エラン	8,400	1,785.00	14,994,000
土木管理総合試験所	5,700	433.00	2,468,100
ネットマーケティング	4,700	736.00	3,459,200
日本郵政	1,020,800	995.00	1,015,696,000
ベルシステム24ホールディングス	20,900	1,598.00	33,398,200
鎌倉新書	9,300	1,680.00	15,624,000
ソネット・メディア・ネットワークス	1,800	705.00	1,269,000
一蔵	1,600	616.00	985,600
L I T A L I C O	2,900	1,847.00	5,356,300
グローバルキッズCOMPANY	2,000	820.00	1,640,000
エボラブルアジア	5,600	2,144.00	12,006,400
アトラエ	3,300	2,987.00	9,857,100
ストライク	4,800	2,618.00	12,566,400
ソラスト	30,600	1,232.00	37,699,200
セラク	4,100	781.00	3,202,100
インソース	4,900	3,010.00	14,749,000
ベイクレント・コンサルティング	8,800	4,960.00	43,648,000
Orchestra Holdings	2,600	973.00	2,529,800
アイモバイル	4,100	778.00	3,189,800
キャリアインデックス	4,500	535.00	2,407,500
MS - J a p a n	5,100	1,457.00	7,430,700
船場	2,200	919.00	2,021,800
グレイステクノロジー	4,500	3,060.00	13,770,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,800	2,807.00	27,508,600
フルテック	1,900	1,186.00	2,253,400
グリーンズ	4,800	1,335.00	6,408,000
ツナググループ・ホールディングス	1,700	563.00	957,100
ソウルドアウト	2,000	1,676.00	3,352,000
MS & C o n s u l t i n g	2,100	1,021.00	2,144,100
日総工産	8,400	1,138.00	9,559,200
キュービーネットホールディングス	7,600	2,333.00	17,730,800
R P Aホールディングス	5,400	1,658.00	8,953,200
スプリックス	4,200	1,748.00	7,341,600
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	864.00	4,406,400

リログループ	68,100	2,684.00	182,780,400
東祥	7,800	2,739.00	21,364,200
エイチ・アイ・エス	19,500	2,562.00	49,959,000
ラックランド	2,600	2,227.00	5,790,200
共立メンテナンス	19,100	4,510.00	86,141,000
イチネンホールディングス	13,100	1,052.00	13,781,200
建設技術研究所	8,700	1,583.00	13,772,100
スペース	8,200	1,159.00	9,503,800
長大	4,800	774.00	3,715,200
燦ホールディングス	2,800	2,098.00	5,874,400
スバル興業	900	6,010.00	5,409,000
東京テアトル	5,000	1,350.00	6,750,000
タナベ経営	2,500	1,267.00	3,167,500
ナガワ	3,500	5,010.00	17,535,000
よみうりランド	2,700	4,610.00	12,447,000
東京都競馬	8,200	3,185.00	26,117,000
カナモト	20,400	2,702.00	55,120,800
東京ドーム	46,700	1,028.00	48,007,600
西尾レントオール	12,700	2,805.00	35,623,500
トランス・コスモス	13,900	2,630.00	36,557,000
乃村工藝社	58,300	1,359.00	79,229,700
藤田観光	5,500	2,796.00	15,378,000
KNT-CTホールディングス	6,600	1,473.00	9,721,800
日本管財	13,400	1,866.00	25,004,400
トーカイ	12,100	2,275.00	27,527,500
白洋舎	1,500	2,823.00	4,234,500
セコム	132,200	8,996.00	1,189,271,200
セントラル警備保障	6,000	5,100.00	30,600,000
丹青社	23,600	1,283.00	30,278,800
メイテック	15,400	5,600.00	86,240,000
応用地質	13,500	1,106.00	14,931,000
船井総研ホールディングス	25,800	2,237.00	57,714,600
進学会ホールディングス	5,900	528.00	3,115,200
オオバ	10,000	600.00	6,000,000
いであ	2,500	1,094.00	2,735,000
学究社	4,200	1,281.00	5,380,200
ベネッセホールディングス	45,700	2,676.00	122,293,200
イオンディライト	15,400	3,285.00	50,589,000
ナック	8,000	949.00	7,592,000
ニチイ学館	17,800	1,756.00	31,256,800
ダイセキ	20,900	2,730.00	57,057,000
ステップ	4,700	1,444.00	6,786,800

合 計	152,380,000	281,196,060,920	
-----	-------------	-----------------	--

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	245,962,668
国債証券	414,722,675,050
地方債証券	26,289,738,427
特殊債証券	33,309,988,163
社債証券	19,410,874,410
未収利息	1,097,511,402
前払費用	42,566,689
流動資産合計	495,119,316,809
資産合計	495,119,316,809
負債の部	
流動負債	
未払金	3,987,000,000
未払解約金	145,357,403
未払利息	530
その他未払費用	12
流動負債合計	4,132,357,945
負債合計	4,132,357,945
純資産の部	
元本等	
元本	339,472,890,353
剰余金	
剰余金又は欠損金()	151,514,068,511
元本等合計	490,986,958,864
純資産合計	490,986,958,864
負債純資産合計	495,119,316,809

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	339,472,890,353口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 103,613,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4463円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,463円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2019年 8月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</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 8月20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 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	289,379,948,264円
期中追加設定元本額	71,016,941,292円
期中一部解約元本額	20,923,999,203円
期末元本額	339,472,890,353円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,894,139,104円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,104,045円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,345,157,193円
世界経済インデックスファンド	1,857,854,974円
D C マイセレクション 2 5	20,243,495,088円
D C マイセレクション 5 0	22,112,443,786円
D C マイセレクション 7 5	5,936,872,869円
D C 日本債券インデックス・オープン	459,787,488円
D C 日本債券インデックス・オープン S	85,685,281,449円
D C 日本債券インデックス・オープン P	39,425,986,741円
D C マイセレクション S 2 5	8,205,880,697円
D C マイセレクション S 5 0	8,979,857,107円
D C マイセレクション S 7 5	1,705,359,287円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,189,405,231円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,290,089,971円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	431,703,198円
D C 世界経済インデックスファンド	1,636,332,306円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	87,998,877円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,201,947円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	42,594,728円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,389,556円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	178,244,661円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	291,117,437円

区分	2019年 8月20日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	61,675,646円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	142,825,940円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,316,708,456円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	945,953,567円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,570,398,059円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	820,473,761円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	105,827,157円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,239,398,678円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	27,145,332円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,449,874,632円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,795,023,520円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	166,695,170円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,234,605,870円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,080,907,019円
分散投資コア戦略ファンドA	5,987,439,585円
分散投資コア戦略ファンドS	2,998,180,104円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	65,191,453円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	797,721,024円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	51,217,568円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,161,387円
SMT インデックスバランス・オープン	64,870,348円
SMT 世界経済インデックス・オープン	10,693,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	11,069,215円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,054,831円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,390,887円
グローバル経済コア	222,249,455円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,803,421円
DCターゲット・イヤーフンド2055	593,624円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	18,784円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	79,200,298,601円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,193,039,000
地方債証券	61,103,928
特殊債券	125,983,524

社債券	162,247,200
合計	7,542,373,652

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第392回利付国債(2年)	730,000,000	732,708,300	
	第393回利付国債(2年)	840,000,000	843,418,800	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,044,555,200	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,620,800	
	第396回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,020,029,900	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,367,316,800	
	第398回利付国債(2年)	5,040,000,000	5,068,929,600	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,119,034,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	634,126,500	
	第401回利付国債(2年)	2,480,000,000	2,497,062,400	
	第402回利付国債(2年)	1,870,000,000	1,883,632,300	
	第403回利付国債(2年)	50,000,000	50,386,000	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,624,079,000	
	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	2,974,415,200	
	第127回利付国債(5年)	4,780,000,000	4,808,775,600	
	第128回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,621,398,800	
	第129回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,367,621,800	
	第130回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,372,607,200	
	第131回利付国債(5年)	5,540,000,000	5,597,560,600	
	第132回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,856,160,000	
第133回利付国債(5年)	4,740,000,000	4,800,435,000		
第134回利付国債(5年)	3,170,000,000	3,214,284,900		

第135回利付国債（5年）	5,680,000,000	5,767,358,400	
第136回利付国債（5年）	5,900,000,000	5,999,533,000	
第137回利付国債（5年）	3,430,000,000	3,491,019,700	
第138回利付国債（5年）	9,070,000,000	9,241,332,300	
第139回利付国債（5年）	5,970,000,000	6,089,280,600	
第140回利付国債（5年）	3,630,000,000	3,707,500,500	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	646,628,000	
第2回利付国債（40年）	470,000,000	740,776,400	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	875,803,500	
第4回利付国債（40年）	1,000,000,000	1,610,780,000	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,392,752,100	
第6回利付国債（40年）	720,000,000	1,113,890,400	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	1,076,248,800	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	1,122,584,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,158,375,700	
第10回利付国債（40年）	1,920,000,000	2,385,561,600	
第11回利付国債（40年）	1,730,000,000	2,094,251,500	
第12回利付国債（40年）	520,000,000	573,008,800	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,429,274,700	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,092,420,000	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,884,561,700	
第313回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,383,804,000	
第314回利付国債（10年）	470,000,000	480,278,900	
第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	3,225,470,800	
第316回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,199,694,600	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	915,907,900	
第318回利付国債（10年）	1,960,000,000	2,012,959,200	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,765,780,200	
第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,708,379,600	
第321回利付国債（10年）	2,470,000,000	2,553,090,800	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	773,280,000	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,003,222,500	
第324回利付国債（10年）	2,550,000,000	2,630,044,500	
第325回利付国債（10年）	2,810,000,000	2,906,607,800	
第326回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,716,423,400	
第327回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,327,820,800	
第328回利付国債（10年）	2,770,000,000	2,862,213,300	
第329回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,348,167,500	
第330回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,507,320,000	
第331回利付国債（10年）	1,380,000,000	1,433,102,400	
第332回利付国債（10年）	3,250,000,000	3,382,795,000	
第333回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,430,702,600	

第334回利付国債（10年）	2,790,000,000	2,918,061,000	
第335回利付国債（10年）	3,620,000,000	3,777,252,800	
第336回利付国債（10年）	510,000,000	533,403,900	
第337回利付国債（10年）	3,380,000,000	3,498,401,400	
第338回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,554,517,000	
第339回利付国債（10年）	3,890,000,000	4,063,610,700	
第340回利付国債（10年）	4,320,000,000	4,521,312,000	
第341回利付国債（10年）	3,430,000,000	3,574,334,400	
第342回利付国債（10年）	4,060,000,000	4,181,597,000	
第343回利付国債（10年）	2,830,000,000	2,918,069,600	
第344回利付国債（10年）	2,420,000,000	2,499,981,000	
第345回利付国債（10年）	1,980,000,000	2,047,795,200	
第346回利付国債（10年）	2,860,000,000	2,960,185,800	
第347回利付国債（10年）	2,270,000,000	2,351,288,700	
第348回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,134,427,800	
第349回利付国債（10年）	3,390,000,000	3,513,362,100	
第350回利付国債（10年）	5,130,000,000	5,315,346,900	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	3,750,000,000	3,884,287,500	
第352回利付国債（10年）	3,890,000,000	4,027,744,900	
第353回利付国債（10年）	4,690,000,000	4,853,774,800	
第354回利付国債（10年）	3,940,000,000	4,075,299,600	
第355回利付国債（10年）	1,890,000,000	1,954,694,700	
第1回利付国債（30年）	110,000,000	143,881,100	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	204,512,000	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	152,691,600	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	148,644,100	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	64,048,000	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	249,834,800	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	236,226,600	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	62,761,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	288,446,400	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	186,171,200	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	112,403,700	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	248,814,500	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	376,901,400	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	408,534,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	469,886,800	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	512,990,200	
第17回利付国債（30年）	570,000,000	784,542,300	
第18回利付国債（30年）	345,000,000	470,811,150	
第19回利付国債（30年）	380,000,000	519,999,600	
第20回利付国債（30年）	480,000,000	674,611,200	

第21回利付国債(30年)	500,000,000	688,370,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	565,780,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	609,894,800
第24回利付国債(30年)	380,000,000	540,892,000
第25回利付国債(30年)	350,000,000	487,826,500
第26回利付国債(30年)	430,000,000	608,729,500
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,456,036,200
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,381,788,400
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	2,018,044,000
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,557,937,000
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,559,360,000
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,938,310,000
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,327,529,100
第34回利付国債(30年)	1,545,000,000	2,230,300,200
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,381,159,300
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,379,518,400
第37回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,494,420,800
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,703,808,300
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,327,637,200
第40回利付国債(30年)	770,000,000	1,071,516,600
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,275,867,000
第42回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,538,790,400
第43回利付国債(30年)	960,000,000	1,322,534,400
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,491,858,000
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,467,774,000
第46回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,738,724,000
第47回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,059,564,500
第48回利付国債(30年)	1,590,000,000	2,091,486,000
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,924,718,000
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,246,164,800
第51回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,283,003,200
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,673,733,600
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,247,411,200
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,552,761,700
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,214,096,000
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,472,751,000
第57回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,530,997,000
第58回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,696,645,000
第59回利付国債(30年)	170,000,000	194,228,400
第60回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,846,413,800
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,486,264,000
第62回利付国債(30年)	670,000,000	728,162,700
第63回利付国債(30年)	470,000,000	497,161,300

第47回利付国債（20年）	90,000,000	92,408,400	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	134,812,600	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	145,299,000	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	227,627,400	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	104,200,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	115,514,300	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	84,488,000	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	211,688,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	148,355,200	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	159,847,500	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	255,069,600	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	320,580,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	213,532,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	370,146,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	251,464,800	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	333,961,600	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	216,440,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	349,456,000	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	241,505,000	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	360,805,500	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	143,442,000	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	212,294,600	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	433,949,100	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	453,596,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	224,836,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	709,128,000	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	405,630,000	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	226,436,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	148,034,900	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	304,387,200	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	328,584,500	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	192,649,100	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	307,578,600	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	251,928,600	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	446,538,300	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	690,708,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	335,677,900	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	540,988,800	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	337,383,100	
第86回利付国債（20年）	210,000,000	247,136,400	
第87回利付国債（20年）	550,000,000	643,560,500	
第88回利付国債（20年）	420,000,000	497,183,400	

第89回利付国債(20年)	350,000,000	411,873,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	745,850,700
第91回利付国債(20年)	450,000,000	536,017,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,041,048,800
第93回利付国債(20年)	410,000,000	484,246,900
第94回利付国債(20年)	610,000,000	725,210,700
第95回利付国債(20年)	610,000,000	738,649,000
第96回利付国債(20年)	320,000,000	382,345,600
第97回利付国債(20年)	400,000,000	483,428,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	528,123,200
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,386,428,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	585,139,200
第101回利付国債(20年)	715,000,000	884,190,450
第102回利付国債(20年)	410,000,000	509,252,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	493,212,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	437,374,800
第105回利付国債(20年)	680,000,000	829,273,600
第106回利付国債(20年)	380,000,000	466,951,600
第107回利付国債(20年)	260,000,000	318,375,200
第108回利付国債(20年)	660,000,000	795,570,600
第109回利付国債(20年)	520,000,000	628,784,000
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,167,350,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,206,456,900
第112回利付国債(20年)	790,000,000	974,638,800
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,795,926,500
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,168,692,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	877,688,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,334,200,800
第117回利付国債(20年)	780,000,000	973,346,400
第118回利付国債(20年)	660,000,000	819,370,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	646,266,100
第120回利付国債(20年)	790,000,000	945,843,300
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,851,750,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	538,208,000
第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,614,771,200
第124回利付国債(20年)	610,000,000	762,500,000
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,047,664,800
第126回利付国債(20年)	730,000,000	915,463,800
第127回利付国債(20年)	990,000,000	1,229,847,300
第128回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,571,081,400
第129回利付国債(20年)	550,000,000	679,167,500
第130回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,380,838,300
第131回利付国債(20年)	870,000,000	1,066,733,100

第132回利付国債（20年）	840,000,000	1,032,645,600	
第133回利付国債（20年）	1,190,000,000	1,477,825,300	
第134回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,308,289,500	
第135回利付国債（20年）	590,000,000	727,593,900	
第136回利付国債（20年）	570,000,000	695,645,100	
第137回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,384,712,000	
第138回利付国債（20年）	320,000,000	387,296,000	
第139回利付国債（20年）	550,000,000	672,831,500	
第140回利付国債（20年）	1,640,000,000	2,032,648,800	
第141回利付国債（20年）	1,610,000,000	2,000,215,700	
第142回利付国債（20年）	520,000,000	653,052,400	
第143回利付国債（20年）	720,000,000	887,256,000	
第144回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,791,283,200	
第145回利付国債（20年）	2,455,000,000	3,066,123,150	
第146回利付国債（20年）	2,100,000,000	2,630,502,000	
第147回利付国債（20年）	1,690,000,000	2,098,574,400	
第148回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,434,251,600	
第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	3,130,550,000	
第150回利付国債（20年）	2,270,000,000	2,768,083,400	
第151回利付国債（20年）	1,735,000,000	2,066,870,800	
第152回利付国債（20年）	2,010,000,000	2,396,945,100	
第153回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,890,991,800	
第154回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,367,822,600	
第155回利付国債（20年）	2,160,000,000	2,514,801,600	
第156回利付国債（20年）	1,960,000,000	2,089,967,600	
第157回利付国債（20年）	2,110,000,000	2,177,351,200	
第158回利付国債（20年）	2,210,000,000	2,392,612,300	
第159回利付国債（20年）	2,070,000,000	2,275,385,400	
第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	2,178,442,500	
第161回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,923,495,000	
第162回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,254,057,000	
第163回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,924,825,000	
第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,925,657,400	
第165回利付国債（20年）	1,040,000,000	1,124,156,800	
第166回利付国債（20年）	900,000,000	1,006,767,000	
第167回利付国債（20年）	2,070,000,000	2,235,496,500	
第168回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,601,596,600	
第169回利付国債（20年）	280,000,000	291,454,800	
国債証券合計	370,770,000,000	414,722,675,050	
地方債証券			
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,370,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,183,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	141,260,000	

第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	139,398,000	
第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	135,770,000	
第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	136,060,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,115,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,524,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	242,160,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	240,950,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	101,900,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	102,183,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	102,128,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	204,876,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	102,585,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	102,272,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	103,353,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	102,838,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	102,374,000	
第764回東京都公募公債	150,000,000	152,139,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	101,437,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	101,250,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,422,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,748,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,302,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,433,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	304,380,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	144,495,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	120,648,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,946,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,868,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,266,000	
第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,570,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,210,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	241,610,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,693,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,260,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,613,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,166,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,404,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,753,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	154,755,370	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,182,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,073,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,675,480	

第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,638,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,104,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,275,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,592,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,285,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,252,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,341,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,850,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,186,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,758,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,851,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,288,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,539,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	130,032,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	113,438,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,468,386	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,245,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,448,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,288,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,444,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,531,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,934,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,335,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,149,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,304,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,318,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,146,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,478,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,676,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,524,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,088,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	112,804,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,821,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,668,000	

平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	129,005,684	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,322,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	118,706,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	116,152,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	241,412,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	205,316,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,823,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,765,430	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,829,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,927,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,037,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	103,008,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,425,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,679,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,290,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,799,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,688,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,478,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	122,454,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,390,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,638,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	140,358,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,976,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	111,913,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	121,370,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	120,468,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,526,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,391,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,394,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,187,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,425,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,676,800	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,471,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,784,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,951,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	364,248,520	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,087,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,250,500	

第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,633,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,826,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,471,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,474,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,421,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,658,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,310,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,863,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,833,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,784,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,174,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,035,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,858,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,687,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,668,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,422,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,550,740	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,140,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,526,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,399,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,017,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,388,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,270,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,181,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,149,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,650,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,504,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,182,767	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,550,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,041,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,122,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,281,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,607,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	242,892,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,296,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	143,526,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,874,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,060,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,497,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,516,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,506,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,554,000	

	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,963,000	
	平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,450,000	
	平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	140,619,600	
	平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	241,188,000	
	平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	122,302,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,683,000	
	第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,363,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,478,000	
	平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,111,000	
	平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,390,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,474,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,542,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	110,961,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,684,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,323,000	
	第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	119,473,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,987,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,439,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,093,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,796,000	
	平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,483,350	
	平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	120,592,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,646,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	102,280,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,160,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,573,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,467,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,077,300	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,971,600	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,822,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	203,650,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,982,000	
	地方債証券合計	24,734,220,000	26,289,738,427	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,466,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,601,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,674,000	

第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,954,000	
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,033,000	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,700,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,983,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,268,000	
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,847,000	
第14回道路債券	100,000,000	106,353,000	
第17回道路債券	100,000,000	105,089,000	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	464,728,000	
第21回道路債券	100,000,000	136,908,000	
第28回道路債券	200,000,000	278,346,000	
第33回道路債券	200,000,000	281,944,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,877,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	167,266,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,678,000	
第42回道路債券	100,000,000	112,079,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,519,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,414,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,298,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	160,150,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,558,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,903,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,576,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,771,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,756,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,053,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,422,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,638,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,821,000	

第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,406,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,305,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,255,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,432,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,978,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,306,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	308,085,540	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,348,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,737,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,613,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,013,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,442,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,090,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,273,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,210,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,440,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,551,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,288,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	153,248,080	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,703,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,259,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,980,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,500,640	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,426,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,277,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,069,000	
	100,000,000	102,771,000	

第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,066,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,674,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,206,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,784,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,275,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,227,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	107,389,480	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	319,030,440	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	207,447,700	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,450,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,281,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,611,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	530,030,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,082,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,408,400	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,796,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	311,880,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	114,117,300	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,416,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	416,241,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,068,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	139,838,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,119,200	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	137,130,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	242,768,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,662,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,980,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	243,198,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,143,220	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,275,530	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,409,000	

第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,111,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,338,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,330,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,605,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,065,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,209,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,490,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,573,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,490,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,398,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,010,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,350,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	221,056,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,716,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,460,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,568,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,212,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,954,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,190,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,564,200	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,625,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,601,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,255,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,357,120	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,051,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,937,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,320,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,710,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,297,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,814,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	111,825,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,058,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	124,111,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,579,600	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,627,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,301,600	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,629,670	
第43回都市再生債券	100,000,000	101,397,000	
第127回都市再生債券	400,000,000	400,564,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,597,000	

第344回東京交通債券	100,000,000	105,745,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,838,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,354,000	14,985,288	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,680,000	15,408,862	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,042,000	15,934,742	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	253,734,000	255,751,185	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	177,722,000	178,980,271	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,936,000	15,742,245	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,011,000	16,930,992	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,993,000	13,376,423	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,838,000	28,029,875	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,602,000	16,419,856	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,880,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,161,000	14,842,568	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,475,000	17,462,676	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,084,000	14,781,158	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,287,000	17,242,721	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,538,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,087,000	15,400,055	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,387,000	15,702,125	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,644,000	23,397,596	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,113,000	23,978,673	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,519,000	26,774,748	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,513,000	29,780,346	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,509,000	32,044,413	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,626,000	33,182,045	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,750,000	70,098,997	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,519,000	15,119,941	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,385,000	34,644,825	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,487,000	15,078,504	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,368,000	15,130,366	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,391,000	37,984,098	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,336,000	13,964,125	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,948,000	37,571,196	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,810,000	35,223,831	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,265,000	16,229,748	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,764,000	70,157,692	

第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,747,000	38,214,615	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,948,000	15,721,110	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,878,000	50,024,451	
第5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,726,000	47,705,646	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,624,000	47,629,426	
第5 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,127,000	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,432,000	101,636,034	
第6 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,773,000	
第6 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,810,000	
第6 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,352,000	
第6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,238,000	107,938,790	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,863,000	54,696,275	
第6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,798,000	55,030,713	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,802,000	56,175,519	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,329,000	49,062,874	
第7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,404,000	48,804,942	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,253,000	55,701,175	
第7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	184,755,000	
第7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,956,000	50,480,883	
第8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,912,000	56,640,486	
第8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,206,000	58,050,765	
第8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,247,000	59,007,602	
第8 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,400,000	
第8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,068,000	
第8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,612,000	124,431,104	
第9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,531,000	63,265,790	
第9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,044,000	130,976,101	
第9 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,962,000	
第9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,117,000	74,188,543	
第9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,710,000	77,756,673	
第9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,965,000	77,347,419	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,860,000	159,354,291	
第1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,670,000	78,203,384	
第1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,279,000	83,162,878	
第1 1 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,340,000	
第1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,179,000	90,034,286	
第1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,405,000	90,079,390	
第1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,221,000	
第1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,498,000	90,570,623	

第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,994,000	91,495,621	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,529,000	91,918,529	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,940,000	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,506,000	93,885,156	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,029,000	94,547,833	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	94,406,496	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	94,742,035	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,945,000	95,379,229	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,982,000	191,484,526	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,201,000	95,609,313	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,900,000	193,296,488	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,977,000	96,410,064	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,178,000	193,799,618	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,815,398	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,306,000	196,886,728	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,530,000	197,191,151	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	140,224,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,836,000	99,771,099	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,387,000	100,560,842	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,771,000	100,088,172	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,762,000	200,630,340	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,733,000	100,444,042	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,098,000	101,130,499	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,004,000	202,369,157	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,842,000	100,895,333	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,209,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,859,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,700,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,142,000	

	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,486,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,733,000	
	い第786号商工債	300,000,000	300,783,000	
	い第795号商工債	200,000,000	200,040,000	
	い第802号商工債	100,000,000	100,097,000	
	い第795号農林債	100,000,000	99,989,000	
	い第796号農林債	200,000,000	199,978,000	
	第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,178,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,340,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,348,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,712,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,380,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,312,000	
	第218号商工債（3年）	300,000,000	300,504,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,350,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,801,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	123,216,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,072,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,518,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,732,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,193,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,926,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,334,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,841,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,047,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,164,000	
	特殊債券合計	31,173,915,000	33,309,988,163	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,162,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	101,149,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,514,000	
	第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,916,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,861,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,670,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,015,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,252,000	

第12回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	200,180,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	100,541,000	
第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,249,000	
第1回H S B C・ホールディングス・ピーエ ルシー円貨社債	100,000,000	100,677,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グ ループ・インク円貨社債	100,000,000	105,401,000	
第11回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	300,000,000	300,888,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	200,000,000	201,412,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,266,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,822,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	102,171,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,394,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,874,000	
第11回アサヒグループホールディングス株 式会社無担保社債	100,000,000	100,925,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	102,895,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	101,466,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,025,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,963,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,093,000	
第7回J・フロント リテイリング株式会社 無担保社債	100,000,000	100,247,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	103,400,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,277,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,164,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	102,182,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,746,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,542,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	102,406,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	100,000,000	102,018,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	102,170,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	101,229,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,312,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,335,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,734,000	

第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,130,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,444,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,478,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,852,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,465,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,960,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,729,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,205,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,482,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,940,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,612,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,662,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,859,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,184,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,878,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,920,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,587,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,426,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,143,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,204,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	202,114,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,551,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,317,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,749,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,161,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,182,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	122,628,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,366,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,954,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,246,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,512,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	125,534,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,499,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,716,000	
	100,000,000	116,023,000	

第 8 8 回株式会社三菱東京 U F J 銀行無担保社債			
第 1 4 1 回株式会社三菱東京 U F J 銀行無担保社債	100,000,000	102,565,000	
第 1 回三井住友 F G 無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,753,000	
第 1 1 回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,978,000	
第 1 回みずほ F G 無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	307,902,000	
第 2 2 回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,459,000	
第 5 7 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,671,000	
第 6 6 回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,483,000	
第 2 3 回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,083,000	
第 2 回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,718,000	
第 5 5 回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,761,000	
第 7 7 回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,590,000	
第 1 9 3 回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,669,000	
第 2 1 回三井住友ファイナンス & リース株式会社無担保社債	200,000,000	201,292,000	
第 4 4 回三菱 U F J リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第 4 8 回三菱 U F J リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
第 5 2 回三菱 U F J リース株式会社無担保社債	200,000,000	203,420,000	
第 5 6 回三菱 U F J リース株式会社無担保社債	100,000,000	102,402,000	
第 3 1 回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,612,000	
第 1 回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,890,000	
第 6 6 回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	202,198,000	
第 1 2 0 回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	202,006,000	
第 1 3 1 回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,879,000	
第 9 7 回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,613,000	
第 1 0 0 回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,373,000	
第 1 3 回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,218,000	
第 1 0 5 回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,786,000	
第 8 6 回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	108,770,000	
第 6 3 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,836,000	
第 8 4 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,937,000	
第 5 1 回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,505,000	
第 1 7 回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,468,000	
第 1 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,902,000	

第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,711,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,878,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,847,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,888,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,991,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,116,060	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,784,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,392,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,645,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,188,600	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	140,023,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	136,744,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	122,775,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,617,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	101,104,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,995,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	205,566,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,331,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,095,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	103,239,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,385,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,863,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,290,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,778,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,205,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,841,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,811,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	204,124,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,427,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,641,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,273,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,600,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,774,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,309,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,941,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,195,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,852,700	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,961,000	

第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,367,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,477,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,720,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,356,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,552,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,091,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,541,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,217,050	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,756,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,000,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,175,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,046,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,908,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,868,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,133,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,747,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,481,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	204,066,000	
社債券合計	18,766,000,000	19,410,874,410	
合計		493,733,276,050	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,790,755,164
コール・ローン	224,873,782
株式	320,984,326,408
投資信託受益証券	257,279,692
投資証券	9,270,233,266

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	29,983,452
未収入金	30,866
未収配当金	624,125,297
前払金	218,586,399
差入委託証拠金	2,081,464,918
流動資産合計	343,481,659,244
資産合計	343,481,659,244
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	248,268,977
未払解約金	55,341,900
未払利息	485
流動負債合計	303,611,362
負債合計	303,611,362
純資産の部	
元本等	
元本	136,510,691,604
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	206,667,356,278
元本等合計	343,178,047,882
純資産合計	343,178,047,882
負債純資産合計	343,481,659,244

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20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> <p>(1)先物取引</p>

2019年 8月20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、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 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	136,510,691,604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 2.5139円 (1万口当たり純資産額) (25,139円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 8月20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 8月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2019年 8月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	136,969,669,259円
期中追加設定元本額	17,163,156,978円
期中一部解約元本額	17,622,134,633円
期末元本額	136,510,691,604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）	2,463,551,937円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,764,244円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,224,638,984円
世界経済インデックスファンド	7,544,551,005円
外国株式インデックス・オープン	891,442,329円
D C マイセクション 2 5	1,082,100,694円
D C マイセクション 5 0	4,785,946,441円
D C マイセクション 7 5	5,025,334,505円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,590,919,845円
D C マイセクション S 2 5	435,984,734円

区分	2019年 8月20日現在
DCマイセレクションS50	1,948,356,768円
DCマイセレクションS75	1,438,549,558円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	111,654,430円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	191,941,120円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	126,089,021円
DC世界経済インデックスファンド	6,556,183,434円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,859,827,523円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,491,154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）	40,546,937円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	50,677,515円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	195,668,175円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	34,527,140円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	274,080,458円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	721,223,748円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	368,413,607円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,403,686,297円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,840,154,878円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	77,673,998円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	349,733,729円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,588,264円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	124,202,686円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,845,367,154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）	2,094,973,438円
外国株式ファンド・シリーズ1	875,582,365円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,485,538,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,428,856,181円
分散投資コア戦略ファンドA	2,320,725,574円
分散投資コア戦略ファンドS	4,791,427,715円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	911,667,962円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,025,091,968円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,119,077,753円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	814,944,474円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,406,077円
SMT インデックスバランス・オープン	273,506,688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）	30,105,017,475円
SMT 世界経済インデックス・オープン	79,006,807円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	323,759,790円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	49,584,153円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,428,727円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	46,473,470円
グローバル経済コア	1,041,062,604円

区分	2019年 8月20日現在
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A 対応型)	6,707,969円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	363,842円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	357,806,843円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	72,561,394円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	58,867円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	66,613円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,359円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	81,330円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,366,189,386円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,177,048,616円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	360,766,802円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	31,820,718円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,506,986,264
投資信託受益証券	11,027,984
投資証券	497,153,955
合計	9,015,168,203

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 8月20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	12,952,807,292	-	12,734,220,893	218,586,399
合計		12,952,807,292	-	12,734,220,893	218,586,399

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 8月20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	286,741,076	-	287,041,950	300,874
	アメリカドル	244,463,850	-	244,726,350	262,500
	ユーロ	42,277,226	-	42,315,600	38,374
	合計	286,741,076	-	287,041,950	300,874

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	34,273	21.90	750,578.70	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	21.42	951,048.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	16.75	600,973.25	
	CHENIERE ENERGY INC	18,402	61.25	1,127,122.50	
	CHEVRON CORP	158,168	117.31	18,554,688.08	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	41.90	318,398.10	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	72.98	1,275,763.38	
	CONOCOPHILLIPS	93,594	53.94	5,048,460.36	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	31.19	238,509.93	
	DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	23.27	881,025.47	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	99.96	1,348,160.52	
	EOG RESOURCES INC	47,650	77.81	3,707,646.50	
	EXXON MOBIL	353,018	69.45	24,517,100.10	
	HALLIBURTON CO	76,620	19.33	1,481,064.60	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	39.83	331,186.45	
	HESS CORP	22,081	63.15	1,394,415.15	
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	45.88	647,366.80		

KINDER MORGAN INC	167,254	20.41	3,413,654.14
MARATHON OIL CORP	74,537	12.88	960,036.56
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	47.81	2,759,593.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	19.31	585,305.41
NOBLE ENERGY INC	38,291	22.46	860,015.86
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	45.58	3,491,063.36
ONEOK INC	34,074	70.91	2,416,187.34
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	16.42	336,199.50
PHILLIPS 66	38,115	98.76	3,764,237.40
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	128.22	1,853,420.10
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	22.43	221,832.70
SCHLUMBERGER	114,004	34.10	3,887,536.40
TARGA RESOURCES CORP	20,002	35.36	707,270.72
TECHNIPFMC PLC	36,005	24.31	875,281.55
VALERO ENERGY CORP	35,352	79.70	2,817,554.40
WILLIAMS COS	98,155	23.56	2,312,531.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,039	228.57	4,123,174.23
ALBEMARLE CORP	8,647	64.92	561,363.24
AMCOR PLC	138,214	10.11	1,397,343.54
AVERY DENNISON CORP	7,457	115.74	863,073.18
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	27.79	489,270.74
BALL CORP	27,142	79.74	2,164,303.08
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	112.49	1,243,351.97
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,157	48.72	835,889.04
CHEMOURS CO/THE	15,493	12.95	200,634.35
CORTEVA INC	64,411	30.57	1,969,044.27
CROWN HOLDINGS INC	10,321	67.14	692,951.94
DOW INC	65,790	45.60	3,000,024.00
DUPONT DE NEMOURS INC	61,822	67.43	4,168,657.46
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	66.54	789,031.32
ECOLAB INC	21,748	208.57	4,535,980.36
FMC CORP	12,118	86.21	1,044,692.78
FREEMONT-MCMORAN INC	112,473	9.25	1,040,375.25
INT'L PAPER CO	33,803	39.32	1,329,133.96
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	113.14	981,376.36
LINDE PLC	46,307	189.11	8,757,116.77
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,636	74.88	1,620,103.68
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	255.38	1,274,090.82
MOSAIC CO/THE	31,911	19.98	637,581.78
NEWMONT GOLDCORP CORP	69,458	38.13	2,648,433.54
NUCOR CORP	24,279	49.91	1,211,764.89
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	102.48	911,047.20

PPG INDUSTRIES INC	19,958	111.62	2,227,711.96
SEALED AIR CORP	14,689	42.73	627,660.97
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,827	528.44	3,607,659.88
STEEL DYNAMICS INC	18,273	28.27	516,577.71
VULCAN MATERIALS CO	10,740	142.36	1,528,946.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	62.88	217,250.40
WESTROCK CO	21,244	33.98	721,871.12
3 M COMPANY	47,704	162.95	7,773,366.80
ACUITY BRANDS INC	3,505	125.00	438,125.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	52.60	595,958.00
ALLEGION PLC	7,435	96.55	717,849.25
AMETEK INC	19,001	86.70	1,647,386.70
ARCONIC INC	36,550	25.03	914,846.50
BOEING CO	44,649	333.78	14,902,943.22
CATERPILLAR	48,214	117.36	5,658,395.04
CUMMINS INC	12,585	149.04	1,875,668.40
DEERE&CO	24,967	152.39	3,804,721.13
DOVER CORP	12,008	91.24	1,095,609.92
EATON CORP	35,051	79.14	2,773,936.14
EMERSON ELECTRIC CO	50,287	58.55	2,944,303.85
FASTENAL CO	46,922	30.66	1,438,628.52
FLOWSERVE CORP	10,826	42.68	462,053.68
FLUOR CORP	11,267	17.47	196,834.49
FORTIVE CORP	25,813	70.08	1,808,975.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	51.18	655,615.80
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	187.59	3,943,329.39
GENERAL ELECTRIC CO	720,575	8.67	6,247,385.25
GRAINGER (WW) INC	3,976	275.39	1,094,950.64
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	37.73	574,476.98
HEICO CORP	3,640	142.44	518,481.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	108.89	702,231.61
HONEYWELL INTL INC	61,318	165.86	10,170,203.48
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	208.24	733,421.28
IDEX CORP	6,916	165.55	1,144,943.80
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	153.03	4,289,124.84
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	118.57	2,409,579.54
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	83.99	1,010,063.74
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	53.00	1,065,300.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	32.51	666,455.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	64,767	42.64	2,761,664.88
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,859	213.05	4,017,909.95
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	257.27	742,223.95

LOCKHEED MARTIN CORP	21,338	380.47	8,118,468.86
MASCO CORP	24,547	38.82	952,914.54
MIDDLEBY CORP	4,364	110.79	483,487.56
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,442	370.08	4,974,615.36
OWENS CORNING	7,979	57.21	456,478.59
PACCAR INC	30,075	64.88	1,951,266.00
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	165.34	1,874,955.60
PENTAIR PLC	13,583	36.73	498,903.59
RAYTHEON COMPANY	23,520	179.19	4,214,548.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	153.24	1,610,705.64
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	362.37	3,159,866.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.64	617,281.92
SMITH (A.O.) CORP	12,146	46.60	566,003.60
SNAP-ON INC	4,900	149.01	730,149.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	73.74	625,388.94
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	136.28	1,803,529.52
TEXTRON	18,220	45.20	823,544.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	537.58	2,189,025.76
UNITED RENTALS INC	6,446	110.64	713,185.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	68,767	126.64	8,708,652.88
WABCO HOLDINGS INC	3,841	132.40	508,548.40
WABTEC CORP	11,163	68.10	760,200.30
XYLEM INC	16,060	76.90	1,235,014.00
CINTAS CORP	7,153	267.82	1,915,716.46
COPART INC	17,540	76.18	1,336,197.20
COSTAR GROUP INC	3,008	617.82	1,858,402.56
EQUIFAX INC	10,799	144.00	1,555,056.00
IHS MARKIT LTD	32,775	65.40	2,143,485.00
MANPOWER GROUP	5,123	85.70	439,041.10
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	20.72	569,882.88
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	90.35	1,667,951.35
ROBERT HALF INTL INC	9,566	55.76	533,400.16
ROLLINS INC	10,546	33.25	350,654.50
TRANSUNION	15,344	83.65	1,283,525.60
VERISK ANALYTICS INC	13,480	158.29	2,133,749.20
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	93.25	2,145,496.00
WASTE MANAGEMENT INC	34,799	120.02	4,176,575.98
AMERCO	602	352.20	212,024.40
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	26.10	258,912.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	84.31	965,180.88
CSX CORP	64,710	65.29	4,224,915.90
DELTA AIR LINES INC	15,095	58.19	878,378.05

EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	71.72	989,951.16
FEDEX CORP	20,310	158.31	3,215,276.10
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	99.51	709,904.34
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	122.08	1,067,345.44
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	34.37	367,759.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	174.37	3,978,077.18
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	165.84	869,830.80
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	50.64	580,587.60
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	34.61	545,072.89
UNION PACIFIC CORP	60,776	168.76	10,256,557.76
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	83.89	503,591.67
UNITED PARCEL SERVICE B	57,471	116.79	6,712,038.09
XPO LOGISTICS INC	10,037	68.08	683,318.96
APTIV PLC	20,863	83.56	1,743,312.28
AUTOLIV INC	6,639	66.19	439,435.41
BORGWARNER INC	15,953	32.52	518,791.56
FORD MOTOR COMPANY	315,578	9.03	2,849,669.34
GENERAL MOTORS CO	106,331	37.36	3,972,526.16
HARLEY-DAVIDSON	14,677	32.56	477,883.12
LEAR CORP	5,287	110.84	586,011.08
TESLA INC	10,812	226.83	2,452,485.96
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	28.58	330,013.26
DR HORTON INC	28,998	48.17	1,396,833.66
GARMIN LTD	9,564	78.19	747,809.16
HANESBRANDS INC	31,136	13.80	429,676.80
HASBRO INC	10,617	114.95	1,220,424.15
LEGGETT & PLATT INC	10,594	39.20	415,284.80
LENNAR CORP-CL A	23,545	50.03	1,177,956.35
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	178.67	1,513,692.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	114.07	577,422.34
NEWELL BRANDS INC	37,563	15.90	597,251.70
NIKE B	104,342	81.13	8,465,266.46
NVR INC	264	3,551.38	937,564.32
POLARIS INC	4,691	82.10	385,131.10
PULTE GROUP INC	21,959	32.51	713,887.09
PVH CORP	7,252	71.96	521,853.92
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	87.15	398,972.70
TAPESTRY INC	25,989	20.97	544,989.33
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	18.77	299,381.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	16.85	274,368.55
VF CORP	28,754	79.99	2,300,032.46
WHIRLPOOL CORP	5,324	135.32	720,443.68

ARAMARK	19,980	40.18	802,796.40
BLOCK H & R INC	16,984	27.68	470,117.12
CARNIVAL CORPORATION	35,126	45.74	1,606,663.24
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,041	820.31	1,674,252.71
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	119.57	1,199,406.67
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	232.02	801,165.06
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	93.46	2,198,459.58
LAS VEGAS SANDS CORP	28,379	54.67	1,551,479.93
MARRIOTT INTL A	23,516	130.57	3,070,484.12
MCDONALD'S CORP	63,604	218.78	13,915,283.12
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	20.71	365,780.02
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	28.77	1,284,753.12
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.35	915,981.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	107.76	1,496,247.60
STARBUCKS CORP	104,538	96.66	10,104,643.08
VAIL RESORTS INC	3,574	240.99	861,298.26
WYNN RESORTS LTD	8,052	112.41	905,125.32
YUM BRANDS INC	25,338	116.46	2,950,863.48
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,388	47.92	2,941,712.96
ALPHABET INC-CL A	24,947	1,200.44	29,947,376.68
ALPHABET INC-CL C	26,200	1,198.45	31,399,390.00
ALTICE USA INC- A	12,457	26.69	332,477.33
CBS CORP-CL B	28,628	44.22	1,265,930.16
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	388.42	5,294,941.44
COMCAST CORP-CL A	375,711	44.00	16,531,284.00
DISCOVERY INC - A	12,804	28.42	363,889.68
DISCOVERY INC-C	23,672	26.60	629,675.20
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	32.59	593,724.62
ELECTRONIC ARTS INC	26,819	90.91	2,438,115.29
FACEBOOK INC-A	198,937	186.17	37,036,101.29
FOX CORP - CLASS A	30,270	33.87	1,025,244.90
FOX CORP- CLASS B	12,152	33.60	408,307.20
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	249.79	1,589,663.56
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	20.48	692,920.32
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	101.26	877,215.38
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.34	408,691.44
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	25.99	1,202,583.29
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	41.01	766,599.93
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.02	624,857.66
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.53	258,743.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	71.47	903,166.39
NETFLIX INC	36,840	309.38	11,397,559.20

NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.99	468,371.21
OMNICOM GROUP	19,030	78.06	1,485,481.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.18	800,340.90
SNAP INC - A	57,914	16.16	935,890.24
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	129.86	1,240,422.72
THE WALT DISNEY CO	149,862	135.29	20,274,829.98
TRIPADVISOR INC	10,393	38.74	402,624.82
TWITTER INC	61,378	41.70	2,559,462.60
VIACOM INC-CLASS B	31,895	26.23	836,605.85
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	36.01	358,731.62
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	136.35	843,461.10
AMAZON.COM	34,845	1,816.12	63,282,701.40
AUTOZONE INC	2,085	1,095.50	2,284,117.50
BEST BUY COMPANY INC	19,308	66.26	1,279,348.08
BOOKING HOLDINGS INC	3,774	1,943.73	7,335,637.02
BURLINGTON STORES INC	6,004	167.82	1,007,591.28
CARMAX INC	14,253	85.97	1,225,330.41
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	138.10	3,083,773.00
DOLLAR TREE INC	19,630	96.20	1,888,406.00
EBAY	71,876	40.39	2,903,071.64
EXPEDIA GROUP INC	9,733	130.80	1,273,076.40
GAP	21,891	16.67	364,922.97
GENUINE PARTS CO	12,722	90.35	1,149,432.70
GRUBHUB INC	8,261	60.90	503,094.90
HOME DEPOT	94,028	207.95	19,553,122.60
KOHL'S CORP	14,645	48.20	705,889.00
L BRANDS INC	19,499	20.23	394,464.77
LKQ CORP	24,693	26.31	649,672.83
LOWES COMPANIES	67,906	95.05	6,454,465.30
MACY'S INC	25,926	16.13	418,186.38
MERCADOLIBRE INC	3,727	603.35	2,248,685.45
NORDSTROM INC	10,094	26.10	263,453.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,459	385.77	2,491,688.43
QURATE RETAIL INC	35,071	12.12	425,060.52
ROSS STORES INC	31,827	104.09	3,312,872.43
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	86.58	3,622,160.88
TIFFANY & CO	9,326	82.09	765,571.34
TJX COMPANIES INC	103,117	51.55	5,315,681.35
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,497	101.21	961,191.37
ULTA BEAUTY INC	4,911	325.25	1,597,302.75
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	112.06	596,943.62
COSTCO WHOLESALE CORP	36,546	275.61	10,072,443.06

DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	7.28	246,792.00
KROGER CO	68,147	22.99	1,566,699.53
SYSCO CORP	39,742	73.60	2,925,011.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	51.16	3,448,542.12
WALMART INC	120,721	113.81	13,739,257.01
ALTRIA GROUP INC	158,456	46.70	7,399,895.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	38.03	1,817,757.94
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	58.49	1,289,119.60
BUNGE LIMITED	11,767	55.01	647,302.67
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	43.19	607,769.68
COCA-COLA CO	337,999	54.69	18,485,165.31
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	55.11	941,058.36
CONAGRA BRANDS INC	39,943	30.04	1,199,887.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	201.80	2,828,832.40
GENERAL MILLS INC	50,246	55.20	2,773,579.20
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	157.77	1,975,438.17
HORMEL FOODS CORP	23,465	41.21	966,992.65
INGREDION INC	5,835	76.65	447,252.75
JM SMUCKER CO	9,442	116.26	1,097,726.92
KELLOGG CO	21,051	64.43	1,356,315.93
KRAFT HEINZ CO/THE	53,058	25.71	1,364,121.18
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	70.12	906,230.88
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	168.56	1,681,554.56
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	52.50	792,750.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	54.56	6,669,087.04
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	57.80	2,019,069.60
PEPSICO INC	116,806	132.57	15,484,971.42
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,717	85.01	11,112,252.17
TYSON FOODS INC	24,363	87.47	2,131,031.61
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	79.69	1,694,528.16
CLOROX COMPANY	10,995	162.13	1,782,619.35
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,386	73.08	4,997,648.88
COTY INC-CL A	30,534	9.19	280,607.46
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,860	201.65	3,601,469.00
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	142.74	4,199,839.02
PROCTER & GAMBLE CO	208,359	120.24	25,053,086.16
ABBOTT LABORATORIES	146,242	85.56	12,512,465.52
ABIOMED INC	3,502	192.31	673,469.62
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	177.62	1,112,611.68
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	87.75	1,127,324.25
ANTHEM INC	21,803	273.41	5,961,158.23
BAXTER INTERNATIONAL	40,492	87.87	3,558,032.04

BECTON DICKINSON & CO	22,592	251.48	5,681,436.16
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,205	42.74	4,966,601.70
CARDINAL HEALTH	25,252	43.48	1,097,956.96
CENTENE CORP	35,914	47.44	1,703,760.16
CERNER CORP	25,778	71.83	1,851,633.74
CIGNA CORP	31,405	162.98	5,118,386.90
CVS HEALTH CORP	107,326	61.39	6,588,743.14
DANAHER CORP	52,355	141.71	7,419,227.05
DAVITA INC	11,875	56.97	676,518.75
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	53.53	954,654.02
DEXCOM INC	7,827	163.59	1,280,418.93
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	222.50	3,969,177.50
HCA HEALTHCARE INC	22,986	124.61	2,864,285.46
HENRY SCHEIN INC	12,492	62.12	776,003.04
HOLOGIC INC	24,459	50.60	1,237,625.40
HUMANA INC	11,247	298.57	3,358,016.79
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	279.53	2,014,013.65
INTUITIVE SURGICAL INC	9,453	495.50	4,683,961.50
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	168.62	1,488,408.74
MCKESSON CORP	16,655	145.96	2,430,963.80
MEDTRONIC PLC	111,529	104.18	11,619,091.22
QUEST DIAGNOSTICS	10,084	102.08	1,029,374.72
RESMED INC	12,398	136.00	1,686,128.00
STERIS PLC	7,229	153.21	1,107,555.09
STRYKER CORP	28,121	218.64	6,148,375.44
TELEFLEX INC	3,697	369.84	1,367,298.48
THE COOPER COS INC	4,135	335.38	1,386,796.30
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,049	244.71	19,588,790.79
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	148.20	1,074,153.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	108.71	895,444.27
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,212	158.10	1,614,517.20
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	273.36	1,203,604.08
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	138.56	2,402,907.52
ABBVIE INC	124,089	66.56	8,259,363.84
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	71.75	1,965,017.25
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	112.68	2,146,328.64
ALKERMES PLC	12,547	22.08	277,037.76
ALLERGAN PLC	27,804	159.25	4,427,787.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	82.20	608,197.80
AMGEN	52,414	206.00	10,797,284.00
BEIGENE LTD-ADR	2,369	148.29	351,299.01
BIOGEN INC	16,410	235.72	3,868,165.20

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	77.41	1,253,422.72
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,033	47.46	6,408,666.18
CELGENE CORP	59,466	95.22	5,662,352.52
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	23,667	29.81	705,513.27
EXACT SCIENCES CORP	10,748	118.16	1,269,983.68
GILEAD SCIENCES INC	107,207	64.11	6,873,040.77
ILLUMINA INC	12,074	288.65	3,485,160.10
INCYTE CORP	16,120	84.52	1,362,462.40
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	70.00	786,520.00
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	156.72	2,234,043.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	135.75	674,813.25
JOHNSON & JOHNSON	222,390	132.25	29,411,077.50
LILLY (ELI) & CO	75,567	112.53	8,503,554.51
MERCK & CO	215,219	86.19	18,549,725.61
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,025	675.51	1,367,907.75
MYLAN NV	42,644	19.19	818,338.36
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	17.87	241,370.09
PERKINELMER INC	9,475	82.69	783,487.75
PERRIGO CO PLC	11,333	47.07	533,444.31
PFIZER	463,115	35.18	16,292,385.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	298.38	2,065,087.98
SEATTLE GENETICS INC	9,601	79.39	762,223.39
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	6.71	541,429.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,612	279.52	9,395,226.24
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	187.09	4,047,505.06
WATERS CORP	5,663	209.87	1,188,493.81
ZOETIS INC	40,026	126.75	5,073,295.50
BANK OF AMERICA CORP	764,204	27.27	20,839,843.08
BB&T CORP	64,191	46.96	3,014,409.36
CIT GROUP INC	7,038	42.35	298,059.30
CITIGROUP	197,425	64.31	12,696,401.75
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	32.95	1,318,329.50
COMERICA INC	14,360	62.07	891,325.20
EAST WEST BANCORP INC	13,827	39.91	551,835.57
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	25.92	1,508,984.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	92.17	1,301,993.42
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	13.10	1,122,185.30
JPMORGAN CHASE & CO	272,920	108.69	29,663,674.80
KEY CORP	87,033	16.54	1,439,525.82
M & T BANK CORP	10,559	149.19	1,575,297.21
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	14.64	537,580.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,675	128.36	4,835,963.00

REGIONS FINL CORP	83,851	14.26	1,195,715.26
SIGNATURE BANK	4,354	120.27	523,655.58
SUNTRUST BANKS	38,353	61.36	2,353,340.08
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	195.71	859,166.90
US BANCORP	125,767	52.67	6,624,147.89
WELLS FARGO & CO	358,909	45.25	16,240,632.25
ZIONS BANCORPORATION	15,186	40.88	620,803.68
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	76.71	340,055.43
ALLY FINANCIAL INC	36,028	30.98	1,116,147.44
AMERICAN EXPRESS	59,335	124.40	7,381,274.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	128.03	1,517,155.50
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	20.53	465,907.82
BANK NEW YORK CO	71,617	42.72	3,059,478.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	108,603	200.94	21,822,686.82
BLACKROCK INC	9,909	425.56	4,216,874.04
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	86.97	3,437,054.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	120.33	1,139,525.10
CME GROUP INC	29,546	216.70	6,402,618.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,947	80.88	2,179,473.36
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	41.51	876,193.08
EATON VANCE CORP	10,061	40.01	402,540.61
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	277.43	904,421.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.29	711,450.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	202.20	5,687,886.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,352	92.85	4,396,633.20
INVESCO LTD	30,943	15.71	486,114.53
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	18.86	484,815.16
KKR & CO INC -A	36,859	24.71	910,785.89
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	368.91	1,184,938.92
MOODY'S CORP	14,012	217.53	3,048,030.36
MORGAN STANLEY	108,193	40.37	4,367,751.41
MSCI INC	6,854	230.31	1,578,544.74
NASDAQ INC	9,070	99.42	901,739.40
NORTHERN TRUST CORP	17,320	88.51	1,532,993.20
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	109.62	2,199,634.92
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,370	76.93	720,834.10
S&P GLOBAL INC	20,750	260.68	5,409,110.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	37.70	3,839,556.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	57.17	617,550.34
STATE STREET CORP	32,349	50.89	1,646,240.61
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	33.46	1,776,558.70
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	43.79	1,024,861.16

VOYA FINANCIAL INC	10,581	50.24	531,589.44
AFLAC	61,401	52.68	3,234,604.68
ALLEGHANY CORP	1,276	765.67	976,994.92
ALLSTATE CORP	27,449	103.99	2,854,421.51
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	100.56	705,227.28
AMERICAN INT'L GROUP	72,339	54.81	3,964,900.59
AON PLC	20,104	194.30	3,906,207.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	40.07	1,384,458.57
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	90.54	1,355,564.88
ASSURANT INC	4,769	123.79	590,354.51
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	39.42	526,138.74
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	35.60	370,809.60
CHUBB LTD	38,690	155.74	6,025,580.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	110.55	1,372,257.15
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	223.43	483,949.38
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	249.92	837,981.76
FNF GROUP	24,961	44.24	1,104,274.64
GLOBE LIFE INC	8,473	87.70	743,082.10
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	59.12	1,874,695.20
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	54.29	965,819.10
LOEWS CORP	22,051	49.19	1,084,688.69
MARKEL CORP	1,132	1,147.30	1,298,743.60
MARSH & MCLENNAN COS	42,543	98.61	4,195,165.23
METLIFE INC	67,515	45.77	3,090,161.55
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	53.88	1,247,591.40
PROGRESSIVE CORP	48,681	77.91	3,792,736.71
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,290	82.22	2,737,103.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	149.40	811,391.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	189.78	616,595.22
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	147.58	3,254,286.58
UNUM GROUP	18,574	26.96	500,755.04
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	197.46	2,158,237.80
WR BERKLEY CORP	11,169	73.02	815,560.38
CBRE GROUP INC-A	26,855	52.23	1,402,636.65
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.76	568,512.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	135.09	496,185.57
WEYERHAEUSER CO	62,107	25.18	1,563,854.26
ACCENTURE PLC-CL A	52,889	195.18	10,322,875.02
ADOBE INC	40,515	287.97	11,667,104.55
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	87.07	1,234,478.46
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	136.54	548,344.64
ANSYS INC	6,865	212.99	1,462,176.35

AUTODESK INC	18,213	146.18	2,662,376.34
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	168.96	6,216,545.28
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	128.25	1,237,612.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,471	69.60	1,563,981.60
CDK GLOBAL INC	10,687	44.82	478,991.34
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	108.77	1,174,824.77
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	92.51	1,050,173.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	61.86	2,991,735.18
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	115.57	358,267.00
DOCUSIGN INC	8,693	44.54	387,186.22
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	17.79	289,034.13
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	33.59	789,297.82
EPAM SYSTEMS INC	4,620	190.64	880,756.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	51,229	138.89	7,115,195.81
FISERV INC	48,231	107.75	5,196,890.25
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	297.59	2,170,026.28
FORTINET INC	12,963	81.16	1,052,077.08
GARTNER INC	6,845	131.21	898,132.45
GLOBAL PAYMENTS INC	12,737	159.48	2,031,296.76
GODADDY INC - CLASS A	14,919	64.17	957,352.23
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,826	135.04	10,104,503.04
INTUIT INC	21,392	274.23	5,866,328.16
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,623	141.53	795,823.19
LEIDOS HOLDINGS	10,999	85.08	935,794.92
MASTERCARD INC-CLASS A	76,003	278.07	21,134,154.21
MICROSOFT CORP	608,377	138.41	84,205,460.57
MONGODB INC	2,694	140.58	378,722.52
OKTA INC	8,635	125.84	1,086,628.40
ORACLE CORP	210,752	53.87	11,353,210.24
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	198.03	1,596,913.92
PAYCHEX INC	27,697	82.29	2,279,186.13
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	243.66	1,032,631.08
PAYPAL HOLDINGS INC	92,521	107.67	9,961,736.07
PTC INC	9,984	66.89	667,829.76
SABRE CORP	24,114	23.93	577,048.02
SALESFORCE.COM INC	71,988	143.67	10,342,515.96
SERVICENOW INC	14,979	255.51	3,827,284.29
SPLUNK INC	11,833	125.56	1,485,751.48
SQUARE INC - A	27,989	64.08	1,793,535.12
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,456	45.21	789,185.76
SYMANTEC CORP	49,346	23.85	1,176,902.10
SYNOPSYS INC	12,264	129.94	1,593,584.16

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	128.73	1,830,283.14
TWILIO INC - A	8,003	125.61	1,005,256.83
VERISIGN INC	8,673	206.90	1,794,443.70
VISA INC-CLASS A SHARES	145,818	179.74	26,209,327.32
VMWARE INC-CLASS A	6,787	144.18	978,549.66
WESTERN UNION CO	38,757	21.39	829,012.23
WIX.COM LTD	3,961	145.19	575,097.59
WORKDAY INC-CLASS A	12,522	187.64	2,349,628.08
AMPHENOL CORPORATION	24,183	88.20	2,132,940.60
APPLE INC	393,573	210.35	82,788,080.55
ARISTA NETWORKS INC	4,324	223.47	966,284.28
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	68.49	456,554.34
CDW CORP/DE	12,482	114.31	1,426,817.42
CISCO SYSTEMS	366,517	48.50	17,776,074.50
COGNEX CORP	16,230	45.20	733,596.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	11.28	168,444.24
CORNING	66,228	27.89	1,847,098.92
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	49.05	681,304.50
F5 NETWORKS INC	5,350	129.68	693,788.00
FLEX LTD	40,465	10.02	405,459.30
FLIR SYSTEMS INC	11,686	47.67	557,071.62
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	13.11	1,469,696.55
HP INC	124,838	19.21	2,398,137.98
IPG PHOTONICS CORP	3,207	124.16	398,181.12
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	24.12	755,052.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	87.37	1,385,076.61
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	176.87	2,464,860.32
NETAPP INC	20,586	47.01	967,747.86
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	46.43	1,060,275.48
TE CONNECTIVITY LTD	28,434	90.91	2,584,934.94
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	37.98	783,223.56
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	57.25	1,349,783.25
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	28.36	474,122.48
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	205.18	943,828.00
AT&T INC	606,346	35.38	21,452,521.48
CENTURYLINK INC	83,301	11.53	960,460.53
SPRINT CORP	64,825	6.96	451,182.00
T-MOBILE US INC	28,273	78.23	2,211,796.79
VERIZON COMMUNICATIONS	343,914	57.00	19,603,098.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	33.83	517,226.87
AES CORP	52,646	15.36	808,642.56
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	51.98	1,000,926.88

AMEREN CORPORATION	21,002	76.97	1,616,523.94
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	90.55	3,750,762.10
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,482	123.99	1,795,623.18
ATMOS ENERGY CORP	9,385	110.88	1,040,608.80
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	28.11	1,202,883.12
CMS ENERGY CORP	24,527	61.57	1,510,127.39
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	88.14	2,423,321.16
DOMINION ENERGY INC	68,162	77.79	5,302,321.98
DTE ENERGY COMPANY	15,603	130.79	2,040,716.37
DUKE ENERGY CORP	59,862	90.67	5,427,687.54
EDISON INTL	26,212	72.65	1,904,301.80
ENERGY CORP	15,636	109.79	1,716,676.44
EVERGY INC	21,330	65.07	1,387,943.10
EVERSOURCE ENERGY	25,559	78.97	2,018,394.23
EXELON CORP	80,900	45.28	3,663,152.00
FIRSTENERGY CORP	43,246	45.13	1,951,691.98
NEXTERA ENERGY INC	39,605	218.96	8,671,910.80
NISOURCE INC	32,308	29.63	957,286.04
NRG ENERGY INC	26,737	35.46	948,094.02
OGE ENERGY CORP	15,686	43.16	677,007.76
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	94.96	894,143.36
PPL CORPORATION	59,613	29.45	1,755,602.85
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	41,036	58.55	2,402,657.80
SEMPRA ENERGY	23,257	139.64	3,247,607.48
SOUTHERN CO	88,512	57.94	5,128,385.28
UGI CORP	13,950	48.92	682,434.00
VISTRA ENERGY CORP	29,561	23.69	700,300.09
WEC ENERGY GROUP INC	25,529	91.36	2,332,329.44
XCEL ENERGY INC	41,786	62.15	2,596,999.90
ADVANCED MICRO DEVICES	78,474	31.48	2,470,361.52
ANALOG DEVICES	30,576	111.17	3,399,133.92
APPLIED MATERIALS	80,718	47.10	3,801,817.80
BROADCOM INC	32,856	278.78	9,159,595.68
INTEL CORP	374,310	47.23	17,678,661.30
KLA CORP	13,856	140.36	1,944,828.16
LAM RESEARCH CORP	12,864	208.05	2,676,355.20
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	25.17	1,377,730.29
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,730	54.69	1,188,413.70
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	90.05	1,867,997.20
MICRON TECHNOLOGY	95,275	45.01	4,288,327.75
NVIDIA CORP	47,691	170.78	8,144,668.98
NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	103.46	2,594,569.88

	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	18.01	648,287.96	
	QORVO INC	10,609	72.02	764,060.18	
	QUALCOMM	100,154	74.87	7,498,529.98	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	77.09	1,118,575.90	
	TEXAS INSTRUMENTS	78,827	124.60	9,821,844.20	
	XILINX INC	20,594	106.91	2,201,704.54	
	アメリカドル 小計	25,324,556		2,080,980,092.78	(221,936,526,894)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	11.50	330,153.50	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	31.64	3,269,297.92	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	11.00	1,063,326.00	
	ENBRIDGE	166,146	44.98	7,473,247.08	
	ENCANA CORP	138,637	5.90	817,958.30	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	9.22	289,867.58	
	IMPERIAL OIL	24,763	33.13	820,398.19	
	INTER PIPELINE LTD	30,317	24.77	750,952.09	
	KEYERA CORP	14,929	32.77	489,223.33	
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	49.64	2,098,580.64	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	16.78	307,913.00	
	SUNCOR ENERGY	134,430	38.08	5,119,094.40	
	TC ENERGY CORP	76,314	64.79	4,944,384.06	
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	13.04	260,343.60	
	VERMILION ENERGY INC	10,067	20.39	205,266.13	
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	77.97	1,673,158.23	
	BARRICK GOLD CORP	149,092	24.12	3,596,099.04	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	59.99	788,208.61	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	9.16	521,204.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	123.43	2,068,439.94	
	KINROSS GOLD CORP	107,615	6.23	670,441.45	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	58.83	1,002,051.39	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.05	376,570.15	
	METHANEX CORP	7,099	44.24	314,059.76	
	NUTRIEN LTD	51,428	66.91	3,441,047.48	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.29	1,018,140.33	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	48.25	208,777.75	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	35.13	1,294,118.94	
	BOMBARDIER B	151,366	1.70	257,322.20	
	CAE INC	25,999	34.38	893,845.62	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	17.14	252,180.82	
	WSP GLOBAL INC	9,471	71.77	679,733.67	
	THOMSON REUTERS CORP	16,142	90.00	1,452,780.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	124.28	7,602,704.72	

CP RAILWAY LIMITED	11,825	320.71	3,792,395.75
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	64.31	1,799,265.18
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	48.44	855,401.96
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	99.88	2,133,936.20
STARS GROUP INC/THE	11,841	18.87	223,439.67
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.11	457,672.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.85	929,229.95
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	134.55	727,780.95
DOLLARAMA INC	26,700	51.97	1,387,599.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	83.12	3,005,452.96
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	36.69	421,898.31
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	72.29	1,129,025.22
METRO INC	19,179	55.00	1,054,845.00
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	107.54	740,197.82
SAPUTO INC	20,412	42.10	859,345.20
AURORA CANNABIS INC	53,000	7.80	413,400.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	35.66	584,824.00
CRONOS GROUP INC	15,900	15.87	252,333.00
BANK MONTREAL	52,006	94.01	4,889,084.06
BANK NOVA SCOTIA	100,507	68.47	6,881,714.29
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	99.91	3,795,580.90
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	61.21	1,727,835.88
ROYAL BANK OF CANADA	120,650	100.46	12,120,499.00
TORONTO-DOMINION BANK	154,324	73.12	11,284,170.88
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,456	68.79	4,709,088.24
CI FINANCIAL CORP	18,671	19.05	355,682.55
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.47	272,586.95
ONEX CORP	6,603	76.70	506,450.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	585.18	1,348,839.90
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	28.36	674,627.68
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	55.89	459,974.70
INTACT FINANCIAL CORP	11,102	126.82	1,407,955.64
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,673	22.18	3,519,367.14
POWER CORP OF CANADA	29,774	27.56	820,571.44
POWER FINANCIAL CORP	20,740	27.96	579,890.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,943	53.33	2,610,130.19
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	22.13	275,850.45
BLACKBERRY LIMITED	39,400	9.28	365,632.00
CGI INC - CL A	21,192	104.78	2,220,497.76
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,261.02	2,144,995.02
OPEN TEXT CORP	24,643	51.59	1,271,332.37
SHOPIFY INC - CLASS A	8,392	481.62	4,041,755.04

	BCE INC	12,539	62.50	783,687.50
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	68.45	2,196,902.75
	TELUS CORP	16,454	48.46	797,360.84
	ALTAGAS INCOME LTD	16,590	19.02	315,541.80
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	46.73	244,911.93
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.05	392,828.20
	EMERA INC	4,086	57.19	233,678.34
	FORTIS INC	38,447	54.64	2,100,744.08
	HYDRO ONE LTD	32,299	24.35	786,480.65
	カナダドル 小計	3,348,325		153,255,180.76 (12,263,479,564)
ユーロ	ENI	211,297	13.27	2,804,756.37
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	12.70	506,310.90
	NESTE OIL OYJ	33,258	30.48	1,013,703.84
	OMV AG	12,139	45.19	548,561.41
	REPSOL SA	129,100	12.82	1,655,062.00
	TENARIS SA	40,648	9.84	400,138.91
	TOTAL SA	200,017	44.15	8,830,750.55
	VOPAK	6,360	43.92	279,331.20
	AIR LIQUIDE	36,297	123.45	4,480,864.65
	AKZO NOBEL	19,742	81.22	1,603,445.24
	ARCELORMITTAL	53,985	12.20	658,832.94
	ARKEMA	5,335	76.94	410,474.90
	BASF SE	77,211	57.97	4,475,921.67
	COVESTRO AG	12,178	38.85	473,115.30
	CRH PLC	71,124	29.03	2,064,729.72
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	22.09	297,198.86
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	31.74	182,885.88
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,833	61.14	723,469.62
	IMERYS SA	3,000	36.50	109,500.00
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	110.00	1,675,740.00
	LANXESS	7,293	51.70	377,048.10
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	26.88	525,907.20
	SOLVAY SA	6,906	89.44	617,672.64
	STORA ENSO OYJ R	47,237	9.86	465,756.82
	SYMRISE AG	11,581	82.00	949,642.00
	THYSSEN KRUPP	33,044	9.71	321,055.50
	UMICORE	17,605	27.21	479,032.05
	UPM KYMMENE OYJ	43,990	23.64	1,039,923.60
	VOESTALPINE AG	8,140	20.12	163,776.80
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	33.79	733,074.05
	AIRBUS SE	48,982	124.78	6,111,973.96

ALSTOM	13,816	38.42	530,810.72
ANDRITZ AG	5,242	32.34	169,526.28
BOUYGUES ORD	16,815	32.53	546,991.95
BRENTAG AG	11,626	41.34	480,618.84
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.40	781,418.40
DASSAULT AVIATION SA	213	1,213.00	258,369.00
EIFFAGE	6,079	90.82	552,094.78
FERROVIAL SA	39,067	25.42	993,083.14
GEA GROUP AG	13,382	23.43	313,540.26
HOCHTIEF AG	1,354	99.20	134,316.80
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	43.28	511,266.64
KION GROUP AG	5,887	42.48	250,079.76
KNORR-BREMSE AG	4,123	85.29	351,650.67
KONE OYJ-B	30,120	52.00	1,566,240.00
LEGRAND SA	21,794	62.22	1,356,022.68
LEONARDO SPA	35,425	10.17	360,449.37
METSO OYJ	9,561	32.81	313,696.41
MTU AERO ENGINES AG	4,753	243.20	1,155,929.60
PRYSMIAN SPA	15,651	18.36	287,352.36
SAFRAN SA	27,260	126.95	3,460,657.00
SAINT-GOBAIN	40,731	32.34	1,317,444.19
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,063	73.06	3,365,362.78
SIEMENS	63,023	87.23	5,497,496.29
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.26	214,439.66
THALES SA	9,665	103.10	996,461.50
VINCI S.A.	43,091	97.46	4,199,648.86
WARTSILA OYJ	34,386	10.89	374,635.47
BUREAU VERITAS SA	19,558	21.24	415,411.92
EDENRED	18,941	44.77	847,988.57
RANDSTAD NV	9,588	42.36	406,147.68
SOCIETE BIC SA	2,424	58.80	142,531.20
TELEPERFORMANCE	4,523	193.70	876,105.10
WOLTERS KLUWER	22,886	64.86	1,484,385.96
ADP	2,382	154.60	368,257.20
AENA SME SA	5,610	163.90	919,479.00
ATLANTIA SPA	42,039	23.79	1,000,107.81
BOLLORE	61,805	3.89	240,792.28
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	13.28	309,052.16
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	28.87	2,453,970.75
FRAPORT AG	3,561	74.88	266,647.68
GETLINK	36,478	12.58	458,893.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	60.36	1,747,180.56

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	49.18	245,457.38
CONTINENTAL AG	9,928	106.80	1,060,310.40
DAIMLER AG	74,100	41.97	3,109,977.00
FAURECIA	5,945	36.86	219,132.70
FERRARI NV	9,947	141.70	1,409,489.90
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	11.26	1,085,227.54
MICHELIN	13,447	93.50	1,257,294.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	26.25	270,165.00
PEUGEOT SA	52,883	19.36	1,024,079.29
PIRELLI & C SPA	39,097	4.60	180,198.07
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	55.88	783,884.64
RENAULT SA	17,362	49.19	854,123.59
VALEO SA	19,350	24.32	470,592.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	142.32	2,276,977.68
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	146.30	379,502.20
ADIDAS AG	15,081	259.50	3,913,519.50
ESSILORLUXOTTICA	23,316	128.55	2,997,271.80
HERMES INTERNATIONAL	2,600	613.20	1,594,320.00
HUGO BOSS AG	4,852	49.98	242,502.96
KERING	6,332	437.95	2,773,099.40
LVMH	23,422	356.85	8,358,140.70
MONCLER SPA	15,736	34.43	541,790.48
PUMA SE	7,720	66.40	512,608.00
SEB SA	2,075	138.40	287,180.00
ACCOR	17,931	38.57	691,598.67
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	71.16	508,295.88
SODEXO	8,135	102.30	832,210.50
AXEL SPRINGER SE	3,827	63.00	241,101.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	15.94	190,957.32
JC DECAUX SA	4,674	25.86	120,869.64
PUBLICIS GROUPE	17,601	42.69	751,386.69
RTL GROUP	3,513	42.04	147,686.52
SES	31,369	14.17	444,655.57
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	45.88	229,308.24
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	73.04	498,863.20
VIVENDI	77,307	25.67	1,984,470.69
DELIVERY HERO SE	8,671	44.97	389,934.87
INDITEX	93,820	26.61	2,496,550.20
ZALANDO SE	9,155	41.12	376,453.60
CARREFOUR	53,759	15.56	836,758.83
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	35.81	132,031.47
COLRUYT SA	4,160	46.01	191,401.60

JERONIMO MARTINS	20,234	14.71	297,642.14
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	20.83	2,046,705.39
METRO AG	13,712	14.38	197,178.56
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	64,009	86.57	5,541,259.13
DANONE (GROUPE)	52,307	80.54	4,212,805.78
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.99	339,782.74
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	88.25	944,363.25
HEINEKEN NV	22,649	94.66	2,143,954.34
KERRY GROUP PLC-A	13,146	107.50	1,413,195.00
PERNOD-RICARD	17,179	158.10	2,715,999.90
REMY COINTREAU	1,575	132.00	207,900.00
BEIERSDORF AG	9,190	110.50	1,015,495.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	79.15	682,114.70
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	87.00	1,369,032.00
LOREAL	21,190	237.60	5,034,744.00
UNILEVER NV	123,171	54.35	6,694,343.85
BIOMERIEUX	3,246	75.95	246,533.70
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	101.20	347,116.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	60.78	1,093,796.88
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	43.46	1,597,208.35
KONINKLIJKE PHILIPS	75,247	42.00	3,160,374.00
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	178.40	579,086.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	36.24	453,062.50
BAYER	78,314	66.30	5,192,218.20
EUROFINS SCIENTIFIC	971	391.00	379,661.00
GRIFOLS SA	27,685	28.94	801,203.90
IPSEN	2,722	96.00	261,312.00
MERCK KGAA	10,480	95.92	1,005,241.60
ORION OYJ-CLASS B	7,975	33.39	266,285.25
QIAGEN N.V.	21,801	31.48	686,295.48
RECORDATI SPA	7,493	39.06	292,676.58
SANOFI	94,252	77.24	7,280,024.48
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	138.20	415,152.80
UCB (GROUPE)	10,465	68.98	721,875.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.49	547,452.55
AIB GROUP PLC	70,200	2.44	171,568.80
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	4.26	2,373,836.63
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.77	343,206.18
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	3.54	4,848,595.88
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	3.29	276,360.00
BANKIA SA	110,053	1.64	181,037.18
BANKINTER SA	58,881	5.35	315,131.11

BNP PARIBAS	94,302	40.79	3,847,050.09
CAIXABANK	286,347	2.07	593,310.98
COMMERZBANK AG	80,494	5.05	406,897.17
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.28	954,333.52
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	30.50	840,580.00
FINECOBANK SPA	44,137	8.81	389,200.06
ING GROEP NV-CVA	332,029	8.49	2,819,590.26
INTESA SANPAOLO	1,286,795	1.91	2,463,182.98
KBC GROEP NV	19,349	52.40	1,013,887.60
MEDIOBANCA	53,990	8.60	464,314.00
NORDEA BANK ABP	3,480	5.54	19,286.16
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.12	251,298.80
SOCIETE GENERALE	63,719	22.38	1,426,031.22
UNICREDIT SPA	159,861	9.76	1,560,722.94
AMUNDI SA	4,764	55.45	264,163.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.32	1,019,472.85
DEUTSCHE BOERSE	15,674	129.85	2,035,268.90
EURAZEO SA	3,357	59.25	198,902.25
EXOR NV	10,345	58.56	605,803.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	81.80	511,004.60
NATIXIS	69,996	3.55	249,115.76
WENDEL	2,023	123.30	249,435.90
AEGON	166,267	3.63	604,214.27
AGEAS	16,065	48.10	772,726.50
ALLIANZ SE-REG	35,781	201.15	7,197,348.15
ASSICURAZIONI GENERALI	89,649	16.17	1,450,072.57
AXA	165,661	21.72	3,598,156.92
CNP ASSURANCES	11,830	16.92	200,163.60
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	146.50	689,429.00
MAPFRE SA	90,939	2.38	216,707.63
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	219.80	2,783,767.00
NN GROUP NV	27,631	30.91	854,074.21
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.50	437,332.50
SAMPO OYJ-A SHS	34,805	37.27	1,297,182.35
SCOR SE	13,354	37.06	494,899.24
AROUNDTOWN SA	59,250	7.25	430,036.50
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	30.79	893,187.11
VONOVIA SE	39,076	44.58	1,742,008.08
ADYEN NV	884	668.00	590,512.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	68.28	2,492,902.80
ATOS SE	7,634	67.34	514,073.56
CAPGEMINI SA	13,238	106.45	1,409,185.10

DASSAULT SYSTEMES SA	10,258	128.25	1,315,588.50
SAP SE	82,678	107.98	8,927,570.44
WIRECARD AG	9,864	141.00	1,390,824.00
WORLDLINE SA	7,022	63.20	443,790.40
INGENICO GROUP	4,681	88.14	412,583.34
NOKIA OYJ	489,813	4.71	2,307,019.23
1&1 DRILLISCH AG	3,773	24.60	92,815.80
CELLNEX TELECOM SA	16,559	35.99	595,958.41
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	14.98	4,186,465.20
ELISA A	11,722	45.50	533,351.00
ILIAD SA	2,053	95.06	195,158.18
KPN (KON.)	261,596	2.76	722,004.96
ORANGE	159,876	13.59	2,173,514.22
PROXIMUS	13,141	27.56	362,165.96
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.45	389,189.98
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	200,846.79
TELEFONICA	378,032	6.11	2,309,775.52
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.23	149,738.21
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	28.92	275,115.96
E.ON SE	183,255	8.40	1,539,525.25
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	10.78	536,402.76
ENAGAS	18,299	20.41	373,482.59
ENDESA	24,774	23.53	582,932.22
ENEL	681,211	6.35	4,331,820.74
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.36	794,554.98
ENGIE	146,155	13.63	1,992,092.65
FORTUM OYJ	38,328	20.79	796,839.12
IBERDROLA SA	501,523	9.29	4,663,160.85
INNOGY SE	11,000	43.84	482,240.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	23.92	553,269.60
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.82	706,440.40
RWE STAMM	42,828	25.55	1,094,255.40
SNAM SPA	163,694	4.53	743,007.06
SUEZ	28,043	13.67	383,488.02
TERNA SPA	130,230	5.51	718,088.22
UNIPER SE	14,751	27.64	407,717.64
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	22.04	1,008,153.68
VERBUND AG	7,463	54.10	403,748.30
ASML HOLDING NV	35,211	195.08	6,868,961.88
INFINEON TECHNOLOGIES	99,840	15.75	1,573,079.04
STMICROELECTRONICS	57,598	16.28	937,983.43
	16,221,884		312,185,971.41

ユーロ 小計				(36,900,381,820)
イギリスポンド	BP PLC	1,694,881	5.00	8,476,099.88
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	372,635	23.15	8,626,500.25
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	314,963	23.04	7,258,322.33
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	4.50	243,432.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	17.39	1,520,740.92
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.15	292,369.82
	BHP GROUP PLC	173,682	17.81	3,093,971.14
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	46.88	468,753.12
	EVRAZ PLC	43,000	5.03	216,290.00
	FRESNILLO PLC	17,743	6.52	115,684.36
	GLENCORE PLC	941,686	2.32	2,193,657.53
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,160	28.30	344,128.00
	MONDI PLC	34,071	15.62	532,359.37
	RIO TINTO PLC REG	94,151	40.65	3,827,238.15
	ASHTED GROUP PLC	42,021	21.24	892,526.04
	BAE SYSTEMS PLC	252,016	5.52	1,392,136.38
	BUNZL PLC	27,712	20.37	564,493.44
	DCC PLC	9,127	66.36	605,667.72
	FERGUSON PLC	19,208	60.30	1,158,242.40
	MEGGITT PLC	66,268	6.14	407,283.12
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.67	683,601.32
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.62	1,136,762.70
	SMITHS GROUP PLC	37,146	15.72	583,935.12
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	78.15	490,547.55
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	13.18	244,963.48
	EXPERIAN PLC	74,903	25.34	1,898,042.02
	G4S PLC	132,555	1.71	227,530.65
	INTERTEK GROUP PLC	12,722	55.22	702,508.84
	RELX PLC	163,442	19.47	3,183,032.95
	RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.58	723,235.13
	EASYJET PLC	11,633	9.22	107,256.26
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.26	604,088.87
	BURBERRY GROUP PLC	35,328	21.17	747,893.76
	PERSIMMON PLC	26,389	18.62	491,363.18
	TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.46	395,611.35
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	38.76	410,817.24
	CARNIVAL PLC	13,721	35.92	492,858.32
	COMPASS GROUP PLC	136,301	20.58	2,805,074.58
	GVC HOLDINGS PLC	42,500	5.79	246,330.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	51.85	831,725.85
	MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.53	295,089.23

TUI AG-DI	37,945	7.77	294,984.43
WHITBREAD PLC	9,395	42.15	395,999.25
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.24	419,572.44
INFORMA PLC	100,899	8.50	857,843.29
ITV PLC	295,435	1.09	324,239.91
PEARSON	66,305	8.23	545,822.76
WPP PLC	113,065	9.59	1,084,519.48
KINGFISHER PLC	170,994	1.94	332,070.34
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.85	251,251.02
NEXT PLC	11,202	57.06	639,186.12
OCADO GROUP PLC	38,762	12.04	466,694.48
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.82	305,987.50
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.88	279,388.97
TESCO	856,393	2.19	1,881,495.42
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.99	663,146.55
BRITISH AMERICAN TOBACCO	188,994	30.36	5,738,802.81
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.15	487,614.00
DIAGEO	204,601	34.46	7,050,550.46
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	21.11	1,757,718.17
RECKITT BENCKISER PLC	57,878	61.93	3,584,384.54
UNILEVER PLC	93,214	50.91	4,745,524.74
NMC HEALTH PLC	9,509	19.00	180,671.00
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	19.16	1,361,232.45
ASTRAZENECA	105,675	72.81	7,694,196.75
GLAXOSMITHKLINE	409,921	16.64	6,823,544.96
BARCLAYS	1,471,691	1.40	2,069,197.54
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,663,075	6.03	10,039,983.77
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.49	2,980,483.32
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	1.84	730,335.06
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.18	1,444,081.49
3I GROUP PLC	79,251	10.82	857,495.82
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	19.15	517,587.25
INVESTEC PLC	54,280	4.11	223,579.32
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	69.28	1,821,786.88
SCHRODERS PLC	8,614	27.25	234,731.50
ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.37	419,307.50
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.42	468,828.69
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.75	353,546.25
AVIVA PIC	348,023	3.63	1,265,063.60
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.99	340,007.85
LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.27	1,113,311.80
PRUDENTIAL	217,306	13.99	3,040,110.94

	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.28	456,920.64
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	15.97	464,342.44
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.95	621,316.87
	HALMA PLC	32,374	19.60	634,530.40
	BT GROUP PLC	730,298	1.67	1,222,372.79
	VODAFONE GROUP PLC	2,170,686	1.50	3,262,975.19
	CENTRICA PLC	440,558	0.66	292,089.95
	NATIONAL GRID PLC	283,108	8.67	2,457,094.33
	SEVERN TRENT PLC	18,112	20.42	369,847.04
	SSE PLC	93,277	11.13	1,038,173.01
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.97	469,588.86
	イギリスポンド 小計	25,074,895		146,907,296.31 (18,999,520,631)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.62	306,552.76
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	584.00	392,448.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,610.00	2,121,930.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	46.94	1,893,277.96
	SIKA AG-BR	10,500	139.70	1,466,850.00
	ABB LTD	153,407	18.30	2,807,348.10
	GEBERIT AG-REG	3,021	437.30	1,321,083.30
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	209.40	309,702.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	210.30	792,410.40
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	51.70	683,680.80
	SGS SA	437	2,389.00	1,043,993.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	140.75	713,180.25
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	75.18	3,363,853.92
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	265.10	658,243.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.44	194,694.72
	DUFREY AG-REG	2,548	77.82	198,285.36
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,938.00	310,080.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,400.00	643,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,425.00	772,200.00
	NESTLE SA - REGISTERED	254,925	109.08	27,807,219.00
	ALCON INC	37,545	60.40	2,267,718.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	227.50	1,161,160.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	784.60	611,203.40
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	348.30	2,266,388.10
	NOVARTIS	180,050	87.89	15,824,594.50
	ROCHE HOLDING GENUSS	58,319	274.70	16,020,229.30
	VIFOR PHARMA AG	3,601	157.00	565,357.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	205,591	11.20	2,302,619.20
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	38.15	807,902.55

	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	69.30	235,412.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	792.40	1,181,468.40	
	UBS GROUP AG	314,000	10.26	3,223,210.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	181.10	702,124.70	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	471.90	1,391,633.10	
	SWISS RE LTD	26,239	99.52	2,611,305.28	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,661	351.20	4,446,543.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	97.20	610,124.40	
	TEMENOS AG - REG	5,252	162.05	851,086.60	
	SWISSCOM	2,064	488.20	1,007,644.80	
	スイスフラン 小計	1,455,910		105,887,958.10 (11,505,785,527)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	287.90	4,085,588.90	
	BOLIDEN AB	15,315	200.45	3,069,891.75	
	ALFA LAVAL AB	25,639	174.05	4,462,467.95	
	ASSA ABLOY AB-B	79,507	215.60	17,141,709.20	
	ATLAS COPCO A	59,675	275.00	16,410,625.00	
	ATLAS COPCO B	36,538	249.10	9,101,615.80	
	EPIROC AB-A	53,833	99.74	5,369,303.42	
	EPIROC AB-B	29,972	95.34	2,857,530.48	
	SANDVIK AB	100,730	135.55	13,653,951.50	
	SKANSKA B	28,530	177.35	5,059,795.50	
	SKF AB-B	28,335	148.20	4,199,247.00	
	VOLVO B	125,906	129.80	16,342,598.80	
	SECURITAS B	22,844	144.35	3,297,531.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	225.70	4,100,969.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.22	2,911,916.64	
	HENNES & MAURITZ B	61,513	174.82	10,753,702.66	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	483.80	2,772,174.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	374.20	5,668,755.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	47,331	293.30	13,882,182.30	
	NORDEA BANK ABP	250,593	59.50	14,910,283.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	83.40	11,568,414.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	85.26	11,628,270.36	
	SWEDBANK AB-A	80,216	125.75	10,087,162.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	199.00	2,545,608.00	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	441.00	17,833,158.00	
	KINNEVIK AB - B	18,104	250.40	4,533,241.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	359.60	2,617,888.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	81.20	21,822,906.00	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	442.70	9,519,820.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	483.80	2,996,657.20	

	TELE2 AB-B SHS	38,012	143.75	5,464,225.00	
	TELIA CO AB	235,437	41.52	9,775,344.24	
	スウェーデンクローナ 小計	2,062,041		270,444,535.80 (2,980,298,784)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	235.90	2,432,364.90	
	EQUINOR ASA	80,907	148.70	12,030,870.90	
	NORSK HYDRO	106,150	26.87	2,852,250.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	374.00	5,037,780.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	246.20	1,716,260.20	
	MOWI ASA	40,968	226.90	9,295,639.20	
	ORKLA	69,804	78.98	5,513,119.92	
	DNB ASA	80,217	148.65	11,924,257.05	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	169.90	3,155,722.60	
	TELENOR ASA	60,821	184.80	11,239,720.80	
	ノルウェークローネ 小計	488,193		65,197,986.07 (774,552,074)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	545.60	4,953,502.40	
	NOVOZYMES A/S	17,687	279.20	4,938,210.40	
	VESTAS WIND SYSEMS	15,201	508.60	7,731,228.60	
	ISS A/S	14,253	167.60	2,388,802.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	7,070.00	2,113,930.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,462.00	3,790,696.00	
	DSV A/S	14,436	635.20	9,169,747.20	
	PANDORA A/S	8,431	233.10	1,965,266.10	
	CARLSBERG AS-B	9,692	982.00	9,517,544.00	
	COLOPLAST-B	9,476	835.20	7,914,355.20	
	DEMANT A/S	7,420	203.90	1,512,938.00	
	GENMAB A/S	4,888	1,373.00	6,711,224.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	266.00	1,295,686.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	144,978	344.00	49,872,432.00	
	DANSKE BANK A/S	59,378	91.80	5,450,900.40	
	TRYG A/S	9,828	202.00	1,985,256.00	
ORSTED A/S	15,908	678.00	10,785,624.00		
	デンマーククローネ 小計	346,333		132,097,343.10 (2,093,742,888)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	25.83	532,847.07	
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.50	772,076.50	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.14	1,182,348.30	
	SANTOS	156,437	6.72	1,051,256.64	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.18	258,566.34	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	31.73	2,652,310.70	
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	13.78	476,732.88	

ALUMINA LIMITED	170,458	2.19	373,303.02
BHP GROUP LTD	242,659	36.25	8,796,388.75
BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	11.18	551,487.04
BORAL LIMITED	81,732	5.00	408,660.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	7.66	1,031,618.16
INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.17	477,398.83
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.54	842,162.02
NEWCREST MINING LIMITED	59,949	35.17	2,108,406.33
ORICA LTD	29,211	21.15	617,812.65
RIO TINTO LTD	32,522	84.96	2,763,069.12
SOUTH32 LTD	408,172	2.82	1,151,045.04
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	31.41	289,600.20
BRAMBLES LTD	129,297	12.78	1,652,415.66
SEEK LTD	26,358	19.11	503,701.38
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.80	925,024.60
TRANSURBAN GROUP	220,227	14.85	3,270,370.95
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	28.46	1,501,321.92
CROWN RESORTS LTD	30,328	11.37	344,829.36
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	41.88	231,303.24
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	43.69	142,560.47
TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.42	737,459.32
REA GROUP LTD	3,593	102.86	369,575.98
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.57	206,394.91
WESFARMERS LTD	91,047	38.22	3,479,816.34
COLES GROUP LTD	93,277	13.20	1,231,256.40
WOOLWORTHS GROUP LTD	103,697	35.35	3,665,688.95
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.47	482,981.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.54	1,023,897.50
COCHLEAR LIMITED	4,811	217.79	1,047,787.69
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	69.75	854,298.00
SONIC HEALTHCARE LTD	32,669	27.75	906,564.75
CSL LIMITED	38,043	229.52	8,731,629.36
AUST AND NZ BANKING GROUP	233,463	26.72	6,238,131.36
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	8.96	318,976.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.76	456,589.84
COMMONWEALTH BANK OF AUST	146,133	76.29	11,148,486.57
NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	27.22	6,471,854.42
WESTPAC BANKING	288,399	28.03	8,083,823.97
AMP LTD	244,230	1.78	434,729.40
ASX LTD	15,814	84.55	1,337,073.70
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	6.70	295,255.60
MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	122.22	3,277,573.74

	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.70	1,612,033.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.36	720,760.32	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.09	1,367,294.37	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.13	1,351,352.73	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	14.84	658,539.84	
	TELSTRA CORP	342,339	3.77	1,290,618.03	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.60	207,735.00	
	AGL ENERGY LTD	51,344	18.92	971,428.48	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.75	211,003.65	
	オーストラリアドル 小計	5,865,828		104,099,227.99 (7,503,472,353)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	4.45	341,065.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.60	815,520.00	
	A2 MILK CO LTD	66,854	16.23	1,085,040.42	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.97	726,762.76	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.19	479,021.23	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.04	587,613.96	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.67	516,240.48	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,551,264.65 (311,078,938)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	69.95	16,368,020.20	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	13.80	2,249,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	56.45	6,717,550.00	
	MTR CORP	112,000	49.25	5,516,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	22.05	1,510,425.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	167,000	49.05	8,191,350.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.28	825,216.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	36.75	7,452,900.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.40	823,200.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.73	1,020,360.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	16.90	2,379,520.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	37.75	2,416,000.00	
	WH GROUP LTD	699,000	6.49	4,536,510.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	21.55	2,352,398.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	27.40	8,494,000.00	
	HANG SENG BANK	68,000	174.20	11,845,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,400	252.80	24,369,920.00	
	AIA GROUP LTD	1,015,800	78.25	79,486,350.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	55.05	11,890,579.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.96	3,107,080.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	39.35	4,927,721.80		
HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	34.55	2,038,450.00		

	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	28.90	1,864,050.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.38	5,101,770.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.74	3,702,796.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	128,500	119.20	15,317,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	81.85	3,314,925.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	27.85	2,679,170.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	17.90	1,628,900.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	47.50	4,512,500.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	47.75	3,103,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.37	1,560,090.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	56.10	2,805,000.00	
	CLP HOLDINGS	128,500	83.10	10,678,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	16.92	15,185,767.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	54.50	6,049,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	93.55	2,217,135.00	
	香港ドル 小計	7,395,184		288,239,454.48 (3,920,056,580)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.92	664,816.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.24	239,680.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	4.11	447,990.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.01	201,899.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.53	421,245.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	8.92	386,530.36	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.79	245,248.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.89	380,375.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.08	264,368.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.36	300,564.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.29	121,510.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.82	682,252.00	
	DBS GROUP	156,300	24.75	3,868,425.00	
	OCBC BANK	264,200	10.71	2,829,582.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,300	25.15	2,597,995.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.17	508,991.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.46	647,366.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.19	286,728.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.19	341,525.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.23	391,411.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.19	2,129,143.17	
	シンガポールドル 小計	3,493,876		17,957,643.53 (1,380,942,787)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	16.97	1,149,819.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	551.30	804,898.00	

BANK HAPOALIM BM	84,067	26.46	2,224,412.82
BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	25.11	3,531,847.05
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.10	1,502,450.00
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	85.17	698,394.00
AZRIELI GROUP	4,323	269.40	1,164,616.20
NICE LTD	4,894	536.50	2,625,631.00
イスラエルシェケル 小計	410,855		13,702,068.39 (414,487,568)
合 計	92,054,146		320,984,326,408 (320,984,326,408)

(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	943,182.63	
		LENDLEASE GROUP	44,009	660,575.09	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	741,345.00	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,345,102.72 (169,035,004)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,711,080.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,777,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,488,580.00 (88,244,688)	
投資信託受益証券合計			818,940	257,279,692 (257,279,692)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	755,425.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,461,795.30	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,095	8,353,423.05	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	112,760	1,017,095.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,437,061.43	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,744,820.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	941,282.68	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,765	5,036,057.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,027	2,116,966.91	
		DUKE REALTY CORP	29,929	1,006,512.27	
		EQUINIX INC	6,911	3,840,650.03	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	993,601.15	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,588,548.98	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,808,429.07	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	1,228,297.32	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	791,909.15			

	HCP INC	41,014	1,420,314.82	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,082,666.91	
	INVITATION HOMES INC	38,000	1,086,040.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,669	786,941.10	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	669,900.44	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	624,201.60	
	MACERICH CO/THE	10,128	294,623.52	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,293,240.21	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	783,839.14	
	PROLOGIS INC	53,238	4,464,538.68	
	PUBLIC STORAGE	12,831	3,349,660.86	
	REALTY INCOME CORP	24,440	1,793,651.60	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	938,032.83	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	2,443,027.44	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,938	3,889,662.48	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	638,745.06	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,080,592.80	
	UDR INC	24,799	1,184,152.25	
	VENTAS INC	30,413	2,229,881.16	
	VEREIT INC	77,798	750,750.70	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	944,792.10	
	WELLTOWER INC	31,753	2,839,353.26	
	WP CAREY INC	13,017	1,154,347.56	
	アメリカドル 小計	990,897	71,864,832.86 (7,664,384,424)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	213,304.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	412,808.50	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	180,473.55	
	カナダドル 小計	30,576	806,586.85 (64,543,079)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	337,763.20	
	GECINA SA	4,459	630,056.70	
	ICADE	2,845	226,035.25	
	KLEPIERRE	17,225	473,343.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,840	1,324,648.00	
	ユーロ 小計	38,947	2,991,846.15 (353,636,214)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	385,316.72	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	439,944.70	
	SEGRO PLC	82,202	622,597.94	
	イギリスポンド 小計	220,166	1,447,859.36 (187,251,651)	

オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,214,701.90
	GOODMAN GROUP	140,271	2,073,205.38
	GPT GROUP	136,015	837,852.40
	MIRVAC GROUP	306,089	964,180.35
	SCENTRE GROUP	486,663	1,863,919.29
	STOCKLAND	207,412	925,057.52
	VICINITY CENTERS	291,115	719,054.05
オーストラリアドル 小計		1,661,655	8,597,970.89 (619,741,741)
香港ドル	LINK REIT	179,500	16,890,950.00
香港ドル 小計		179,500	16,890,950.00 (229,716,920)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	600,400.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	505,440.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	526,789.00
	SUNTEC REIT	173,000	330,430.00
シンガポールドル 小計		813,800	1,963,059.00 (150,959,237)
投資証券合計		3,935,541	9,270,233,266 (9,270,233,266)
合計			9,527,512,958 (9,527,512,958)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 611銘柄	96.7%			67.1%
	投資証券 39銘柄			3.3%	2.3%
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	99.1%			11.2%
	投資証券 5銘柄			0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	99.0%			5.7%
	投資証券 3銘柄			1.0%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			0.9%

ノルウェークロネ	株式	10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククロネ	株式	17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	90.5%			2.3%
	投資信託受 益証券	3銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券	7銘柄			7.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	37銘柄	92.5%			1.2%
	投資信託受 益証券	2銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券	1銘柄			5.4%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	90.1%			0.4%
	投資証券	4銘柄			9.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	677,153,241
コール・ローン	3,013,637,233
国債証券	378,547,953,169
派生商品評価勘定	60,052,059
未収入金	537,873
未収利息	2,041,088,798
前払費用	272,207,122
差入委託証拠金	288,762,468
流動資産合計	384,901,391,963
資産合計	384,901,391,963
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	575,474
前受金	39,442,599
未払解約金	126,839,453
未払利息	6,502

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	9
流動負債合計	166,864,037
負債合計	166,864,037
純資産の部	
元本等	
元本	138,036,622,052
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	246,697,905,874
元本等合計	384,734,527,926
純資産合計	384,734,527,926
負債純資産合計	384,901,391,963

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2019年 8月20日現在
	(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 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,036,622,052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 2.7872円 (1万口当たり純資産額) (27,872円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	93,887,447,277円
期中追加設定元本額	60,454,845,514円

区分	2019年 8月20日現在
期中一部解約元本額	16,305,670,739円
期末元本額	138,036,622,052円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,770,282,068円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	716,131,176円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	481,639,875円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,017,571,731円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,884,921円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,159,710,143円
世界経済インデックスファンド	6,643,330,696円
DCマイセレクション25	1,665,668,010円
DCマイセレクション50	1,271,804,048円
DCマイセレクション75	813,924,480円
DC外国債券インデックス・オープン	1,886,585,283円
DCマイセレクションS25	675,674,012円
DCマイセレクションS50	519,646,540円
DCマイセレクションS75	233,377,496円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	50,974,567円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	66,401,911円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	31,671,728円
DC世界経済インデックスファンド	5,780,792,511円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	621,171,527円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	41,993,548円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,776,276円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,021,753円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	49,508,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	102,626,939円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	174,775,873円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	158,276,498円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	418,918,989円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,155,007,557円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	608,003,302円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,162,681,601円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	877,265,148円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	86,401,545円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	615,256,731円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	35,527,524円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	237,568,711円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	295,994,614円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	978,728,657円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,059,419,831円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	838,905,195円

区分	2019年 8月20日現在
外国債券ファンド・シリーズ1	471,117,761円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,396,130,836円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,652,743,627円
分散投資コア戦略ファンドA	1,394,855,175円
分散投資コア戦略ファンドS	3,493,829,944円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,503,618円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,665,351,099円
コア投資戦略ファンド（切替型）	633,079,220円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,054,142円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,518,575円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,081,479,582円
S M T インデックスバランス・オープン	234,060,069円
外国債券 S M T B セレクション（S M A 専用）	24,424,639,577円
S M T 世界経済インデックス・オープン	68,615,493円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	93,221,731円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	127,647,845円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,295,170円
グローバル経済コア	962,705,130円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	5,781,688円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	75,575円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	196,196,006円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,410,328円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	16,800円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	22,219円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	27,638円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	32,515円
F O F s 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）	842,122,207円
F O F s 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）	11,568,976,832円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	351,169,707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）	40,426,040,188円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	15,788,801,687
合計	15,788,801,687

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

(2019年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,370,938,469	-	2,410,381,068	39,442,599
合計		2,370,938,469	-	2,410,381,068	39,442,599

(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 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,796,923,614	-	2,816,957,600	20,033,986
	アメリカドル	1,422,015,949	-	1,438,409,700	16,393,751
	カナダドル	113,712,846	-	114,271,300	558,454
	ユーロ	1,076,675,756	-	1,076,893,100	217,344
	イギリスポンド	184,519,063	-	187,383,500	2,864,437
合計		2,796,923,614	-	2,816,957,600	20,033,986

(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	6,450,488.26	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,718,269.56	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,957,910.15	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,775,390.63	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,479,287.10	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,507,166.02	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,937,890.60	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,957,890.68	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,463,818.39	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,671,425.76	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,977,539.05	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,488,769.52	
		T 1.375% 09/30/20	15,970,000.00	15,910,112.50	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,962,812.48	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,977,617.18	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,498,417.98	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,802,742.16	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,001,093.76	
		T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,975,976.60	
		T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,157,718.81	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,141,449.23	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,516,542.96	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,310,057.81	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,024,414.05	
		T 1.625% 07/31/20	24,000,000.00	23,967,656.16	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,509,472.65	
		T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,054,492.15	
		T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,493,554.72	
		T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,048,867.21	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,201,257.81	
		T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,047,974.61	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,614,587.90	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,514,648.45	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,609,314.47	
		T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,273,062.52	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,825,234.39	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,664,062.50			
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,613,044.89			

T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,051,953.16	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,413,135.97	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,227,314.47	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,206,648.47	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,124,662.14	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,209,128.89	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,100,781.28	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,521,777.35	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,551,347.67	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,549,193.38	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,096,679.71	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,044,218.76	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,822,251.91	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,441,554.67	
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,026,757.80	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,020,390.64	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,351,316.42	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,607,546.91	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,399,843.72	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,577,343.75	
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,137,406.25	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,944,562.51	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,166,957.01	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,524,882.84	
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,423,117.23	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,246,562.48	
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	13,011,364.03	
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,755,097.61	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,430,764.04	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,130,468.76	
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,398,015.64	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,388,410.20	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,080,321.30	
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,190,625.00	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,537,529.31	
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,516,210.90	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,039,257.82	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,988,855.51	
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	19,861,500.09	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,536,003.92	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,533,003.95	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,587,000.00	

T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,413,402.41
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,865,214.81
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,722,875.00
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,438,867.15
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,641,503.93
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,365,359.44
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	19,866,210.93
T 2.375% 05/15/29	13,040,000.00	13,943,631.30
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,028,808.62
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,104,628.92
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,343,945.35
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,571,441.42
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,258,984.40
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,986,164.08
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	7,926,203.12
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	17,924,414.14
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,193,332.05
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	3,034,238.27
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	17,378,750.08
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,727,201.16
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,112,500.00
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	19,186,171.92
T 2.625% 02/15/29	15,000,000.00	16,353,515.70
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,453,976.56
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,679,902.38
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,765,563.25
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,462,531.25
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,415,429.68
T 2.625% 07/31/20	12,700,000.00	12,801,203.12
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,546,835.96
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,126,113.24
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	12,045,800.81
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,792,675.82
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,164,296.89
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,366,062.55
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,939,328.14
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,914,062.60
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,217,773.49
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,285,703.14
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,254,589.83
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,400,781.25
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	11,357,769.58
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,382,191.38

T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,226,826.15
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,254,433.61
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,759,781.25
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	10,337,503.95
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,737,890.60
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,756,186.00
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	13,310,351.62
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,530,789.03
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,180,216.38
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,627,668.82
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,677,210.99
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,010,322.27
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,593,095.67
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,181,796.94
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,612,304.66
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,595,607.40
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,530,371.10
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,207,656.28
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,618,203.10
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,022,187.52
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,230,078.10
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,827,535.14
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,191,250.00
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,750,605.49
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,211,273.44
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,043,710.93
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,632,964.81
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,860,562.50
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,015,332.05
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,705,617.18
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,425,687.51
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,533,785.98
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,522,665.99
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,031,953.12
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,224,148.43
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,828,812.50
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	6,021,484.40
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,438,296.87
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,761,539.08
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	14,506,875.00
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	16,287,750.00
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,911,171.87

T	3.375%	05/15/44	6,610,000.00	8,308,460.18	
T	3.375%	11/15/48	8,300,000.00	10,668,742.22	
T	3.5%	02/15/39	3,930,000.00	4,965,616.42	
T	3.625%	02/15/21	11,100,000.00	11,423,677.77	
T	3.625%	02/15/44	7,500,000.00	9,788,085.97	
T	3.625%	08/15/43	2,000,000.00	2,604,375.00	
T	3.75%	08/15/41	2,000,000.00	2,631,406.26	
T	3.75%	11/15/43	12,500,000.00	16,599,609.37	
T	3.875%	08/15/40	3,150,000.00	4,202,789.06	
T	3%	02/15/48	4,450,000.00	5,329,222.67	
T	3%	02/15/49	14,970,000.00	18,001,425.00	
T	3%	05/15/42	2,950,000.00	3,482,382.81	
T	3%	05/15/45	3,500,000.00	4,157,070.33	
T	3%	05/15/47	7,750,000.00	9,260,644.57	
T	3%	08/15/48	11,950,000.00	14,337,199.27	
T	3%	09/30/25	15,000,000.00	16,277,929.65	
T	3%	10/31/25	10,000,000.00	10,861,328.10	
T	3%	11/15/44	6,050,000.00	7,168,777.37	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	1,250,367.19	
T	4.25%	11/15/40	4,350,000.00	6,093,398.43	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,399,218.75	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	2,696,960.94	
T	4.375%	05/15/41	2,650,000.00	3,781,632.81	
T	4.375%	11/15/39	2,700,000.00	3,819,445.32	
T	4.5%	02/15/36	3,840,000.00	5,336,100.01	
T	4.5%	05/15/38	1,600,000.00	2,275,625.00	
T	4.5%	08/15/39	1,700,000.00	2,438,968.75	
T	4.625%	02/15/40	8,700,000.00	12,710,835.98	
T	4.75%	02/15/41	2,950,000.00	4,403,566.42	
T	5.0%	05/15/37	1,100,000.00	1,635,648.44	
T	5.25%	02/15/29	1,250,000.00	1,653,125.00	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,708,789.06	
T	5.375%	02/15/31	3,300,000.00	4,592,929.70	
T	5.5%	08/15/28	1,200,000.00	1,593,375.00	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	2,167,699.22	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	1,961,011.72	
T	6.25%	05/15/30	1,900,000.00	2,767,617.19	
T	6.25%	08/15/23	1,650,000.00	1,953,703.12	
T	8.0%	11/15/21	1,700,000.00	1,939,726.57	
アメリカドル 小計			1,611,470,000.00	1,708,615,740.63 (182,223,868,738)	
カナダドル	CAN	0.5%	03/01/22	3,100,000.00	3,036,605.00
	CAN	0.75%	03/01/21	5,690,000.00	5,630,425.70

CAN 0.75% 09/01/20	5,320,000.00	5,276,056.80	
CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,667,829.50	
CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	462,272.40	
CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,227,488.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,344,827.00	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	608,391.00	
CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,064,560.00	
CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,716,294.50	
CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,942,577.60	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,486,410.00	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,402,016.50	
CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	4,020,343.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,140,966.40	
CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,241,136.70	
CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,102,521.10	
CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,789,978.50	
CAN 2.75% 12/01/64	790,000.00	1,152,222.90	
CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,286,076.40	
CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,171,095.05	
CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,122,005.90	
CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,096,908.00	
CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,813,087.60	
CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,842,452.70	
CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	4,043,880.75	
CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,074,738.10	
CAN 5.75% 06/01/33	1,880,000.00	2,937,584.60	
CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,641,553.20	
CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,782,131.75	
カナダドル 小計	81,350,000.00	91,124,436.65 (7,291,777,420)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,256,062.75
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,229,826.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	35,652,555.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,220,858.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	63,590,000.00	63,014,192.55
	MBONO 7.25% 12/09/21	25,330,000.00	25,437,652.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	55,608,832.20
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,208,936.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,133,402.30
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,527,287.30
	MBONO 8.5% 05/31/29	29,250,000.00	32,241,690.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	26,786,089.45

	MBONO 8% 09/05/24	18,970,000.00	19,837,877.50
	MBONO 8% 11/07/47	18,970,000.00	20,147,657.60
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,597,692.50
	メキシコペソ 小計	509,770,000.00	530,900,612.45 (2,850,936,288)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,287,846.00
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,408,844.55
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,361,500.50
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,425,525.05
	BGB 0.8% 06/22/28	3,160,000.00	3,499,068.00
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,287,890.60
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,003,909.50
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	980,000.00
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,917,151.50
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,647,068.75
	BGB 1.9% 06/22/38	1,330,000.00	1,746,828.65
	BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,244,901.75
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,699,471.65
	BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,525,270.00
	BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,975,090.30
	BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,203,924.00
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,836,536.60
	BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,919,896.00
	BGB 3.75% 09/28/20	3,270,000.00	3,433,336.50
	BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,216,846.60
	BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	6,164,825.25
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,602,507.50
	BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,814,968.85
	BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,250,253.60
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,493,653.50
	BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,418,585.00
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,229,366.90
	BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,354,822.20
	BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	3,001,366.00
	BTPS 0.05% 04/15/21	7,190,000.00	7,185,901.70
	BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,393,620.95
	BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,585,340.60
	BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,407,336.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,217,665.50
	BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,563,461.75
	BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,220,481.40
	BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,539,270.00
	BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,573,742.50

BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,479,638.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,971,264.75	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,971,151.50	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,358,006.00	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,080,649.50	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,334,814.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	2,990,883.45	
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,730,068.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	5,250,000.00	5,272,181.25	
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,163,520.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,093,830.00	
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,655,386.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,101,655.25	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,605,350.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,780,595.50	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,778,763.50	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,816,478.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,712,850.00	
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,234,824.00	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,209,496.75	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,908,608.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,264,750.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	1,943,332.05	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,435,328.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,237,963.30	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,758,792.75	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,332,101.50	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,226,562.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,171,177.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	3,390,000.00	4,037,998.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	3,114,822.15	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,661,055.65	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,015,992.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,787,680.75	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,533,839.35	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,445,936.75	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	2,961,532.80	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,404,626.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,405,555.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,479,441.20	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,446,604.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,861,101.00	

BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,309,489.50
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,540,210.80
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	4,267,542.30
BTPS 4% 02/01/37	5,470,000.00	7,050,747.95
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,582,182.00
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,265,186.00
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,458,225.20
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,909,405.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,986,958.00
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,785,136.85
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,365,402.00
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,867,546.75
BTPS 5% 08/01/34	3,690,000.00	5,189,154.75
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	5,860,094.70
BTPS 6.5% 11/01/27	5,620,000.00	7,931,365.50
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,016,640.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,986,117.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,071,672.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,690,000.00	5,075,353.85
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,832,095.15
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,533,297.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,087,685.55
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,456,550.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,458,308.50
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,142,923.25
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,260,700.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,379,773.00
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,730,387.20
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,225,338.25
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,559,086.45
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,012,996.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,853,032.50
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,633,420.75
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,512,688.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,489,219.40
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,800,729.75
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,077,637.25
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,039,722.00
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,669,644.80
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	9,052,264.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,533,821.50
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,311,865.25
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,991,290.65

DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,766,138.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,060,000.00	7,295,414.00
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	5,260,180.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,839,547.75
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,477,282.40
DBR 4.75% 07/04/40	3,210,000.00	6,751,625.10
DBR 5.5% 01/04/31	3,900,000.00	6,734,890.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,826,997.40
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,643,550.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,185,287.50
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,035,706.75
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,063,900.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,202,521.00
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,368,682.75
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	11,192,064.00
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,605,920.00
FRTR 0.75% 05/25/28	8,430,000.00	9,331,799.25
FRTR 0.75% 11/25/28	8,510,000.00	9,440,994.00
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,072,180.00
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,326,480.00
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,634,355.40
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,625,836.40
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,158,302.00
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,680,147.50
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,708,933.25
FRTR 1.25% 05/25/36	6,420,000.00	7,690,068.60
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,637,713.80
FRTR 1.5% 05/25/50	2,760,000.00	3,548,835.60
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,040,187.20
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,654,843.10
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,288,097.40
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,865,773.45
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,453,885.25
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,955,460.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,699,297.00
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,310,642.10
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,404,874.20
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,660,424.50
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,373,175.00
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,882,576.80
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,717,129.85
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,823,299.25

FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,277,898.60
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,246,911.25
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,407,358.00
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,598,000.00
FRTR 4.5% 04/25/41	6,640,000.00	12,741,462.80
FRTR 4.75% 04/25/35	4,200,000.00	7,374,339.00
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	6,131,397.50
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,439,735.00
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,502,302.00
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,417,832.50
FRTR 5.75% 10/25/32	5,410,000.00	9,707,000.70
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,699,016.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,349,705.00
IRISH 0.8% 03/15/22	2,040,000.00	2,117,438.40
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,876,323.15
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,367,744.70
IRISH 1.1% 05/15/29	910,000.00	1,015,332.50
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	892,179.60
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,020,433.95
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,043,708.55
IRISH 1.7% 05/15/37	940,000.00	1,143,665.10
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,227,812.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,630,000.00	2,052,096.65
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,969,917.00
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,740,928.35
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,501,779.30
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,149,054.55
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	245,328.35
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	3,055,377.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,727,072.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,457,900.80
NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,845,123.50
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	5,041,029.30
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,852,991.50
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,574,515.00
NETHER 0% 01/15/24	3,410,000.00	3,537,704.50
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,260,428.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,814,886.30
NETHER 2.5% 01/15/33	2,430,000.00	3,400,335.45
NETHER 2.75% 01/15/47	2,680,000.00	4,844,126.80
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,436,517.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,162,422.25
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,682,906.00

NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,539,696.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,860,000.00	5,054,520.90	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,744,564.80	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	258,464.00	
OBL 0.25% 10/16/20	5,010,000.00	5,074,178.10	
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,155,116.00	
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,515,570.75	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,299,087.50	
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,596,148.35	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,651,870.00	
OBL 0% 10/13/23	2,930,000.00	3,047,273.25	
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	1,004,908.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	780,000.00	848,031.60	
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,273,197.50	
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,179,615.60	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,633,552.50	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,547,407.50	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,127,841.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,912,464.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,130,000.00	1,513,194.30	
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	962,569.60	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,104,993.55	
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,582,106.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,944,590.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,133,854.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,330,000.00	2,309,890.80	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,905,113.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,365,658.05	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,587,800.60	
RAGB 3.8% 01/26/62	640,000.00	1,497,033.60	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,581,033.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,905,534.20	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	201,862.05	
RFGB 0.375% 09/15/20	1,330,000.00	1,346,598.40	
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,259,183.25	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,137,806.25	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	729,569.70	
RFGB 0.5% 09/15/29	430,000.00	468,749.45	
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	978,602.10	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	755,884.65	
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	868,619.25	
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,508,559.60	

RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	920,103.80
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	742,027.00
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	705,627.00
RFGB 1.625% 09/15/22	1,430,000.00	1,538,873.05
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,478,210.00
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,189,776.20
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	678,978.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	857,876.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,450,552.75
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,630,780.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,760,794.50
SPGB 0.25% 07/30/24	450,000.00	462,561.75
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,919,838.90
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,363,213.60
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,937,794.25
SPGB 0.6% 10/31/29	1,160,000.00	1,215,227.60
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,256,188.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,598,898.20
SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	6,993,206.15
SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,626,703.00
SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,396,903.50
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,918,058.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,416,716.75
SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,425,967.35
SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,900,362.70
SPGB 1.95% 04/30/26	4,820,000.00	5,496,896.70
SPGB 1.95% 07/30/30	3,650,000.00	4,351,511.75
SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,856,779.65
SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,489,835.10
SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,317,263.60
SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,099,006.00
SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	5,028,139.90
SPGB 3.45% 07/30/66	1,850,000.00	3,228,361.00
SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,955,317.60
SPGB 4.2% 01/31/37	3,350,000.00	5,399,580.25
SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,111,326.25
SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,121,240.45
SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	7,158,447.90
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,756,761.25
SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,205,347.75
SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	6,000,802.50
SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,765,586.40
SPGB 5.15% 10/31/44	2,400,000.00	4,726,356.00

	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,849,180.10
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,596,508.10
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,311,827.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,954,100.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,942,748.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,640,824.50
	ユーロ 小計	1,002,570,000.00	1,216,623,547.50 (143,804,903,314)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,749,396.05
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,013,435.10
	UKT 0.875% 10/22/29	510,000.00	527,082.45
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,223,155.00
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,165,068.40
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,418,057.50
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,590,897.20
	UKT 1.625% 10/22/28	5,750,000.00	6,345,757.50
	UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,562,610.35
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,515,018.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,480,000.00	1,740,776.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,391,410.00
	UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,539,961.00
	UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,595,762.00
	UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,174,285.55
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,687,525.00
	UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,474,467.10
	UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,740,974.25
	UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,386,283.90
	UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,885,868.30
	UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,201,028.00
	UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,195,512.10
	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,767,814.40
	UKT 3.75% 09/07/20	8,060,000.00	8,331,742.90
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,025,869.90
	UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,553,318.20
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,318,755.00
	UKT 4.25% 09/07/39	2,450,000.00	3,925,818.75
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	881,418.50
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,963,814.00
UKT 4.25% 12/07/46	3,950,000.00	6,950,953.25	
UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,975,168.75	
UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,424,775.30	
UKT 4.5% 09/07/34	3,170,000.00	4,851,098.55	

	UKT 4.5% 12/07/42	3,910,000.00	6,743,361.95	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,955,936.05	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,192,399.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,884,424.00	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,127,840.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,134,775.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,884,131.25	
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	840,436.50	
イギリスポンド 小計		136,690,000.00	180,858,182.00 (23,390,388,678)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,292,029.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,446,493.55	
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	18,238,659.75	
	SGB 1% 11/12/26	11,970,000.00	13,339,846.80	
	SGB 2.5% 05/12/25	11,460,000.00	13,556,549.70	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,460,000.00	14,036,451.30	
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,699,832.55	
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	20,291,942.80	
スウェーデンクローナ 小計		100,120,000.00	115,901,805.65 (1,277,237,898)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,678,913.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	7,460,000.00	7,840,049.70	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	6,025,185.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,140,000.00	5,454,953.50	
	NGB 2% 04/26/28	5,730,000.00	6,178,257.90	
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,904,688.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	16,040,000.00	16,776,476.60	
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,818,386.25	
ノルウェークローネ 小計		71,020,000.00	74,676,910.65 (887,161,698)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,534,890.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	19,322,021.70	
	DGB 0.5% 11/15/29	4,930,000.00	5,521,994.40	
	DGB 1.5% 11/15/23	13,990,000.00	15,446,359.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	13,107,992.90	
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	14,110,394.40	
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	49,903,273.00	
デンマーククローネ 小計		94,460,000.00	126,946,925.40 (2,012,108,767)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,810,000.00	7,850,143.40	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,796,122.35	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,033,954.10	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,066,737.00	

	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,748,674.05
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	7,109,752.45
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,000,000.00	6,439,170.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,460,000.00	2,660,022.60
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,617,629.60
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,752,915.05
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,819,342.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,110,000.00	3,252,671.25
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	810,945.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,048,614.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,706,697.00
	ポーランドズロチ 小計	75,720,000.00	79,713,389.85 (2,156,247,195)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	1,450,000.00	1,530,598.25
	ACGB 1.75% 11/21/20	6,310,000.00	6,383,511.50
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,436,540.35
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,069,386.50
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,540,000.00	4,096,364.10
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,633,851.70
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	998,408.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,753,487.45
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,597,550.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	4,700,000.00	5,452,470.00
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,242,730.00
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,800,430.40
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,672,668.20
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,960,985.95
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,570,000.00	2,091,137.95
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,232,119.60
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,303,273.20
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,791,815.85
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,805,174.75
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,290,476.20
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,697,420.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,268,215.80
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,104,422.35
	オーストラリアドル 小計	88,360,000.00	103,213,038.10 (7,439,595,786)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	981,104.85
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	801,596.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	781,361.10
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	871,228.75
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,605,852.30

	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	731,710.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	652,689.45	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	278,551.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,120,922.25	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,521,557.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	830,000.00	951,657.25	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,663,544.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	613,950.40	
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	741,214.30	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	415,184.45	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,146,612.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,086,756.20	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,060,000.00	1,256,269.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,335,418.00	
	SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,115,499.00	
	シンガポールドル 小計	18,510,000.00	19,672,678.80	(1,512,828,999)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,517,650.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,726,730.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,747,696.10	
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,718,339.15	
	MGS 3.659% 10/15/20	2,360,000.00	2,374,584.80	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,342,627.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	356,693.75	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,232.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,228,019.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	3,124,564.95	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,635.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	500,000.00	515,697.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,510,867.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,174,216.90	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,052,277.05	
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,702,738.20	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,800,737.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,086,520.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,973,872.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,194,812.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,770,115.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,616,262.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,157,200.00	
MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,535,247.00		
MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,369,966.20		

	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,340,580.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,694,962.50	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,490,000.00	1,749,498.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,480,000.00	2,880,234.80	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	950,180.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,884,412.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,728,280.80	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	686,757.00	
	マレーシアリングット 小計	65,080,000.00	68,803,207.85 (1,753,793,768)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	43,600,000.00	48,479,058.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,851,088.80	
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,188,207.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,705,778.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,754,176.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,650,165.35	
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	23,518,028.95	
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	23,974,557.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,880,078.90	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	39,419,955.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	19,712,775.00	
	SAGB 8% 01/31/30	29,930,000.00	27,723,560.40	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,331,646.50	
	南アフリカランド 小計	307,740,000.00	282,189,075.40 (1,947,104,620)	
	合計		378,547,953,169 (378,547,953,169)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	48.1%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 299銘柄	100.0%	38.0%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%

デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	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%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,017,223,865
コール・ローン	42,860,092
株式	49,479,038,371
投資信託受益証券	175,242,835
投資証券	147,168,040
派生商品評価勘定	5,500,987
未収入金	1,608,728
未収配当金	156,650,878
前払金	125,570,243
差入委託証拠金	367,519,467
流動資産合計	52,518,383,506
資産合計	52,518,383,506
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	130,995,392
未払金	1,426,822
未払解約金	3,640,229
未払利息	92
流動負債合計	136,062,535
負債合計	136,062,535
純資産の部	
元本等	
元本	20,402,768,336
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,979,552,635
元本等合計	52,382,320,971
純資産合計	52,382,320,971

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	52,518,383,506

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2019年 8月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,402,768,336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 2.5674円 (1万口当たり純資産額) (25,674円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2019年 8月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	17,830,347,012円
期中追加設定元本額	3,644,921,610円
期中一部解約元本額	1,072,500,286円
期末元本額	20,402,768,336円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,173,986,952円
世界経済インデックスファンド	3,313,279,937円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,134,827,459円
DC 世界経済インデックスファンド	2,889,295,803円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	208,621,180円
分散投資コア戦略ファンドA	149,789,331円
分散投資コア戦略ファンドS	370,745,935円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	407,609,115円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	447,482,063円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	362,568,851円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,046,896円
SMT インデックスバランス・オープン	119,162,216円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,183,758円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	205,515,846円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	30,064,138円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,277,303円
グローバル経済コア	482,930,100円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	15,698,445円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	26,252円

区分	2019年 8月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	29,706円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,160円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	36,269円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	21,557,621円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	911,029,622
投資信託受益証券	7,748,947
投資証券	4,343,254
合計	914,435,315

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 8月20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	3,091,880,018	-	2,966,309,775	125,570,243
	合計	3,091,880,018	-	2,966,309,775	125,570,243

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2019年 8月20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	437,303,969	-	437,376,973	73,004

	アメリカドル	437,303,969	-	437,376,973	73,004
	売建	192,969	-	190,135	2,834
	ブラジルリアル	192,969	-	190,135	2,834
	合計	437,496,938	-	437,567,108	75,838

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	507,578	6.73	3,417,015.09	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	104,000	0.92	95,680.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	38,742	78.28	3,032,723.76	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	8,617	187.60	1,616,549.20	
	ROSNEFT OJSC-GDR	103,060	6.05	623,513.00	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	160,402	3.83	615,622.87	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	24,530	64.02	1,570,410.60	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	7,076	8.78	62,127.28	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	15,511	9.78	151,697.58	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	14.44	244,469.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	66,497	22.10	1,469,583.70	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	15,509	20.88	323,827.92	
	PHOSAGRO OAO-GDR REG S	18,620	12.59	234,425.80	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,124	53.75	382,915.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	25,350	14.12	357,942.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,402	30.30	163,680.60	
	51JOB INC-ADR	1,655	72.33	119,706.15	
	DP WORLD PLC	21,152	13.90	294,012.80	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	29,952	20.19	604,730.88	
	NIO INC - ADR	53,878	3.00	161,634.00	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	10,934	33.84	370,006.56		
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,433	105.25	1,413,823.25		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	33,143	33.48	1,109,627.64		
YUM CHINA HOLDINGS INC	33,306	45.43	1,513,091.58		

	58.COM INC-ADR	9,450	54.82	518,049.00
	AUTOHOME INC-ADR	5,298	84.81	449,323.38
	BAIDU INC - SPON ADR	24,875	104.22	2,592,472.50
	IQIYI INC-ADR	11,977	18.08	216,544.16
	MOMO INC-SPON ADR	12,997	34.46	447,876.62
	NETEASE INC-ADR	6,498	262.25	1,704,100.50
	SINA CORP	5,725	43.45	248,751.25
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,073	13.97	126,749.81
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	42.31	222,085.19
	YY INC-ADR	4,344	57.81	251,126.64
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	129,785	178.28	23,138,069.80
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	49.40	173,295.20
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	38,071	35.30	1,343,906.30
	JD.COM INC-ADR	68,369	31.58	2,159,093.02
	PINDUODUO INC-ADR	17,726	25.57	453,253.82
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,239	8.33	301,870.87
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,845	12.86	512,406.70
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	3,643	20.00	72,860.00
	BANCO MACRO SA-ADR	4,035	32.44	130,895.40
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	4,996	5.01	25,029.96
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	147,287	4.42	651,744.97
	CREDICORP LTD	6,431	206.47	1,327,808.57
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	8,771	14.95	131,126.45
	SBERBANK-SPONSORED ADR	233,869	13.25	3,098,764.25
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	205,916	1.14	234,744.24
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	29.48	59,579.08
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	1.10	59,875.20
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	4,405	41.85	184,349.25
	GLOBANT SA	3,122	91.64	286,100.08
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	7.59	302,491.86
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	6,359	10.30	65,497.70
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	5,650	16.07	90,795.50
	アメリカドル 小計	2,482,221		61,529,453.73 (6,562,116,240)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,455,661	5.90	8,588,399.90
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	295,492	40.54	11,979,245.68
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	194.14	2,815,030.00
	MEXICHEM SAB DE CV-*	96,852	32.95	3,191,273.40
	ALFA S.A.B. -A	242,900	14.82	3,599,778.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	53.34	2,000,250.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	277.66	6,470,866.30
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	31,080	180.57	5,612,115.60

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	161.04	2,734,459.20	
	ALSEA SAB DE CV	34,300	40.88	1,402,184.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	209,790	31.28	6,562,231.20	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	75.53	2,371,642.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	98.68	1,075,612.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	468,580	56.23	26,348,253.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	33,675	101.67	3,423,737.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	179,140	174.43	31,247,390.20	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	178.35	4,629,966.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	132,400	34.22	4,530,728.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.46	6,992,028.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	169,700	25.75	4,369,775.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	260,400	99.03	25,787,412.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	22.84	5,767,100.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,037,840	13.02	39,552,676.80	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	37,700	73.88	2,785,276.00	
	メキシコペソ 小計	7,280,355		213,837,429.93 (1,148,306,998)	
ブラジルリアル	COSAN SA	18,400	49.60	912,640.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,100	26.74	7,436,394.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	371,740	24.03	8,932,912.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	15.85	1,198,260.00	
	BRASKEM SA-PREF A	14,800	29.01	429,348.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	13.87	873,810.00	
	GERDAU SA-PREF	87,000	12.26	1,066,620.00	
	SUZANO SA	50,679	31.93	1,618,180.47	
	VALE SA	285,178	43.65	12,448,019.70	
	EMBRAER SA	69,700	17.95	1,251,115.00	
	WEG SA	66,872	22.54	1,507,294.88	
	CCR SA	101,100	15.31	1,547,841.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	59,002	44.75	2,640,339.50	
	RUMO SA	97,700	23.04	2,251,008.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	138,184	10.79	1,491,005.36	
	B2W CIA DIGITAL	23,600	42.25	997,100.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	63,716	17.75	1,130,959.00	
	LOJAS RENNER S.A.	66,407	49.40	3,280,505.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	56,800	37.83	2,148,744.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	59,600	28.00	1,668,800.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	22.57	936,655.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	14,800	87.12	1,289,376.00	
	RAIA DROGASIL SA	21,100	89.29	1,884,019.00	
	AMBEV SA	438,500	19.11	8,379,735.00	

	BRF SA	52,500	38.26	2,008,650.00	
	JBS SA	90,300	28.90	2,609,670.00	
	M DIAS BRANCO SA	6,300	36.95	232,785.00	
	NATURA COSMETICOS SA	20,700	63.30	1,310,310.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	39,000	47.24	1,842,360.00	
	HYPERA SA	35,300	31.71	1,119,363.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,362	29.10	3,386,134.20	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	365,953	32.79	11,999,598.87	
	BANCO DO BRASIL S.A.	81,100	44.83	3,635,713.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	442,781	34.20	15,143,110.20	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	410,067	12.29	5,039,723.43	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	190,503	45.50	8,667,886.50	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	56,300	33.15	1,866,345.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	19,100	100.60	1,921,460.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	53.51	390,623.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	57,063	14.05	801,735.15	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,400	27.00	1,225,800.00	
	CIELO SA	99,269	7.26	720,692.94	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	48,400	52.41	2,536,644.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	72,900	11.98	873,342.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	40.42	715,434.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	24,100	40.65	979,665.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	65,992	14.75	973,382.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	52.58	1,372,338.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,750	45.15	756,262.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	13,000	96.57	1,255,410.00	
	ブラジルリアル 小計	4,983,318		140,705,119.70 (3,682,252,982)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,265.00	280,233,450.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,610.00	218,903,650.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	9,857	18,900.00	186,297,300.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,754	6,291.00	149,436,414.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	70,837	4,150.20	293,987,717.40	
	CENCOSUD SA	137,988	1,140.80	157,416,710.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	8,205.00	76,495,215.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,221.10	33,787,373.20	
	BANCO DE CHILE	2,335,280	103.90	242,635,592.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,194	43,101.00	223,866,594.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	50.78	318,889,310.38	
	ITAU CORPBANCA	16,749,156	5.50	92,170,605.46	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	18,552	6,019.60	111,675,619.20	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	384.50	62,768,856.00	

	COLBUN SA	475,888	122.00	58,058,336.00	
	ENEL AMERICAS SA	2,867,591	116.48	334,016,999.68	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	59.92	153,471,777.76	
	チリペソ 小計	31,903,674		2,994,111,520.48 (447,619,672)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,750.00	1,344,692,250.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	7,260.00	232,399,860.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	15,820.00	280,377,860.00	
	BANCOLOMBIA SA	20,302	40,600.00	824,261,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	43,400.00	1,661,265,200.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,235.00	375,079,380.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	32,220.00	670,820,400.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	12,561	30,440.00	382,356,840.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,000.00	909,198,000.00	
	コロンビアペソ 小計	984,893		6,680,450,990.00 (207,093,980)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,000	21.20	190,800.00	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	4,358	19.50	84,981.00	
	OPAP SA	17,668	9.61	169,877.82	
	JUMBO SA	8,599	15.98	137,412.02	
	ALPHA BANK AE	129,138	1.45	187,250.10	
	EUROBANK ERGASIAS SA	182,882	0.69	127,011.54	
	NATIONAL BANK OF GREECE	27,165	2.16	58,703.56	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,293	12.02	243,921.86	
	ユーロ 小計	399,103		1,199,957.90 (141,835,023)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	26,700	10.79	288,226.50	
	イギリスポンド 小計	26,700		288,226.50 (37,276,333)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	126.80	1,471,260.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	6.13	715,708.15	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	23,811	17.07	406,453.77	
	KOC HOLDING AS	62,460	17.37	1,084,930.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	43,168	4.17	180,010.56	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	22.46	220,916.56	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	11.18	695,295.38	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	59.75	194,665.50	
	ARCELIK AS	15,358	17.14	263,236.12	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	49.72	2,129,209.28	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	23.80	267,274.00	
	AKBANK T.A.S.	276,321	6.80	1,878,982.80	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	8.76	2,102,329.92	

	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.39	932,534.68	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	114,378	8.64	988,225.92	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	95,096	12.54	1,192,503.84	
	トルコリラ 小計	1,301,293		14,723,537.08 (277,980,380)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	829.00	6,186,827.00	
	MONETA MONEY BANK AS	68,748	76.25	5,242,035.00	
	CEZ AS	13,737	520.50	7,150,108.50	
	チェココルナ 小計	89,948		18,578,970.50 (85,091,684)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	32,872	2,966.00	97,498,352.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	4,880.00	74,068,640.00	
	OTP BANK NYRT	19,549	12,250.00	239,475,250.00	
	ハンガリーフォリント 小計	67,599		411,042,242.00 (148,756,187)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	11,057	79.18	875,493.26	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	26,414	90.12	2,380,429.68	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	146,497	4.82	707,287.51	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,171	34.96	145,818.16	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	77.88	1,022,720.16	
	CCC SA	3,138	127.90	401,350.20	
	LPP SA	124	7,145.00	885,980.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	236.00	1,582,144.00	
	CYFROWY POLSAT SA	23,502	28.00	658,056.00	
	DINO POLSKA SA	4,430	134.60	596,278.00	
	ALIOR BANK SA	8,830	42.34	373,862.20	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	6.92	228,477.64	
	BANK PEKAO SA	15,510	98.30	1,524,633.00	
	M BANK SA	1,663	317.00	527,171.00	
	PKO BANK POLSKI SA	76,505	39.44	3,017,357.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	296.80	1,072,932.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,951	37.64	1,917,795.64	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.02	335,061.16	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.66	486,887.32	
	ポーランドズロチ 小計	548,414		18,739,734.13 (506,909,808)	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	CHINA COAL ENERGY CO - H	98,000	2.80	274,400.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.86	1,509,120.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,377,400	4.67	11,102,458.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	344,000	15.54	5,345,760.00	
	CNOOC LTD-R	1,626,000	11.46	18,633,960.00	

PETROCHINA CO LTD-H	1,976,000	3.85	7,607,600.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	6.35	901,700.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.28	775,200.00
ANGANG STEEL CO LTD-H	75,400	2.80	211,120.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110,000	44.35	4,878,500.00
BBMG CORPORATION - H	131,000	2.20	288,200.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	101,500	5.15	522,725.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	336,000	2.30	772,800.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	330,000	6.60	2,178,000.00
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	144,000	3.09	444,960.00
CHINA RESOURCES CEMENT	210,000	7.00	1,470,000.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	79,600	2.99	238,004.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	8.91	739,530.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	4.15	688,900.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	292,000	2.95	861,400.00
MMG LIMITED	168,000	1.87	314,160.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	5.80	748,200.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	2.40	477,600.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	10.18	921,290.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	3.05	2,223,450.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	3.97	492,280.00
BOC AVIATION LTD	32,500	67.55	2,195,375.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	395,000	6.04	2,385,800.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	136,000	5.01	681,360.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	26.35	4,202,825.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	191,500	8.56	1,639,240.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	5.15	1,545,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	6.78	1,152,600.00
CITIC LTD	502,000	9.26	4,648,520.00
CRRG CORP LTD-H	511,050	5.58	2,851,659.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.65	2,779,200.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	557,500	0.22	125,995.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	14.78	517,300.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	143,000	1.75	250,250.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.45	411,600.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	15.24	579,120.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	5.59	399,685.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	42,500	12.00	510,000.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	143,800	11.46	1,647,948.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	31,416	8.41	264,208.56
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	34.60	2,155,580.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	385,074	6.53	2,514,533.22

COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	136,000	18.88	2,567,680.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.31	1,135,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	118,000	7.03	829,540.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.03	651,240.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	66,000	3.86	254,760.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	97,547	12.16	1,186,171.52
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.80	844,800.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	86,000	3.95	339,700.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	146,500	2.79	408,735.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	104,344	6.50	678,236.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.38	705,840.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	15.06	1,926,505.32
SINOTRANS LIMITED-H	110,000	2.56	281,600.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.98	614,240.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	117,000	4.49	525,330.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	250,000	7.48	1,870,000.00
BYD CO LTD-H	68,500	43.35	2,969,475.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	250,000	2.14	535,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.93	1,843,380.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	27,200	21.60	587,520.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	471,000	11.06	5,209,260.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	4.91	1,732,002.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	252,344	7.50	1,892,580.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	92,000	6.48	596,160.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	58.50	6,493,500.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	116,000	18.78	2,178,480.00
LI NING CO LTD	217,000	21.05	4,567,850.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70,000	111.40	7,798,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	27,000	10.58	285,660.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	1.34	1,943,000.00
CHINA LITERATURE LTD	32,200	24.80	798,560.00
TENCENT HOLDINGS LTD	520,700	336.80	175,371,760.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	593,958	0.71	421,710.18
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	1,656,000	0.13	223,560.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	81,600	69.25	5,650,800.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	42,000	24.05	1,010,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	195,000	7.90	1,540,500.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	103,000	2.11	217,330.00
CHINA HUI SHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	0.00	0.04
CHINA MENGNIU DAIRY CO	257,000	31.25	8,031,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	142,000	41.00	5,822,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	120,500	5.06	609,730.00

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	148,000	12.04	1,781,920.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	28,000	52.30	1,464,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	8.59	687,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.45	3,612,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	34,000	46.35	1,575,900.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	66,500	54.45	3,620,925.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	286,000	6.70	1,916,200.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	7.13	1,739,720.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.20	1,823,280.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	27.15	2,704,140.00
3SBIO INC	119,000	12.38	1,473,220.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	7.71	771,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	452,000	12.96	5,857,920.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	8.02	1,263,150.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.33	552,780.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	17.94	1,471,080.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	81,500	5.66	461,290.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55,500	22.30	1,237,650.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	321,000	1.48	475,080.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	579,000	9.93	5,749,470.00
SSY GROUP LTD	114,000	6.38	727,320.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	37,000	8.50	314,500.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	27,600	78.00	2,152,800.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	82.40	3,666,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,418,000	3.01	7,278,180.00
BANK OF CHINA LTD-H	7,408,200	3.02	22,372,764.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	947,475	5.33	5,050,041.75
CHINA CITIC BANK-H	951,200	4.07	3,871,384.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,580,620	5.77	49,510,177.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.28	731,440.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	354,423	36.80	13,042,766.40
CHINA MINSHENG BANKING-H	551,400	5.11	2,817,654.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	3.97	599,470.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,109,515	4.98	30,425,384.70
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	730,000	4.51	3,292,300.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.51	1,256,320.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80,000	23.08	1,846,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	9.28	575,360.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	328,500	3.83	1,258,155.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.16	1,075,320.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	15.00	1,980,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	199,000	14.46	2,877,540.00

FAR EAST HORIZON LTD	141,000	6.63	934,830.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	7.98	707,028.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	59,200	11.40	674,880.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	276,800	7.62	2,109,216.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	158,800	11.86	1,883,368.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	710,000	18.38	13,049,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	270,800	33.10	8,963,480.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	239,000	1.27	303,530.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	141,824	19.44	2,757,058.56
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	67,000	34.95	2,341,650.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	692,000	3.06	2,117,520.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	613,288	8.90	5,458,263.20
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	495,000	90.60	44,847,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	10,700	17.96	192,172.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	10.00	1,420,000.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	69,000	10.40	717,600.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	18.62	3,463,320.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	4.86	2,809,080.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	381,040	25.70	9,792,728.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	243,111	31.75	7,718,774.25
CHINA VANKE CO LTD-H	174,000	27.70	4,819,800.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	4.78	1,319,280.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	770,285	10.00	7,702,850.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	128,000	6.52	834,560.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	13.22	909,536.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.93	457,080.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	89,000	6.45	574,050.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	94,000	11.14	1,047,160.00
LONGFOR PROPERTIES	178,500	27.95	4,989,075.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.88	967,680.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	132,500	21.20	2,809,000.00
SHUI ON LAND LTD	209,500	1.61	337,295.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	225,091	3.01	677,523.91
SOHO CHINA LTD	113,000	2.44	275,720.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	211,000	34.45	7,268,950.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	578,000	1.77	1,023,060.00
YUZHOU PROPERTIES CO	104,086	3.33	346,606.38
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	242,000	7.80	1,887,600.00
KINGSOFT CORP LTD	66,000	15.80	1,042,800.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	15.16	1,197,640.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	37.30	2,666,950.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	85,000	12.36	1,050,600.00

	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	236,000	5.02	1,184,720.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	18.12	1,214,040.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.02	415,380.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	21,100	16.80	354,480.00	
	LENOVO GROUP LTD	578,000	5.65	3,265,700.00	
	MEITU INC	143,000	2.06	294,580.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	61,100	100.70	6,152,770.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	323,200	9.14	2,954,048.00	
	ZTE CORP-H	82,908	19.78	1,639,920.24	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	557,500	66.25	36,934,375.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,356,000	3.54	4,800,240.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	3,672,000	1.86	6,829,920.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	508,000	7.81	3,967,480.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	37.15	1,448,850.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	408,000	4.12	1,680,960.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,342,000	2.09	2,804,780.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	172,200	31.25	5,381,250.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	4.45	1,125,850.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	165,000	1.84	303,600.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	86,000	38.90	3,345,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	10.52	1,845,208.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	138,000	1.71	235,980.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	75,100	79.20	5,947,920.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	222,000	16.36	3,631,920.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	184,000	3.18	585,120.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.36	1,613,200.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	1.93	590,580.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	258,000	6.67	1,720,860.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	46,000	5.45	250,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	13.98	629,100.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	265,000	8.50	2,252,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	221,725	4.32	957,852.00	
	香港ドル 小計	82,929,196		811,014,261.13 (11,029,793,951)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	3.48	1,439,564.64	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	22.86	573,786.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	210,100	7.28	1,529,528.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	144,300	4.80	692,640.00	
	GAMUDA BHD	139,200	3.65	508,080.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	9.62	367,484.00	
	IJM CORP BHD	198,100	2.27	449,687.00	
	SIME DARBY BERHAD	167,246	2.14	357,906.44	

	AIRASIA GROUP BHD	64,800	1.87	121,176.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	8.43	451,797.42	
	MISC BHD	125,040	7.31	914,042.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.97	277,900.00	
	GENTING BHD	205,300	5.99	1,229,747.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	3.07	687,987.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	22.04	240,236.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,500	34.80	295,800.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.70	135,800.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.22	758,080.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	54,800	23.78	1,303,144.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,900	148.30	1,023,270.00	
	PPB GROUP BERHAD	52,680	18.80	990,384.00	
	QL RESOURCES BHD	83,200	6.80	565,760.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.71	1,163,586.66	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	158,600	4.98	789,828.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.69	1,304,717.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	98,400	4.52	444,768.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	70,600	3.25	229,450.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	3.91	509,082.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	431,570	5.04	2,175,112.80	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	17.22	1,055,448.24	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	16.82	251,173.06	
	MALAYAN BANKING BHD	359,804	8.52	3,065,530.08	
	PUBLIC BANK BERHAD	256,420	20.76	5,323,279.20	
	RHB BANK BHD	206,419	5.51	1,137,368.69	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	167,246	0.86	143,831.56	
	SP SETIA BHD	185,105	1.65	305,423.25	
	AXIATA GROUP BERHAD	281,687	4.89	1,377,449.43	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.97	1,549,149.00	
	MAXIS BHD	267,900	5.47	1,465,413.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	4.08	287,852.16	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.98	1,206,490.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	294,475	13.68	4,028,418.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	252,365	1.02	257,412.30	
	マレーシアリングット 小計	6,660,482		42,984,583.13 (1,095,677,023)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	364,800	12.00	4,377,600.00	
	IRPC PCL - NVDR	829,500	3.96	3,284,820.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	124,700	123.50	15,400,450.00	
	PTT PCL-NVDR	961,200	43.25	41,571,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	65.25	7,836,525.00	

	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	39.00	8,049,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	54.25	12,202,669.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	73,400	414.00	30,387,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	71.50	30,609,150.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	11.20	9,150,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	471,100	12.90	6,077,190.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	323,310	38.50	12,447,435.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,235	17.10	8,058,118.50	
	ROBINSON PCL-NVDR	34,800	63.25	2,201,100.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	102,700	53.25	5,468,775.00	
	CP ALL PCL-NVDR	566,800	84.00	47,611,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	340,700	28.75	9,795,125.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	240,000	18.20	4,368,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	819,600	23.10	18,932,760.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,800	141.50	4,641,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	32,700	173.00	5,657,100.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	126,400	161.50	20,413,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	40,800	161.00	6,568,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	17.70	4,376,325.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	182,300	127.00	23,152,100.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	1.52	2,031,480.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	54.25	4,871,650.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	172,500	67.25	11,600,625.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	537,100	10.90	5,854,390.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	105,900	218.00	23,086,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	150,800	61.25	9,236,500.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,000	60.25	3,976,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	6.25	6,008,806.25	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	23,200	324.00	7,516,800.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	185,500	48.50	8,996,750.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	52,400	123.00	6,445,200.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	68.00	3,692,400.00	
	タイパーツ 小計	11,918,038		435,956,844.25 (1,508,410,681)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.80	12,325,292.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	590,600	13.20	7,795,920.00	
	AYALA CORPORATION	22,370	953.50	21,329,795.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	9.45	3,264,502.50	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	230,360	67.40	15,526,264.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	1,020.00	23,261,100.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	63,240	131.50	8,316,060.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	234.00	14,276,340.00	

	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	172.50	10,933,050.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	59,845	90.00	5,386,050.00	
	BDO UNIBANK INC	173,721	146.80	25,502,242.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	142,732	71.50	10,205,338.00	
	SECURITY BANK CORP	30,810	191.90	5,912,439.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	884.00	6,062,472.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	5.10	12,014,070.00	
	AYALA LAND INC	637,000	49.40	31,467,800.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.29	3,375,020.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	24.80	2,306,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	887,550	34.75	30,842,362.50	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,900.00	3,401,000.00	
	PLDT INC	6,225	1,149.00	7,152,525.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	36.30	3,248,850.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	366.00	10,654,260.00	
	フィリピンベソ 小計	6,788,996		274,559,152.80 (560,100,671)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,045.00	1,504,068,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	447,300	2,450.00	1,095,885,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	20,700.00	2,668,230,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,370,000	740.00	1,013,800,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,525.00	1,837,605,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	22,600.00	4,294,000,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	86,700	10,450.00	906,015,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	13,250.00	3,108,450,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,750.00	710,125,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,721,200	6,425.00	11,058,710,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	533,000	1,240.00	660,920,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	550,200	4,700.00	2,585,940,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	76,625.00	2,360,050,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	917,900	3,020.00	2,772,058,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	11,525.00	1,855,525,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,675.00	3,293,342,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	118,600	44,500.00	5,277,700,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,565.00	4,312,983,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	915,000	30,075.00	27,518,625,000.00	
	BANK MANDIRI	1,818,096	7,350.00	13,363,005,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,875.00	6,380,325,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	669,100	2,300.00	1,538,930,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,886,100	4,180.00	20,423,898,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,360.00	929,424,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	1,610,400	690.00	1,111,176,000.00	

	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	4,543,100	4,340.00	19,717,054,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	791,500	1,995.00	1,579,042,500.00	
	インドネシアルピア 小計	28,209,096		143,876,887,600.00 (1,079,076,657)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,227	46,750.00	197,612,250.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	88,900.00	302,348,900.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	160,000.00	893,760,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	10,706	17,100.00	183,072,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,242	37,300.00	270,126,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	442,500.00	346,477,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	72,100.00	75,777,100.00	
	LG CHEM LTD	4,436	321,000.00	1,423,956,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	163,000.00	78,077,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,400	228,500.00	319,900,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	67,400.00	75,959,800.00	
	POSCO	7,270	208,500.00	1,515,795,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,159	47,400.00	54,936,600.00	
	CJ CORP	1,230	79,100.00	97,293,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,753	95,600.00	167,586,800.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	4,035.00	33,369,450.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,700.00	153,795,600.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	31,900.00	215,644,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	22,600.00	63,845,000.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,201	34,700.00	76,374,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,380	40,850.00	260,623,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	810	312,500.00	253,125,000.00	
	KCC CORP	870	220,000.00	191,400,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,176	38,400.00	198,758,400.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3,318	103,000.00	341,754,000.00	
	LG CORP	8,323	68,900.00	573,454,700.00	
	LOTTE CORP	2,370	31,400.00	74,418,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,988	17,700.00	105,987,600.00	
	SAMSUNG C&T CORP	7,702	89,500.00	689,329,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	15,200.00	281,443,200.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	37,151	7,260.00	269,716,260.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,879	195,500.00	758,344,500.00	
S-1 CORPORATION	960	104,000.00	99,840,000.00		
CJ LOGISTICS	862	140,000.00	120,680,000.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,455	156,500.00	227,707,500.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,504	22,850.00	125,766,400.00		
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,480.00	133,217,280.00		
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	28,300.00	199,967,800.00		

HANON SYSTEMS	19,000	11,400.00	216,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,414	242,000.00	1,552,188,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,176	128,000.00	1,686,528,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,892	81,600.00	235,987,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,003	72,500.00	217,717,500.00
KIA MOTORS CORPORATION	27,283	43,500.00	1,186,810,500.00
FILA KOREA LTD	4,080	54,400.00	221,952,000.00
HLB INC	2,398	33,200.00	79,613,600.00
LG ELECTRONICS INC	9,197	60,300.00	554,579,100.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,607	82,500.00	297,577,500.00
KANGWON LAND INC	13,208	28,450.00	375,767,600.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	26,450.00	134,101,500.00
KAKAO CORP	4,122	130,500.00	537,921,000.00
NAVER CORP	13,191	139,000.00	1,833,549,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,650	528,000.00	871,200,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	89,000.00	219,385,000.00
PEARL ABYSS CORP	338	172,000.00	58,136,000.00
CJ ENM CO LTD	830	157,500.00	130,725,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	75,400.00	230,045,400.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	71,100.00	86,884,200.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	126,000.00	130,284,000.00
SHINSEGAE CO LTD	530	220,500.00	116,865,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	208,000.00	114,192,000.00
EMART	1,661	110,500.00	183,540,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,311	40,250.00	52,767,750.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	230,500.00	178,637,500.00
KT&G CORP	10,696	101,500.00	1,085,644,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,993	85,100.00	169,604,300.00
OTTOGI CORPORATION	68	582,000.00	39,576,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,873	123,500.00	354,815,500.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	68,900.00	48,919,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	926	1,160,000.00	1,074,160,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	135	700,000.00	94,500,000.00
PACIFIC CORP	2,115	55,000.00	116,325,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,731	41,150.00	153,530,650.00
CELLTRION INC	7,739	153,000.00	1,184,067,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,112	30,850.00	34,305,200.00
HANMI PHARM CO LTD	481	280,000.00	134,680,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	628	40,800.00	25,622,400.00
HELIXMITH CO LTD	1,641	179,400.00	294,395,400.00
MEDY-TOX INC	326	348,000.00	113,448,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	283,500.00	443,110,500.00

	SILLAJEN INC	5,667	13,500.00	76,504,500.00	
	YUHAN CORPORATION	630	221,500.00	139,545,000.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,216	6,550.00	152,064,800.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	26,441	32,400.00	856,688,400.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	12,350.00	349,875,500.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	38,159	39,250.00	1,497,740,750.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	42,483	40,600.00	1,724,809,800.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	45,214	11,600.00	524,482,400.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	71,300.00	328,122,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,700.00	225,148,800.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	31,092	7,260.00	225,727,920.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	12,200.00	137,835,600.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	32,400.00	61,527,600.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	34,850.00	201,293,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	48,200.00	202,873,800.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	29,897	2,320.00	69,361,040.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	24,250.00	104,711,500.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,975	23,900.00	95,002,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	230,000.00	714,840,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	66,100.00	490,263,700.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,121	197,000.00	614,837,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	12,900.00	310,515,900.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	105,500.00	149,282,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	91,400.00	512,114,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	436,138	43,600.00	19,015,616,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	73,732	36,100.00	2,661,725,200.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,221	253,000.00	1,320,913,000.00	
	LG UPLUS CORP	14,194	12,350.00	175,295,900.00	
	SK TELECOM	1,647	232,500.00	382,927,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,467	25,700.00	628,801,900.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	38,050.00	54,487,600.00	
	SK HYNIX INC	50,048	75,100.00	3,758,604,800.00	
	韓国ウォン 小計	1,407,798		66,085,040,450.00 (5,828,700,567)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,240	98.10	10,716,444.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.60	9,975,897.60	
	CHINA STEEL	1,120,261	23.05	25,822,016.05	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,061	86.20	27,072,058.20	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	92.00	35,771,808.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	467,752	67.00	31,339,384.00	
	TAIWAN CEMENT	469,479	38.10	17,887,149.90	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	325.00	3,900,000.00	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	28.55	9,936,199.40
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21,237	250.00	5,309,250.00
CHINA AIRLINES LTD	130,203	9.30	1,210,887.90
EVA AIRWAYS CORP	159,403	14.00	2,231,642.00
EVERGREEN MARINE	132,968	12.45	1,655,451.60
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	177,000	38.30	6,779,100.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	40.00	7,082,440.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,937	372.50	4,446,532.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	36,207	199.50	7,223,296.50
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	34.80	1,392,000.00
GIANT MANUFACTURING	25,464	229.50	5,843,988.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	270.50	4,328,000.00
POU CHEN	273,780	37.70	10,321,506.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	22,108	68.20	1,507,765.60
TATUNG CO LTD	210,000	18.60	3,906,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	437.00	11,362,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,544	290.50	13,230,532.00
STANDARD FOODS CORP	35,756	58.40	2,088,150.40
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,395	77.00	34,372,415.00
TAI MED BIOLOGICS INC	13,000	142.50	1,852,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	420,468	20.30	8,535,500.40
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,256,780	9.13	11,474,401.40
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	1,628,237	20.45	33,297,446.65
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	978,573	25.40	24,855,754.20
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,004,094	21.35	21,437,406.90
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	579,945	19.95	11,569,902.75
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	902,339	28.30	25,536,193.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	12.35	14,287,579.15
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	964,768	13.65	13,169,083.20
TAIWAN BUSINESS BANK	209,620	12.50	2,620,250.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	769,621	19.85	15,276,976.85
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	306,000	48.45	14,825,700.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	132,022	125.00	16,502,750.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,153	18.00	13,898,754.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	731,951	40.00	29,278,040.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	177,791	24.40	4,338,100.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	649,082	43.35	28,137,704.70
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,142,638	8.93	10,203,757.34
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	48.75	2,053,350.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,440	43.05	1,439,592.00
ACER INC	255,803	16.85	4,310,280.55
ADVANTECH CO LTD	28,402	267.50	7,597,535.00

ASUSTEK COMPUTER INC	63,092	199.00	12,555,308.00	
AU OPTRONICS CORP	945,090	7.80	7,371,702.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	57,700	217.50	12,549,750.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,792	87.20	2,510,662.40	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	775,000	7.04	5,456,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	17.80	7,685,328.00	
DELTA ELECTRONICS INC	186,903	148.00	27,661,644.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	62.30	5,784,555.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,196,248	72.40	86,608,355.20	
INVENTEC CO LTD	280,511	20.80	5,834,628.80	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	3,740.00	33,809,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	47.10	10,618,789.20	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	87.60	5,256,000.00	
PEGATRON CORP	159,474	51.50	8,212,911.00	
QUANTA COMPUTER INC	242,270	56.10	13,591,347.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	38.20	4,893,420.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	150.00	4,050,000.00	
WISTRON CORP	242,695	23.70	5,751,871.50	
WPG HOLDINGS LTD	143,692	40.20	5,776,418.40	
YAGEO CORPORATION	22,764	264.50	6,021,078.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	119.00	2,608,718.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	347,315	107.50	37,336,362.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	71.40	11,209,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	152,200	110.00	16,742,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	293,315	68.70	20,150,740.50	
GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	289.50	5,211,000.00	
MEDIATEK INC	138,804	353.00	48,997,812.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	103,000	71.50	7,364,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,045	173.00	9,176,785.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	291.00	3,375,309.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	123,770	73.00	9,035,210.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,944	211.00	6,951,184.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,249,389	252.00	566,846,028.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	977,000	13.45	13,140,650.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	62.20	5,535,800.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	270.00	8,640,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	204,000	17.20	3,508,800.00	
新台湾ドル 小計	29,929,356		1,661,040,541.34 (5,647,537,840)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,120	347.00	22,943,640.00	
COAL INDIA LTD	110,683	198.95	22,020,382.85	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	244.70	14,541,297.50	

INDIAN OIL CORP LTD	193,765	125.80	24,375,637.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	126.30	31,917,146.70
PETRONET LNG LTD	49,423	237.55	11,740,433.65
RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,198	1,292.60	328,576,334.80
AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	212.00	7,883,220.00
ASIAN PAINTS LTD	24,960	1,586.45	39,597,792.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	27,342	732.35	20,023,913.70
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,357	181.15	21,983,820.55
JSW STEEL LTD	80,284	226.20	18,160,240.80
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,108	1,369.10	11,100,662.80
SHREE CEMENT LTD	901	19,409.65	17,488,094.65
TATA STEEL LTD	25,839	359.55	9,290,412.45
ULTRATECH CEMENT LTD	9,271	4,158.15	38,550,208.65
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	542.05	29,381,278.20
VEDANTA LTD	198,772	144.30	28,682,799.60
ASHOK LEYLAND LIMITED	143,603	64.50	9,262,393.50
HAVELLS INDIA LTD	23,476	663.70	15,581,021.20
LARSEN & TOUBRO LTD	44,586	1,352.20	60,289,189.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	357.40	22,346,792.40
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	465.15	12,305,543.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,617.10	13,518,956.00
BAJAJ AUTO LTD	8,362	2,725.50	22,790,631.00
BHARAT FORGE LTD	13,392	396.55	5,310,597.60
BOSCH LTD	431	13,633.10	5,875,866.10
EICHER MOTORS LTD	1,254	16,337.70	20,487,475.80
HERO MOTOCORP LTD	3,249	2,631.50	8,549,743.50
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	62,948	520.55	32,767,581.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,499	5,982.55	56,828,242.45
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	76,837	97.65	7,503,133.05
TATA MOTORS LTD	147,050	120.80	17,763,640.00
PAGE INDUSTRIES LTD	601	18,218.45	10,949,288.45
TITAN INDUSTRIES LTD	27,819	1,088.95	30,293,500.05
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	49,307	348.05	17,161,301.35
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,026	1,504.70	16,590,822.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,478	2,478.40	13,576,675.20
ITC LTD	316,525	251.55	79,621,863.75
NESTLE INDIA LIMITED	2,395	12,066.60	28,899,507.00
UNITED SPIRITS LTD	32,483	585.70	19,025,293.10
DABUR INDIA LTD	58,111	432.10	25,109,763.10
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,936	626.10	17,490,729.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,690	1,820.90	108,689,521.00
MARICO LTD	42,465	396.05	16,818,263.25

	AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	603.80	12,278,876.80	
	CIPLA LTD	31,308	475.85	14,897,911.80	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	9,058	1,518.10	13,750,949.80	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	10,424	2,509.10	26,154,858.40	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	16,036	368.15	5,903,653.40	
	LUPIN LTD	16,340	732.00	11,960,880.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,701	1,796.50	12,038,346.50	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	82,950	426.00	35,336,700.00	
	AXIS BANK LTD	162,301	685.00	111,176,185.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	147,455	2,114.05	311,727,242.75	
	ICICI BANK LTD	222,300	423.40	94,121,820.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	26,918	536.85	14,450,928.30	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	27,971	478.45	13,382,724.95	
	STATE BANK OF INDIA	167,428	286.85	48,026,721.80	
	YES BANK LTD	152,956	76.65	11,724,077.40	
	BAJAJ FINANCE LTD	16,731	3,328.05	55,681,604.55	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	27,929	317.80	8,875,836.20	
	REC LTD	48,168	147.05	7,083,104.40	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,040.20	12,624,907.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,167	7,376.65	23,361,850.55	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	4,537	1,161.60	5,270,179.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	45,839	1,064.05	48,774,987.95	
	INFOSYS LTD	308,929	777.65	240,238,636.85	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	80,692	2,163.00	174,536,796.00	
	TECH MAHINDRA LTD	48,055	670.35	32,213,669.25	
	WIPRO LTD	118,712	252.10	29,927,295.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	160,097	361.00	57,795,017.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	35,804	255.30	9,140,761.20	
	IDEA CELLULAR LTD	467,944	6.00	2,807,664.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	127.30	22,247,966.40	
	NTPC LTD	260,019	118.90	30,916,259.10	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,781	207.05	34,532,006.05	
	TATA POWER CO LTD	93,250	57.25	5,338,562.50	
	インドルピー 小計	6,014,451		2,931,963,631.10 (4,397,945,446)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,000	112.78	8,232,940.00	
	HABIB BANK LTD	66,500	111.45	7,411,425.00	
	MCB BANK LTD	53,300	163.48	8,713,484.00	
	パキスタンルピー 小計	192,800		24,357,849.00 (16,563,337)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	25,990	21.16	549,948.40	
	MESAI EED PETROCHEMICAL HOLDI	302,960	2.52	763,459.20	

	INDUSTRIES QATAR	159,480	10.36	1,652,212.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	4.33	883,276.70	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	3.58	1,455,413.20	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	15.25	1,742,007.50	
	QATAR NATIONAL BANK	412,820	18.00	7,430,760.00	
	QATAR INSURANCE CO	189,640	3.00	568,920.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.39	703,391.10	
	OOREDOO QSC	72,800	6.50	473,200.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,820	14.55	550,281.00	
	カタールリアル 小計	2,133,760		16,772,869.90 (489,600,072)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,638	138.07	2,711,418.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,431	800.94	5,150,845.14	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	42,469	314.89	13,373,063.41	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	81.45	5,260,122.45	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	418.18	2,246,462.96	
	SAPPI LIMITED	49,985	44.03	2,200,839.55	
	SASOL LTD	51,446	273.71	14,081,284.66	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	174.00	4,820,148.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	133.02	5,391,167.58	
	MR PRICE GROUP LTD	21,299	173.43	3,693,885.57	
	NASPERS LTD-N SHS	40,322	3,399.00	137,054,478.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	24,032	147.49	3,544,479.68	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,367	53.52	2,535,081.84	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	83,684	53.94	4,513,914.96	
	BID CORP LTD	33,071	302.05	9,989,095.55	
	CLICKS GROUP LTD	20,499	198.07	4,060,236.93	
	PICK N PAY STORES LTD	62,266	60.28	3,753,394.48	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,792	139.79	6,261,473.68	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	14,613	184.25	2,692,445.25	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	215.07	2,800,856.61	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	156,543	22.04	3,450,207.72	
	NETCARE LTD	99,170	14.93	1,480,608.10	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	65.91	2,454,752.04	
	ABSA GROUP LTD	61,049	147.85	9,026,094.65	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	1,096.39	3,532,568.58	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	220.00	8,368,140.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	109,999	173.52	19,087,026.48	
FIRSTRAND LTD	312,664	58.00	18,134,512.00		
INVESTEC LTD	28,883	77.21	2,230,056.43		
PSG GROUP LTD	18,494	198.02	3,662,181.88		
REINET INVESTMENTS SCA	11,647	257.39	2,997,821.33		

	REMGRO LTD	46,153	169.23	7,810,472.19	
	RMB HOLDINGS LTD	74,398	68.89	5,125,278.22	
	DISCOVERY LIMITED	34,996	101.47	3,551,044.12	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	103.00	641,278.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	68,078	15.84	1,078,355.52	
	OLD MUTUAL LTD	407,000	17.97	7,313,790.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	28.25	1,141,526.00	
	SANLAM LTD	172,493	70.10	12,091,759.30	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	30,914	128.64	3,976,776.96	
	MTN GROUP LTD	156,559	103.55	16,211,684.45	
	TELKOM SA LTD	11,353	84.30	957,057.90	
	VODACOM GROUP	58,903	115.00	6,773,845.00	
	南アフリカランド 小計	2,697,554		377,231,531.83 (2,602,897,569)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	269,490	8.22	2,215,207.80	
	DUBAI ISLAMIC BANK	128,588	5.12	658,370.56	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	223,903	14.94	3,345,110.82	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	637,262	2.21	1,408,349.02	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	30,545	4.20	128,289.00	
	EMAAR MALLS PJSC	179,643	1.86	334,135.98	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,622	5.13	1,542,190.86	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	168,271	16.12	2,712,528.52	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	1,938,324		12,344,182.56 (358,968,828)	
香港・オフショア 人民元	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	9.13	349,679.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	39.63	1,166,707.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.93	229,491.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	145,800	1.52	221,616.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	40,900	6.60	269,940.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	10,700	50.45	539,815.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	14.38	339,368.00	
	ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	9.90	336,600.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	22.72	259,008.00	
	AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	17,000	15.38	261,460.00	
	CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	28,920	10.15	293,538.00	
	CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	101,300	5.94	601,722.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	126,000	5.59	704,340.00	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	21,900	18.18	398,142.00	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	62,300	4.75	295,925.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	13.56	568,164.00	
	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	9.78	221,028.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.02	241,734.22		

ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	10,400	22.51	234,104.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.19	212,121.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.25	210,000.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	193,400	2.59	500,906.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	61,300	7.66	469,558.00
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	63,300	3.17	200,661.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	84.86	451,370.34
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.87	260,628.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	43.70	362,710.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37,300	21.56	804,188.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	13,300	22.82	303,506.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	24.50	1,043,700.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	9,900	52.42	518,958.00
HLA CORP LTD-A	21,400	8.60	184,040.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,600	51.57	1,062,342.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	15.40	400,400.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	14,800	90.90	1,345,320.00
CHINA FILM CO LTD-A	17,000	14.07	239,190.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	21,060	9.47	199,438.20
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	14.31	243,270.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	10.76	492,808.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	9.87	399,735.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	7,300	102.73	749,929.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	10,800	21.87	236,196.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	17,602	29.20	513,978.40
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4,700	107.77	506,519.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	3,400	1,055.88	3,589,992.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4,400	86.20	379,280.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	8,200	71.35	585,070.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	17.97	481,596.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	11,700	127.90	1,496,430.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	13,780	32.08	442,062.40
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	28.30	275,076.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,800	12.81	279,258.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	11.78	292,615.20
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	29.77	303,654.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	7,493	32.25	241,649.25
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	14,160	71.94	1,018,670.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	22.10	154,700.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	30.65	344,260.80
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	17.28	336,960.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	100.09	390,351.00

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.43	1,212,848.00		
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.29	306,820.00		
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	57,800	6.69	386,682.00		
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	7.88	397,940.00		
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	22.78	546,720.00		
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	9.14	415,870.00		
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.07	883,043.00		
CHINA MERCHANTS BANK-A	38,900	35.30	1,373,170.00		
CHINA MINSHENG BANKING-A	192,200	5.83	1,120,526.00		
HUAXIA BANK CO LTD-A	34,200	7.34	251,028.00		
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	54,100	18.04	975,964.00		
PING AN BANK CO LTD-A	52,000	14.92	775,840.00		
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67,700	11.38	770,426.00		
ANXIN TRUST CO LTD-A	31,900	4.76	151,844.00		
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	184,500	7.19	1,326,555.00		
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,200	17.00	479,400.00		
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,800	11.16	1,136,088.00		
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	43,400	6.37	276,458.00		
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	10.39	329,363.00		
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110,500	4.85	535,925.00		
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	39,900	88.45	3,529,155.00		
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14,000	27.83	389,620.00		
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	25,000	20.61	515,250.00		
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	43,900	14.28	626,892.00		
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	25.72	329,216.00		
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	33.07	357,156.00		
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.93	450,378.00		
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	48,100	5.02	241,462.00		
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	24,800	31.28	775,744.00		
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	87,632	24.23	2,123,323.36		
CHINA UNITED NETWORK-A	349,700	5.76	2,014,272.00		
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	87,800	5.47	480,266.00		
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	68,800	19.52	1,342,976.00		
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	298,300	4.19	1,249,877.00		
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	5.68	852,000.00		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	16,300	24.76	403,588.00		
香港・オフショア人民元 小計	4,910,809		59,389,163.77 (895,588,589)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	11,202	20.20	226,280.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	4,532	58.50	265,122.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	14,891	14.90	221,875.90	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	16,636	19.74	328,394.64	

SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	7,247	82.30	596,428.10	
SAUDI ARABIAN MINING CO	17,360	48.20	836,752.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	39,544	104.20	4,120,484.80	
SAUDI CEMENT	3,778	67.00	253,126.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	10,232	23.50	240,452.00	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	30,724	11.16	342,879.84	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	8,967	56.10	503,048.70	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,653	90.70	149,927.10	
JARIR MARKETING CO	2,739	169.20	463,438.80	
ALMARAI CO	10,437	51.20	534,374.40	
SAVOLA	12,202	32.10	391,684.20	
AL RAJHI BANK	52,987	67.60	3,581,921.20	
ALINMA BANK	31,229	24.20	755,741.80	
BANK AL-JAZIRA	18,868	14.88	280,755.84	
BANK ALBILAD	16,191	29.10	471,158.10	
BANQUE SAUDI FRANSI	23,540	36.90	868,626.00	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	51,744	51.70	2,675,164.80	
RIYAD BANK	55,344	26.50	1,466,616.00	
SAMBA FINANCIAL GROUP	43,179	30.15	1,301,846.85	
SAUDI BRITISH BANK	15,048	37.50	564,300.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,609	104.00	167,336.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	3,040	71.80	218,272.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	25,475	11.70	298,057.50	
EMAAR ECONOMIC CITY	21,809	10.18	222,015.62	
ETIHAD ETISALAT CO	19,605	25.05	491,105.25	
SAUDI TELECOM CO	16,505	112.00	1,848,560.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	33,800	20.66	698,308.00	
サウジアラビアリアル 小計	622,117		25,384,053.84 (722,937,853)	
合 計	236,420,295		49,479,038,371 (49,479,038,371)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	5,001,150.00	
		メキシコペソ 小計	43,300	5,001,150.00 (26,856,175)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,620,520.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		39,900	1,688,967.00		
ENERGISA SA-UNITS		16,500	804,540.00		

		KLABIN SA-UNIT	55,100	814,929.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	741,149.50	
		ブラジルリアル 小計	153,462	5,670,105.50 (148,386,660)	
		投資信託受益証券合計	196,762	175,242,835 (175,242,835)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	7,774,764.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	7,774,764.00 (41,750,482)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	189,245	3,987,392.15	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	6,824,437.11	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	4,466,077.75	
		南アフリカランド 小計	1,032,277	15,277,907.01 (105,417,558)	
		投資証券合計	1,340,677	147,168,040 (147,168,040)	
	合計		322,410,875 (322,410,875)		

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 56銘柄	100.0%			13.2%
メキシコペソ	株式 24銘柄	94.4%			2.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 1銘柄			3.4%	0.1%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	96.1%			7.4%
	投資信託受 益証券 5銘柄		3.9%		0.3%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.9%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0%			0.6%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%

ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	19銘柄	100.0%			1.0%
香港ドル	株式	206銘柄	100.0%			22.1%
マレーシアリングギット	株式	43銘柄	100.0%			2.2%
タイバーツ	株式	37銘柄	100.0%			3.0%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアルピア	株式	27銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式	112銘柄	100.0%			11.7%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			11.3%
インドルピー	株式	78銘柄	100.0%			8.8%
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式	43銘柄	96.1%			5.2%
	投資証券	3銘柄			3.9%	0.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	8銘柄	100.0%			0.7%
香港・オフショア人民元	株式	96銘柄	100.0%			1.8%
サウジアラビアリアル	株式	31銘柄	100.0%			1.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	685,557,699
コール・ローン	808,589,705
国債証券	47,172,666,269
未収利息	637,132,379
前払費用	56,976,601
流動資産合計	49,360,922,653
資産合計	49,360,922,653

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払解約金	26,288,076
未払利息	1,744
流動負債合計	26,289,820
負債合計	26,289,820
純資産の部	
元本等	
元本	29,692,604,998
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,642,027,835
元本等合計	49,334,632,833
純資産合計	49,334,632,833
負債純資産合計	49,360,922,653

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月20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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,692,604,998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) 1.6615円 (16,615円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 8月20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 8月20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

	2019年 8月20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>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	27,405,750,667円
期中追加設定元本額	4,945,346,949円
期中一部解約元本額	2,658,492,618円
期末元本額	29,692,604,998円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,143,778,786円
世界経済インデックスファンド	5,526,701,430円
DC 新興国債券インデックス・オープン	4,218,396,568円
DC 世界経済インデックスファンド	4,817,305,314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）	1,873,493,539円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	492,238,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	98,140,490円
分散投資コア戦略ファンドA	172,801,832円
分散投資コア戦略ファンドS	456,719,090円

区分	2019年 8月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,268,303円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,233,705,350円
コア投資戦略ファンド(切替型)	79,323,611円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	199,764,082円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	93,491,708円
S M T インデックスバランス・オープン	202,122,421円
外国債券S M T Bセクション(S M A専用)	3,450,986,889円
S M T 世界経済インデックス・オープン	82,282,836円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	111,621,900円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	150,923,005円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,130,054円
グローバル経済コア	785,260,021円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	21,634,647円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	3,268,814円
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)	117,300,853円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,638,425,307
合計	2,638,425,307

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,200,000.00	39,126,204.00	
		MBONO 10% 12/05/24	82,250,000.00	93,663,832.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	48,500,000.00	45,420,250.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	81,200,000.00	80,366,888.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	91,700,000.00	90,869,656.50	
		MBONO 7.25% 12/09/21	64,300,000.00	64,573,275.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	85,300,000.00	87,727,638.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	49,800,000.00	52,184,673.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	61,500,000.00	63,453,855.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	24,000,000.00	25,097,040.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	63,700,000.00	70,215,236.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	48,350,000.00	53,716,608.25	
		MBONO 8% 09/05/24	25,000,000.00	26,143,750.00	
		MBONO 8% 11/07/47	34,750,000.00	36,907,280.00	
		MBONO 8% 12/07/23	77,600,000.00	80,822,340.00	
	メキシコペソ 小計		869,150,000.00	910,288,526.25 (4,888,249,385)	
国債証券	ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/22	35,400,000.00	30,851,871.72	
		BLTN 0% 07/01/21	14,600,000.00	13,169,237.96	
		BLTN 0% 07/01/22	13,250,000.00	11,148,514.22	
		BLTN 0% 07/01/23	17,500,000.00	13,666,646.00	
		BNTNF 10% 01/01/21	21,200,000.00	22,398,026.92	
		BNTNF 10% 01/01/23	28,650,000.00	31,678,067.31	
		BNTNF 10% 01/01/25	21,100,000.00	23,973,370.65	
		BNTNF 10% 01/01/27	15,900,000.00	18,458,352.99	
		BNTNF 10% 01/01/29	7,000,000.00	8,268,289.42	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,715,875.00	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	519,468.75	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	2,110,187.50	
			ブラジルリアル 小計		178,350,000.00
国債証券	チリペソ	BTPCL 4.5% 03/01/21	1,590,000,000.00	1,649,791,188.39	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	1,825,000,000.00	2,044,391,500.82	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	955,000,000.00	1,141,351,112.52	
		BTPCL 4% 03/01/23	1,260,000,000.00	1,336,671,863.10	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,060,000,000.00	2,630,060,413.36	
		BTPCL 6% 01/01/43	1,620,000,000.00	2,472,283,331.64	
			9,310,000,000.00	11,274,549,409.83	

チリペソ 小計			(1,685,545,136)
コロンビア ペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	23,650,000,000.00	23,196,274,750.00
	COLOM 7.75% 04/14/21	9,600,000,000.00	10,036,464,000.00
	COLOM 9.85% 06/28/27	55,400,000,000.00	70,783,472,000.00
コロンビアペソ 小計		88,650,000,000.00	104,016,210,750.00 (3,224,502,533)
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.4% 08/12/34	2,750,000.00	2,933,122.50
	PERUGB 5.7% 08/12/24	5,700,000.00	6,365,361.00
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,400,000.00	7,280,000.00
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,000,000.00	8,059,555.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,350,000.00	8,591,415.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	8,592,980.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,350,000.00	9,002,647.50
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,500,000.00	8,251,002.50
ペルーヌエボソル 小計		50,000,000.00	59,076,083.50 (1,860,305,869)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.5% 03/15/28	15,600,000.00	13,663,806.00
	URUGUA 9.875% 06/20/22	17,350,000.00	17,053,141.50
ウルグアイペソ 小計		32,950,000.00	30,716,947.50 (89,693,486)
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,691,312.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	26,095,000.00
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	46,786,312.00 (97,783,392)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,450,000.00	2,909,488.50
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,050,000.00	6,310,475.50
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,750,000.00	7,853,430.00
	TURKGB 10.7% 02/17/21	6,700,000.00	6,321,885.50
	TURKGB 10.7% 08/17/22	10,750,000.00	9,585,560.00
	TURKGB 11% 02/24/27	9,300,000.00	7,509,564.00
	TURKGB 11% 03/02/22	5,600,000.00	5,080,348.00
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,101,961.00
	TURKGB 12.4% 03/08/28	5,200,000.00	4,455,230.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	4,844,029.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	6,500,000.00	5,488,145.00
	TURKGB 8% 03/12/25	6,100,000.00	4,437,079.00
	TURKGB 9.2% 09/22/21	10,850,000.00	9,722,251.00
	TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	2,663,745.00
	TURKGB 9% 07/24/24	7,250,000.00	5,742,217.50
トルコリラ 小計		108,600,000.00	92,025,409.00 (1,737,439,721)
チェココル ナ	CZGB 0.25% 02/10/27	32,200,000.00	30,754,864.00
	CZGB 0.45% 10/25/23	22,400,000.00	21,947,408.00

	CZGB 0.95% 05/15/30	46,400,000.00	46,262,656.00	
	CZGB 1% 06/26/26	42,800,000.00	43,131,058.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	51,500,000.00	56,171,050.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	48,800,000.00	55,424,844.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	44,500,000.00	52,050,760.00	
	CZGB 3.75% 09/12/20	36,500,000.00	37,567,260.00	
	CZGB 3.85% 09/29/21	37,900,000.00	40,217,395.50	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,300,000.00	39,298,254.50	
	CZGB 5.7% 05/25/24	38,800,000.00	47,976,782.00	
	チェココルナ 小計	437,100,000.00	470,802,332.00 (2,156,274,680)	
ハンガリー フォリント	HGB 0.5% 04/21/21	370,000,000.00	372,676,950.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	535,000,000.00	557,520,825.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	430,000,000.00	466,517,750.00	
	HGB 2.5% 10/27/21	341,000,000.00	359,391,835.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	373,000,000.00	415,369,070.00	
	HGB 3% 06/26/24	466,000,000.00	516,344,310.00	
	HGB 3% 10/27/27	626,000,000.00	710,140,660.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	597,000,000.00	752,658,795.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	496,000,000.00	608,195,200.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	332,000,000.00	485,000,540.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	237,000,000.00	258,671,280.00	
	HGB 7% 06/24/22	475,500,000.00	564,870,225.00	
	ハンガリーフォリント 小計	5,278,500,000.00	6,067,357,440.00 (2,195,776,657)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	11,650,000.00	11,709,881.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	10,800,000.00	10,997,478.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	21,150,000.00	21,777,837.75	
	POLGB 2.5% 04/25/24	10,500,000.00	10,895,850.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	13,950,000.00	14,587,584.75	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,000,000.00	14,702,590.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	10,950,000.00	11,751,485.25	
	POLGB 2.75% 10/25/29	5,730,000.00	6,195,906.30	
	POLGB 2% 04/25/21	8,500,000.00	8,574,672.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	12,700,000.00	13,765,974.50	
	POLGB 4% 10/25/23	9,900,000.00	10,868,220.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,200,000.00	7,530,300.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,490,843.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	7,150,000.00	7,794,965.75	
	ポーランドズロチ 小計	151,730,000.00	159,643,589.05 (4,318,359,083)	
ロシアルーブル	RFLB 6.5% 02/28/24	135,100,000.00	132,844,505.50	

	RFLB 6.9% 05/23/29	89,000,000.00	87,115,425.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	177,000,000.00	176,385,810.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	164,100,000.00	165,037,011.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	89,000,000.00	88,160,730.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	100,000,000.00	101,847,000.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	172,900,000.00	175,273,917.00	
	RFLB 7.5% 08/18/21	123,000,000.00	124,473,540.00	
	RFLB 7.6% 04/14/21	44,400,000.00	44,933,466.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	95,000,000.00	96,762,250.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	174,200,000.00	179,530,520.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	162,500,000.00	168,406,062.50	
	RFLB 7.95% 10/07/26	147,000,000.00	153,853,140.00	
	RFLB 7% 01/25/23	97,200,000.00	97,462,440.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,569,304.00	
	RFLB 7% 12/15/21	151,000,000.00	151,328,425.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	176,000,000.00	186,619,840.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	123,150,000.00	135,306,752.25	
	ロシアルーブル 小計	2,327,750,000.00	2,372,910,138.25	(3,772,927,119)
マレーシア リンギット	MGS 3.62% 11/30/21	8,750,000.00	8,842,181.25	
	MGS 3.659% 10/15/20	10,800,000.00	10,866,744.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	10,250,000.00	10,586,097.50	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,942,756.25	
	MGS 3.8% 08/17/23	8,650,000.00	8,836,191.25	
	MGS 3.885% 08/15/29	7,350,000.00	7,754,323.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	11,550,000.00	12,032,385.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,372,764.75	
	MGS 3.906% 07/15/26	4,500,000.00	4,682,475.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	11,200,000.00	11,617,872.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	7,550,000.00	7,843,544.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	6,050,000.00	6,164,647.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	6,000,000.00	6,256,500.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	6,900,000.00	8,013,556.50	
	マレーシアリンギット 小計	112,450,000.00	116,812,039.25	(2,977,538,880)
タイバーツ	THAIGB 1.875% 06/17/22	99,700,000.00	100,997,595.50	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	98,000,000.00	102,770,150.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	70,000,000.00	72,929,500.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	59,000,000.00	66,330,160.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	77,900,000.00	79,432,682.50	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	54,000,000.00	69,112,710.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	176,100,000.00	222,994,549.50	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	90,959,400.00	

	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,900,000.00	168,252,153.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	64,100,000.00	67,399,868.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	59,000,000.00	74,045,590.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	76,000,000.00	87,202,020.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	95,000,000.00	124,589,650.00	
	タイバーツ 小計	1,149,700,000.00	1,327,016,029.00 (4,591,475,460)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	25,000,000.00	24,944,500.00	
	PHILIP 4.95% 01/15/21	20,000,000.00	20,246,200.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	24,024,700.00	
	フィリピンペソ 小計	65,000,000.00	69,215,400.00 (141,199,416)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,914,066,500.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	10,700,000,000.00	12,771,413,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	18,500,000,000.00	19,543,677,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	6,800,000,000.00	7,538,208,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	40,800,000,000.00	39,440,748,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	36,000,000,000.00	33,264,360,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	29,000,000,000.00	26,349,545,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	23,400,000,000.00	22,783,293,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	30,500,000,000.00	30,036,552,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	33,700,000,000.00	34,168,093,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	44,300,000,000.00	43,814,472,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	29,600,000,000.00	31,285,128,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	23,600,000,000.00	25,169,636,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,200,000,000.00	34,535,470,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,900,000,000.00	19,729,048,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	31,800,000,000.00	32,817,282,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	48,200,000,000.00	51,164,782,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	32,500,000,000.00	34,401,900,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	12,500,000,000.00	13,210,187,500.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	45,000,000,000.00	47,896,875,000.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	32,700,000,000.00	35,534,109,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,059,669,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	32,500,000,000.00	35,785,100,000.00		
	インドネシアルピア 小計	632,900,000,000.00	653,213,615,500.00 (4,899,102,116)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	86,950,000.00	96,680,139.75	
	SAGB 6.25% 03/31/36	34,700,000.00	24,721,668.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	52,700,000.00	36,391,985.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	18,350,000.00	18,359,909.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	42,500,000.00	42,872,300.00	
	SAGB 7% 02/28/31	41,800,000.00	34,940,411.00	

	SAGB 8.25% 03/31/32	47,650,000.00	43,317,900.25	
	SAGB 8.5% 01/31/37	46,800,000.00	41,402,556.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	53,500,000.00	47,073,847.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	74,400,000.00	65,319,480.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	35,250,000.00	32,700,015.00	
	SAGB 8% 01/31/30	50,300,000.00	46,591,884.00	
	SAGB 9% 01/31/40	35,000,000.00	31,850,350.00	
	南アフリカランド 小計	619,900,000.00	562,222,445.50	(3,879,334,873)
	合計		47,172,666,269	(47,172,666,269)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.4%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	9.9%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	3.6%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	6.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 8銘柄	100.0%	3.9%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	3.7%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	4.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	4.7%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.2%
ロシアルーブル	国債証券 18銘柄	100.0%	8.0%
マレーシアリンギット	国債証券 14銘柄	100.0%	6.3%
タイバーツ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.7%
フィリピンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 23銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	8.2%

(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。

J - REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,864,935,126
投資証券	115,255,374,900
派生商品評価勘定	205,393,400
未収入金	152,705,670
未収配当金	722,897,245
差入委託証拠金	42,156,000
流動資産合計	118,243,462,341
資産合計	118,243,462,341
負債の部	
流動負債	
前受金	205,393,400
未払金	84,096,362
未払解約金	104,454,553
未払利息	4,023
その他未払費用	3
流動負債合計	393,948,341
負債合計	393,948,341
純資産の部	
元本等	
元本	57,883,572,656
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,965,941,344
元本等合計	117,849,514,000
純資産合計	117,849,514,000
負債純資産合計	118,243,462,341

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20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> <p>先物取引</p>

2019年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,883,572,656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 2.0360円 (1万口当たり純資産額) (20,360円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

2019年 8月20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。

	2019年 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	63,469,051,269円
期中追加設定元本額	9,376,036,275円
期中一部解約元本額	14,961,514,888円
期末元本額	57,883,572,656円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,671,893,895円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,594,392円
SMT J-REITインデックス・オープン	11,920,556,056円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,634,980,016円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,208,720,640円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,727,243,144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
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	32,096,006円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	577,014,199円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,974,824円
グローバル経済コア	336,788,024円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	4,537,813円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	298,343,177円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,238,083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）	976,655,571円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	960,373,516円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	407,203,140円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	494,254,537円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	15,916,093,099

合計	15,916,093,099
----	----------------

(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 8月20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	2,226,188,100	-	2,431,581,500	205,393,400
合計		2,226,188,100	-	2,431,581,500	205,393,400

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,124	129,934,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,082	129,948,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,637	2,469,523,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	12,984	1,464,595,200	
	森ヒルズリート投資法人	12,593	2,069,029,900	
	産業ファンド投資法人	13,467	1,976,955,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,134	3,445,560,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,812	1,350,819,600	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	5,485	2,907,050,000	
	G L P 投資法人	27,262	3,707,632,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,557	1,499,253,000	
	日本プロロジスリート投資法人	15,726	4,453,603,200	

星野リゾート・リート投資法人	1,665	929,070,000	
Oneリート投資法人	1,706	528,860,000	
イオンリート投資法人	11,235	1,513,354,500	
ヒューリックリート投資法人	8,897	1,701,106,400	
日本リート投資法人	3,555	1,526,872,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	70,320	1,357,176,000	
日本ヘルスケア投資法人	531	95,580,000	
積水ハウス・リート投資法人	32,004	2,893,161,600	
トーセイ・リート投資法人	2,013	262,696,500	
ケネディクス商業リート投資法人	4,012	1,047,132,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,335	309,621,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,191	256,347,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	34,135	6,417,380,000	
いちごホテルリート投資法人	1,813	218,647,800	
ラサールロジポート投資法人	9,083	1,307,043,700	
スターアジア不動産投資法人	3,632	421,312,000	
マリモ地方創生リート投資法人	941	111,884,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,695	1,157,502,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,860	162,936,000	
さくら総合リート投資法人	2,368	227,328,000	
投資法人みらい	11,873	682,697,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,568	366,967,200	
三菱地所物流リート投資法人	1,748	555,864,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,536	202,905,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,589	213,402,700	
タカラレーベン不動産投資法人	2,321	282,697,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,693	184,198,400	
日本ビルファンド投資法人	10,599	8,352,012,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,946	7,684,092,000	
日本リテールファンド投資法人	20,687	4,544,933,900	
オリックス不動産投資法人	21,809	4,900,482,300	
日本プライムリアルティ投資法人	6,929	3,433,319,500	
プレミア投資法人	9,886	1,465,105,200	
東急リアル・エステート投資法人	7,339	1,478,808,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,601	1,098,344,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,576	4,964,352,000	
森トラスト総合リート投資法人	7,823	1,487,152,300	
インヴィンシブル投資法人	48,014	2,938,456,800	
フロンティア不動産投資法人	3,723	1,710,718,500	
平和不動産リート投資法人	6,816	896,985,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,152	1,883,836,800	
福岡リート投資法人	5,661	1,033,132,500	

ケネディクス・オフィス投資法人	3,386	2,725,730,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,475	889,875,000	
大和証券オフィス投資法人	2,526	2,111,736,000	
阪急阪神リート投資法人	4,944	782,635,200	
スタートプロシード投資法人	1,705	316,618,500	
大和ハウスリート投資法人	14,757	4,111,300,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,261	3,050,076,500	
日本賃貸住宅投資法人	12,311	1,186,780,400	
ジャパンエクセレント投資法人	9,802	1,671,241,000	
合計	627,910	115,255,374,900	

(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 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	371,459,093
コール・ローン	22,798,255
投資証券	76,543,025,216
派生商品評価勘定	31,500
未収入金	5,817,007
未収配当金	203,703,027
流動資産合計	77,146,834,098
資産合計	77,146,834,098
負債の部	
流動負債	
未払金	122,264,133
未払解約金	8,850,254
未払利息	49
流動負債合計	131,114,436
負債合計	131,114,436
純資産の部	
元本等	
元本	40,660,606,854
剰余金	
剰余金又は欠損金()	36,355,112,808
元本等合計	77,015,719,662

	2019年 8月20日現在
項目	金額（円）
純資産合計	77,015,719,662
負債純資産合計	77,146,834,098

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,660,606,854口
2. 1口当たり純資産額	1.8941円

2019年 8月20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) (18,941円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 8月20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 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2019年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	37,293,344,466円
期中追加設定元本額	8,372,461,343円
期中一部解約元本額	5,005,198,955円
期末元本額	40,660,606,854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）	139,298,636円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,635,003,441円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,433,421円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,052,448,954円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,977,899,987円

区分	2019年 8月20日現在
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
S M T インデックスバランス・オープン	184,581,243円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	529,571,646円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,914,250円
グローバル経済コア	341,587,060円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	4,520,156円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	147,929,095円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,070,058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）	893,334,863円
F O F s用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	575,975,369円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,332,731,984
合計	6,332,731,984

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルR E I T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 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	79,195,850	-	79,227,350	31,500
	アメリカドル	79,195,850	-	79,227,350	31,500
合計		79,195,850	-	79,227,350	31,500

(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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,910	1,304,567.10	
		AGREE REALTY CORP	25,170	1,838,668.50	
		ALEXANDER'S INC	2,050	745,072.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	9,672,813.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,970	1,275,141.60	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,760	3,626,910.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	31,600	393,104.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	153,120	3,863,217.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	112,270	4,075,401.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	84,610	4,314,263.90	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,993	1,948,209.12	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	134,407.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	79,810	16,577,335.10	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	111,870.00	
		BOSTON PROPERTIES	88,810	11,402,315.90	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	133,835.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	101,518	1,467,950.28	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	169,340	3,163,271.20	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	52,700	1,022,907.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	71,200.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	55,700	5,966,027.00	
		CARETRUST REIT INC	57,290	1,341,731.80	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	83,306.49	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	123,121.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	23,860	403,472.60	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	34,960	914,204.00	
		CITY OFFICE REIT INC	20,000	270,200.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	80,592.00			
COLONY CAPITAL INC	282,000	1,254,900.00			

COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	62,520	1,354,808.40	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	420,592.00	
CORECIVIC INC	68,050	1,194,277.50	
CORESITE REALTY CORP	20,530	2,345,141.90	
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,720	1,934,212.80	
COUSINS PROPERTIES INC	82,193	2,839,768.15	
CUBESMART	109,640	3,879,063.20	
CYRUSONE INC	65,900	4,645,950.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	1,147,857.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	119,910	14,908,410.30	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	94,500	3,999,240.00	
DUKE REALTY CORP	203,230	6,834,624.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	45,300	937,710.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,700	2,710,330.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	82,810	1,117,935.00	
EPR PROPERTIES	44,390	3,374,527.80	
EQUITY COMMONWEALTH	72,020	2,445,079.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,860	6,936,795.40	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	213,050	17,634,148.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,510	1,004,405.70	
ESSEX PROPERTY TRUST	37,880	12,037,127.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,930	8,998,020.30	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	121,220.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,270	5,683,514.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,790	2,749,483.60	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	37,890	1,068,498.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	425,020.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	304,290.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	114,470	4,320,097.80	
GEO GROUP INC/THE	69,850	1,240,536.00	
GETTY REALTY CORP	19,000	579,310.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	335,100.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	58,100.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	104,120.00	
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	1,025,544.00	
HCP INC	273,990	9,488,273.70	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	74,700	2,482,281.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	114,780	3,237,943.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	261,681.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61,100	2,696,343.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	92,450	2,310,325.50	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	419,930	6,714,680.70	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	85,970	2,921,260.60	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	676,000.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	793,737.60	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,040	775,808.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	449,721.71	
INVITATION HOMES INC	239,090	6,833,192.20	
IRON MOUNTAIN INC	162,310	5,177,689.00	
JBG SMITH PROPERTIES	68,500	2,659,170.00	
KILROY REALTY CORPORATION	57,310	4,549,267.80	
KIMCO REALTY CORP	236,880	4,481,769.60	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	744,955.60	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	125,366	1,330,133.26	
LIBERTY PROPERTY TRUST	83,080	4,386,624.00	
LIFE STORAGE INC	27,070	2,801,203.60	
LTC PROPERTIES INC	23,290	1,143,073.20	
MACERICH CO/THE	59,540	1,732,018.60	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	1,221,902.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	740,080	669,772.40	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	250,200	4,578,660.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,170	8,232,926.10	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	742,609.40	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	93,550	5,170,508.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	1,037,768.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,730	2,049,622.40	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	264,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	601,510.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	507,584.70	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	790,157.70	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	122,626	4,821,654.32	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	224,400.00	
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	1,617,181.20	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	118,330	2,861,219.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,640	2,073,764.40	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	147,701.40	
PHYSICIANS REALTY TRUST	104,360	1,853,433.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,810	1,371,118.20	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	328,900.00	
PROLOGIS INC	362,610	30,408,474.60	
PS BUSINESS PARKS INC	11,900	2,122,008.00	
PUBLIC STORAGE	86,510	22,584,300.60	
QTS REALTY TRUST INC	33,510	1,655,394.00	
REALTY INCOME CORP	179,860	13,199,925.40	

REGENCY CENTERS CORP	96,890	6,368,579.70	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,140	1,090,737.60	
RETAIL PROPETISE OF AME-A	129,080	1,472,802.80	
RETAIL VALUE	8,630	321,985.30	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	60,880	2,665,326.40	
RLJ LODGING TRUST	99,770	1,641,216.50	
RPT REALTY	51,580	617,928.40	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,830	2,383,952.70	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	104,520	2,251,360.80	
SAFEHOLD INC	4,700	136,065.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	353,358.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	143,800	1,295,638.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	15,700	613,085.00	
SIMON PROPERTY GROUP	177,960	26,686,881.60	
SITE CENTERS CORP	84,059	1,161,695.38	
SL GREEN REALTY CORP	48,540	3,843,397.20	
SPIRIT MTA REIT	23,901	203,636.52	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	51,730	2,387,856.80	
STAG INDUSTRIAL INC	74,400	2,194,056.00	
STORE CAPITAL CORP	117,680	4,309,441.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	737,846.90	
SUN COMMUNITIES INC	51,510	7,557,547.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	137,090	1,805,475.30	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	809,895.60	
TAUBMAN CENTERS INC	34,900	1,408,564.00	
TERRENO REALTY CORP	34,490	1,755,196.10	
UDR INC	163,470	7,805,692.50	
UMH PROPERTIES INC	20,000	255,000.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	764,019.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	1,199,749.60	
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	347,325.00	
VENTAS INC	211,090	15,477,118.80	
VEREIT INC	565,380	5,455,917.00	
VICI PROPERTIES INC	237,740	5,018,691.40	
VORNADO REALTY TRUST	99,150	6,086,818.50	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	354,692.50	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	1,255,152.80	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,570	1,814,698.20	
WELLTOWER INC	231,630	20,712,354.60	
WHITESTONE REIT	22,610	287,373.10	
WP CAREY INC	97,520	8,648,073.60	

	XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	1,409,195.90	
	アメリカドル 小計	13,143,101	531,044,725.23 (56,635,919,945)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,590	1,746,008.20	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	540,862.20	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	637,199.20	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	43,270	2,293,742.70	
	CHOICE PROPERTIES REIT	83,590	1,151,870.20	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	665,150.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	341,562.54	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	31,000	447,020.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	59,940	859,539.60	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	419,796.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	505,693.40	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,100	886,608.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	83,630	1,886,692.80	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,000	527,000.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	528,870.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	102,902.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	154,722.90	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	461,771.93	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	33,000	383,130.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	82,380	2,195,427.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	100,810.00	
SLATE RETAIL REIT	10,300	132,870.00		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,810	1,243,860.50		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	33,000	424,050.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	101,250.00		
	カナダドル 小計	851,840	18,738,409.17 (1,499,447,501)	
ユーロ	AEDIFICA	13,866	1,389,373.20	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	90,000	1,333,800.00	
	ALTAREA	2,000	373,200.00	
	BEFIMMO S.C.A.	11,960	617,136.00	
	COFINIMMO	14,310	1,728,648.00	
	COVIVIO(FP)	38,160	3,602,304.00	
	EUROCOMMERCIAL	21,040	478,028.80	

	GECINA SA	31,760	4,487,688.00
	GREEN REIT PLC	377,170	716,623.00
	HAMBORNER REIT AG	44,000	410,212.00
	HIBERNIA REIT PLC	402,550	590,138.30
	ICADE	25,220	2,003,729.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	179,762.80
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	162,460	1,666,839.60
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	374,660.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	225,021	388,836.28
	KLEPIERRE	116,480	3,200,870.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	226,450.00
	MERCIALYS	34,020	354,148.20
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,470	2,594,736.90
	MONTEA	5,900	450,170.00
	NSI NV	11,700	459,810.00
	RETAIL ESTATES	4,200	340,200.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	78,160	9,551,152.00
	VASTNED RETAIL	8,500	223,125.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	10,300	1,683,020.00
	WERELDHAVE NV	24,970	448,960.60
	ユーロ 小計	2,048,307	39,873,622.08 (4,713,062,129)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	1,400,150	952,102.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	92,570	910,425.95
	BRITISH LAND CO PLC	540,830	2,624,107.16
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	41,760.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	368,000	310,592.00
	DERWENT LONDON PLC	62,900	1,936,062.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	310,000	280,550.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	153,000	1,033,974.00
	HAMMERSON PLC	431,120	903,196.40
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	239,594.22
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	189,732.46
	LAND SECURITIES GROUP PLC	428,830	3,222,228.62
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	474,110	960,546.86
	LXI REIT PLC	297,000	372,438.00
	NEWRIVER REIT PL	173,000	267,112.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	320,000	277,440.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	653,700	857,654.40
	RDI REIT PLC	154,400	162,120.00
	REGIONAL REIT LTD	232,000	240,816.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	792,980.00

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	134,500.00	
	SEGRO PLC	631,660	4,784,192.84	
	SHAFTESBURY PLC	132,430	1,019,711.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	194,258.82	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,018,700	1,469,984.10	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	354,000	295,236.00	
	UNITE GROUP PLC	165,020	1,721,158.60	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,420	595,292.40	
	イギリスポンド 小計	10,138,666	26,789,765.83 (3,464,720,414)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	214,440	836,316.00	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	216,750.00	
	ARENA REIT	141,000	399,030.00	
	BWP TRUST	298,560	1,131,542.40	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	130,800	498,348.00	
	CHARTER HALL GROUP	271,600	3,264,632.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	154,000	840,840.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	852,243.40	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,117,623	1,352,323.83	
	DEXUS	622,590	8,037,636.90	
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	436,912.50	
	GOODMAN GROUP	923,710	13,652,433.80	
	GPT GROUP	1,100,530	6,779,264.80	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	142,860	628,584.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	263,640.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	124,000	429,040.00	
	MIRVAC GROUP	2,244,360	7,069,734.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	380,000	653,600.00	
	RURAL FUNDS GROUP	189,816	385,326.48	
	SCENTRE GROUP	3,063,440	11,732,975.20	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	514,230	1,306,144.20		
STOCKLAND	1,376,580	6,139,546.80		
VICINITY CENTERS	1,897,480	4,686,775.60		
VIVA ENERGY REIT	290,000	768,500.00		
	オーストラリアドル 小計	15,829,499	72,362,139.91 (5,215,863,044)	
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	710,325.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	580,000	1,241,200.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	780,000	1,263,600.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	615,000	1,134,675.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	228,000	531,240.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	483,646.80	
		2,885,460	5,364,686.80	

ニュージーランドドル 小計			(366,676,342)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,133,000	6,220,170.00	
	FORTUNE REIT	758,000	7,519,360.00	
	LINK REIT	1,209,500	113,813,950.00	
	PROSPERITY REIT	782,000	2,463,300.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	3,517,080.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	740,000	3,936,800.00	
香港ドル 小計		5,258,500	137,470,660.00	(1,869,600,976)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	340,000	493,000.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	456,750.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,436,566	4,367,160.64	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	884,480.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	711,000	522,585.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,554,528	3,233,418.24	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,639,600	4,312,148.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	367,460	543,840.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	733,280.00	
	ESR REIT	1,130,579	587,901.08	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	307,200.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	348,140.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	366,829	975,765.14	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	579,600.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	322,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	977,820	1,163,605.80	
	KEPPEL DC REIT	519,460	924,638.80	
	KEPPEL REIT	1,074,800	1,332,752.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	214,650.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,035,830	2,123,451.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	774,860	1,743,435.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,387,152	2,163,957.12	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,251,800	1,702,448.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	680,000	493,000.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	760,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	215,343.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	186,296.00	
	SPH REIT	322,300	351,307.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	706,300	533,256.50	

	SUNTEC REIT	1,334,500	2,548,895.00	
	シンガポールドル 小計	22,837,424	35,124,304.62 (2,701,059,025)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	126,000,000.00	
	韓国ウォン 小計	17,500	126,000,000.00 (11,113,200)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	104,000	2,167,360.00	
	イスラエルシェケル 小計	104,000	2,167,360.00 (65,562,640)	
	合計	73,114,297	76,543,025,216 (76,543,025,216)	

(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%	74.0%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.2%
イギリスポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	4.5%
オーストラリアドル	投資証券 24銘柄	100.0%	6.8%
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%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.5%
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。

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 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	61,973,742
コール・ローン	75,500,274
投資信託受益証券	27,443,523,546
派生商品評価勘定	599,544,714
未収入金	8,828,823
流動資産合計	28,189,371,099
資産合計	28,189,371,099
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,867,080
未払解約金	82,153,674
未払利息	162
流動負債合計	89,020,916
負債合計	89,020,916
純資産の部	
元本等	
元本	25,825,073,104
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,275,277,079
元本等合計	28,100,350,183
純資産合計	28,100,350,183
負債純資産合計	28,189,371,099

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月20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>

2019年 8月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,825,073,104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 1.0881円 (1万口当たり純資産額) (10,881円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 8月20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 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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つた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	18,603,798,505円
期中追加設定元本額	10,204,483,421円
期中一部解約元本額	2,983,208,822円
期末元本額	25,825,073,104円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,113,291,867円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,919,017,488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）	969,000,483円
グローバル経済コア	2,501,143,959円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	228,519,558円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	592,718,530円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	53,734,804円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月20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	1,839,789,288
合計	1,839,789,288

(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 8月20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	28,074,352,671	-	27,481,675,037	592,677,634
	アメリカドル	28,074,352,671	-	27,481,675,037	592,677,634
合計		28,074,352,671	-	27,481,675,037	592,677,634

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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	17,969,500	257,323,240.00	
		アメリカドル 小計	17,969,500	257,323,240.00 (27,443,523,546)	
合計			17,969,500	27,443,523,546 (27,443,523,546)	

(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。

【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3期中間計算期間(2019年8月21日から2020年2月20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。

【グローバル経済コア】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2019年 8月20日現在)	第3期中間計算期間 (2020年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	169,064,818	187,472,232
親投資信託受益証券	12,651,925,042	11,476,509,697
未収入金	10,660,686	162,936,895
流動資産合計	12,831,650,546	11,826,918,824
資産合計	12,831,650,546	11,826,918,824
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,148,466	167,743,029
未払受託者報酬	3,370,986	3,391,193
未払委託者報酬	53,935,681	54,259,046
未払利息	364	97
その他未払費用	337,041	339,058
流動負債合計	85,792,538	225,732,423
負債合計	85,792,538	225,732,423
純資産の部		
元本等		
元本	12,719,497,109	10,495,313,529
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	26,360,899	1,105,872,872
(分配準備積立金)	337,823,036	226,266,189
元本等合計	12,745,858,008	11,601,186,401
純資産合計	12,745,858,008	11,601,186,401
負債純資産合計	12,831,650,546	11,826,918,824

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2018年 8月21日 至 2019年 2月20日	第3期中間計算期間 自 2019年 8月21日 至 2020年 2月20日
営業収益		
受取利息	25	157
有価証券売買等損益	373,975,041	1,252,546,881
営業収益合計	373,975,066	1,252,547,038
営業費用		
支払利息	66,727	33,683
受託者報酬	3,499,892	3,391,193
委託者報酬	55,998,153	54,259,046
その他費用	354,700	339,108
営業費用合計	59,919,472	58,023,030
営業利益又は営業損失（ ）	314,055,594	1,194,524,008
経常利益又は経常損失（ ）	314,055,594	1,194,524,008
中間純利益又は中間純損失（ ）	314,055,594	1,194,524,008
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（ ）	17,898,231	209,832,055
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	521,605,120	26,360,899
剰余金増加額又は欠損金減少額	96,402,375	115,291,562
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	96,402,375	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	115,291,562
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,006,431	20,471,542
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	20,471,542
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,006,431	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	182,051,813	1,105,872,872

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2019年 8月20日現在)	第3期中間計算期間 (2020年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,719,497,109口	10,495,313,529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) 1.0021円 (10,021円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1054円 (11,054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3期中間計算期間 (2020年 2月20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。

	第3期中間計算期間 (2020年 2月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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2期 自 2018年 8月21日 至 2019年 8月20日	第3期中間計算期間 自 2019年 8月21日 至 2020年 2月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,165,027,817円	12,719,497,109円
期中追加設定元本額	3,975,335,196円	2,496,625,579円
期中一部解約元本額	5,420,865,904円	4,720,809,159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

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,161,277,207
株式	314,563,626,880

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	2,879,300
未収入金	23,495,000
未収配当金	517,395,108
前払金	51,512,000
差入委託証拠金	114,656,000
流動資産合計	318,434,841,495
資産合計	318,434,841,495
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	54,411,650
未払金	256,550
未払解約金	261,543,415
未払利息	1,652
流動負債合計	316,213,267
負債合計	316,213,267
純資産の部	
元本等	
元本	203,805,556,316
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	114,313,071,912
元本等合計	318,118,628,228
純資産合計	318,118,628,228
負債純資産合計	318,434,841,495

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2020年 2月20日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	203,805,556,316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 1.5609円 (1万口当たり純資産額) (15,609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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	204,872,395,529円
期中追加設定元本額	20,369,783,935円
期中一部解約元本額	21,436,623,148円
期末元本額	203,805,556,316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）	544,887,611円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,003,261,240円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,420,919円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,140,261,533円
世界経済インデックスファンド	2,108,449,394円
日本株式インデックス・オープン	4,427,782,767円
DCマイセレクション25	6,749,330,615円
DCマイセレクション50	19,072,847,932円
DCマイセレクション75	17,476,612,675円
DC日本株式インデックス・オープン	5,605,644,330円
DCマイセレクションS25	2,699,747,072円
DCマイセレクションS50	7,782,700,714円
DCマイセレクションS75	5,102,265,040円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,680,219,749円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	395,781,971円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	719,651,694円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	476,560,893円
DC世界経済インデックスファンド	2,792,700,219円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,031,399,041円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,194,356円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,549,748円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	39,929,163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）	276,171,661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）	73,815,045円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	261,809,314円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,310,674円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	359,339,540円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,598,484,418円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	678,708,658円

区分	2020年 2月20日現在
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,969,519,022円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	602,676,470円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	38,635,799円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	738,819,378円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	33,379,122円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	420,191,759円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	544,293,035円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,821,786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)	806,482,259円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,554,598,923円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,679,219,587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)	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	6,190,630,568円
分散投資コア戦略ファンドS	17,758,549,641円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	295,786,125円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	301,718,960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)	207,755,895円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,697,888円
SMT インデックスバランス・オープン	69,276,581円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,686,580,487円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	19,092,354円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	66,373,376円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	11,368,195円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,917,181円
グローバル経済コア	262,547,963円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,724,760円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	41,632,364円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,998,871円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	371,773,817円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,792,567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)	47,001,446,790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)	538,222,154円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	17,213,426円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	10,463,930円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 2月20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	3,558,532,000	-	3,507,020,000	51,512,000
合計		3,558,532,000	-	3,507,020,000	51,512,000

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 2月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,457,737,205
国債証券	465,635,426,850
地方債証券	30,203,067,787
特殊債券	38,074,345,183
社債券	23,084,293,330
未収入金	598,399,700
未収利息	1,249,149,463
前払費用	32,417,046
流動資産合計	560,334,836,564
資産合計	560,334,836,564
負債の部	
流動負債	
未払金	1,400,000,000
未払解約金	267,954,781
未払利息	762
流動負債合計	1,667,955,543
負債合計	1,667,955,543
純資産の部	
元本等	
元本	391,858,476,687
剰余金	
剰余金又は欠損金()	166,808,404,334
元本等合計	558,666,881,021
純資産合計	558,666,881,021
負債純資産合計	560,334,836,564

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	391,858,476,687口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,835,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4257円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,257円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 2月20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

	2020年 2月20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>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> <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>

(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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	339,472,890,353円
期中追加設定元本額	62,817,642,967円
期中一部解約元本額	10,432,056,633円
期末元本額	391,858,476,687円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,844,848,547円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,791,285円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,171,295,807円
世界経済インデックスファンド	1,893,993,462円
D C マイセレクション 2 5	21,419,398,709円
D C マイセレクション 5 0	23,325,242,848円
D C マイセレクション 7 5	6,406,883,650円
D C 日本債券インデックス・オープン	457,248,242円
D C 日本債券インデックス・オープン S	88,905,271,829円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,939,958,588円

区分	2020年 2月20日現在
DCマイセレクションS25	8,719,399,175円
DCマイセレクションS50	9,545,944,133円
DCマイセレクションS75	1,854,044,875円
DCターゲット・イヤーフンド2025	1,118,703,616円
DCターゲット・イヤーフンド2035	1,353,656,178円
DCターゲット・イヤーフンド2045	457,485,872円
DC世界経済インデックスファンド	2,510,101,269円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	69,224,082円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	5,496,023円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	43,938,112円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,795,070円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	936,306円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	157,929,405円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	239,013,073円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	58,118,177円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	110,078,145円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,064,273,373円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	925,803,629円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,508,827,279円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	802,462,619円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	92,998,901円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,194,808,889円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	26,792,803円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,373,379,170円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,770,820,683円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	156,740,070円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,414,966,554円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,558,985,200円
分散投資コア戦略ファンドA	12,107,273,774円
分散投資コア戦略ファンドS	11,035,940,003円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	80,437,883円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	886,389,117円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	46,195,796円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,198,940円
SMT インデックスバランス・オープン	58,002,464円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,148,985円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	23,598,235円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,398,853円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,832,011円
グローバル経済コア	218,595,923円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,962,474円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,408,380円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円

区分	2020年 2月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,757,790,970円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	14,368,599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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,102,658,344
コール・ローン	213,695,562
株式	402,965,056,174
投資信託受益証券	289,074,025
投資証券	11,158,312,327
派生商品評価勘定	445,715,592
未収入金	131,608
未収配当金	488,081,287
差入委託証拠金	2,098,857,061
流動資産合計	429,761,581,980
資産合計	429,761,581,980
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,687,899
前受金	434,037,407
未払解約金	297,873,457
未払利息	111
流動負債合計	745,598,874
負債合計	745,598,874
純資産の部	
元本等	
元本	141,526,447,301
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	287,489,535,805
元本等合計	429,015,983,106
純資産合計	429,015,983,106
負債純資産合計	429,761,581,980

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20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 2月20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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,526,447,301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 3.0313円 (1万口当たり純資産額) (30,313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 2月20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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	136,510,691,604円
期中追加設定元本額	18,154,268,737円
期中一部解約元本額	13,138,513,040円
期末元本額	141,526,447,301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）	2,379,405,245円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,971,137円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,981,871,905円
世界経済インデックスファンド	7,405,995,318円
外国株式インデックス・オープン	677,811,144円
D C マイセレクション 2 5	1,064,002,566円
D C マイセレクション 5 0	4,712,232,400円
D C マイセレクション 7 5	4,925,388,294円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,945,850,112円
D C マイセレクション S 2 5	420,849,013円
D C マイセレクション S 5 0	1,916,558,810円
D C マイセレクション S 7 5	1,432,841,416円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	110,910,468円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	197,608,772円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	130,901,172円
D C 世界経済インデックスファンド	9,757,774,341円

区分	2020年 2月20日現在
外国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	1,892,514,280円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	7,966,343円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	10,869,716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)	38,234,500円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	37,816,816円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	144,362,791円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	29,957,802円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	194,604,265円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	602,400,845円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	321,805,279円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,177,662,089円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,664,535,380円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	63,162,042円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	309,942,695円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	7,601,558円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	101,774,382円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,750,665,949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)	1,870,201,277円
外国株式ファンド・シリーズ1	999,280,513円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,147,459,980円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,268,074,755円
分散投資コア戦略ファンドA	2,488,858,275円
分散投資コア戦略ファンドS	7,529,579,522円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,033,147,167円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,111,545,752円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,354,628,498円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	728,259,287円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	40,387,375円
S M T インデックスバランス・オープン	241,451,832円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,183,334,181円
外国株式S M T B セレクション(S M A 専用)	29,548,578,929円
S M T 世界経済インデックス・オープン	94,312,955円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	327,803,834円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	56,134,574円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,704,874円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	56,725,089円
グローバル経済コア	871,869,049円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A 対応型)	8,657,599円
D C ターゲット・イヤーフンド2055	838,726円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	874,242,211円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	66,563,030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 2月20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）	1,104,488,511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）	773,111,536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）	2,106,405,021円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	84,928,146円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	51,729,705円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	341,366,833円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	736,648,251円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 2月20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	13,675,989,825	-	14,110,027,232	434,037,407
	合計	13,675,989,825	-	14,110,027,232	434,037,407

(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

（2020年 2月20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	512,440,896	-	514,450,610	2,009,714
	アメリカドル	399,233,760	-	400,857,810	1,624,050
	カナダドル	24,879,600	-	25,263,000	383,400
	ユーロ	60,144,500	-	60,145,000	500
	イギリスポンド	28,183,036	-	28,184,800	1,764
	合計	512,440,896	-	514,450,610	2,009,714

(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

項目	2020年 2月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	740,844,585
コール・ローン	2,635,266,983
国債証券	407,678,437,869
派生商品評価勘定	37,496,115
未収入金	69,732
未収利息	2,542,377,860
前払費用	127,505,732
差入委託証拠金	280,740,073
流動資産合計	414,042,738,949
資産合計	
414,042,738,949	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	876,021
前受金	11,018,177
未払金	433,538
未払解約金	60,006,985
未払利息	1,377
流動負債合計	72,336,098
負債合計	
72,336,098	
純資産の部	
元本等	
元本	142,025,785,328
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	271,944,617,523
元本等合計	413,970,402,851
純資産合計	
413,970,402,851	
負債純資産合計	
414,042,738,949	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2020年 2月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(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>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,025,785,328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 2.9148円 (1万口当たり純資産額) (29,148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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	138,036,622,052円
期中追加設定元本額	11,833,228,238円
期中一部解約元本額	7,844,064,962円
期末元本額	142,025,785,328円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,669,103,218円

区分	2020年 2月20日現在
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	675,101,388円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	471,049,301円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,040,779,918円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,976,894円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,569,021,041円
世界経済インデックスファンド	6,781,695,966円
DCマイセレクション25	1,714,348,513円
DCマイセレクション50	1,303,507,048円
DCマイセレクション75	837,076,565円
DC外国債券インデックス・オープン	1,951,472,671円
DCマイセレクションS25	690,653,112円
DCマイセレクションS50	535,457,743円
DCマイセレクションS75	244,667,449円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,946,216円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	68,706,354円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	32,888,256円
DC世界経済インデックスファンド	9,045,977,890円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	616,827,707円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	31,953,090円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,716,019円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,082,256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）	46,468,633円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	89,858,688円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	136,916,537円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	144,394,884円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	312,580,254円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,990,254,329円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	590,773,108円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,125,145,230円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	835,424,907円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	73,523,111円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	592,510,668円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	33,762,723円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	220,854,697円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	288,753,156円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	921,099,069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）	2,037,110,408円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	863,019,605円
外国債券ファンド・シリーズ1	561,925,889円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,177,068,436円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,006,283,821円
分散投資コア戦略ファンドA	1,750,414,452円
分散投資コア戦略ファンドS	6,593,342,498円

区分	2020年 2月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	309,446,316円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,922,965,171円
コア投資戦略ファンド(切替型)	858,743,754円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	218,928,189円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,046,294円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,063,066,888円
S M T インデックスバランス・オープン	213,293,421円
外国債券S M T Bセクション(S M A専用)	23,018,782,261円
S M T 世界経済インデックス・オープン	94,977,345円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	105,669,054円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	167,392,610円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,625,346円
グローバル経済コア	897,173,931円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	7,656,756円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	171,025円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	249,643,871円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,162,672円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
F O F s 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)	711,734,875円
F O F s 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)	10,863,405,155円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	347,529,591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)	40,051,713,283円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	64,064,630円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2020年 2月20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	2,177,921,950	-	2,188,940,127	11,018,177
	合計	2,177,921,950	-	2,188,940,127	11,018,177

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2020年 2月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,653,592,483	-	2,679,194,400	25,601,917
	アメリカドル	1,381,276,828	-	1,399,126,700	17,849,872
	カナダドル	107,315,883	-	109,330,000	2,014,117
	ユーロ	981,430,000	-	985,338,900	3,908,900
	イギリスポンド	183,569,772	-	185,398,800	1,829,028
合計		2,653,592,483	-	2,679,194,400	25,601,917

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,208,552,944
コール・ローン	43,554,358
株式	67,443,915,991
投資信託受益証券	234,388,814
投資証券	152,717,805
派生商品評価勘定	19,122,912
未収入金	2,378,435
未収配当金	110,035,515
前払金	47,178,826
差入委託証拠金	740,718,994
流動資産合計	72,002,564,594
資産合計	72,002,564,594
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	66,841,738
未払金	15,122
未払解約金	75,764,701
未払利息	22

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	142,621,583
負債合計	142,621,583
純資産の部	
元本等	
元本	23,563,466,524
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	48,296,476,487
元本等合計	71,859,943,011
純資産合計	71,859,943,011
負債純資産合計	72,002,564,594

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20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</p>

	2020年 2月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,563,466,524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 3.0496円 (1万口当たり純資産額) (30,496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 2月20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。

	2020年 2月20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>

(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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	20,402,768,336円
期中追加設定元本額	3,950,377,520円
期中一部解約元本額	789,679,332円
期末元本額	23,563,466,524円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,312,651,475円
世界経済インデックスファンド	3,386,687,089円
DC新興国株式インデックス・オープン	4,313,013,316円
DC世界経済インデックスファンド	4,436,350,189円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	211,999,348円

区分	2020年 2月20日現在
分散投資コア戦略ファンドA	347,760,091円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,634,607円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	478,284,543円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	490,475,699円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	339,201,241円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,985,892円
SMT インデックスバランス・オープン	108,554,378円
SMT 世界経済インデックス・オープン	67,764,331円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	235,572,622円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,342,775円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,571,328円
グローバル経済コア	414,758,732円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	15,942,818円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	26,252円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	29,706円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,160円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	36,269円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	60,774,062円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	38,016,601円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 2月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,025,096,083	-	3,977,917,257	47,178,826
	合計	4,025,096,083	-	3,977,917,257	47,178,826

(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

（2020年 2月20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	43,968,000	-	44,508,000	540,000
	アメリカドル	43,968,000	-	44,508,000	540,000
合計	43,968,000	-	44,508,000	540,000	

(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。

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 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	802,511,656
コール・ローン	701,648,924
国債証券	58,706,661,823
未収利息	816,845,338
前払費用	74,243,592
流動資産合計	61,101,911,333
資産合計	61,101,911,333
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,030,987
未払利息	366
流動負債合計	20,031,353
負債合計	20,031,353
純資産の部	
元本等	
元本	33,638,503,619
剰余金	
剰余金又は欠損金()	27,443,376,361
元本等合計	61,081,879,980
純資産合計	61,081,879,980
負債純資産合計	61,101,911,333

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2020年 2月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(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> <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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	33,638,503,619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	<p>1口当たり純資産額 1.8158円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,158円)</p>

(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 2月20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</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

	2020年 2月20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>

（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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	29,692,604,998円
期中追加設定元本額	5,608,656,111円
期中一部解約元本額	1,662,757,490円
期末元本額	33,638,503,619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	4,108,660,743円
世界経済インデックスファンド	5,641,908,664円
DC 新興国債券インデックス・オープン	4,414,977,113円
DC 世界経済インデックスファンド	7,412,053,555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）	1,822,265,945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）	407,214,225円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	98,696,583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）	257,354,327円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,441,756,197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）	187,550,512円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	88,293,214円

区分	2020年 2月20日現在
SMT インデックスバランス・オープン	185,298,222円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,266,682,471円
SMT 世界経済インデックス・オープン	112,964,557円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	125,668,442円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	199,085,100円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,563,090円
グローバル経済コア	706,077,372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）	91,120,298円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	77,018,183円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	275,740,363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 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,402,410,618
投資証券	125,358,884,020
派生商品評価勘定	128,271,200
未収入金	368,836,460
未収配当金	880,572,155
差入委託証拠金	71,343,500
流動資産合計	129,210,317,953
資産合計	129,210,317,953
負債の部	
流動負債	
前受金	128,271,200
未払金	80,242,925
未払解約金	215,209,375
未払利息	1,255
流動負債合計	423,724,755
負債合計	423,724,755
純資産の部	

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	57,587,131,083
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,199,462,115
元本等合計	128,786,593,198
純資産合計	128,786,593,198
負債純資産合計	129,210,317,953

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,587,131,083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 2.2364円 (1万口当たり純資産額) (22,364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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	57,883,572,656円
期中追加設定元本額	6,152,703,012円
期中一部解約元本額	6,449,144,585円
期末元本額	57,587,131,083円

区分	2020年 2月20日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,606,215,052円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,370,719円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	13,416,018,395円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,110,415,394円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,986,320,493円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,824,191,741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	4,793,092,764円
コア投資戦略ファンド（切替型）	987,019,160円
S M T インデックスバランス・オープン	29,757,506円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	378,087,577円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,261,325円
グローバル経済コア	270,731,414円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,778,753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）	33,478,944円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	837,288,638円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	3,125,882円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	944,190,097円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	399,796,490円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	325,152,323円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2020年 2月20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	3,165,297,800	-	3,293,569,000	128,271,200
	合計	3,165,297,800	-	3,293,569,000	128,271,200

(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 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	307,820,462
コール・ローン	783,383
投資証券	99,569,364,917
未収入金	6,163,080
未収配当金	202,223,679
流動資産合計	100,086,355,521
資産合計	100,086,355,521
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	731,700
未払解約金	57,461,722
流動負債合計	58,193,422
負債合計	58,193,422
純資産の部	
元本等	
元本	46,909,006,463
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,119,155,636
元本等合計	100,028,162,099
純資産合計	100,028,162,099
負債純資産合計	100,086,355,521

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 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 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			46,909,006,463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)		2.1324円 (21,324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 2月20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	<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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月21日
期首元本額	40,660,606,854円
期中追加設定元本額	9,155,384,442円
期中一部解約元本額	2,906,984,833円
期末元本額	46,909,006,463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	84,343,236円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	127,958,404円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,615,710,559円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,458,149円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,776,979,333円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	21,079,587,060円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,389,605,380円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,784,732,695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）	843,424,193円
SMT インデックスバランス・オープン	169,490,335円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	398,653,196円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,308,285円
グローバル経済コア	285,660,426円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	5,853,818円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	449,833,412円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,528,157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）	841,103,117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）	699,130,991円

FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	30,291,840円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	122,123,981円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 2月20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	59,576,640	-	60,308,340	731,700
	アメリカドル	59,576,640	-	60,308,340	731,700
合計		59,576,640	-	60,308,340	731,700

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2020年 2月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,986,428
コール・ローン	69,349,465
投資信託受益証券	29,297,095,778
流動資産合計	29,374,431,671
資産合計	29,374,431,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	731,606,742
未払金	1,622,740
未払解約金	15,902,640
未払利息	36
流動負債合計	749,132,158

	2020年 2月20日現在
項目	金額（円）
負債合計	749,132,158
純資産の部	
元本等	
元本	24,788,519,931
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,836,779,582
元本等合計	28,625,299,513
純資産合計	28,625,299,513
負債純資産合計	29,374,431,671

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 2月20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 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		24,788,519,931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)	1.1548円 (11,548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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2020年 2月20日現在
期首	2019年 8月21日
期首元本額	25,825,073,104円
期中追加設定元本額	3,364,113,602円
期中一部解約元本額	4,400,666,775円
期末元本額	24,788,519,931円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,339,081,821円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,714,891,643円
分散投資コア戦略ファンドA	3,802,615,813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）	1,578,743,286円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	684,528,194円
グローバル経済コア	1,502,872,884円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	367,631,981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）	49,366,759円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,263,781円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 2月20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	27,765,329,283	-	28,496,936,025	731,606,742
	アメリカドル	27,765,329,283	-	28,496,936,025	731,606,742
合計		27,765,329,283	-	28,496,936,025	731,606,742

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	10,206,006,266円
負債総額	51,309,492円
純資産総額（ - ）	10,154,696,774円
発行済口数	10,718,527,891口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9474円
（1万口当たり純資産額）	（9,474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 3月31日現在)

資産総額	286,112,891,528円
負債総額	380,599,746円
純資産総額（ - ）	285,732,291,782円
発行済口数	215,676,267,391口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3248円
（1万口当たり純資産額）	（13,248円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	541,700,734,110円
負債総額	4,680,241,497円
純資産総額（ - ）	537,020,492,613円
発行済口数	379,552,519,382口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4149円
（1万口当たり純資産額）	（14,149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 3月31日現在)

資産総額	338,917,674,442円
負債総額	1,445,799,305円
純資産総額（ - ）	337,471,875,137円
発行済口数	149,458,546,758口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2580円
（1万口当たり純資産額）	（22,580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 3月31日現在)

資産総額	394,136,693,880円
負債総額	1,496,636,658円
純資産総額（ - ）	392,640,057,222円
発行済口数	134,837,064,235口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9120円
（1万口当たり純資産額）	（29,120円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	55,795,009,696円
負債総額	295,295,079円
純資産総額（ - ）	55,499,714,617円
発行済口数	24,612,349,538口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2550円
（1万口当たり純資産額）	（22,550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 3月31日現在)

資産総額	51,176,042,689円
負債総額	22,825,600円
純資産総額（ - ）	51,153,217,089円
発行済口数	34,038,163,758口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5028円
（1万口当たり純資産額）	（15,028円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	96,657,349,013円
負債総額	1,187,841,772円
純資産総額（ - ）	95,469,507,241円
発行済口数	59,857,812,099口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5949円
（1万口当たり純資産額）	（15,949円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	73,435,583,621円
負債総額	1,932,448,694円
純資産総額（ - ）	71,503,134,927円
発行済口数	49,604,786,531口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4415円
（1万口当たり純資産額）	（14,415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 3月31日現在)

資産総額	28,144,123,261円
負債総額	1,156,494,528円
純資産総額（ - ）	26,987,628,733円

発行済口数	23,315,980,713口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1575円
（1万口当たり純資産額）	（11,575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 3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、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2020年 5月20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3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	545	11,815,780
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	82	293,064
単位型公社債投資信託	23	176,922
合計	650	12,285,766

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

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

6. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

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

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

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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

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

（貸借対照表関係）

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

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

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

(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	"	-	"
賞与引当金損金繰入限度超過額	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5月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル経済コアの2018年8月21日から2019年8月20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、グローバル経済コアの2019年8月20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4月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル経済コアの2019年8月21日から2020年2月20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な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、グローバル経済コアの2020年2月20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8月21日から2020年2月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。