

【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6月5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】	S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）
愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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 6月 6日から2020年12月 7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、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、国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」といふことがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

<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	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	ファンド	()		
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株	年4回	日本	ファンド・	なし		
債券			オブ・ファンズ		その他	ロング・
一般	年6回	北米			()	ショート型/ 絶対収益追求型
公債	(隔月)	欧州				
社債						
その他債券	年12回					その他
クレジット属性	(毎月)	アジア				()
()	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
	()					
その他資産		アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株		中近東				
式、債券、不動		(中東)				
産投信)資産配						
分固定型))		エマージン				
		グ				
資産複合						
()						
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

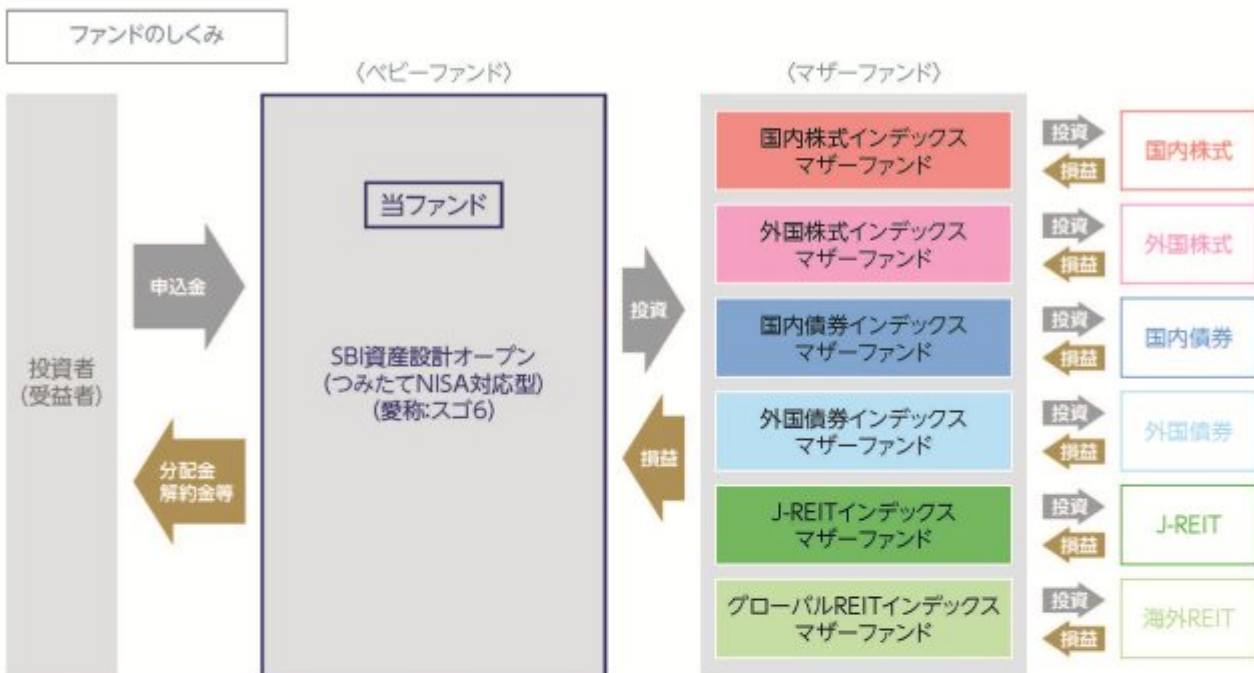
[特殊型]

- (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. 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6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。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

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、各マザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J-REIT	東証REIT指数(配当込み)
海外REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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

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

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数

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

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

「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。

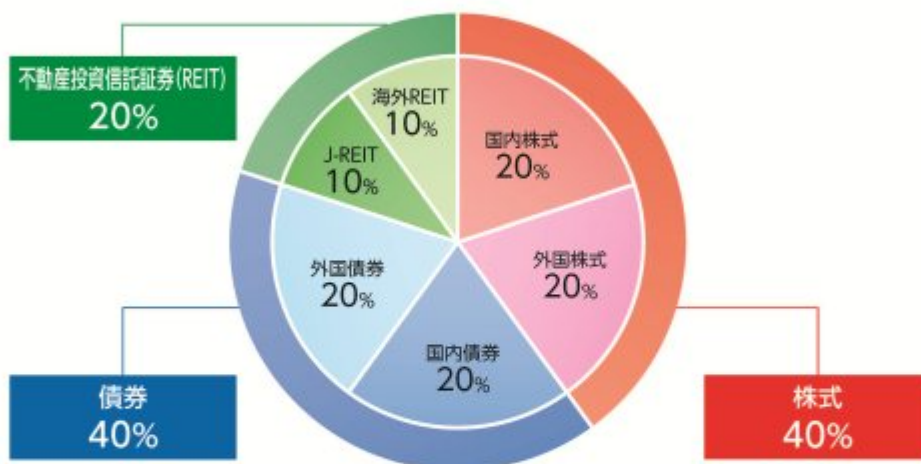
「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE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

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

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

3. 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券(REIT)20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.55%(税抜0.5%)です。)

分配方針

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

主な投資制限

- 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は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

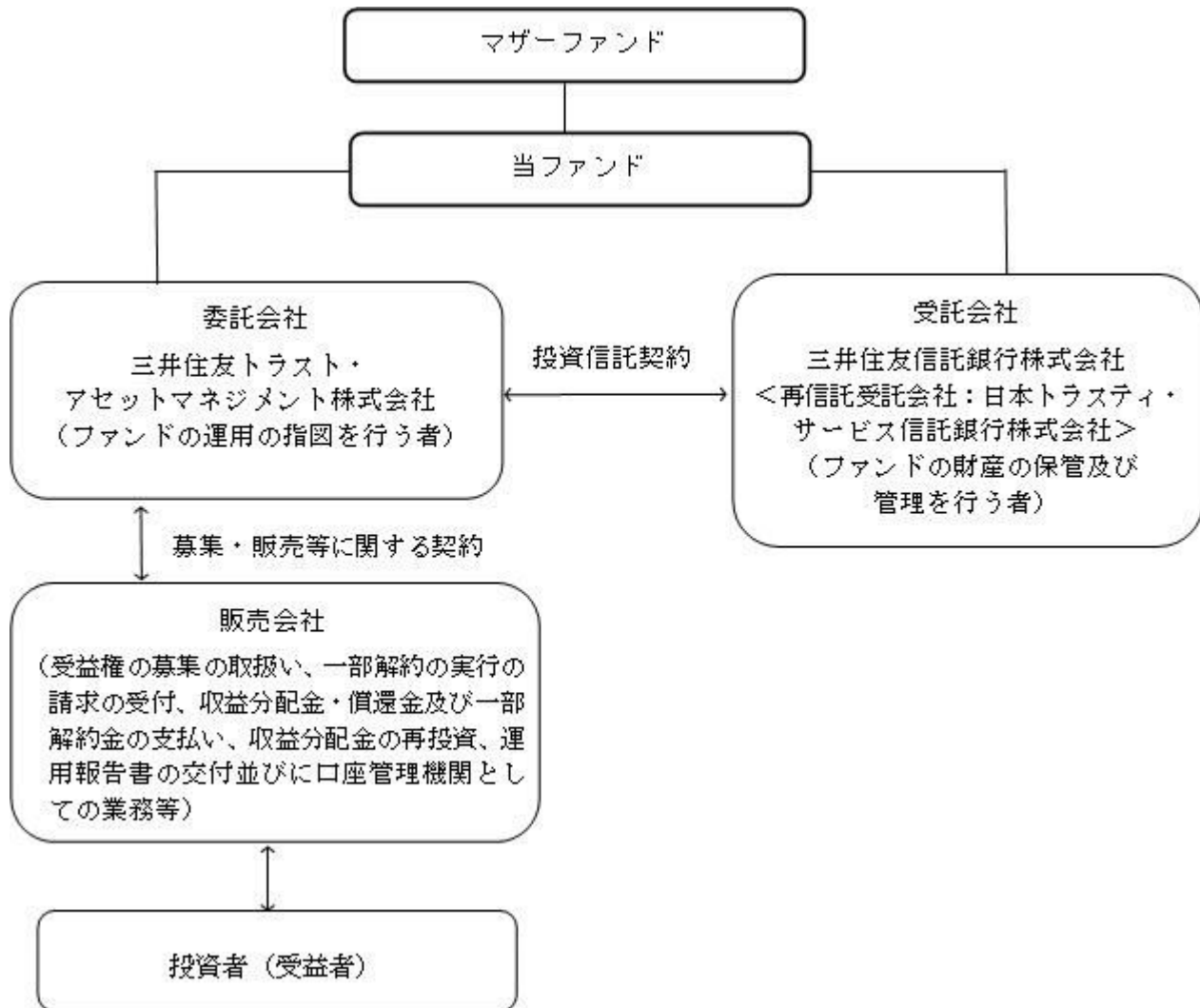
(2) 【ファンドの沿革】

2017年12月19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

ハ．大株主の状況

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	TOPIX（東証株価指数）	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	10%

ハ．各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ホ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ロ.次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

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。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場

合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債並びに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。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

係る先物オプション取引を行うことができます。

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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がたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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券、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。

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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

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並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

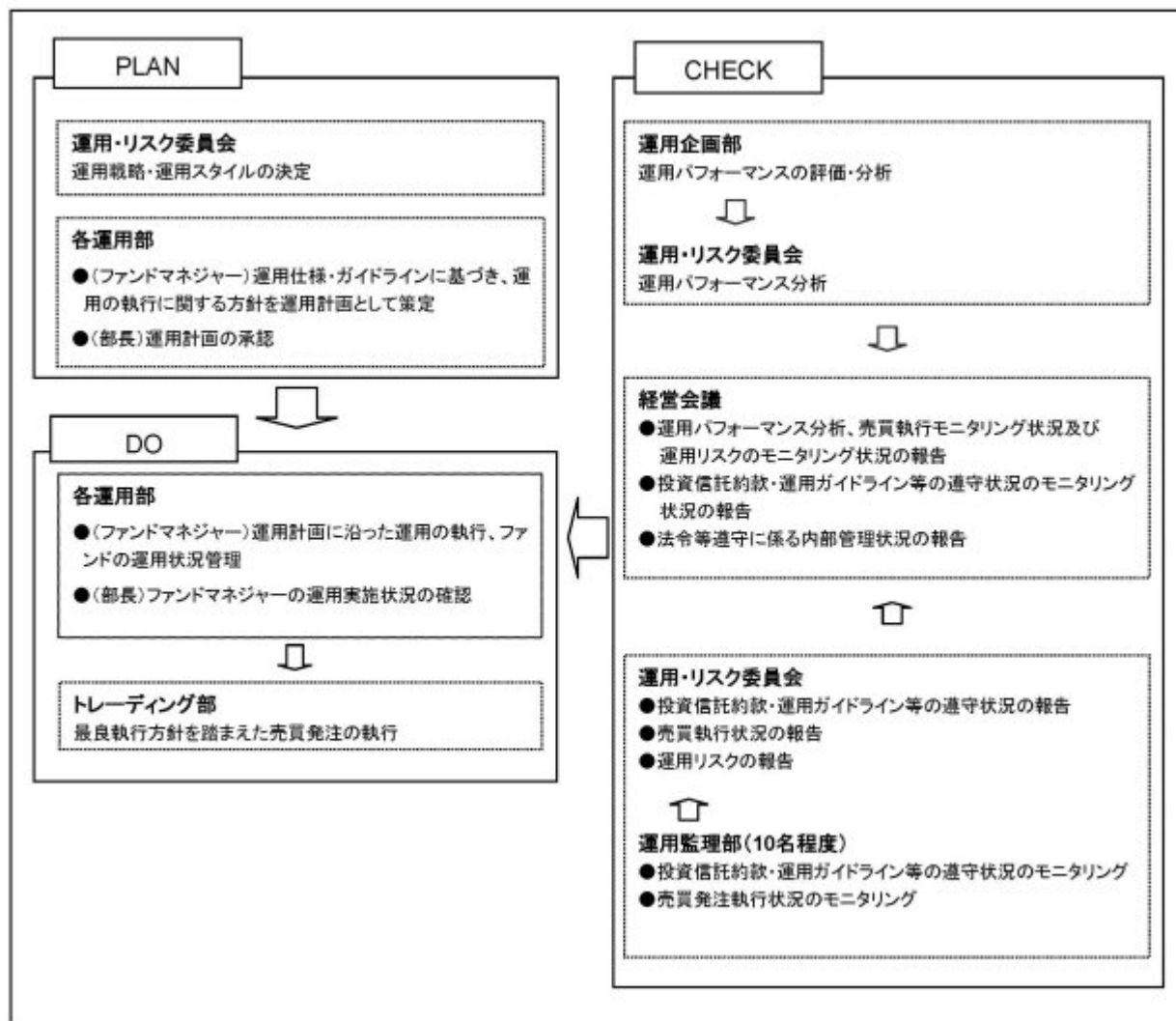
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年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は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

二．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ます。

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行

うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

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

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として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）金利先渡取引及び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、金利先渡取引及び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るものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

カ．資金の借入れ

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

及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(八) 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。

(二) 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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者

の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年12月～2020年3月の1年4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全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIロジック・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロジック・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 JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) (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】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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。

「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せん。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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。

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に相当する額を、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（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所
 得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同
 一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取
 扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、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。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	106,227,077	96.79
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,523,024	3.21
合計（純資産総額）		109,750,101	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	8,010,960	2.8174	22,570,519	2.9120	23,327,915	21.26
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	16,369,643	1.4323	23,447,398	1.3248	21,686,503	19.76
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	9,184,653	2.5701	23,605,478	2.2580	20,738,946	18.90
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	14,498,405	1.4438	20,933,710	1.4149	20,513,793	18.69
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	6,498,765	2.0169	13,107,688	1.5949	10,364,880	9.44
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	6,656,289	1.8817	12,525,207	1.4415	9,595,040	8.74

(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	96.79
合計	96.79

(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 9月 5日)	41,839,685	41,839,685	9,973	9,973
第2期計算期間末	(2019年 9月 5日)	87,957,030	87,957,030	10,188	10,188

2019年 3月末日	69,332,045		10,087
4月末日	70,206,188		10,186
5月末日	72,958,737		9,898
6月末日	77,212,086		10,072
7月末日	82,432,193		10,221
8月末日	86,069,285		10,114
9月末日	92,320,314		10,372
10月末日	98,871,132		10,638
11月末日	103,635,721		10,734
12月末日	109,327,023		10,785
2020年 1月末日	115,253,069		10,818
2月末日	114,532,049		10,295
3月末日	109,750,101		9,377

【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12月19日～2018年 9月 5日	0
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0.3
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	2.2
第3期中間計算期間	2019年 9月 6日～2020年 3月 5日	2.0

(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12月19日～2018年 9月 5日	44,509,649	2,557,562	41,952,087
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	54,949,184	10,565,823	86,335,448
第3期中間計算期間	2019年 9月 6日～2020年 3月 5日	31,773,070	5,065,981	113,042,537

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	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
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。

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。

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。

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	SP1 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。

J - R E I T 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	プレミアム投資法人	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	SEGRO 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。

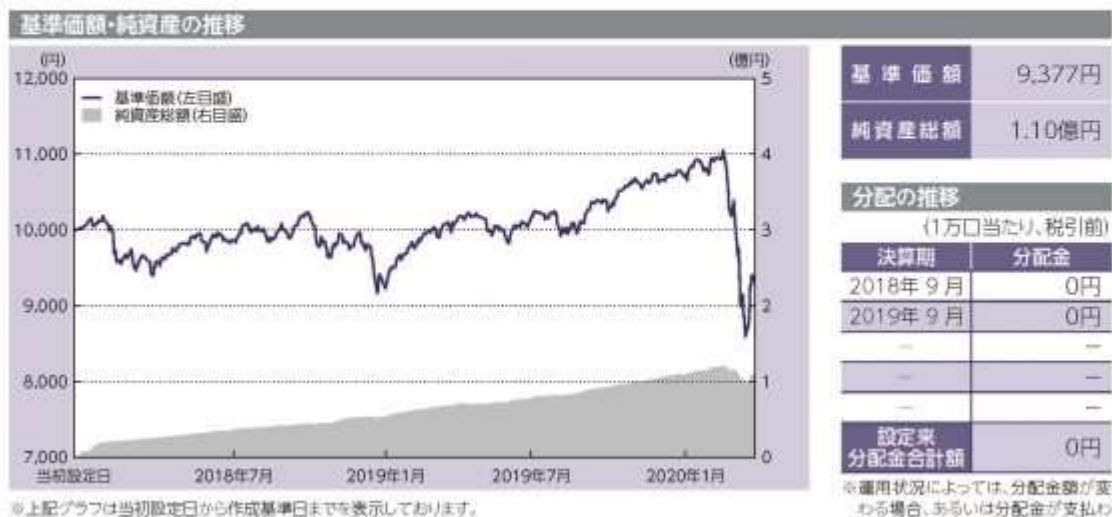
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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

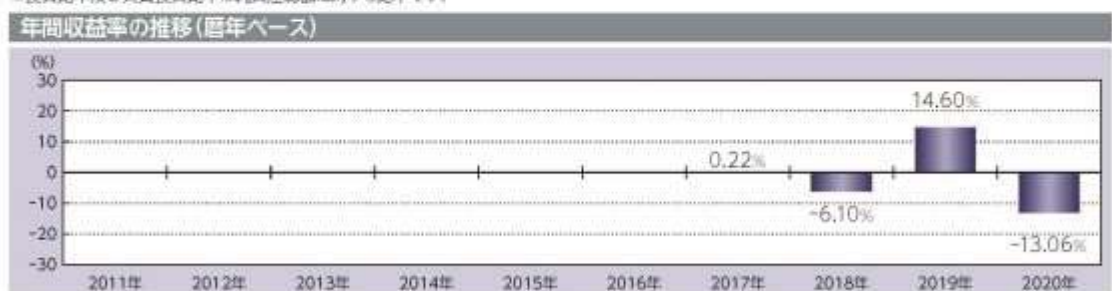
当初設定日：2017年12月19日
作成基準日：2020年3月31日



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	21.3%	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%
国内株式 インデックス マザーファンド	19.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式 インデックス マザーファンド	18.9%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.6%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.6%
国内債券 インデックス マザーファンド	18.7%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.3%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	9.4%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
グローバル REITインデックス マザーファンド	8.7%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%

※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。



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 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

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、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、5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、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >**マザーファンド受益証券の評価方法**

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年12月19日設定）

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年9月6日から翌年9月5日までとします。

ただし、第1計算期間は、2017年12月19日から2018年9月5日までとします。

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

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のう

え、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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します。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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9月6日から2019年9月5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】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2018年 9月 5日現在）	第2期 （2019年 9月 5日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	506,042	2,205,669
親投資信託受益証券	41,379,142	85,959,198
流動資産合計	41,885,184	88,164,867
資産合計	41,885,184	88,164,867
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,007
未払受託者報酬	4,507	20,487
未払委託者報酬	40,567	184,348
未払利息	1	4
その他未払費用	424	1,991
流動負債合計	45,499	207,837
負債合計	45,499	207,837
純資産の部		
元本等		
元本	41,952,087	86,335,448
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	112,402	1,621,582
（分配準備積立金）	360,571	2,215,367
元本等合計	41,839,685	87,957,030
純資産合計	41,839,685	87,957,030
負債純資産合計	41,885,184	88,164,867

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年12月19日	自	2018年 9月 6日
	至	2018年 9月 5日	至	2019年 9月 5日
営業収益				
有価証券売買等損益		303,634		2,503,822
営業収益合計		303,634		2,503,822
営業費用				
支払利息		159		659
受託者報酬		10,750		34,448
委託者報酬		96,662		309,939
その他費用		991		3,323
営業費用合計		108,562		348,369
営業利益又は営業損失（ ）		195,072		2,155,453
経常利益又は経常損失（ ）		195,072		2,155,453
当期純利益又は当期純損失（ ）		195,072		2,155,453
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（ ）		4,909		109,022
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		112,402
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,926		58,210
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,926		58,210
剰余金減少額又は欠損金増加額		327,309		370,657
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		327,309		370,657
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		112,402		1,621,582

(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 9月 5日現在)	第2期 (2019年 9月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,952,087口	86,335,448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 112,402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 0.9973円 (1万口当たり純資産額) (9,973円)	1口当たり純資産額 1.0188円 (1万口当たり純資産額) (10,188円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年12月19日 至 2018年 9月 5日			第2期 自 2018年 9月 6日 至 2019年 9月 5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	360,571円	費用控除後の配当等収益額	A	1,271,977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	641,785円
収益調整金額	C	38,099円	収益調整金額	C	565,103円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	301,605円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	398,670円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,780,470円
当ファンドの期末残存口数	F	41,952,087口	当ファンドの期末残存口数	F	86,335,448口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	95円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	322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 9月 6日 至 2019年 9月 5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 9月 5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12月19日 至 2018年 9月 5日	自 2018年 9月 6日 至 2019年 9月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	41,952,087円
期中追加設定元本額	44,009,649円	54,949,184円
期中一部解約元本額	2,557,562円	10,565,823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 9月 5日現在)	(2019年 9月 5日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	319,568	2,418,178
合計	319,568	2,418,178

（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 - R E I Tインデックス マザーファンド	4,690,484	9,672,247	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	4,686,341	9,024,955	
	国内株式インデックス マザーファンド	11,725,328	16,581,958	
	外国株式インデックス マザーファンド	6,960,441	17,628,708	
	国内債券インデックス マザーファンド	11,168,471	16,200,984	
	外国債券インデックス マザーファンド	6,005,969	16,850,346	
合計		45,237,034	85,959,198	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	412,137,224
国債証券	416,186,660,500
地方債証券	26,709,015,277
特殊債券	33,989,524,958
社債券	19,888,042,820
未収入金	1,206,084,100
未収利息	1,197,060,902
前払費用	72,775,882
流動資産合計	499,661,301,663
資産合計	499,661,301,663
負債の部	
流動負債	
未払金	706,202,000

項目	2019年 9月 5日現在
	金額（円）
未払解約金	564,292,098
未払利息	918
その他未払費用	12
流動負債合計	1,270,495,028
負債合計	1,270,495,028
純資産の部	
元本等	
元本	343,586,564,686
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,804,241,949
元本等合計	498,390,806,635
純資産合計	498,390,806,635
負債純資産合計	499,661,301,663

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 9月 5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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	343,586,564,686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 103,912,000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 1.4506円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,506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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 9月 5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年 9月 5日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	293,713,040,447円
期中追加設定元本額	70,811,630,002円
期中一部解約元本額	20,938,105,763円
期末元本額	343,586,564,686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）	3,900,664,322円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,062,690円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,384,577,130円
世界経済インデックスファンド	1,879,237,076円
D C マイセレクション 2 5	20,318,135,619円
D C マイセレクション 5 0	22,073,184,574円
D C マイセレクション 7 5	5,974,907,729円
D C 日本債券インデックス・オープン	460,522,936円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,270,250,666円
D C 日本債券インデックス・オープン P	39,830,171,374円
D C マイセレクション S 2 5	8,293,333,762円
D C マイセレクション S 5 0	8,955,238,910円

区分	2019年 9月 5日現在
DCマイセレクションS75	1,718,476,591円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,093,418,304円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,298,448,576円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	435,051,643円
DC世界経済インデックスファンド	1,652,694,025円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	73,577,766円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,809,222円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,594,728円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,389,556円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	165,596,381円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	286,636,597円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	59,664,398円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	133,749,642円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,265,071,367円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	943,187,404円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,554,692,728円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	774,877,347円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	102,740,482円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,235,432,469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）	1,434,701,899円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,790,579,290円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	164,232,985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	10,080,090,423円
分散投資コア戦略ファンドA	7,773,747,168円
分散投資コア戦略ファンドS	4,728,603,997円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	67,004,020円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	808,489,091円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	51,507,053円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,340,656円
SMT インデックスバランス・オープン	64,925,535円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,076,624円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	11,514,025円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	24,280,482円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,466,788円
グローバル経済コア	227,761,766円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,168,471円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	685,829円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円

区分	2019年 9月 5日現在
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
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	78,826,096,503円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,535,662,800
地方債証券	21,047,778
特殊債券	96,485,319
社債券	134,095,610
合計	8,787,291,507

(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393回利付国債(2年)	840,000,000	843,284,400	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,044,388,800	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,531,200	
	第396回利付国債(2年)	1,710,000,000	1,718,379,000	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,367,099,200	
	第398回利付国債(2年)	3,460,000,000	3,479,306,800	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,118,290,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	633,962,700	
	第401回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,717,874,000	
	第402回利付国債(2年)	1,870,000,000	1,883,127,400	

第403回利付国債（2年）	50,000,000	50,372,500	
第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,973,941,600	
第127回利付国債（5年）	4,780,000,000	4,807,580,600	
第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,620,980,200	
第129回利付国債（5年）	3,340,000,000	3,367,054,000	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,372,525,600	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,597,283,600	
第132回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,854,624,000	
第133回利付国債（5年）	4,740,000,000	4,800,340,200	
第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	3,214,221,500	
第135回利付国債（5年）	5,680,000,000	5,767,301,600	
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）	4,430,000,000	4,508,854,000	
第138回利付国債（5年）	9,070,000,000	9,243,599,800	
第139回利付国債（5年）	5,970,000,000	6,090,952,200	
第140回利付国債（5年）	5,970,000,000	6,097,758,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	654,324,000	
第2回利付国債（40年）	470,000,000	750,984,800	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	889,581,000	
第4回利付国債（40年）	1,000,000,000	1,636,970,000	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,416,123,500	
第6回利付国債（40年）	720,000,000	1,134,972,000	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	1,099,044,000	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	1,148,984,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,190,563,400	
第10回利付国債（40年）	1,920,000,000	2,449,075,200	
第11回利付国債（40年）	1,730,000,000	2,151,393,400	
第12回利付国債（40年）	500,000,000	566,365,000	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,882,085,200	
第313回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,382,751,000	
第314回利付国債（10年）	470,000,000	479,954,600	
第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	3,223,115,800	
第316回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,198,875,600	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	915,365,000	
第318回利付国債（10年）	1,960,000,000	2,011,842,000	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,764,925,200	
第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,706,277,400	
第321回利付国債（10年）	2,470,000,000	2,551,979,300	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	772,980,000	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,002,698,700	
第324回利付国債（10年）	2,740,000,000	2,824,666,000	
第325回利付国債（10年）	2,920,000,000	3,019,396,800	

第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,715,958,600	
第327回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,327,411,200	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,861,603,900	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,347,470,000	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,506,585,600	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,432,522,800	
第332回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,382,177,500	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,430,283,200	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,917,586,700	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,777,795,800	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	533,495,700	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,499,280,200	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,555,129,500	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,064,699,900	
第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	4,524,033,600	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,576,769,700	
第342回利付国債(10年)	4,060,000,000	4,186,347,200	
第343回利付国債(10年)	2,830,000,000	2,921,550,500	
第344回利付国債(10年)	2,420,000,000	2,501,287,800	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,049,696,000	
第346回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,964,161,200	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,355,533,600	
第348回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,139,310,000	
第349回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,448,982,000	
第350回利付国債(10年)	5,350,000,000	5,559,292,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,978,987,000	
第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,042,060,100	
第353回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,570,324,000	
第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,090,665,600	
第355回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,698,046,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	144,248,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	204,979,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	153,056,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	148,915,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	64,224,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	250,549,200	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	236,946,600	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	62,971,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	289,648,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	186,982,400	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	112,803,300	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	249,515,600	

第13回利付国債(30年)	290,000,000	377,997,600
第14回利付国債(30年)	300,000,000	409,707,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	470,903,400
第16回利付国債(30年)	370,000,000	514,518,300
第17回利付国債(30年)	570,000,000	786,343,500
第18回利付国債(30年)	345,000,000	471,928,950
第19回利付国債(30年)	380,000,000	521,675,400
第20回利付国債(30年)	480,000,000	676,252,800
第21回利付国債(30年)	500,000,000	690,680,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	567,688,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	612,504,900
第24回利付国債(30年)	380,000,000	543,251,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	489,587,000
第26回利付国債(30年)	430,000,000	610,952,600
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,461,510,400
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,388,824,000
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	2,026,178,000
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,565,948,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,569,205,000
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,950,825,600
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,343,093,500
第34回利付国債(30年)	1,545,000,000	2,245,503,000
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,397,890,300
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,396,637,600
第37回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,512,826,000
第38回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,744,612,500
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,337,770,400
第40回利付国債(30年)	810,000,000	1,137,240,000
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,285,873,800
第42回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,580,564,400
第43回利付国債(30年)	910,000,000	1,265,218,500
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,505,768,400
第45回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,535,523,000
第46回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,755,325,000
第47回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,081,988,000
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	2,274,129,000
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,946,150,800
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,261,968,700
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,928,448,800
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,695,463,000
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,263,707,200
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,573,150,600
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,231,817,600

第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,494,435,600	
第57回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,613,014,400	
第58回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,722,020,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	197,434,600	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,986,758,100	
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,511,185,000	
第62回利付国債(30年)	650,000,000	719,426,500	
第63回利付国債(30年)	570,000,000	614,129,400	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	134,654,000	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	145,140,800	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	227,398,600	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	104,090,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,397,700	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,412,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	211,492,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,230,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	159,693,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	254,834,400	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	320,334,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,386,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	369,939,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,368,800	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	333,862,400	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	216,292,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	349,132,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	241,335,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	360,567,900	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,343,200	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	212,125,500	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	433,621,500	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	453,212,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	224,660,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	708,794,100	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,464,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,336,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	147,932,200	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	304,198,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,367,000	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,589,600	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	307,470,600	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,831,800	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	446,534,400	

第82回利付国債(20年)	600,000,000	690,678,000
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	541,007,600
第85回利付国債(20年)	290,000,000	337,510,700
第86回利付国債(20年)	210,000,000	247,214,100
第87回利付国債(20年)	550,000,000	643,786,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	497,368,200
第89回利付国債(20年)	350,000,000	412,041,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	745,655,400
第91回利付国債(20年)	450,000,000	535,855,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,041,233,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	484,558,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	725,643,800
第95回利付国債(20年)	610,000,000	739,094,300
第96回利付国債(20年)	320,000,000	382,601,600
第97回利付国債(20年)	400,000,000	483,964,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	528,721,600
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,388,107,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	586,128,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	885,627,600
第102回利付国債(20年)	410,000,000	510,126,100
第103回利付国債(20年)	400,000,000	494,072,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	438,163,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,442,420,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	468,038,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	319,157,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	797,577,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	630,422,000
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,170,333,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,209,008,000
第112回利付国債(20年)	790,000,000	976,724,400
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,799,928,500
第114回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,657,392,800
第115回利付国債(20年)	700,000,000	879,697,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,337,349,000
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,350,928,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	821,422,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	647,925,000
第120回利付国債(20年)	790,000,000	948,323,900
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,856,595,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	539,633,600
第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,619,046,400
第124回利付国債(20年)	610,000,000	764,537,400

第125回利付国債（20年）	820,000,000	1,051,108,800	
第126回利付国債（20年）	730,000,000	918,522,500	
第127回利付国債（20年）	990,000,000	1,233,995,400	
第128回利付国債（20年）	1,260,000,000	1,575,579,600	
第129回利付国債（20年）	550,000,000	681,131,000	
第130回利付国債（20年）	1,115,000,000	1,384,952,650	
第131回利付国債（20年）	870,000,000	1,069,943,400	
第132回利付国債（20年）	840,000,000	1,036,476,000	
第133回利付国債（20年）	1,190,000,000	1,483,263,600	
第134回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,312,384,500	
第135回利付国債（20年）	590,000,000	729,894,900	
第136回利付国債（20年）	570,000,000	697,868,100	
第137回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,389,203,200	
第138回利付国債（20年）	620,000,000	752,866,000	
第139回利付国債（20年）	550,000,000	675,031,500	
第140回利付国債（20年）	1,670,000,000	2,076,711,800	
第141回利付国債（20年）	1,610,000,000	2,007,009,900	
第142回利付国債（20年）	520,000,000	655,252,000	
第143回利付国債（20年）	720,000,000	890,373,600	
第144回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,797,618,900	
第145回利付国債（20年）	2,455,000,000	3,077,023,350	
第146回利付国債（20年）	2,100,000,000	2,638,188,000	
第147回利付国債（20年）	1,650,000,000	2,055,075,000	
第148回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,443,617,000	
第149回利付国債（20年）	2,540,000,000	3,140,506,800	
第150回利付国債（20年）	2,270,000,000	2,779,251,800	
第151回利付国債（20年）	1,435,000,000	1,715,298,550	
第152回利付国債（20年）	2,010,000,000	2,405,226,300	
第153回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,903,395,900	
第154回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,376,297,000	
第155回利付国債（20年）	2,160,000,000	2,526,206,400	
第156回利付国債（20年）	1,960,000,000	2,100,042,000	
第157回利付国債（20年）	2,110,000,000	2,188,175,500	
第158回利付国債（20年）	2,210,000,000	2,404,413,700	
第159回利付国債（20年）	2,070,000,000	2,286,687,600	
第160回利付国債（20年）	1,950,000,000	2,189,323,500	
第161回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,933,312,500	
第162回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,265,721,500	
第163回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,664,688,800	
第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,935,981,400	
第165回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,783,992,000	
第166回利付国債（20年）	900,000,000	1,013,184,000	

	第167回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,293,570,000	
	第168回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,558,842,000	
	第169回利付国債(20年)	630,000,000	660,208,500	
	国債証券合計	370,250,000,000	416,186,660,500	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,150,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,944,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	140,586,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	138,070,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	135,090,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	135,987,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,877,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,265,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	241,382,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	240,160,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	101,818,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	102,095,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,041,000	
	第702回東京都公募公債	200,000,000	204,694,000	
	第716回東京都公募公債	100,000,000	102,466,000	
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,156,000	
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,215,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,697,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,192,000	
	第764回東京都公募公債	150,000,000	151,896,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,277,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,125,000	
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,246,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,625,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,128,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,132,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	303,786,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	143,830,000	
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,261,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,522,000	
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,556,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,093,000	
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,328,000	
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,125,000	
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	240,876,000	
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,622,000	
	第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,240,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,527,000	

第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,035,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,241,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,622,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,528,870	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,036,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,936,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,567,840	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,496,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,840,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,224,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,148,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,081,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,181,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,715,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,023,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,552,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,813,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,157,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,403,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	129,794,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	113,232,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,379,556	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,157,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,329,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,202,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,358,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,442,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,667,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,243,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,063,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,215,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,201,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,994,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,296,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,466,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,284,000	

平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,912,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	112,177,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,566,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,550,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,771,504	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,134,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,522,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	116,720,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	240,676,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	204,624,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,738,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,597,520	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,724,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,804,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,889,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,822,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,310,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,555,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,205,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,615,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,452,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,233,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	122,082,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,218,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,456,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	139,955,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,684,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,790,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,177,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	121,115,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	120,087,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,444,800	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,252,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,233,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,017,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,309,000	

平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,286,400	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,381,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,700,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,864,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	363,917,440	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,000,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,121,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,536,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,721,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,366,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,363,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,306,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,412,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,173,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,727,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,695,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,486,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,730,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,880,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,703,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,529,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,340,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,080,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,327,528	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,952,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,424,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,297,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,705,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,174,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,715,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,064,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,027,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,526,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,334,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,015,669	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,461,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,735,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	102,112,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	204,896,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,214,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	102,287,000	

平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,287,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,516,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	242,206,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	136,247,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	142,842,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,637,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,452,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,381,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,396,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,414,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,440,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,838,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,084,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	140,360,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	240,786,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	122,010,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,437,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,097,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,387,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,989,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,214,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,372,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,232,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,780,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,565,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,167,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	119,114,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,864,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,282,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,907,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,592,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,305,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,331,000	
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	102,112,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,330,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,126,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,072,000	

	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,351,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,310,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,948,150	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,801,600	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,642,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,342,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,446,000	
	地方債証券合計	25,134,220,000	26,709,015,277	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,393,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,589,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,595,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,758,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,022,000	
	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	102,911,000	
	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	206,126,000	
	第14回道路債券	100,000,000	106,199,000	
	第17回道路債券	100,000,000	104,982,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	464,352,000	
	第21回道路債券	100,000,000	136,319,000	
	第28回道路債券	200,000,000	277,120,000	
	第33回道路債券	200,000,000	280,712,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,579,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	167,322,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,372,000	
	第42回道路債券	100,000,000	111,832,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,200,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,324,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,010,000	
	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	162,518,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,904,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,441,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,439,000	

第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,580,000	
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	141,075,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,879,000	
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	203,332,000	
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	123,040,000	
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	101,778,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,813,000	
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	102,262,000	
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	102,224,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,275,000	
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	306,903,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,926,000	
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	308,034,370	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	233,850,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,296,000	
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	102,707,000	
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	102,591,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,956,000	
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	121,281,000	
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	103,068,000	
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	309,213,000	
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	205,186,000	
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	204,424,000	
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	307,515,000	
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	207,240,000	
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	153,224,400	
	100,000,000	128,336,000	

第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	103,248,000	
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	241,208,000	
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	105,489,420	
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	103,417,000	
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	103,270,000	
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	102,908,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,611,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,595,000	
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	116,409,000	
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	234,706,000	
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	204,418,000	
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	101,102,000	
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	104,247,000	
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	107,186,180	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	318,407,920	
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	207,043,850	
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	101,256,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,729,000	
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	101,441,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	529,729,200	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,964,000	
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	217,980,400	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,686,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	311,637,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,912,700	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,274,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	414,405,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,847,000	

第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	139,203,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,029,200	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	136,523,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	241,940,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,618,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,800,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,298,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,097,770	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,231,090	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,306,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	120,652,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,321,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,780,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,505,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,045,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,200,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,478,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,554,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,468,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,251,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,539,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,208,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,774,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,531,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,293,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,525,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,133,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,758,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,992,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,089,810	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,457,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,432,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,049,300	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,258,840	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,851,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,689,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,147,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,340,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,194,000	

F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,595,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	111,580,000	
第 1 9 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,011,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	123,657,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,369,180	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,459,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,948,800	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,255,670	
第 1 2 7 回都市再生債券	400,000,000	400,532,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	200,828,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,359,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	105,583,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,808,400	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,354,000	14,960,456	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,680,000	15,385,814	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,042,000	15,910,374	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	253,734,000	255,319,837	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	177,722,000	178,676,367	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,936,000	15,710,730	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,011,000	16,894,326	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	12,993,000	13,358,233	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	26,838,000	27,988,008	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,602,000	16,397,233	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,602,000	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,161,000	14,819,486	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,475,000	17,476,844	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,084,000	14,762,707	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,287,000	17,232,460	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,260,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,087,000	15,387,231	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,387,000	15,690,739	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,644,000	23,394,566	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,113,000	23,966,732	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,519,000	26,785,781	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,513,000	29,752,007	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,509,000	32,038,806	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,626,000	33,175,308	

第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,750,000	70,106,767	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,519,000	15,099,179	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,385,000	34,580,703	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,487,000	15,073,144	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,368,000	15,100,911	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,391,000	37,947,999	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,336,000	13,939,987	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,948,000	37,496,058	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,810,000	35,157,555	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,265,000	16,212,193	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,764,000	70,092,586	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,747,000	38,134,899	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,948,000	15,694,802	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,878,000	50,005,700	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,726,000	47,678,363	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,624,000	47,615,146	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,432,000	101,676,115	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,681,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,717,000	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,170,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,238,000	108,036,939	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,863,000	54,691,608	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,798,000	55,094,424	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,802,000	56,243,106	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,329,000	49,074,456	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,404,000	48,756,218	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,253,000	55,597,714	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	184,086,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,956,000	50,441,079	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,912,000	56,573,635	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,206,000	57,988,382	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,247,000	58,934,481	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,337,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,617,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,612,000	124,295,887	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,531,000	63,205,864	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,044,000	130,897,954	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	409,572,000	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,897,000	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,117,000	74,116,715	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,710,000	77,688,687	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,965,000	77,274,933	

第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,860,000	159,319,363
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,670,000	78,113,780
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,279,000	83,088,355
第 1 1 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,118,000
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,179,000	90,016,650
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,405,000	90,062,593
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,991,000
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,498,000	90,552,038
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,994,000	91,353,230
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,529,000	91,842,429
第 1 1 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,712,000
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,506,000	93,700,313
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,029,000	94,359,174
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	94,251,762
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	94,555,393
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,945,000	95,287,214
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,982,000	191,305,023
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,201,000	95,418,251
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,900,000	193,108,588
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,977,000	96,318,906
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,178,000	193,426,937
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,699,093
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,306,000	196,507,886
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,530,000	196,813,792
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	139,661,000
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,836,000	99,544,502
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,387,000	100,330,035
第 1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,771,000	99,785,082
	196,762,000	200,028,249

第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,733,000	100,323,588	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,098,000	100,851,043	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,004,000	202,146,273	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,842,000	100,674,682	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,029,000	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,019,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,673,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,326,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,134,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,187,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,491,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,699,000	
い第795号商工債	200,000,000	199,998,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,050,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,949,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,894,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,098,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,247,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,254,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,520,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,276,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,194,000	
第218号商工債（3年）	300,000,000	300,417,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	200,288,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,616,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	122,692,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,029,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,344,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,673,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,008,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,771,000	
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,096,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,665,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,042,000	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,330,000	

特殊債券合計		31,873,915,000	33,989,524,958	
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	100,102,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	101,013,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,487,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,870,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,861,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,640,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,991,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	400,452,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,136,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,513,000	
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,650,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	210,568,000	
	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	300,840,000	
	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	201,348,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,239,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,731,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,493,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,129,000	
	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	100,589,000	
	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	100,585,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,503,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,628,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,877,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,551,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,668,000	
	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	100,297,000	
	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	103,297,000	
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	100,257,000		
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	100,138,000		

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	101,888,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,643,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,176,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,846,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,577,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,552,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,805,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,184,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,539,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,068,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,320,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,315,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,819,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,398,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,806,000	
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	100,394,000	
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	101,073,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,353,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,750,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,440,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,538,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,784,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,016,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,475,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,686,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,338,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,313,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,258,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,127,000	
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	100,197,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	200,404,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,387,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,292,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,698,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,028,000	

第2回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,707,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	122,310,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,395,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,074,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,144,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,297,000	
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	125,555,000	
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	101,423,000	
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	102,605,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	115,742,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,445,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,426,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,852,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	308,208,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,264,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,350,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,005,000	
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	100,642,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	201,134,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,252,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,381,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,638,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,668,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,193,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	203,320,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	102,302,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,401,000	
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	200,276,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,872,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,836,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,745,000	

第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,491,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,268,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	103,795,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,391,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	109,486,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,184,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,899,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,987,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,337,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,747,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,410,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,272,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,674,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,357,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,637,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,086,800	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,487,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,520,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,117,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,156,400	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	138,983,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	135,405,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	124,796,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,552,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,810,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,693,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,520,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,133,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,218,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,763,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,273,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,667,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,167,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,702,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,943,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,652,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,472,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,630,000	

第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,179,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,370,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,022,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,390,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,634,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,951,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,499,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,941,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,593,140	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,536,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,221,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,907,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,499,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,149,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,874,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,944,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,435,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,159,480	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,500,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,583,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,516,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,074,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,765,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,838,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,737,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,209,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,152,000	
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	101,417,000	
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	203,772,000	
社債券合計	19,266,000,000	19,888,042,820	
合計		496,773,243,555	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,965,253,883
株式	290,428,937,158
派生商品評価勘定	25,576,480
未収入金	41,156,497
未収配当金	196,365,488
差入委託証拠金	119,046,900
流動資産合計	293,776,336,406
資産合計	293,776,336,406
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,818,540
前受金	15,760,100
未払金	16,478,200
未払解約金	107,657,011
未払利息	6,610
その他未払費用	9
流動負債合計	149,720,470
負債合計	149,720,470
純資産の部	
元本等	
元本	207,624,577,796
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,002,038,140
元本等合計	293,626,615,936
純資産合計	293,626,615,936
負債純資産合計	293,776,336,406

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月 5日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2019年 9月 5日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2019年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	207,624,577,796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 1.4142円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,142円)</p>

（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 9月 5日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>

	2019年 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	141,877,070,550円
期中追加設定元本額	82,061,381,820円
期中一部解約元本額	16,313,874,574円
期末元本額	207,624,577,796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）	594,098,440円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,062,127,658円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,896,640円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,020,475,625円
世界経済インデックスファンド	2,091,041,451円
日本株式インデックス・オープン	5,352,377,815円
DCマイセレクション25	6,896,373,038円
DCマイセレクション50	19,546,704,901円
DCマイセレクション75	17,886,478,043円
DC日本株式インデックス・オープン	5,688,637,453円
DCマイセレクションS25	2,775,762,487円
DCマイセレクションS50	7,956,131,985円
DCマイセレクションS75	5,145,016,799円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,564,941,182円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	388,301,969円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	693,979,774円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	456,118,148円
DC世界経済インデックスファンド	1,840,909,440円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,185,570,697円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,912,032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）	290,258,939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）	81,721,303円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	340,015,328円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	65,697,831円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	505,050,784円

区分	2019年 9月 5日現在
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,817,216,946円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	738,989,139円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,275,638,511円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	682,753,988円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	49,362,281円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	814,360,340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)	466,185,824円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	591,788,050円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	55,101,372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)	908,229,079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	1,515,384,178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	4,194,823,625円
分散投資コア戦略ファンドS	8,682,788,174円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	257,999,194円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	279,002,679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)	222,946,563円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,402,910円
SMT インデックスバランス・オープン	75,766,099円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,317,569,938円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	680,819,456円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,742,213円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	59,132,765円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	8,849,826円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,561,052円
グローバル経済コア	318,753,319円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,725,328円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	48,869,474円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,576,110円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	189,847,927円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	32,298,139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)	56,691,776,095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)	660,174,717円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	6,563,300円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		250,640,799
合計		250,640,799

(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 9月 5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	3,146,039,900	-	3,161,800,000	15,760,100
	合計	3,146,039,900	-	3,161,800,000	15,760,100

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	5,800	2,800.00	16,240,000	
日本水産	179,500	606.00	108,777,000	
マルハニチロ	25,900	2,720.00	70,448,000	
カネコ種苗	5,400	1,140.00	6,156,000	
サカタのタネ	21,800	3,715.00	80,987,000	
ホクト	15,100	1,919.00	28,976,900	
ホクリヨウ	2,400	602.00	1,444,800	
住石ホールディングス	38,700	135.00	5,224,500	
日鉄鉱業	4,100	3,895.00	15,969,500	

三井松島ホールディングス	7,500	1,199.00	8,992,500
国際石油開発帝石	720,200	915.20	659,127,040
石油資源開発	25,800	2,599.00	67,054,200
K & O エナジーグループ	8,700	1,353.00	11,771,100
ヒノキヤグループ	4,800	1,841.00	8,836,800
ショーボンドホールディングス	25,600	3,675.00	94,080,000
ミライト・ホールディングス	50,500	1,555.00	78,527,500
タマホーム	8,600	1,499.00	12,891,400
サンヨーホームズ	2,600	630.00	1,638,000
日本アクア	7,100	613.00	4,352,300
ファーストコーポレーション	5,500	577.00	3,173,500
ベステラ	3,400	1,341.00	4,559,400
TATERU	36,400	175.00	6,370,000
スペースバリューホールディングス	21,900	457.00	10,008,300
ダイセキ環境ソリューション	3,500	665.00	2,327,500
第一カッター興業	2,200	1,587.00	3,491,400
安藤・間	115,100	706.00	81,260,600
東急建設	52,600	747.00	39,292,200
コムシスホールディングス	63,700	2,911.00	185,430,700
ミサワホーム	14,200	1,064.00	15,108,800
ピーアールホールディングス	19,600	355.00	6,958,000
高松コンストラクショングループ	11,200	2,331.00	26,107,200
東建コーポレーション	5,500	6,380.00	35,090,000
ソネック	1,800	881.00	1,585,800
ヤマウラ	7,500	849.00	6,367,500
大成建設	147,400	3,725.00	549,065,000
大林組	444,200	985.00	437,537,000
清水建設	453,100	892.00	404,165,200
飛鳥建設	12,700	1,143.00	14,516,100
長谷工コーポレーション	185,200	1,149.00	212,794,800
松井建設	16,700	693.00	11,573,100
銭高組	1,800	3,775.00	6,795,000
鹿島建設	347,200	1,304.00	452,748,800
不動テトラ	10,300	1,127.00	11,608,100
大末建設	5,800	924.00	5,359,200
鉄建建設	9,000	2,656.00	23,904,000
西松建設	31,900	1,872.00	59,716,800
三井住友建設	106,800	525.00	56,070,000
大豊建設	10,000	2,678.00	26,780,000
前田建設工業	105,600	856.00	90,393,600
佐田建設	11,100	388.00	4,306,800
ナカノフドー建設	12,500	436.00	5,450,000

奥村組	24,400	2,782.00	67,880,800
東鉄工業	17,800	3,100.00	55,180,000
イチケン	3,000	1,589.00	4,767,000
富士ピー・エス	6,100	482.00	2,940,200
浅沼組	5,000	3,465.00	17,325,000
戸田建設	172,200	575.00	99,015,000
熊谷組	21,100	2,963.00	62,519,300
青木あすなろ建設	7,800	1,209.00	9,430,200
北野建設	3,200	2,331.00	7,459,200
植木組	2,100	2,357.00	4,949,700
矢作建設工業	20,100	666.00	13,386,600
ピーエス三菱	16,100	676.00	10,883,600
日本ハウスホールディングス	28,300	437.00	12,367,100
大東建託	52,800	13,645.00	720,456,000
新日本建設	17,700	753.00	13,328,100
N I P P O	39,200	1,861.00	72,951,200
東亜道路工業	2,800	3,255.00	9,114,000
前田道路	43,900	2,360.00	103,604,000
日本道路	4,000	5,980.00	23,920,000
東亜建設工業	12,900	1,279.00	16,499,100
日本国土開発	24,200	533.00	12,898,600
若築建設	7,400	1,487.00	11,003,800
東洋建設	54,200	428.00	23,197,600
五洋建設	176,100	556.00	97,911,600
世紀東急工業	21,600	669.00	14,450,400
福田組	4,800	3,820.00	18,336,000
住友林業	105,000	1,342.00	140,910,000
日本基礎技術	15,200	311.00	4,727,200
巴コーポレーション	19,400	383.00	7,430,200
大和ハウス工業	410,200	3,374.00	1,384,014,800
ライト工業	28,500	1,381.00	39,358,500
積水ハウス	453,600	1,892.00	858,211,200
日特建設	12,600	633.00	7,975,800
北陸電気工事	7,200	856.00	6,163,200
ユアテック	23,700	656.00	15,547,200
四電工	2,300	2,706.00	6,223,800
中電工	19,100	2,251.00	42,994,100
関電工	67,400	907.00	61,131,800
きんでん	98,500	1,552.00	152,872,000
東京エネシス	15,300	875.00	13,387,500
トーエネック	4,200	3,120.00	13,104,000
住友電設	10,200	1,993.00	20,328,600

日本電設工業	25,300	2,080.00	52,624,000
協和エクシオ	58,000	2,565.00	148,770,000
新日本空調	12,000	1,748.00	20,976,000
九電工	29,200	3,275.00	95,630,000
三機工業	33,400	1,245.00	41,583,000
日揮	127,600	1,302.00	166,135,200
中外炉工業	4,400	1,436.00	6,318,400
ヤマト	14,000	685.00	9,590,000
太平電業	10,000	2,347.00	23,470,000
高砂熱学工業	36,000	1,727.00	62,172,000
三晃金属工業	2,000	2,291.00	4,582,000
朝日工業社	3,200	2,861.00	9,155,200
明星工業	26,800	709.00	19,001,200
大気社	20,200	3,155.00	63,731,000
ダイダン	9,900	2,041.00	20,205,900
日比谷総合設備	13,300	1,848.00	24,578,400
東芝プラントシステム	32,100	1,740.00	55,854,000
OSJBホールディングス	65,400	234.00	15,303,600
東洋エンジニアリング	17,400	590.00	10,266,000
レイズネクスト	26,600	1,178.00	31,334,800
日本製粉	42,100	1,649.00	69,422,900
日清製粉グループ本社	149,900	1,956.00	293,204,400
日東富士製粉	1,000	6,310.00	6,310,000
昭和産業	12,200	3,070.00	37,454,000
鳥越製粉	11,800	816.00	9,628,800
中部飼料	16,200	1,114.00	18,046,800
フィード・ワン	89,100	157.00	13,988,700
東洋精糖	2,000	1,027.00	2,054,000
日本甜菜製糖	7,500	1,795.00	13,462,500
三井製糖	10,500	2,169.00	22,774,500
塩水港精糖	14,400	203.00	2,923,200
日新製糖	6,300	1,915.00	12,064,500
森永製菓	33,400	5,150.00	172,010,000
中村屋	3,400	4,150.00	14,110,000
江崎グリコ	39,900	4,585.00	182,941,500
名糖産業	6,400	1,263.00	8,083,200
井村屋グループ	5,600	2,035.00	11,396,000
不二家	7,400	1,982.00	14,666,800
山崎製パン	99,400	1,828.00	181,703,200
第一屋製パン	2,300	919.00	2,113,700
モロゾフ	2,300	4,650.00	10,695,000
亀田製菓	8,200	4,670.00	38,294,000

寿スピリッツ	14,100	6,550.00	92,355,000
カルビー	60,500	3,170.00	191,785,000
森永乳業	26,600	4,455.00	118,503,000
六甲バター	9,300	1,648.00	15,326,400
ヤクルト本社	98,300	6,110.00	600,613,000
明治ホールディングス	94,000	7,500.00	705,000,000
雪印メグミルク	31,900	2,427.00	77,421,300
プリマハム	18,700	2,134.00	39,905,800
日本ハム	54,900	4,080.00	223,992,000
林兼産業	4,400	558.00	2,455,200
丸大食品	14,100	2,187.00	30,836,700
S Foods	11,900	3,030.00	36,057,000
伊藤ハム米久ホールディングス	85,400	639.00	54,570,600
サッポロホールディングス	45,300	2,569.00	116,375,700
アサヒグループホールディングス	277,900	5,083.00	1,412,565,700
キリンホールディングス	562,700	2,100.50	1,181,951,350
宝ホールディングス	99,300	1,035.00	102,775,500
オエノンホールディングス	36,000	377.00	13,572,000
養命酒製造	4,100	1,906.00	7,814,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,100	2,327.00	216,643,700
サントリー食品インターナショナル	88,800	4,745.00	421,356,000
ダイドーグループホールディングス	7,500	4,315.00	32,362,500
伊藤園	40,300	4,950.00	199,485,000
キーコーヒー	13,000	2,153.00	27,989,000
ユニカフェ	3,500	970.00	3,395,000
ジャパンフーズ	1,900	1,193.00	2,266,700
日清オイリオグループ	17,100	3,310.00	56,601,000
不二製油グループ本社	32,300	2,921.00	94,348,300
かどや製油	1,400	3,505.00	4,907,000
J - オイルミルズ	6,900	4,040.00	27,876,000
キッコーマン	87,500	4,800.00	420,000,000
味の素	293,000	1,920.50	562,706,500
キューピー	73,900	2,475.00	182,902,500
ハウス食品グループ本社	49,600	4,045.00	200,632,000
カゴメ	53,200	2,712.00	144,278,400
焼津水産化学工業	6,400	1,022.00	6,540,800
アリアケジャパン	12,100	8,170.00	98,857,000
ピエトロ	1,700	1,606.00	2,730,200
エバラ食品工業	3,200	2,042.00	6,534,400
やまみ	600	1,993.00	1,195,800
ニチレイ	68,900	2,378.00	163,844,200
東洋水産	68,300	4,360.00	297,788,000

イトアンド	4,600	1,724.00	7,930,400
大冷	1,500	2,026.00	3,039,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,600	834.00	3,002,400
日清食品ホールディングス	56,400	7,500.00	423,000,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,039.00	14,476,900
一正蒲鉾	5,200	1,074.00	5,584,800
フジッコ	14,400	1,905.00	27,432,000
ロック・フィールド	14,300	1,365.00	19,519,500
日本たばこ産業	766,100	2,219.50	1,700,358,950
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,157.00	15,961,800
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,710.00	14,877,000
なとり	7,400	1,562.00	11,558,800
イフジ産業	2,300	709.00	1,630,700
ピクルスコーポレーション	3,200	2,338.00	7,481,600
北の達人コーポレーション	52,100	746.00	38,866,600
ユーグレナ	56,600	899.00	50,883,400
ミヨシ油脂	5,100	1,082.00	5,518,200
理研ビタミン	6,300	3,370.00	21,231,000
片倉工業	19,100	1,281.00	24,467,100
ゲンゼ	8,800	4,365.00	38,412,000
東洋紡	55,100	1,373.00	75,652,300
ユニチカ	39,300	320.00	12,576,000
富士紡ホールディングス	6,900	2,542.00	17,539,800
倉敷紡績	12,600	2,024.00	25,502,400
シキボウ	6,800	898.00	6,106,400
日本毛織	43,100	933.00	40,212,300
トーア紡コーポレーション	5,300	483.00	2,559,900
帝国繊維	14,800	1,683.00	24,908,400
帝人	105,800	1,940.00	205,252,000
東レ	1,005,000	756.50	760,282,500
サカイオーベックス	3,400	1,631.00	5,545,400
住江織物	3,800	2,880.00	10,944,000
日本フェルト	8,300	451.00	3,743,300
イチカワ	2,200	1,367.00	3,007,400
日東製網	1,500	1,398.00	2,097,000
アツギ	10,800	818.00	8,834,400
ダイニック	5,200	670.00	3,484,000
セーレン	32,200	1,220.00	39,284,000
ソトー	5,300	970.00	5,141,000
東海染工	1,900	1,128.00	2,143,200
小松マテーレ	21,400	750.00	16,050,000
ワコールホールディングス	36,600	2,521.00	92,268,600

ホギメディカル	16,100	2,859.00	46,029,900
レナウン	37,400	110.00	4,114,000
クラウドホールディングス	3,400	487.00	1,655,800
T S Iホールディングス	48,000	545.00	26,160,000
マツオカコーポレーション	4,200	2,082.00	8,744,400
ワールド	17,000	2,361.00	40,137,000
三陽商会	7,500	1,304.00	9,780,000
ナイガイ	5,000	342.00	1,710,000
オンワードホールディングス	78,000	514.00	40,092,000
ルックホールディングス	4,600	1,024.00	4,710,400
ゴールドウイン	11,700	16,090.00	188,253,000
デサント	31,700	1,426.00	45,204,200
キング	7,100	535.00	3,798,500
ヤマトインターナショナル	8,100	400.00	3,240,000
特種東海製紙	8,200	3,690.00	30,258,000
王子ホールディングス	582,900	508.00	296,113,200
日本製紙	62,000	1,798.00	111,476,000
三菱製紙	21,100	488.00	10,296,800
北越コーポレーション	85,900	550.00	47,245,000
中越パルプ工業	5,500	1,481.00	8,145,500
巴川製紙所	4,300	803.00	3,452,900
大王製紙	63,100	1,354.00	85,437,400
阿波製紙	3,300	400.00	1,320,000
レンゴー	133,500	783.00	104,530,500
トーモク	7,900	1,503.00	11,873,700
ザ・パック	9,800	3,370.00	33,026,000
クラレ	203,900	1,259.00	256,710,100
旭化成	921,100	981.00	903,599,100
共和レザー	8,000	707.00	5,656,000
昭和電工	92,200	2,783.00	256,592,600
住友化学	1,019,100	479.00	488,148,900
住友精化	6,300	3,220.00	20,286,000
日産化学	79,000	4,440.00	350,760,000
ラサ工業	4,600	1,189.00	5,469,400
クレハ	12,000	5,780.00	69,360,000
多木化学	3,800	4,445.00	16,891,000
テイカ	10,600	1,905.00	20,193,000
石原産業	24,900	877.00	21,837,300
片倉コープアグリ	3,800	1,048.00	3,982,400
日本曹達	20,400	2,494.00	50,877,600
東ソー	200,100	1,379.00	275,937,900
トクヤマ	37,300	2,274.00	84,820,200

セントラル硝子	28,200	2,265.00	63,873,000
東亜合成	81,300	1,053.00	85,608,900
大阪ソーダ	14,300	2,440.00	34,892,000
関東電化工業	30,700	750.00	23,025,000
デンカ	50,900	2,844.00	144,759,600
信越化学工業	228,100	11,160.00	2,545,596,000
日本カーバイド工業	4,400	1,192.00	5,244,800
堺化学工業	8,600	2,343.00	20,149,800
第一稀元素化学工業	14,000	820.00	11,480,000
エア・ウォーター	106,000	1,796.00	190,376,000
大陽日酸	106,700	2,103.00	224,390,100
日本化学工業	4,400	2,169.00	9,543,600
東邦アセチレン	1,900	1,216.00	2,310,400
日本パーカラライジング	70,800	1,162.00	82,269,600
高压ガス工業	20,500	781.00	16,010,500
チタン工業	1,600	2,576.00	4,121,600
四国化成工業	21,800	1,058.00	23,064,400
戸田工業	2,800	2,013.00	5,636,400
ステラ ケミファ	7,600	2,660.00	20,216,000
保土谷化学工業	4,500	2,695.00	12,127,500
日本触媒	21,800	6,230.00	135,814,000
大日精化工業	10,700	2,847.00	30,462,900
カネカ	33,500	3,190.00	106,865,000
三菱瓦斯化学	131,600	1,284.00	168,974,400
三井化学	117,500	2,288.00	268,840,000
J S R	129,900	1,761.00	228,753,900
東京応化工業	22,200	3,955.00	87,801,000
大阪有機化学工業	12,000	957.00	11,484,000
三菱ケミカルホールディングス	865,500	750.60	649,644,300
K Hネオケム	22,800	2,144.00	48,883,200
ダイセル	190,700	841.00	160,378,700
住友ベークライト	22,400	3,915.00	87,696,000
積水化学工業	278,400	1,575.00	438,480,000
日本ゼオン	116,800	1,262.00	147,401,600
アイカ工業	38,800	3,035.00	117,758,000
宇部興産	65,400	2,070.00	135,378,000
積水樹脂	21,400	1,989.00	42,564,600
タキロンシーアイ	28,000	617.00	17,276,000
旭有機材	8,900	1,250.00	11,125,000
日立化成	59,900	3,470.00	207,853,000
ニチバン	6,800	1,503.00	10,220,400
リケンテクノス	35,300	458.00	16,167,400

大倉工業	6,300	1,538.00	9,689,400
積水化成成品工業	19,300	701.00	13,529,300
群栄化学工業	3,300	2,255.00	7,441,500
タイガースポリマー	6,800	530.00	3,604,000
ミライアル	3,700	1,260.00	4,662,000
ダイキアクシス	4,600	720.00	3,312,000
ダイキョーニシカワ	27,300	725.00	19,792,500
竹本容器	4,600	867.00	3,988,200
森六ホールディングス	7,000	2,436.00	17,052,000
日本化薬	80,100	1,209.00	96,840,900
カーリットホールディングス	13,800	551.00	7,603,800
日本精化	10,400	1,095.00	11,388,000
扶桑化学工業	13,100	2,256.00	29,553,600
トリケミカル研究所	2,900	6,260.00	18,154,000
A D E K A	63,800	1,313.00	83,769,400
日油	48,700	3,480.00	169,476,000
新日本理化	23,300	180.00	4,194,000
ハリマ化成グループ	10,700	1,187.00	12,700,900
花王	316,500	7,691.00	2,434,201,500
第一工業製薬	4,800	2,667.00	12,801,600
石原ケミカル	3,300	1,613.00	5,322,900
日華化学	4,400	771.00	3,392,400
ニイタカ	2,000	1,440.00	2,880,000
三洋化成工業	8,700	4,785.00	41,629,500
有機合成薬品工業	9,900	223.00	2,207,700
大日本塗料	14,600	1,035.00	15,111,000
日本ペイントホールディングス	106,800	5,020.00	536,136,000
関西ペイント	145,500	2,255.00	328,102,500
神東塗料	10,200	160.00	1,632,000
中国塗料	42,500	859.00	36,507,500
日本特殊塗料	9,700	1,015.00	9,845,500
藤倉化成	17,500	525.00	9,187,500
太陽ホールディングス	10,700	3,370.00	36,059,000
D I C	54,700	2,832.00	154,910,400
サカタインクス	28,300	974.00	27,564,200
東洋インキS Cホールディングス	27,400	2,245.00	61,513,000
T & K T O K A	10,000	913.00	9,130,000
富士フイルムホールディングス	274,600	4,607.00	1,265,082,200
資生堂	262,700	8,720.00	2,290,744,000
ライオン	171,900	2,004.00	344,487,600
高砂香料工業	9,100	2,638.00	24,005,800
マンダム	29,700	2,600.00	77,220,000

ミルボン	17,700	5,060.00	89,562,000
ファンケル	58,800	2,595.00	152,586,000
コーセー	22,400	17,920.00	401,408,000
コタ	6,900	1,168.00	8,059,200
シーボン	1,600	2,349.00	3,758,400
ポーラ・オルビスホールディングス	56,400	2,459.00	138,687,600
ノエビアホールディングス	12,600	5,470.00	68,922,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	925.00	2,682,500
エステー	9,400	1,557.00	14,635,800
アグロ カネショウ	5,100	1,418.00	7,231,800
コニシ	23,400	1,489.00	34,842,600
長谷川香料	17,500	2,059.00	36,032,500
星光PMC	8,400	752.00	6,316,800
小林製薬	37,000	7,850.00	290,450,000
荒川化学工業	11,900	1,370.00	16,303,000
メック	9,100	1,389.00	12,639,900
日本高純度化学	3,600	2,399.00	8,636,400
タカラバイオ	34,600	2,362.00	81,725,200
JCU	17,100	1,852.00	31,669,200
新田ゼラチン	8,300	646.00	5,361,800
OATアグリオ	2,300	1,319.00	3,033,700
デクセリアルズ	34,100	731.00	24,927,100
アース製薬	10,000	5,090.00	50,900,000
北興化学工業	13,500	455.00	6,142,500
大成ラミック	4,300	2,768.00	11,902,400
クミアイ化学工業	54,700	918.00	50,214,600
日本農薬	23,500	432.00	10,152,000
アキレス	9,600	1,642.00	15,763,200
有沢製作所	20,800	970.00	20,176,000
日東電工	91,200	5,134.00	468,220,800
レック	14,100	976.00	13,761,600
三光合成	15,100	345.00	5,209,500
きもと	22,500	172.00	3,870,000
藤森工業	11,900	2,932.00	34,890,800
前澤化成工業	9,000	1,110.00	9,990,000
未来工業	7,100	1,879.00	13,340,900
ウェーブロックホールディングス	3,700	726.00	2,686,200
JSP	7,700	1,730.00	13,321,000
エフピコ	14,500	6,900.00	100,050,000
天馬	8,800	1,951.00	17,168,800
信越ポリマー	23,700	727.00	17,229,900
東リ	32,900	244.00	8,027,600

ニフコ	52,900	2,449.00	129,552,100
バルカー	10,700	2,130.00	22,791,000
ユニ・チャーム	254,800	3,321.00	846,190,800
ショーエイコーポレーション	1,100	799.00	878,900
協和キリン	133,000	1,967.00	261,611,000
武田薬品工業	1,154,100	3,756.00	4,334,799,600
アステラス製薬	1,162,800	1,514.50	1,761,060,600
大日本住友製薬	98,000	1,770.00	173,460,000
塩野義製薬	169,000	5,750.00	971,750,000
田辺三菱製薬	138,300	1,174.00	162,364,200
わかもと製薬	15,700	246.00	3,862,200
あすか製薬	16,300	1,044.00	17,017,200
日本新薬	34,600	8,780.00	303,788,000
ピオフェルミン製薬	2,200	2,110.00	4,642,000
中外製薬	137,800	7,770.00	1,070,706,000
科研製薬	22,600	5,090.00	115,034,000
エーザイ	158,200	5,285.00	836,087,000
ロート製薬	67,900	2,643.00	179,459,700
小野薬品工業	312,200	1,941.50	606,136,300
久光製薬	39,100	4,370.00	170,867,000
持田製薬	20,000	4,095.00	81,900,000
参天製薬	246,200	1,807.00	444,883,400
扶桑薬品工業	4,700	1,915.00	9,000,500
日本ケミファ	1,700	2,798.00	4,756,600
ツムラ	41,000	2,926.00	119,966,000
日医工	34,800	1,194.00	41,551,200
キッセイ薬品工業	23,400	2,404.00	56,253,600
生化学工業	25,600	1,088.00	27,852,800
栄研化学	23,200	1,621.00	37,607,200
日水製薬	5,600	1,182.00	6,619,200
鳥居薬品	8,300	2,818.00	23,389,400
JCRファーマ	9,300	7,980.00	74,214,000
東和薬品	19,000	2,368.00	44,992,000
富士製薬工業	9,000	1,277.00	11,493,000
沢井製薬	27,100	5,550.00	150,405,000
ゼリア新薬工業	26,200	1,860.00	48,732,000
第一三共	378,300	6,953.00	2,630,319,900
キョーリン製薬ホールディングス	29,200	1,755.00	51,246,000
大幸薬品	5,900	2,281.00	13,457,900
ダイト	7,700	3,045.00	23,446,500
大塚ホールディングス	251,800	4,408.00	1,109,934,400
大正製薬ホールディングス	28,000	7,340.00	205,520,000

ペプチドリーム	66,900	5,530.00	369,957,000
日本コークス工業	111,700	84.00	9,382,800
ニチレキ	16,900	1,051.00	17,761,900
ユシロ化学工業	6,800	1,282.00	8,717,600
ビーピー・カストロール	4,700	1,338.00	6,288,600
富士石油	32,100	233.00	7,479,300
MORESCO	4,800	1,288.00	6,182,400
出光興産	152,600	2,897.00	442,082,200
JXTGホールディングス	2,186,900	452.50	989,572,250
コスモエネルギーホールディングス	38,300	1,968.00	75,374,400
横浜ゴム	76,500	2,052.00	156,978,000
TOYO TIRE	75,900	1,324.00	100,491,600
ブリヂストン	406,300	4,067.00	1,652,422,100
住友ゴム工業	118,800	1,205.00	143,154,000
藤倉コンポジット	11,500	399.00	4,588,500
オカモト	8,800	4,030.00	35,464,000
フコク	5,800	667.00	3,868,600
ニッタ	14,900	2,725.00	40,602,500
住友理工	25,600	769.00	19,686,400
三ツ星ベルト	17,400	1,760.00	30,624,000
バンドー化学	25,200	827.00	20,840,400
日東紡績	19,700	2,959.00	58,292,300
AGC	130,700	3,175.00	414,972,500
日本板硝子	63,200	633.00	40,005,600
石塚硝子	2,200	1,915.00	4,213,000
日本山村硝子	5,500	1,221.00	6,715,500
日本電気硝子	53,100	2,293.00	121,758,300
オハラ	5,300	1,299.00	6,884,700
住友大阪セメント	26,700	4,375.00	116,812,500
太平洋セメント	83,500	2,726.00	227,621,000
日本ヒューム	13,300	662.00	8,804,600
日本コンクリート工業	28,600	240.00	6,864,000
三谷セキサン	6,200	2,908.00	18,029,600
アジアパイルホールディングス	18,800	495.00	9,306,000
東海カーボン	138,500	1,060.00	146,810,000
日本カーボン	6,800	3,720.00	25,296,000
東洋炭素	7,800	2,103.00	16,403,400
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	3,875.00	30,612,500
TOTO	101,700	3,860.00	392,562,000
日本碍子	161,400	1,446.00	233,384,400
日本特殊陶業	111,500	1,850.00	206,275,000
MARUWA	4,600	6,350.00	29,210,000

品川リフラクトリーズ	3,500	2,590.00	9,065,000
黒崎播磨	2,600	5,450.00	14,170,000
ヨータイ	11,600	562.00	6,519,200
イソライト工業	6,900	425.00	2,932,500
東京窯業	16,900	286.00	4,833,400
ニッカトー	6,000	646.00	3,876,000
フジインコーポレーテッド	11,800	2,443.00	28,827,400
クニミネ工業	6,000	896.00	5,376,000
エーアンドエーマテリアル	2,600	968.00	2,516,800
ニチアス	36,200	1,793.00	64,906,600
ニチハ	18,400	2,742.00	50,452,800
日本製鉄	607,500	1,504.50	913,983,750
神戸製鋼所	239,300	570.00	136,401,000
中山製鋼所	18,200	441.00	8,026,200
合同製鐵	6,400	2,133.00	13,651,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	353,100	1,275.50	450,379,050
東京製鐵	70,100	838.00	58,743,800
共英製鋼	14,800	1,861.00	27,542,800
大和工業	27,800	2,672.00	74,281,600
東京鐵鋼	5,400	1,208.00	6,523,200
大阪製鐵	8,700	1,371.00	11,927,700
淀川製鋼所	17,700	1,828.00	32,355,600
丸一鋼管	46,300	2,580.00	119,454,000
モリ工業	3,900	1,800.00	7,020,000
大同特殊鋼	21,400	4,065.00	86,991,000
日本高周波鋼業	4,900	400.00	1,960,000
日本冶金工業	108,300	225.00	24,367,500
山陽特殊製鋼	16,500	1,437.00	23,710,500
愛知製鋼	7,400	3,140.00	23,236,000
日立金属	140,900	1,180.00	166,262,000
日本金属	3,000	775.00	2,325,000
大平洋金属	8,900	2,250.00	20,025,000
新日本電工	84,500	163.00	13,773,500
栗本鐵工所	6,600	1,382.00	9,121,200
虹技	2,000	1,228.00	2,456,000
三菱製鋼	9,700	1,083.00	10,505,100
日亜鋼業	19,300	277.00	5,346,100
日本精線	1,900	2,408.00	4,575,200
エンビプロ・ホールディングス	5,000	580.00	2,900,000
シンニッタン	20,400	420.00	8,568,000
新家工業	3,000	1,343.00	4,029,000
大紀アルミニウム工業所	21,700	719.00	15,602,300

日本軽金属ホールディングス	356,900	190.00	67,811,000
三井金属鉱業	35,300	2,350.00	82,955,000
東邦亜鉛	7,300	1,969.00	14,373,700
三菱マテリアル	86,400	2,598.00	224,467,200
住友金属鉱山	179,100	3,260.00	583,866,000
DOWAホールディングス	30,600	3,470.00	106,182,000
古河機械金属	21,700	1,318.00	28,600,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,200	1,558.00	23,681,600
東邦チタニウム	23,600	797.00	18,809,200
UACJ	19,900	1,636.00	32,556,400
CKサンエツ	2,500	2,860.00	7,150,000
古河電気工業	37,800	2,352.00	88,905,600
住友電気工業	488,900	1,275.50	623,591,950
フジクラ	158,300	352.00	55,721,600
昭和電線ホールディングス	15,200	793.00	12,053,600
東京特殊電線	1,800	1,787.00	3,216,600
タツタ電線	26,200	444.00	11,632,800
カナレ電気	2,200	1,723.00	3,790,600
平河ヒューテック	5,600	1,050.00	5,880,000
リョービ	16,200	1,624.00	26,308,800
アーレスティ	16,300	533.00	8,687,900
アサヒホールディングス	24,600	2,293.00	56,407,800
稲葉製作所	7,400	1,377.00	10,189,800
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,473.00	5,892,000
トーカロ	33,800	846.00	28,594,800
アルファC o	4,600	1,166.00	5,363,600
SUMCO	156,500	1,419.00	222,073,500
川田テクノロジーズ	2,900	6,410.00	18,589,000
RS Technologies	3,700	3,310.00	12,247,000
信和	6,900	979.00	6,755,100
東洋製罐グループホールディングス	83,300	1,589.00	132,363,700
ホッカンホールディングス	6,700	1,517.00	10,163,900
コロナ	7,300	992.00	7,241,600
横河ブリッジホールディングス	24,300	1,501.00	36,474,300
駒井ハルテック	2,500	1,450.00	3,625,000
高田機工	1,200	2,456.00	2,947,200
三和ホールディングス	135,100	1,183.00	159,823,300
文化シャッター	38,600	901.00	34,778,600
三協立山	18,200	1,167.00	21,239,400
アルインコ	10,400	920.00	9,568,000
東洋シャッター	3,200	667.00	2,134,400
LIXILグループ	192,900	1,759.00	339,311,100

日本ファイルコン	10,100	478.00	4,827,800	
ノーリツ	27,900	1,205.00	33,619,500	
長府製作所	13,300	2,181.00	29,007,300	
リンナイ	23,300	6,830.00	159,139,000	
ダイニチ工業	7,100	611.00	4,338,100	
日東精工	18,100	535.00	9,683,500	
三洋工業	1,700	1,780.00	3,026,000	
岡部	26,500	808.00	21,412,000	
ジーテクト	14,400	1,502.00	21,628,800	
東プレ	24,400	1,633.00	39,845,200	
高周波熱錬	25,200	813.00	20,487,600	
東京製綱	8,000	929.00	7,432,000	
サンコール	7,400	461.00	3,411,400	
モリテック スチール	10,300	334.00	3,440,200	
パイオラックス	21,000	1,731.00	36,351,000	
エイチワン	12,900	615.00	7,933,500	
日本発條	130,300	765.00	99,679,500	
中央発條	1,600	2,765.00	4,424,000	
アドバネクス	1,700	1,648.00	2,801,600	
立川ブラインド工業	5,800	1,379.00	7,998,200	
三益半導体工業	11,700	1,808.00	21,153,600	
日本ドライケミカル	3,600	1,093.00	3,934,800	
日本製鋼所	39,700	2,030.00	80,591,000	
三浦工業	56,600	2,999.00	169,743,400	
タクマ	47,800	1,195.00	57,121,000	
ツガミ	29,500	888.00	26,196,000	
オークマ	16,600	5,290.00	87,814,000	
東芝機械	14,800	2,127.00	31,479,600	
アマダホールディングス	196,500	1,128.00	221,652,000	
アイダエンジニアリング	35,400	803.00	28,426,200	
滝澤鉄工所	4,100	1,254.00	5,141,400	
F U J I	52,300	1,445.00	75,573,500	
牧野フライス製作所	15,400	4,490.00	69,146,000	
オーエスジー	60,400	2,039.00	123,155,600	
ダイジェット工業	1,600	1,443.00	2,308,800	
旭ダイヤモンド工業	34,500	608.00	20,976,000	
D M G 森精機	82,800	1,439.00	119,149,200	
ソディック	30,800	754.00	23,223,200	
ディスコ	17,700	20,940.00	370,638,000	
日東工器	7,200	2,054.00	14,788,800	
日進工具	3,900	1,850.00	7,215,000	
パンチ工業	9,300	463.00	4,305,900	

富士ダイス	5,900	571.00	3,368,900
豊和工業	7,400	750.00	5,550,000
OKK	5,500	700.00	3,850,000
東洋機械金属	9,500	556.00	5,282,000
津田駒工業	2,800	1,264.00	3,539,200
エンシュウ	3,500	1,062.00	3,717,000
島精機製作所	18,100	2,527.00	45,738,700
オプトラン	14,600	3,150.00	45,990,000
NCホールディングス	4,400	452.00	1,988,800
イワキポンプ	5,600	930.00	5,208,000
フリュー	10,500	919.00	9,649,500
ヤマシンフィルタ	22,900	699.00	16,007,100
日阪製作所	16,200	828.00	13,413,600
やまびこ	25,400	1,030.00	26,162,000
平田機工	6,200	6,520.00	40,424,000
ペガサスミシン製造	12,400	495.00	6,138,000
マルマエ	5,500	862.00	4,741,000
タツモ	6,200	1,096.00	6,795,200
ナプテスコ	77,100	3,165.00	244,021,500
三井海洋開発	13,900	2,451.00	34,068,900
レオン自動機	12,900	1,493.00	19,259,700
SMC	38,700	41,860.00	1,619,982,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,100	415.00	4,191,500
ホソカワミクロン	4,600	3,680.00	16,928,000
ユニオンツール	5,500	3,265.00	17,957,500
オイレス工業	18,400	1,493.00	27,471,200
日精エー・エス・ビー機械	4,400	3,165.00	13,926,000
サトーホールディングス	15,800	2,612.00	41,269,600
技研製作所	11,500	3,330.00	38,295,000
日本エアーテック	4,300	571.00	2,455,300
カワタ	3,700	932.00	3,448,400
日精樹脂工業	11,100	981.00	10,889,100
オカダアイヨン	4,600	1,120.00	5,152,000
ワイエイシイホールディングス	5,200	659.00	3,426,800
小松製作所	598,600	2,285.50	1,368,100,300
住友重機械工業	75,700	3,035.00	229,749,500
日立建機	53,000	2,312.00	122,536,000
日工	3,600	3,260.00	11,736,000
巴工業	5,700	2,300.00	13,110,000
井関農機	13,300	1,371.00	18,234,300
TOWA	11,400	738.00	8,413,200
丸山製作所	3,000	1,154.00	3,462,000

北川鉄工所	6,000	1,848.00	11,088,000
ローツェ	5,800	2,360.00	13,688,000
タカキタ	4,800	525.00	2,520,000
クボタ	708,300	1,555.50	1,101,760,650
荏原実業	3,700	1,921.00	7,107,700
三菱化工機	4,600	1,744.00	8,022,400
月島機械	26,300	1,331.00	35,005,300
帝国電機製作所	9,300	1,128.00	10,490,400
新東工業	31,500	916.00	28,854,000
澁谷工業	11,600	2,699.00	31,308,400
アイチ コーポレーション	23,000	655.00	15,065,000
小森コーポレーション	33,600	1,074.00	36,086,400
鶴見製作所	10,300	2,006.00	20,661,800
住友精密工業	2,200	2,900.00	6,380,000
日本ギア工業	4,100	484.00	1,984,400
酒井重工業	2,500	2,682.00	6,705,000
荏原製作所	58,700	2,597.00	152,443,900
石井鐵工所	2,100	1,989.00	4,176,900
西島製作所	13,600	1,039.00	14,130,400
北越工業	13,700	1,213.00	16,618,100
ダイキン工業	180,500	13,580.00	2,451,190,000
オルガノ	4,800	4,275.00	20,520,000
トーヨーカネツ	5,000	1,755.00	8,775,000
栗田工業	71,600	2,803.00	200,694,800
椿本チエイン	17,300	3,220.00	55,706,000
大同工業	6,400	794.00	5,081,600
木村化工機	11,300	362.00	4,090,600
アネスト岩田	20,700	894.00	18,505,800
ダイフク	72,800	5,080.00	369,824,000
サムコ	3,700	805.00	2,978,500
加藤製作所	6,800	1,691.00	11,498,800
油研工業	2,300	1,567.00	3,604,100
タダノ	63,900	977.00	62,430,300
フジテック	48,100	1,265.00	60,846,500
C K D	36,900	1,163.00	42,914,700
キトー	10,100	1,493.00	15,079,300
平和	36,900	2,098.00	77,416,200
理想科学工業	11,700	1,789.00	20,931,300
S A N K Y O	33,100	3,665.00	121,311,500
日本金銭機械	14,700	951.00	13,979,700
マースグループホールディングス	8,400	1,880.00	15,792,000
福島工業	8,200	3,030.00	24,846,000

オーイズミ	5,800	420.00	2,436,000
ダイコク電機	6,100	1,462.00	8,918,200
竹内製作所	22,200	1,565.00	34,743,000
アマノ	37,800	3,200.00	120,960,000
J U K I	18,400	846.00	15,566,400
蛇の目マシン工業	12,300	377.00	4,637,100
マックス	20,200	1,724.00	34,824,800
グローリー	36,700	2,903.00	106,540,100
新晃工業	12,300	1,698.00	20,885,400
大和冷機工業	19,200	1,064.00	20,428,800
セガサミーホールディングス	131,200	1,482.00	194,438,400
日本ピストンリング	4,900	1,217.00	5,963,300
リケン	6,100	3,650.00	22,265,000
T P R	17,800	1,646.00	29,298,800
ツバキ・ナカシマ	27,000	1,639.00	44,253,000
ホシザキ	38,700	7,720.00	298,764,000
大豊工業	10,900	757.00	8,251,300
日本精工	271,600	890.00	241,724,000
N T N	284,400	295.00	83,898,000
ジェイテクト	126,900	1,175.00	149,107,500
不二越	12,300	4,420.00	54,366,000
日本トムソン	39,400	428.00	16,863,200
T H K	77,000	2,588.00	199,276,000
ユーシン精機	10,300	954.00	9,826,200
前澤給装工業	5,200	1,880.00	9,776,000
イーグル工業	16,400	973.00	15,957,200
前澤工業	9,100	327.00	2,975,700
日本ピラー工業	13,400	1,117.00	14,967,800
キッツ	53,700	683.00	36,677,100
マキタ	160,900	3,170.00	510,053,000
日立造船	105,100	326.00	34,262,600
三菱重工業	221,600	4,036.00	894,377,600
I H I	101,600	2,168.00	220,268,800
スター精密	21,600	1,471.00	31,773,600
日清紡ホールディングス	88,300	780.00	68,874,000
イビデン	81,100	2,127.00	172,499,700
コニカミノルタ	289,300	750.00	216,975,000
ブラザー工業	172,400	1,856.00	319,974,400
ミネベアミツミ	245,600	1,682.00	413,099,200
日立製作所	595,100	3,901.00	2,321,485,100
三菱電機	1,322,000	1,318.00	1,742,396,000
富士電機	85,800	3,130.00	268,554,000

東洋電機製造	5,300	1,558.00	8,257,400
安川電機	153,300	3,705.00	567,976,500
シンフォニアテクノロジー	18,500	1,156.00	21,386,000
明電舎	26,200	1,756.00	46,007,200
オリジン	3,700	1,376.00	5,091,200
山洋電気	6,500	4,365.00	28,372,500
デンヨー	12,300	1,574.00	19,360,200
東芝テック	16,600	3,065.00	50,879,000
芝浦メカトロニクス	2,500	2,857.00	7,142,500
マブチモーター	36,700	3,830.00	140,561,000
日本電産	159,100	14,000.00	2,227,400,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,600	802.00	6,095,200
トレックス・セミコンダクター	6,300	1,139.00	7,175,700
東光高岳	7,000	1,087.00	7,609,000
ダイヘン	14,500	3,180.00	46,110,000
ヤーマン	19,600	774.00	15,170,400
JVCケンウッド	102,200	311.00	31,784,200
ミマキエンジニアリング	12,600	501.00	6,312,600
第一精工	5,500	2,242.00	12,331,000
日新電機	31,100	1,301.00	40,461,100
大崎電気工業	26,500	648.00	17,172,000
オムロン	140,500	5,500.00	772,750,000
日東工業	21,200	2,009.00	42,590,800
I D E C	17,800	1,861.00	33,125,800
正興電機製作所	3,600	713.00	2,566,800
不二電機工業	1,800	1,195.00	2,151,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,700	1,811.00	86,384,700
サクサホールディングス	3,400	1,750.00	5,950,000
メルコホールディングス	5,600	2,784.00	15,590,400
テクノメディカ	3,200	1,982.00	6,342,400
日本電気	171,100	4,650.00	795,615,000
富士通	127,500	8,545.00	1,089,487,500
沖電気工業	57,400	1,422.00	81,622,800
岩崎通信機	6,200	771.00	4,780,200
電気興業	7,000	2,923.00	20,461,000
サンケン電気	15,500	1,968.00	30,504,000
ナカヨ	2,600	1,591.00	4,136,600
アイホン	7,600	1,616.00	12,281,600
ルネサスエレクトロニクス	629,600	699.00	440,090,400
セイコーエプソン	164,100	1,427.00	234,170,700
ワコム	96,900	345.00	33,430,500
アルバック	26,400	4,650.00	122,760,000

アクセル	6,200	625.00	3,875,000	
E I Z O	12,200	3,640.00	44,408,000	
日本信号	33,800	1,186.00	40,086,800	
京三製作所	28,800	351.00	10,108,800	
能美防災	17,700	2,186.00	38,692,200	
ホーチキ	8,700	1,367.00	11,892,900	
星和電機	7,800	509.00	3,970,200	
エレコム	12,600	4,290.00	54,054,000	
パナソニック	1,510,300	835.00	1,261,100,500	
シャープ	131,200	1,154.00	151,404,800	
アンリツ	85,200	2,007.00	170,996,400	
富士通ゼネラル	40,400	1,783.00	72,033,200	
ソニー	887,200	6,389.00	5,668,320,800	
T D K	69,200	8,990.00	622,108,000	
帝国通信工業	6,200	1,065.00	6,603,000	
タムラ製作所	51,200	559.00	28,620,800	
アルプスアルパイン	137,800	1,891.00	260,579,800	
池上通信機	4,200	1,029.00	4,321,800	
鈴木	7,700	615.00	4,735,500	
日本トリム	2,600	4,515.00	11,739,000	
ローランド ディー . ジー .	7,500	1,946.00	14,595,000	
フォスター電機	15,000	1,838.00	27,570,000	
S M K	3,700	2,682.00	9,923,400	
ヨコオ	9,600	2,697.00	25,891,200	
ホシデン	39,300	1,010.00	39,693,000	
ヒロセ電機	18,900	12,640.00	238,896,000	
日本航空電子工業	30,400	1,433.00	43,563,200	
T O A	14,300	1,223.00	17,488,900	
マクセルホールディングス	28,700	1,502.00	43,107,400	
古野電気	17,500	892.00	15,610,000	
ユニデンホールディングス	4,000	1,762.00	7,048,000	
スミダコーポレーション	11,100	1,001.00	11,111,100	
アイコム	7,400	2,145.00	15,873,000	
リオン	6,200	2,218.00	13,751,600	
本多通信工業	12,100	455.00	5,505,500	
横河電機	132,400	1,921.00	254,340,400	
新電元工業	4,700	3,130.00	14,711,000	
アズビル	83,500	2,757.00	230,209,500	
東亜ディーケーケー	7,000	831.00	5,817,000	
日本光電工業	58,400	2,939.00	171,637,600	
チノー	4,700	1,340.00	6,298,000	
共和電業	14,100	407.00	5,738,700	

日本電子材料	5,500	501.00	2,755,500
堀場製作所	26,200	5,650.00	148,030,000
アドバンテスト	90,100	4,605.00	414,910,500
小野測器	6,500	490.00	3,185,000
エスベック	11,900	1,847.00	21,979,300
キーエンス	64,900	63,500.00	4,121,150,000
日置電機	7,000	3,390.00	23,730,000
シスメックス	103,100	6,876.00	708,915,600
日本マイクロニクス	23,500	821.00	19,293,500
メガチップス	10,600	1,633.00	17,309,800
O B A R A G R O U P	7,000	3,460.00	24,220,000
澤藤電機	1,800	1,640.00	2,952,000
原田工業	5,800	819.00	4,750,200
コーセル	17,100	1,053.00	18,006,300
イリソ電子工業	12,200	4,890.00	59,658,000
オブテックスグループ	22,500	1,466.00	32,985,000
千代田インテグレ	6,300	1,993.00	12,555,900
アイ・オー・データ機器	5,300	859.00	4,552,700
レーザーテック	27,200	6,540.00	177,888,000
スタンレー電気	93,400	2,630.00	245,642,000
岩崎電気	5,500	1,190.00	6,545,000
ウシオ電機	77,100	1,449.00	111,717,900
岡谷電機産業	10,400	360.00	3,744,000
ヘリオス テクノ ホールディング	12,900	536.00	6,914,400
エノモト	4,100	893.00	3,661,300
日本セラミック	13,600	2,683.00	36,488,800
遠藤照明	7,300	650.00	4,745,000
古河電池	10,100	575.00	5,807,500
双信電機	7,300	443.00	3,233,900
山一電機	9,900	1,176.00	11,642,400
図研	8,800	1,847.00	16,253,600
日本電子	26,200	2,400.00	62,880,000
カシオ計算機	117,000	1,509.00	176,553,000
ファナック	125,600	18,615.00	2,338,044,000
日本シイエムケイ	34,400	535.00	18,404,000
エンプラス	6,100	3,285.00	20,038,500
大真空	5,200	991.00	5,153,200
ローム	63,300	8,110.00	513,363,000
浜松ホトニクス	94,900	3,680.00	349,232,000
三井ハイテック	14,900	1,379.00	20,547,100
新光電気工業	44,800	878.00	39,334,400
京セラ	201,500	6,521.00	1,313,981,500

太陽誘電	59,000	2,199.00	129,741,000
村田製作所	416,100	4,713.00	1,961,079,300
双葉電子工業	21,200	1,297.00	27,496,400
北陸電気工業	5,300	969.00	5,135,700
ニチコン	42,000	912.00	38,304,000
日本ケミコン	9,400	1,433.00	13,470,200
K O A	20,300	1,239.00	25,151,700
市光工業	20,300	757.00	15,367,100
小糸製作所	79,300	4,980.00	394,914,000
ミツバ	25,000	557.00	13,925,000
S C R E E Nホールディングス	23,000	6,440.00	148,120,000
キャノン電子	14,100	1,779.00	25,083,900
キャノン	711,700	2,783.00	1,980,661,100
リコー	397,600	945.00	375,732,000
象印マホービン	39,000	1,363.00	53,157,000
M U T O Hホールディングス	2,000	1,622.00	3,244,000
東京エレクトロン	88,200	20,050.00	1,768,410,000
トヨタ紡織	46,400	1,435.00	66,584,000
芦森工業	3,000	1,308.00	3,924,000
ユニプレス	25,800	1,683.00	43,421,400
豊田自動織機	107,000	5,930.00	634,510,000
モリタホールディングス	23,300	1,633.00	38,048,900
三櫻工業	17,500	478.00	8,365,000
デンソー	291,100	4,577.00	1,332,364,700
東海理化電機製作所	35,000	1,709.00	59,815,000
三井E & Sホールディングス	47,700	831.00	39,638,700
川崎重工業	102,900	2,122.00	218,353,800
名村造船所	39,700	241.00	9,567,700
日本車輛製造	4,800	2,277.00	10,929,600
三菱ロジスネクスト	21,900	1,100.00	24,090,000
近畿車輛	2,000	1,286.00	2,572,000
日産自動車	1,559,000	657.70	1,025,354,300
いすゞ自動車	417,900	1,150.00	480,585,000
トヨタ自動車	1,473,100	7,000.00	10,311,700,000
日野自動車	165,100	866.00	142,976,600
三菱自動車工業	489,300	453.00	221,652,900
エフテック	9,700	678.00	6,576,600
レシップホールディングス	4,700	777.00	3,651,900
G M B	3,000	725.00	2,175,000
ファルテック	2,800	705.00	1,974,000
武蔵精密工業	32,300	1,267.00	40,924,100
日産車体	25,800	946.00	24,406,800

新明和工業	55,400	1,275.00	70,635,000
極東開発工業	26,300	1,154.00	30,350,200
日信工業	24,400	1,369.00	33,403,600
トピー工業	11,000	1,892.00	20,812,000
ティラド	5,000	1,725.00	8,625,000
タチエス	22,000	1,226.00	26,972,000
N O K	71,300	1,525.00	108,732,500
フタバ産業	37,200	695.00	25,854,000
K Y B	13,700	2,920.00	40,004,000
大同メタル工業	22,000	604.00	13,288,000
プレス工業	66,300	448.00	29,702,400
ミクニ	17,800	302.00	5,375,600
太平洋工業	27,900	1,448.00	40,399,200
ケーヒン	30,600	1,496.00	45,777,600
河西工業	16,700	757.00	12,641,900
アイシン精機	108,900	3,275.00	356,647,500
マツダ	414,900	902.50	374,447,250
今仙電機製作所	12,700	844.00	10,718,800
本田技研工業	1,115,200	2,654.00	2,959,740,800
スズキ	241,900	4,096.00	990,822,400
S U B A R U	410,400	2,910.50	1,194,469,200
安永	6,600	1,281.00	8,454,600
ヤマハ発動機	172,400	1,735.00	299,114,000
ショーワ	31,400	1,373.00	43,112,200
T B K	16,600	384.00	6,374,400
エクセディ	18,100	1,992.00	36,055,200
豊田合成	42,900	2,033.00	87,215,700
愛三工業	21,100	741.00	15,635,100
盟和産業	2,300	1,014.00	2,332,200
日本プラスト	10,800	669.00	7,225,200
ヨロズ	12,600	1,265.00	15,939,000
エフ・シー・シー	23,900	1,985.00	47,441,500
シマノ	49,500	15,250.00	754,875,000
テイ・エス テック	30,800	2,958.00	91,106,400
ジャムコ	6,800	1,457.00	9,907,600
テルモ	374,100	3,081.00	1,152,602,100
クリエートメディック	4,400	901.00	3,964,400
日機装	40,800	1,144.00	46,675,200
島津製作所	170,100	2,666.00	453,486,600
J M S	12,200	606.00	7,393,200
長野計器	10,400	681.00	7,082,400
ブイ・テクノロジー	6,200	5,410.00	33,542,000

東京計器	8,500	876.00	7,446,000
愛知時計電機	1,700	3,890.00	6,613,000
インターアクション	7,100	1,954.00	13,873,400
オーバル	13,100	223.00	2,921,300
東京精密	24,000	3,090.00	74,160,000
マニー	52,700	2,491.00	131,275,700
ニコン	230,400	1,339.00	308,505,600
トプコン	71,000	1,282.00	91,022,000
オリンパス	787,700	1,368.00	1,077,573,600
理研計器	11,700	1,869.00	21,867,300
タムロン	11,200	2,181.00	24,427,200
HOYA	266,100	9,089.00	2,418,582,900
シード	5,700	854.00	4,867,800
ノーリツ鋼機	10,400	1,783.00	18,543,200
エー・アンド・デイ	12,100	657.00	7,949,700
朝日インテック	112,200	2,426.00	272,197,200
シチズン時計	144,700	504.00	72,928,800
リズム時計工業	4,500	887.00	3,991,500
大研医器	10,500	523.00	5,491,500
メニコン	18,100	3,975.00	71,947,500
シンシア	1,900	661.00	1,255,900
松風	6,500	1,512.00	9,828,000
セイコーホールディングス	20,400	2,244.00	45,777,600
ニプロ	91,500	1,134.00	103,761,000
中本パックス	3,700	1,392.00	5,150,400
スノーピーク	5,900	1,348.00	7,953,200
パラマウントベッドホールディングス	15,200	3,955.00	60,116,000
トランザクション	8,400	1,054.00	8,853,600
SHO-BI	3,900	373.00	1,454,700
ニホンフラッシュ	5,700	2,451.00	13,970,700
前田工織	14,600	1,394.00	20,352,400
永大産業	17,300	314.00	5,432,200
アートネイチャー	14,100	636.00	8,967,600
バンダイナムコホールディングス	136,700	6,440.00	880,348,000
アイフィスジャパン	3,400	716.00	2,434,400
共立印刷	22,000	144.00	3,168,000
SHOEI	6,400	4,495.00	28,768,000
フランスベッドホールディングス	18,700	1,005.00	18,793,500
パイロットコーポレーション	23,100	3,690.00	85,239,000
萩原工業	7,300	1,368.00	9,986,400
トッパン・フォームズ	28,300	929.00	26,290,700
フジシールインターナショナル	29,600	2,820.00	83,472,000

タカラトミー	55,300	1,121.00	61,991,300
廣濟堂	12,300	696.00	8,560,800
エステールホールディングス	3,500	616.00	2,156,000
アーク	50,500	91.00	4,595,500
タカノ	5,200	728.00	3,785,600
プロネクサス	11,300	1,029.00	11,627,700
ホクシン	8,200	146.00	1,197,200
ウッドワン	4,400	1,016.00	4,470,400
大建工業	10,000	1,839.00	18,390,000
凸版印刷	196,500	1,768.00	347,412,000
大日本印刷	186,300	2,387.00	444,698,100
共同印刷	4,100	2,653.00	10,877,300
N I S S H A	27,100	975.00	26,422,500
光村印刷	1,100	1,713.00	1,884,300
宝印刷	6,400	1,607.00	10,284,800
アシックス	109,100	1,473.00	160,704,300
ツツミ	4,100	1,918.00	7,863,800
小松ウオール工業	4,000	1,871.00	7,484,000
ヤマハ	78,600	4,535.00	356,451,000
河合楽器製作所	4,100	2,849.00	11,680,900
クリナップ	12,300	540.00	6,642,000
ピジョン	79,900	4,205.00	335,979,500
兼松サステック	900	1,728.00	1,555,200
キングジム	11,000	844.00	9,284,000
リンテック	31,400	2,051.00	64,401,400
イトーキ	28,100	406.00	11,408,600
任天堂	75,700	40,960.00	3,100,672,000
三菱鉛筆	21,800	1,675.00	36,515,000
タカラスタндарт	27,300	1,690.00	46,137,000
コクヨ	63,400	1,398.00	88,633,200
ナカバヤシ	13,000	505.00	6,565,000
グローブライド	6,400	2,946.00	18,854,400
オカムラ	46,100	1,083.00	49,926,300
美津濃	13,100	2,663.00	34,885,300
東京電力ホールディングス	1,055,300	519.00	547,700,700
中部電力	404,400	1,553.50	628,235,400
関西電力	539,400	1,304.50	703,647,300
中国電力	182,700	1,366.00	249,568,200
北陸電力	129,500	666.00	86,247,000
東北電力	309,600	1,051.00	325,389,600
四国電力	119,000	1,019.00	121,261,000
九州電力	272,500	1,040.00	283,400,000

北海道電力	123,700	553.00	68,406,100
沖縄電力	24,500	1,623.00	39,763,500
電源開発	105,200	2,457.00	258,476,400
エフオン	6,200	707.00	4,383,400
イーレックス	23,000	1,160.00	26,680,000
レノバ	21,800	844.00	18,399,200
東京瓦斯	259,300	2,687.00	696,739,100
大阪瓦斯	256,500	1,927.00	494,275,500
東邦瓦斯	65,500	4,160.00	272,480,000
北海道瓦斯	7,100	1,520.00	10,792,000
広島ガス	27,200	329.00	8,948,800
西部瓦斯	14,900	2,277.00	33,927,300
静岡ガス	38,900	878.00	34,154,200
メタウォーター	6,400	3,645.00	23,328,000
SBSホールディングス	12,500	1,541.00	19,262,500
東武鉄道	139,400	3,325.00	463,505,000
相鉄ホールディングス	45,300	2,806.00	127,111,800
東急	359,000	1,893.00	679,587,000
京浜急行電鉄	181,100	1,937.00	350,790,700
小田急電鉄	211,700	2,431.00	514,642,700
京王電鉄	73,900	6,580.00	486,262,000
京成電鉄	99,100	4,210.00	417,211,000
富士急行	18,000	4,465.00	80,370,000
新京成電鉄	3,400	2,016.00	6,854,400
東日本旅客鉄道	235,100	10,130.00	2,381,563,000
西日本旅客鉄道	118,500	9,087.00	1,076,809,500
東海旅客鉄道	118,400	20,865.00	2,470,416,000
西武ホールディングス	163,700	1,809.00	296,133,300
鴻池運輸	21,000	1,672.00	35,112,000
西日本鉄道	36,600	2,409.00	88,169,400
ハマキョウレックス	10,100	3,645.00	36,814,500
サカイ引越センター	6,900	6,100.00	42,090,000
近鉄グループホールディングス	125,200	5,330.00	667,316,000
阪急阪神ホールディングス	167,000	4,045.00	675,515,000
南海電気鉄道	55,900	2,732.00	152,718,800
京阪ホールディングス	55,700	4,485.00	249,814,500
神戸電鉄	3,200	3,940.00	12,608,000
名古屋鉄道	102,900	3,185.00	327,736,500
山陽電気鉄道	9,600	2,118.00	20,332,800
日本通運	48,300	5,530.00	267,099,000
ヤマトホールディングス	219,500	1,825.50	400,697,250
山九	34,800	5,170.00	179,916,000

丸運	7,100	261.00	1,853,100
丸全昭和運輸	10,200	3,075.00	31,365,000
センコーグループホールディングス	69,000	840.00	57,960,000
トナミホールディングス	3,000	4,310.00	12,930,000
ニッコンホールディングス	47,600	2,414.00	114,906,400
日本石油輸送	1,500	2,867.00	4,300,500
福山通運	16,000	3,590.00	57,440,000
セイノーホールディングス	93,800	1,351.00	126,723,800
エスライン	3,800	808.00	3,070,400
神奈川中央交通	3,100	3,740.00	11,594,000
日立物流	27,500	3,295.00	90,612,500
丸和運輸機関	6,600	5,350.00	35,310,000
C & F ロジホールディングス	12,700	1,213.00	15,405,100
九州旅客鉄道	105,100	3,190.00	335,269,000
S Gホールディングス	118,300	2,871.00	339,639,300
日本郵船	105,200	1,686.00	177,367,200
商船三井	74,600	2,729.00	203,583,400
川崎汽船	38,600	1,239.00	47,825,400
N S ユナイテッド海運	7,300	2,293.00	16,738,900
飯野海運	61,700	331.00	20,422,700
共栄タンカー	1,700	1,343.00	2,283,100
乾汽船	11,200	965.00	10,808,000
日本航空	229,200	3,315.00	759,798,000
A N Aホールディングス	228,800	3,615.00	827,112,000
パスコ	2,400	897.00	2,152,800
ランコム	3,500	5,670.00	19,845,000
日新	10,800	1,485.00	16,038,000
三菱倉庫	43,300	2,664.00	115,351,200
三井倉庫ホールディングス	15,300	1,612.00	24,663,600
住友倉庫	46,100	1,415.00	65,231,500
澁澤倉庫	6,900	1,856.00	12,806,400
東陽倉庫	22,600	295.00	6,667,000
日本トランスシティ	27,600	443.00	12,226,800
ケイヒン	2,400	1,189.00	2,853,600
中央倉庫	7,600	1,008.00	7,660,800
川西倉庫	2,500	1,045.00	2,612,500
安田倉庫	10,300	925.00	9,527,500
ファイズ	2,200	741.00	1,630,200
東洋埠頭	3,800	1,306.00	4,962,800
宇徳	10,700	500.00	5,350,000
上組	77,200	2,463.00	190,143,600
サンリツ	3,000	644.00	1,932,000

キムラユニティー	3,300	1,002.00	3,306,600
キューソー流通システム	3,100	1,752.00	5,431,200
近鉄エクスプレス	23,600	1,459.00	34,432,400
東海運	7,100	286.00	2,030,600
エーアイティー	8,100	904.00	7,322,400
内外トランスライン	4,400	1,218.00	5,359,200
日本コンセプト	4,400	1,340.00	5,896,000
NEC ネットエスアイ	14,400	2,843.00	40,939,200
クロスキャット	3,700	990.00	3,663,000
システナ	46,400	1,576.00	73,126,400
デジタルアーツ	7,000	7,760.00	54,320,000
日鉄ソリューションズ	19,500	3,650.00	71,175,000
キューブシステム	7,200	759.00	5,464,800
エイジア	2,700	1,243.00	3,356,100
コア	5,700	1,290.00	7,353,000
ソリトンシステムズ	7,200	1,010.00	7,272,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,800	1,692.00	9,813,600
T I S	43,300	6,420.00	277,986,000
ネオス	5,200	764.00	3,972,800
電算システム	5,000	2,850.00	14,250,000
グリー	90,000	463.00	41,670,000
コーエーテクモホールディングス	26,600	2,216.00	58,945,600
三菱総合研究所	5,600	3,550.00	19,880,000
電算	1,600	2,018.00	3,228,800
A G S	7,700	654.00	5,035,800
ファインデックス	11,200	1,010.00	11,312,000
ブレインパッド	2,500	6,760.00	16,900,000
K L a b	24,900	1,226.00	30,527,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	17,400	1,217.00	21,175,800
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,769.00	3,891,800
ネクソン	368,100	1,397.00	514,235,700
アイスタイル	33,600	707.00	23,755,200
エムアップ	4,600	1,934.00	8,896,400
エイチーム	9,100	1,111.00	10,110,100
エニグモ	9,400	1,249.00	11,740,600
テクノスジャパン	11,400	505.00	5,757,000
コロプラ	42,800	720.00	30,816,000
ブロードリーフ	64,700	564.00	36,490,800
クロス・マーケティンググループ	6,600	323.00	2,131,800
デジタルハーツホールディングス	6,100	948.00	5,782,800
システム情報	6,800	1,036.00	7,044,800
メディアドゥホールディングス	4,700	3,675.00	17,272,500

じげん	18,700	578.00	10,808,600
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	754.00	1,583,400
サイバーリンクス	2,200	1,087.00	2,391,400
フィックスターズ	14,000	1,528.00	21,392,000
CARTA HOLDINGS	6,500	955.00	6,207,500
オブティム	5,700	2,940.00	16,758,000
セレス	4,400	1,284.00	5,649,600
ティーガイア	9,300	2,108.00	19,604,400
セック	2,200	3,090.00	6,798,000
日本アジアグループ	13,700	327.00	4,479,900
豆蔵ホールディングス	9,000	1,689.00	15,201,000
テクマトリックス	9,200	2,297.00	21,132,400
プロシップ	3,900	1,188.00	4,633,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,400	2,368.00	74,355,200
GMOペイメントゲートウェイ	21,400	7,960.00	170,344,000
ザッパラス	7,500	362.00	2,715,000
システムリサーチ	1,800	3,955.00	7,119,000
インターネットイニシアティブ	21,200	2,493.00	52,851,600
さくらインターネット	15,900	603.00	9,587,700
ヴィンクス	4,400	1,267.00	5,574,800
GMOクラウド	2,800	2,561.00	7,170,800
SRAホールディングス	7,000	2,484.00	17,388,000
Minor iソリューションズ	2,700	1,796.00	4,849,200
システムインテグレータ	4,000	659.00	2,636,000
朝日ネット	10,800	697.00	7,527,600
eBASE	8,000	998.00	7,984,000
アバント	4,700	1,909.00	8,972,300
アドソル日進	4,700	2,146.00	10,086,200
フリービット	7,900	1,125.00	8,887,500
コムチュア	7,300	3,870.00	28,251,000
サイバーコム	2,500	1,665.00	4,162,500
アステリア	9,000	625.00	5,625,000
アイル	2,400	1,743.00	4,183,200
マークラインズ	6,600	1,849.00	12,203,400
メディカル・データ・ビジョン	11,200	1,049.00	11,748,800
ショーケース	3,500	731.00	2,558,500
モバイルファクトリー	3,600	1,645.00	5,922,000
テラスカイ	2,200	1,839.00	4,045,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,585.00	9,351,500
PCIホールディングス	2,700	2,019.00	5,451,300
パイブドHD	2,200	1,272.00	2,798,400
アイビーシー	2,600	1,000.00	2,600,000

ネオジャパン	2,700	1,046.00	2,824,200
P R T I M E S	1,200	2,948.00	3,537,600
ランドコンピュータ	2,200	1,010.00	2,222,000
ダブルスタンダード	1,200	4,365.00	5,238,000
オープンドア	6,500	2,211.00	14,371,500
マイネット	4,700	503.00	2,364,100
アカツキ	4,600	7,230.00	33,258,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,763.00	2,115,600
U b i c o mホールディングス	2,500	1,607.00	4,017,500
L I N E	29,700	3,910.00	116,127,000
カナミックネットワーク	8,400	596.00	5,006,400
ノムラシステムコーポレーション	3,500	380.00	1,330,000
チェンジ	2,700	2,093.00	5,651,100
シンクロ・フード	6,100	470.00	2,867,000
オークネット	8,200	1,194.00	9,790,800
セグエグループ	1,300	1,338.00	1,739,400
エイトレッド	1,500	1,764.00	2,646,000
A O I T Y O H o l d i n g s	13,900	621.00	8,631,900
マクロミル	23,200	959.00	22,248,800
ビーグリー	3,400	880.00	2,992,000
オロ	3,500	2,599.00	9,096,500
テモナ	2,200	566.00	1,245,200
ニーズウェル	1,900	705.00	1,339,500
サインポスト	2,100	2,232.00	4,687,200
ソルクシーズ	5,800	885.00	5,133,000
フェイス	5,500	743.00	4,086,500
プロトコーポレーション	11,800	1,187.00	14,006,600
ハイマックス	1,700	1,849.00	3,143,300
野村総合研究所	247,600	2,242.00	555,119,200
サイバネットシステム	10,400	604.00	6,281,600
C Eホールディングス	3,900	1,013.00	3,950,700
日本システム技術	2,300	1,196.00	2,750,800
インテージホールディングス	16,500	898.00	14,817,000
東邦システムサイエンス	4,100	949.00	3,890,900
ソースネクスト	50,900	457.00	23,261,300
インフォコム	14,300	2,572.00	36,779,600
F I G	14,900	300.00	4,470,000
アルテリア・ネットワークス	14,500	1,452.00	21,054,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,673.00	5,186,300
フォーカスシステムズ	9,000	828.00	7,452,000
クレスコ	4,000	3,370.00	13,480,000
フジ・メディア・ホールディングス	134,700	1,369.00	184,404,300

オービック	45,000	12,260.00	551,700,000
ジャストシステム	18,500	3,730.00	69,005,000
TDCソフト	11,700	734.00	8,587,800
ヤフー	846,700	286.00	242,156,200
トレンドマイクロ	57,700	5,070.00	292,539,000
IDホールディングス	5,100	1,198.00	6,109,800
日本オラクル	26,300	9,110.00	239,593,000
アルファシステムズ	4,100	2,602.00	10,668,200
フューチャー	17,000	1,806.00	30,702,000
CAC Holdings	9,100	1,326.00	12,066,600
ソフトバンク・テクノロジー	5,700	2,021.00	11,519,700
トーセ	3,800	804.00	3,055,200
オービックビジネスコンサルタント	13,300	4,375.00	58,187,500
伊藤忠テクノソリューションズ	59,200	3,020.00	178,784,000
アイティフォー	16,000	845.00	13,520,000
東計電算	2,000	3,005.00	6,010,000
エクスネット	2,600	927.00	2,410,200
大塚商会	70,200	3,985.00	279,747,000
サイボウズ	15,400	1,062.00	16,354,800
ソフトブレーン	10,200	589.00	6,007,800
電通国際情報サービス	8,100	3,415.00	27,661,500
デジタルガレージ	25,300	3,605.00	91,206,500
EMシステムズ	10,700	1,908.00	20,415,600
ウェザーニューズ	4,500	3,130.00	14,085,000
C I J	9,900	820.00	8,118,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	2,627.00	3,677,800
日本エンタープライズ	14,900	169.00	2,518,100
WOWOW	6,300	2,543.00	16,020,900
スカラ	9,300	1,031.00	9,588,300
インテリジェント ウェイブ	5,200	811.00	4,217,200
IMAGICA GROUP	11,500	466.00	5,359,000
ネットワンシステムズ	46,000	2,890.00	132,940,000
システムソフト	33,100	106.00	3,508,600
アルゴグラフィックス	11,100	2,577.00	28,604,700
マーベラス	20,100	763.00	15,336,300
エイベックス	22,400	1,251.00	28,022,400
日本ユニシス	40,600	3,390.00	137,634,000
兼松エレクトロニクス	7,100	2,977.00	21,136,700
東京放送ホールディングス	86,200	1,689.00	145,591,800
日本テレビホールディングス	119,300	1,378.00	164,395,400
朝日放送グループホールディングス	13,200	705.00	9,306,000
テレビ朝日ホールディングス	35,800	1,650.00	59,070,000

スカパーJ S A Tホールディングス	85,900	417.00	35,820,300
テレビ東京ホールディングス	10,700	2,109.00	22,566,300
日本BS放送	4,600	1,060.00	4,876,000
ビジョン	4,100	4,790.00	19,639,000
スマートバリュー	4,200	728.00	3,057,600
ワイヤレスゲート	6,500	726.00	4,719,000
コネクシオ	9,400	1,353.00	12,718,200
クロップス	2,800	596.00	1,668,800
日本電信電話	887,300	5,107.00	4,531,441,100
K D D I	1,063,400	2,870.00	3,051,958,000
ソフトバンク	1,375,500	1,506.50	2,072,190,750
光通信	15,300	24,370.00	372,861,000
N T T ドコモ	821,400	2,708.00	2,224,351,200
エムティーアイ	12,900	705.00	9,094,500
G M O インターネット	51,900	1,854.00	96,222,600
ファイバーゲート	2,600	1,723.00	4,479,800
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	536.00	1,768,800
K A D O K A W A	38,000	1,564.00	59,432,000
学研ホールディングス	4,400	5,310.00	23,364,000
ゼンリン	26,000	1,806.00	46,956,000
昭文社	6,700	351.00	2,351,700
インプレスホールディングス	10,700	143.00	1,530,100
アイネット	7,500	1,359.00	10,192,500
松竹	8,600	12,720.00	109,392,000
東宝	85,400	4,650.00	397,110,000
東映	5,500	15,300.00	84,150,000
エヌ・ティ・ティ・データ	345,500	1,394.00	481,627,000
ピー・シー・エー	1,700	4,115.00	6,995,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,516.00	5,786,800
D T S	29,100	2,245.00	65,329,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,400	4,300.00	259,720,000
シーイーシー	14,000	2,246.00	31,444,000
カブコン	55,700	2,866.00	159,636,200
アイ・エス・ビー	2,700	1,523.00	4,112,100
ジャステック	8,500	1,061.00	9,018,500
S C S K	34,300	5,220.00	179,046,000
日本システムウエア	4,400	2,450.00	10,780,000
アイネス	16,700	1,078.00	18,002,600
T K C	11,000	4,530.00	49,830,000
富士ソフト	16,700	4,605.00	76,903,500
N S D	21,400	3,190.00	68,266,000
コナミホールディングス	53,100	4,970.00	263,907,000

福井コンピュータホールディングス	4,400	2,129.00	9,367,600
J B C Cホールディングス	10,400	1,537.00	15,984,800
ミロク情報サービス	12,900	2,808.00	36,223,200
ソフトバンクグループ	1,029,300	4,795.00	4,935,493,500
ハウスイ	1,100	779.00	856,900
高千穂交易	5,000	1,072.00	5,360,000
伊藤忠食品	3,200	4,150.00	13,280,000
エレマテック	12,200	976.00	11,907,200
J A L U X	3,700	2,273.00	8,410,100
あらた	9,600	3,675.00	35,280,000
トーメンデバイス	2,000	2,304.00	4,608,000
東京エレクトロン デバイス	4,700	1,991.00	9,357,700
フィールズ	11,400	493.00	5,620,200
双日	719,100	337.00	242,336,700
アルフレッサ ホールディングス	144,700	2,441.00	353,212,700
横浜冷凍	36,500	1,031.00	37,631,500
神栄	1,600	819.00	1,310,400
ラサ商事	6,900	810.00	5,589,000
ラクーンホールディングス	6,300	632.00	3,981,600
アルコニックス	13,800	1,164.00	16,063,200
神戸物産	22,500	5,330.00	119,925,000
あい ホールディングス	18,600	1,757.00	32,680,200
ディーブイエックス	5,100	764.00	3,896,400
ダイワボウホールディングス	11,900	4,040.00	48,076,000
マクニカ・富士エレホールディングス	36,100	1,432.00	51,695,200
ラクト・ジャパン	5,400	3,625.00	19,575,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,500	1,039.00	25,455,500
八洲電機	10,100	873.00	8,817,300
メディアスホールディングス	7,400	667.00	4,935,800
レスターホールディングス	14,300	1,717.00	24,553,100
ジュテックホールディングス	3,000	921.00	2,763,000
大光	5,600	644.00	3,606,400
O C H Iホールディングス	3,800	1,139.00	4,328,200
T O K A Iホールディングス	68,800	998.00	68,662,400
黒谷	3,000	427.00	1,281,000
C o m i n i x	2,300	782.00	1,798,600
三洋貿易	6,600	2,150.00	14,190,000
ビューティガレージ	2,100	1,922.00	4,036,200
ウイン・パートナーズ	8,500	1,071.00	9,103,500
ミタチ産業	3,900	656.00	2,558,400
シップヘルスケアホールディングス	27,100	4,745.00	128,589,500
明治電機工業	4,100	1,328.00	5,444,800

デリカフーズホールディングス	4,600	721.00	3,316,600
スターティアホールディングス	2,600	498.00	1,294,800
コメダホールディングス	30,200	1,970.00	59,494,000
富士興産	5,100	701.00	3,575,100
協栄産業	1,600	1,329.00	2,126,400
小野建	11,700	1,304.00	15,256,800
南陽	2,700	1,497.00	4,041,900
佐島電機	9,600	798.00	7,660,800
エコートレーディング	3,000	515.00	1,545,000
伯東	8,900	1,119.00	9,959,100
コンドーテック	10,100	871.00	8,797,100
中山福	7,500	489.00	3,667,500
ナガイレーベン	18,800	2,156.00	40,532,800
三菱食品	14,300	2,559.00	36,593,700
松田産業	9,500	1,425.00	13,537,500
第一興商	19,400	4,670.00	90,598,000
メディパルホールディングス	140,500	2,312.00	324,836,000
S P K	2,800	2,362.00	6,613,600
萩原電気ホールディングス	4,800	2,763.00	13,262,400
アズワン	9,300	9,110.00	84,723,000
スズデン	4,500	1,300.00	5,850,000
尾家産業	4,200	1,128.00	4,737,600
シモジマ	8,000	1,041.00	8,328,000
ドウシシャ	12,300	1,749.00	21,512,700
小津産業	2,900	1,743.00	5,054,700
高速	7,800	1,211.00	9,445,800
たけびし	4,600	1,262.00	5,805,200
リックス	2,900	1,486.00	4,309,400
丸文	11,600	549.00	6,368,400
ハビネット	10,900	1,244.00	13,559,600
橋本総業ホールディングス	2,600	1,494.00	3,884,400
日本ライフライン	38,600	1,677.00	64,732,200
タカショー	6,400	453.00	2,899,200
エクセル	4,800	1,127.00	5,409,600
マルカ	4,600	1,893.00	8,707,800
I D O M	43,900	414.00	18,174,600
日本エム・ディ・エム	7,600	1,777.00	13,505,200
進和	7,700	2,050.00	15,785,000
エスケイジャパン	3,200	414.00	1,324,800
ダイトロン	5,700	1,216.00	6,931,200
シークス	16,600	1,404.00	23,306,400
田中商事	4,400	613.00	2,697,200

オーハシテクニカ	7,300	1,362.00	9,942,600
白銅	4,200	1,295.00	5,439,000
伊藤忠商事	910,700	2,133.50	1,942,978,450
丸紅	1,283,900	685.00	879,471,500
高島	2,100	1,537.00	3,227,700
長瀬産業	73,200	1,463.00	107,091,600
蝶理	8,300	1,622.00	13,462,600
豊田通商	145,300	3,395.00	493,293,500
三共生興	22,200	498.00	11,055,600
兼松	52,000	1,220.00	63,440,000
ツカモトコーポレーション	2,300	1,015.00	2,334,500
三井物産	1,072,700	1,706.00	1,830,026,200
日本紙パルプ商事	7,400	3,800.00	28,120,000
日立ハイテクノロジーズ	39,600	5,800.00	229,680,000
カメイ	17,000	1,030.00	17,510,000
東都水産	1,800	2,550.00	4,590,000
OUGホールディングス	2,100	2,689.00	5,646,900
スターゼン	4,800	4,015.00	19,272,000
山善	50,900	948.00	48,253,200
椿本興業	2,900	3,275.00	9,497,500
住友商事	770,000	1,625.00	1,251,250,000
内田洋行	5,600	3,700.00	20,720,000
三菱商事	913,600	2,644.00	2,415,558,400
第一実業	5,900	2,710.00	15,989,000
キャノンマーケティングジャパン	37,200	2,123.00	78,975,600
西華産業	7,400	1,266.00	9,368,400
佐藤商事	11,700	791.00	9,254,700
菱洋エレクトロ	13,200	1,803.00	23,799,600
東京産業	13,000	466.00	6,058,000
ユアサ商事	13,300	2,942.00	39,128,600
神鋼商事	2,900	2,227.00	6,458,300
小林産業	7,800	269.00	2,098,200
阪和興業	22,600	2,843.00	64,251,800
正栄食品工業	8,700	3,025.00	26,317,500
カナデン	11,800	1,257.00	14,832,600
菱電商事	10,300	1,608.00	16,562,400
フルサト工業	7,200	1,371.00	9,871,200
岩谷産業	28,900	3,550.00	102,595,000
すてきナイスグループ	5,600	624.00	3,494,400
昭光通商	4,400	616.00	2,710,400
二チモウ	2,000	1,778.00	3,556,000
極東貿易	4,000	1,676.00	6,704,000

イワキ	17,100	491.00	8,396,100
三愛石油	35,000	1,001.00	35,035,000
稲畑産業	31,300	1,287.00	40,283,100
G S I クレオス	3,500	1,004.00	3,514,000
明和産業	12,000	610.00	7,320,000
クワザワ	4,700	398.00	1,870,600
ワキタ	27,800	1,037.00	28,828,600
東邦ホールディングス	38,600	2,491.00	96,152,600
サンゲツ	38,500	2,011.00	77,423,500
ミツウロコグループホールディングス	17,300	948.00	16,400,400
シナネンホールディングス	5,400	1,714.00	9,255,600
伊藤忠エネクス	28,800	834.00	24,019,200
サンリオ	40,200	2,013.00	80,922,600
サンワテクノス	7,900	775.00	6,122,500
リョーサン	14,400	2,661.00	38,318,400
新光商事	12,300	1,889.00	23,234,700
トーヨー	5,900	1,728.00	10,195,200
三信電気	9,000	1,530.00	13,770,000
東陽テクニカ	15,000	1,047.00	15,705,000
モスフードサービス	17,100	2,359.00	40,338,900
加賀電子	13,000	1,649.00	21,437,000
ソーダニッカ	13,500	519.00	7,006,500
立花エレテック	9,600	1,525.00	14,640,000
フォーバル	5,700	940.00	5,358,000
P A L T A C	23,500	5,160.00	121,260,000
三谷産業	15,300	283.00	4,329,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,800	3,355.00	9,394,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,255.00	1,380,500
国際紙パルプ商事	30,500	301.00	9,180,500
ヤマタネ	6,500	1,292.00	8,398,000
丸紅建材リース	1,300	1,615.00	2,099,500
日鉄物産	9,300	4,090.00	38,037,000
泉州電業	4,100	2,580.00	10,578,000
トラスコ中山	27,100	2,398.00	64,985,800
オートバックスセブン	51,800	1,774.00	91,893,200
モリト	9,500	779.00	7,400,500
加藤産業	20,400	3,165.00	64,566,000
北恵	2,500	918.00	2,295,000
イノテック	7,800	882.00	6,879,600
イエローハット	24,600	1,558.00	38,326,800
J Kホールディングス	11,800	459.00	5,416,200
日伝	10,800	1,960.00	21,168,000

北沢産業	9,900	263.00	2,603,700
杉本商事	7,000	1,871.00	13,097,000
因幡電機産業	18,500	4,685.00	86,672,500
東テク	4,300	1,997.00	8,587,100
ミスミグループ本社	163,100	2,399.00	391,276,900
アルテック	10,400	200.00	2,080,000
タキヒヨー	4,000	1,757.00	7,028,000
蔵王産業	2,100	1,365.00	2,866,500
スズケン	59,400	5,740.00	340,956,000
ジェコス	9,000	835.00	7,515,000
グローセル	12,000	403.00	4,836,000
ローソン	33,000	5,300.00	174,900,000
サンエー	9,900	4,540.00	44,946,000
カワチ薬品	10,200	2,029.00	20,695,800
エービーシー・マート	20,300	6,750.00	137,025,000
ハードオフコーポレーション	5,400	710.00	3,834,000
アスクル	13,700	2,953.00	40,456,100
ゲオホールディングス	19,900	1,305.00	25,969,500
アダストリア	18,100	2,214.00	40,073,400
ジーフット	8,100	615.00	4,981,500
くら寿司	7,300	4,260.00	31,098,000
キャンドウ	6,300	1,621.00	10,212,300
パルグループホールディングス	6,700	3,325.00	22,277,500
エディオン	55,300	1,021.00	56,461,300
サーラコーポレーション	26,700	585.00	15,619,500
ワッツ	6,000	613.00	3,678,000
ハローズ	5,000	2,084.00	10,420,000
フジオフードシステム	5,500	2,774.00	15,257,000
あみやき亭	2,900	3,370.00	9,773,000
ひらまつ	26,400	342.00	9,028,800
大黒天物産	3,200	3,210.00	10,272,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,426.00	16,541,600
ファーマライズホールディングス	3,300	556.00	1,834,800
アルペン	10,100	1,581.00	15,968,100
ハブ	4,300	1,161.00	4,992,300
クオールホールディングス	19,300	1,406.00	27,135,800
ジズホールディングス	6,900	6,240.00	43,056,000
ビックカメラ	77,400	1,023.00	79,180,200
D C Mホールディングス	70,400	1,039.00	73,145,600
ペッパーフードサービス	10,400	1,548.00	16,099,200
MonotaRO	92,600	2,557.00	236,778,200
東京一番フーズ	3,500	608.00	2,128,000

D Dホールディングス	5,800	1,472.00	8,537,600
きちりホールディングス	3,700	724.00	2,678,800
アークランドサービスホールディングス	9,600	1,932.00	18,547,200
J . フロント リテイリング	166,700	1,197.00	199,539,900
ドトール・日レスホールディングス	22,900	2,020.00	46,258,000
マツモトキヨシホールディングス	53,900	3,950.00	212,905,000
ブロンコピリー	6,900	2,281.00	15,738,900
Z O Z O	140,800	2,041.00	287,372,800
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,243.00	4,847,700
物語コーポレーション	3,200	9,560.00	30,592,000
ココカラファイン	14,700	5,910.00	86,877,000
三越伊勢丹ホールディングス	243,800	802.00	195,527,600
H a m e e	4,200	757.00	3,179,400
ウエルシアホールディングス	34,400	5,470.00	188,168,000
クリエイトSDホールディングス	19,300	2,388.00	46,088,400
丸善CHIホールディングス	15,200	375.00	5,700,000
ティーライフ	1,900	833.00	1,582,700
エー・ピーカンパニー	2,700	521.00	1,406,700
チムニー	4,000	2,402.00	9,608,000
シュッピン	9,000	1,001.00	9,009,000
ネクステージ	20,800	1,101.00	22,900,800
ジョイフル本田	38,200	1,331.00	50,844,200
鳥貴族	4,400	2,131.00	9,376,400
麒麟堂ホールディングス	5,200	1,835.00	9,542,000
ホットランド	7,700	1,175.00	9,047,500
すかいらーくホールディングス	146,000	1,841.00	268,786,000
S F Pホールディングス	5,600	2,116.00	11,849,600
綿半ホールディングス	4,900	2,200.00	10,780,000
ヨシックス	2,200	3,295.00	7,249,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,000	945.00	35,910,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	678.00	4,203,600
B E E N O S	4,700	1,248.00	5,865,600
あさひ	10,900	1,225.00	13,352,500
日本調剤	4,600	3,780.00	17,388,000
コスモス薬品	5,800	21,790.00	126,382,000
トーエル	6,500	681.00	4,426,500
オンリー	2,400	788.00	1,891,200
セブン&アイ・ホールディングス	545,800	3,908.00	2,132,986,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,100	1,650.00	57,915,000
ツルハホールディングス	28,300	11,620.00	328,846,000
サンマルクホールディングス	10,300	2,429.00	25,018,700

フェリシモ	3,000	1,002.00	3,006,000
トリドールホールディングス	16,100	2,489.00	40,072,900
TOKYO BASE	11,900	881.00	10,483,900
ウイルプラスホールディングス	2,200	812.00	1,786,400
ジャパンミート	6,600	2,115.00	13,959,000
サツドラホールディングス	2,000	1,732.00	3,464,000
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	7,200	787.00	5,666,400
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,065.00	4,336,500
パロックジャパンリミテッド	10,700	1,011.00	10,817,700
クスリのアオキホールディングス	13,000	8,220.00	106,860,000
力の源ホールディングス	5,100	824.00	4,202,400
スシログローバルホールディングス	14,300	6,970.00	99,671,000
LIXILビバ	11,100	1,391.00	15,440,100
メディカルシステムネットワーク	14,100	512.00	7,219,200
はるやまホールディングス	6,300	775.00	4,882,500
ノジマ	23,200	1,775.00	41,180,000
カッパ・クリエイト	18,300	1,396.00	25,546,800
ライトオン	9,700	652.00	6,324,400
良品計画	184,500	1,925.00	355,162,500
三城ホールディングス	16,600	300.00	4,980,000
アドヴァン	20,000	1,150.00	23,000,000
アルビス	5,000	2,326.00	11,630,000
コナカ	15,700	427.00	6,703,900
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,590.00	2,703,000
G - 7ホールディングス	3,900	3,235.00	12,616,500
イオン北海道	13,300	731.00	9,722,300
コジマ	22,700	448.00	10,169,600
ヒマラヤ	4,700	793.00	3,727,100
コーナン商事	17,100	2,301.00	39,347,100
エコス	4,900	1,505.00	7,374,500
ワタミ	17,200	1,469.00	25,266,800
マルシェ	3,600	778.00	2,800,800
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	312,000	1,645.00	513,240,000
西松屋チェーン	28,700	903.00	25,916,100
ゼンショーホールディングス	63,300	2,400.00	151,920,000
幸楽苑ホールディングス	8,300	2,522.00	20,932,600
ハークスレイ	2,900	1,022.00	2,963,800
サイゼリヤ	21,500	2,691.00	57,856,500
V Tホールディングス	59,100	447.00	26,417,700
魚力	3,700	1,543.00	5,709,100
フジ・コーポレーション	3,500	2,148.00	7,518,000

ユナイテッドアローズ	14,900	3,425.00	51,032,500
ハイデイ日高	18,900	2,107.00	39,822,300
京都きもの友禅	8,700	340.00	2,958,000
コロワイド	43,300	2,075.00	89,847,500
ピーシーデポコーポレーション	17,600	459.00	8,078,400
壱番屋	9,200	5,150.00	47,380,000
P L A N T	3,500	675.00	2,362,500
スギホールディングス	28,600	5,600.00	160,160,000
薬王堂ホールディングス	5,700	2,439.00	13,902,300
スクロール	20,500	326.00	6,683,000
ヨンドシーホールディングス	14,500	2,538.00	36,801,000
ファミリーマート	145,700	2,498.00	363,958,600
木曽路	16,000	2,605.00	41,680,000
S R S ホールディングス	15,500	1,027.00	15,918,500
タカキュー	10,900	172.00	1,874,800
ケーヨー	24,400	473.00	11,541,200
上新電機	15,400	1,963.00	30,230,200
日本瓦斯	20,600	3,180.00	65,508,000
ロイヤルホールディングス	22,800	2,588.00	59,006,400
いなげや	14,600	1,516.00	22,133,600
島忠	27,600	2,558.00	70,600,800
チヨダ	13,800	1,539.00	21,238,200
ライフコーポレーション	9,900	2,078.00	20,572,200
リンガーハット	16,100	2,515.00	40,491,500
M r M a x H D	18,200	435.00	7,917,000
テンアライド	12,000	436.00	5,232,000
A O K I ホールディングス	26,200	1,051.00	27,536,200
オークワ	18,700	1,146.00	21,430,200
コメリ	20,200	2,165.00	43,733,000
青山商事	22,800	1,863.00	42,476,400
しまむら	15,200	8,250.00	125,400,000
はせがわ	7,300	401.00	2,927,300
高島屋	102,300	1,173.00	119,997,900
松屋	26,500	772.00	20,458,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,900	1,143.00	76,466,700
近鉄百貨店	5,000	3,000.00	15,000,000
パルコ	12,600	1,258.00	15,850,800
丸井グループ	110,200	2,131.00	234,836,200
アクシアル リテイリング	10,800	3,925.00	42,390,000
イオン	501,100	1,922.00	963,114,200
イズミ	26,500	4,020.00	106,530,000
平和堂	26,500	1,990.00	52,735,000

フジ	15,800	1,810.00	28,598,000
ヤオコー	14,800	4,675.00	69,190,000
ゼビオホールディングス	15,900	1,133.00	18,014,700
ケーズホールディングス	135,400	1,127.00	152,595,800
Olympicグループ	7,900	605.00	4,779,500
日産東京販売ホールディングス	19,700	276.00	5,437,200
Genky DrugStores	6,400	2,071.00	13,254,400
総合メディカルホールディングス	11,400	1,479.00	16,860,600
ブックオフグループホールディングス	6,700	1,143.00	7,658,100
アインホールディングス	17,500	5,830.00	102,025,000
元気寿司	3,700	2,792.00	10,330,400
ヤマダ電機	397,000	492.00	195,324,000
アークランドサカモト	22,200	1,258.00	27,927,600
ニトリホールディングス	56,400	15,030.00	847,692,000
グルメ杵屋	9,400	1,174.00	11,035,600
愛眼	10,400	239.00	2,485,600
ケーユーホールディングス	7,000	803.00	5,621,000
吉野家ホールディングス	45,500	2,334.00	106,197,000
松屋フーズホールディングス	6,300	3,860.00	24,318,000
サガミホールディングス	17,500	1,345.00	23,537,500
関西スーパーマーケット	10,000	1,119.00	11,190,000
王将フードサービス	9,600	7,200.00	69,120,000
プレナス	14,700	1,737.00	25,533,900
ミニストップ	9,800	1,383.00	13,553,400
アークス	24,500	2,173.00	53,238,500
パローホールディングス	28,200	1,797.00	50,675,400
ベルク	6,500	5,070.00	32,955,000
大庄	7,100	1,565.00	11,111,500
ファーストリテイリング	17,400	63,990.00	1,113,426,000
サンドラッグ	49,000	3,270.00	160,230,000
サックスパーホールディングス	11,200	890.00	9,968,000
ヤマザワ	2,800	1,617.00	4,527,600
やまや	2,300	2,272.00	5,225,600
ベルーナ	32,200	688.00	22,153,600
島根銀行	4,100	603.00	2,472,300
じもとホールディングス	88,100	92.00	8,105,200
めぶきフィナンシャルグループ	680,900	240.00	163,416,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,300	1,295.00	23,698,500
九州フィナンシャルグループ	216,000	400.00	86,400,000
ゆうちょ銀行	370,200	993.00	367,608,600
富山第一銀行	34,100	265.00	9,036,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	820,200	375.00	307,575,000

西日本フィナンシャルホールディングス	83,300	653.00	54,394,900
関西みらいフィナンシャルグループ	62,400	676.00	42,182,400
三十三フィナンシャルグループ	11,800	1,478.00	17,440,400
第四北越フィナンシャルグループ	23,000	2,480.00	57,040,000
新生銀行	95,700	1,432.00	137,042,400
あおぞら銀行	72,800	2,443.00	177,850,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,975,200	515.80	4,629,408,160
りそなホールディングス	1,430,800	421.00	602,366,800
三井住友トラスト・ホールディングス	256,400	3,540.00	907,656,000
三井住友フィナンシャルグループ	918,900	3,511.00	3,226,257,900
千葉銀行	450,000	538.00	242,100,000
群馬銀行	263,200	340.00	89,488,000
武蔵野銀行	19,900	1,762.00	35,063,800
千葉興業銀行	38,700	285.00	11,029,500
筑波銀行	54,200	151.00	8,184,200
七十七銀行	41,500	1,390.00	57,685,000
青森銀行	10,400	2,473.00	25,719,200
秋田銀行	8,800	1,880.00	16,544,000
山形銀行	15,200	1,418.00	21,553,600
岩手銀行	9,400	2,293.00	21,554,200
東邦銀行	116,600	238.00	27,750,800
東北銀行	6,600	929.00	6,131,400
みちのく銀行	8,400	1,561.00	13,112,400
ふくおかフィナンシャルグループ	115,300	1,835.00	211,575,500
静岡銀行	324,000	729.00	236,196,000
十六銀行	17,900	2,156.00	38,592,400
八十二銀行	316,800	397.00	125,769,600
山梨中央銀行	16,600	931.00	15,454,600
大垣共立銀行	27,800	2,208.00	61,382,400
福井銀行	11,800	1,239.00	14,620,200
北國銀行	13,800	2,385.00	32,913,000
清水銀行	5,900	1,808.00	10,667,200
富山銀行	2,900	2,231.00	6,469,900
滋賀銀行	26,500	2,285.00	60,552,500
南都銀行	20,700	2,218.00	45,912,600
百五銀行	119,900	318.00	38,128,200
京都銀行	46,900	3,835.00	179,861,500
紀陽銀行	46,700	1,463.00	68,322,100
ほくほくフィナンシャルグループ	87,600	958.00	83,920,800
広島銀行	194,200	482.00	93,604,400
山陰合同銀行	78,700	594.00	46,747,800
中国銀行	113,100	881.00	99,641,100

鳥取銀行	5,100	1,319.00	6,726,900
伊予銀行	174,400	497.00	86,676,800
百十四銀行	14,300	1,959.00	28,013,700
四国銀行	19,400	898.00	17,421,200
阿波銀行	20,300	2,228.00	45,228,400
大分銀行	8,300	2,868.00	23,804,400
宮崎銀行	9,000	2,267.00	20,403,000
佐賀銀行	8,500	1,356.00	11,526,000
沖縄銀行	12,200	3,045.00	37,149,000
琉球銀行	30,900	1,034.00	31,950,600
セブン銀行	443,500	280.00	124,180,000
みずほフィナンシャルグループ	17,716,700	157.40	2,788,608,580
高知銀行	4,700	721.00	3,388,700
山口フィナンシャルグループ	164,000	679.00	111,356,000
長野銀行	4,800	1,549.00	7,435,200
名古屋銀行	10,800	2,936.00	31,708,800
北洋銀行	200,500	212.00	42,506,000
愛知銀行	5,000	3,345.00	16,725,000
中京銀行	5,700	2,133.00	12,158,100
大光銀行	5,000	1,582.00	7,910,000
愛媛銀行	18,900	1,091.00	20,619,900
トマト銀行	5,900	1,004.00	5,923,600
京葉銀行	57,000	593.00	33,801,000
栃木銀行	72,600	162.00	11,761,200
北日本銀行	4,600	1,650.00	7,590,000
東和銀行	22,900	693.00	15,869,700
福島銀行	11,300	186.00	2,101,800
大東銀行	6,300	540.00	3,402,000
トモニホールディングス	103,400	319.00	32,984,600
フィデアホールディングス	126,600	112.00	14,179,200
池田泉州ホールディングス	143,100	176.00	25,185,600
F P G	41,100	1,059.00	43,524,900
マーキュリアインベストメント	6,000	717.00	4,302,000
S B Iホールディングス	155,400	2,215.00	344,211,000
ジャフコ	21,400	3,815.00	81,641,000
大和証券グループ本社	1,046,500	470.10	491,959,650
野村ホールディングス	2,294,500	443.80	1,018,299,100
岡三証券グループ	111,500	351.00	39,136,500
丸三証券	39,000	488.00	19,032,000
東洋証券	47,800	147.00	7,026,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,000	290.00	45,240,000
光世証券	3,400	547.00	1,859,800

水戸証券	38,500	197.00	7,584,500
いちよし証券	26,400	634.00	16,737,600
松井証券	64,000	884.00	56,576,000
だいこう証券ビジネス	5,600	538.00	3,012,800
マネックスグループ	120,700	312.00	37,658,400
極東証券	17,700	804.00	14,230,800
岩井コスモホールディングス	13,500	1,071.00	14,458,500
藍澤証券	23,600	691.00	16,307,600
マネーパートナーズグループ	15,800	267.00	4,218,600
スパークス・グループ	52,200	242.00	12,632,400
かんぽ生命保険	46,200	1,531.00	70,732,200
S O M P Oホールディングス	229,800	4,366.00	1,003,306,800
アニコム ホールディングス	10,800	3,920.00	42,336,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	340,900	3,387.00	1,154,628,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	107,100	2,296.00	245,901,600
第一生命ホールディングス	737,700	1,482.00	1,093,271,400
東京海上ホールディングス	466,200	5,504.00	2,565,964,800
T & Dホールディングス	403,200	1,069.00	431,020,800
アドバンスクリエイト	3,000	1,803.00	5,409,000
全国保証	36,700	3,995.00	146,616,500
ジェイリース	3,600	311.00	1,119,600
イントラスト	3,600	669.00	2,408,400
日本モーゲージサービス	2,300	1,062.00	2,442,600
C a s a	5,900	1,227.00	7,239,300
アルヒ	11,800	2,191.00	25,853,800
プレミアグループ	7,500	1,812.00	13,590,000
クレディセゾン	91,300	1,167.00	106,547,100
芙蓉総合リース	14,900	6,180.00	92,082,000
興銀リース	24,500	2,746.00	67,277,000
東京センチュリー	26,300	4,335.00	114,010,500
日本証券金融	57,500	500.00	28,750,000
アイフル	198,900	224.00	44,553,600
リコーリース	10,300	3,310.00	34,093,000
イオンフィナンシャルサービス	83,300	1,572.00	130,947,600
アコム	262,100	378.00	99,073,800
ジャックス	14,400	2,176.00	31,334,400
オリエントコーポレーション	352,700	142.00	50,083,400
日立キャピタル	30,700	2,133.00	65,483,100
アプラスフィナンシャル	62,600	70.00	4,382,000
オリックス	869,800	1,611.50	1,401,682,700
三菱UFJリース	294,100	588.00	172,930,800
九州リースサービス	6,400	584.00	3,737,600

日本取引所グループ	352,200	1,753.00	617,406,600
イー・ギャランティ	12,200	1,313.00	16,018,600
アサックス	5,400	589.00	3,180,600
NECキャピタルソリューション	5,300	2,071.00	10,976,300
いちご	168,400	441.00	74,264,400
日本駐車場開発	149,400	170.00	25,398,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,878.00	13,709,400
ヒューリック	279,437	1,044.00	291,732,228
三栄建築設計	6,000	1,446.00	8,676,000
野村不動産ホールディングス	87,400	2,282.00	199,446,800
三重交通グループホールディングス	28,500	532.00	15,162,000
サムティ	19,100	1,832.00	34,991,200
ディア・ライフ	18,800	513.00	9,644,400
コーセーアールイー	5,500	672.00	3,696,000
エー・ディー・ワークス	401,600	34.00	13,654,400
日本商業開発	8,900	1,468.00	13,065,200
プレサンスコーポレーション	21,400	1,605.00	34,347,000
ユニゾホールディングス	18,800	4,310.00	81,028,000
日本管理センター	9,400	1,393.00	13,094,200
サンセイランディック	5,200	808.00	4,201,600
エストラスト	1,800	718.00	1,292,400
フージャースホールディングス	28,300	618.00	17,489,400
オープンハウス	19,100	5,220.00	99,702,000
東急不動産ホールディングス	352,300	656.00	231,108,800
飯田グループホールディングス	109,400	1,688.00	184,667,200
イーランド	3,500	684.00	2,394,000
ムゲンエステート	10,800	612.00	6,609,600
ハウスドゥ	7,200	1,576.00	11,347,200
シーアールイー	4,200	1,053.00	4,422,600
ケイアイスター不動産	4,100	1,954.00	8,011,400
グッドコムアセット	3,700	1,644.00	6,082,800
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,155.00	6,648,000
テンポイノベーション	2,100	1,575.00	3,307,500
パーク24	70,400	2,232.00	157,132,800
パラカ	3,900	2,075.00	8,092,500
三井不動産	692,200	2,582.00	1,787,260,400
三菱地所	914,000	2,055.50	1,878,727,000
平和不動産	24,400	2,555.00	62,342,000
東京建物	143,300	1,427.00	204,489,100
ダイビル	39,400	1,050.00	41,370,000
京阪神ビルディング	23,700	1,240.00	29,388,000
住友不動産	293,400	3,958.00	1,161,277,200

テーオーシー	31,200	824.00	25,708,800
東京楽天地	2,100	5,480.00	11,508,000
スターツコーポレーション	18,200	2,425.00	44,135,000
フジ住宅	18,300	675.00	12,352,500
空港施設	17,300	519.00	8,978,700
明和地所	9,200	533.00	4,903,600
ゴールドクレスト	10,800	2,098.00	22,658,400
日本エスリード	5,800	1,590.00	9,222,000
日神不動産	21,700	451.00	9,786,700
日本エスコン	25,000	757.00	18,925,000
タカラレーベン	62,300	403.00	25,106,900
サンヨーハウジング名古屋	8,500	852.00	7,242,000
イオンモール	66,000	1,706.00	112,596,000
毎日コムネット	4,300	719.00	3,091,700
ファースト住建	6,500	1,219.00	7,923,500
カチタス	14,800	4,145.00	61,346,000
トーセイ	18,800	1,273.00	23,932,400
穴吹興産	1,800	2,779.00	5,002,200
サンフロンティア不動産	18,900	1,235.00	23,341,500
エフ・ジェー・ネクスト	12,400	1,029.00	12,759,600
インテリックス	5,200	719.00	3,738,800
ランドビジネス	5,500	765.00	4,207,500
日本社宅サービス	4,400	980.00	4,312,000
グランディハウス	13,900	448.00	6,227,200
日本空港ビルデング	41,900	4,280.00	179,332,000
日本工営	8,600	2,780.00	23,908,000
LIFULL	44,300	651.00	28,839,300
ジェイエイシーリクルートメント	9,800	1,930.00	18,914,000
日本M&Aセンター	95,400	3,120.00	297,648,000
メンバーズ	4,300	1,861.00	8,002,300
中広	1,600	601.00	961,600
アイティメディア	2,800	655.00	1,834,000
タケエイ	13,300	961.00	12,781,300
E・Jホールディングス	1,700	1,204.00	2,046,800
トラスト・テック	14,100	1,211.00	17,075,100
コシダカホールディングス	30,500	1,721.00	52,490,500
アルトナー	3,300	688.00	2,270,400
パソナグループ	15,500	1,479.00	22,924,500
CDS	3,300	1,285.00	4,240,500
リンクアンドモチベーション	28,200	593.00	16,722,600
GCA	15,100	707.00	10,675,700
エス・エム・エス	46,500	2,553.00	118,714,500

サニーサイドアップ	3,000	965.00	2,895,000
パーソルホールディングス	126,400	2,121.00	268,094,400
リニカル	7,300	1,015.00	7,409,500
クックパッド	44,700	293.00	13,097,100
エスクリ	3,600	828.00	2,980,800
アイ・ケイ・ケイ	6,400	690.00	4,416,000
学情	5,000	1,193.00	5,965,000
スタジオアリス	6,400	1,903.00	12,179,200
シミックホールディングス	7,100	1,697.00	12,048,700
N J S	2,900	1,552.00	4,500,800
総合警備保障	50,300	5,350.00	269,105,000
カカクコム	94,600	2,464.00	233,094,400
アイロムグループ	4,800	1,645.00	7,896,000
セントケア・ホールディング	9,500	501.00	4,759,500
サイネックス	2,400	626.00	1,502,400
ルネサンス	7,100	1,585.00	11,253,500
ディップ	20,400	2,498.00	50,959,200
オプトホールディング	7,500	1,536.00	11,520,000
ツクイ	30,100	434.00	13,063,400
キャリアデザインセンター	3,300	1,296.00	4,276,800
ベネフィット・ワン	35,100	1,815.00	63,706,500
エムスリー	266,000	2,455.00	653,030,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	576.00	4,780,800
プラス	1,700	615.00	1,045,500
アウトソーシング	72,400	964.00	69,793,600
ウェルネット	12,200	711.00	8,674,200
ワールドホールディングス	4,300	1,516.00	6,518,800
ディー・エヌ・エー	68,200	2,054.00	140,082,800
博報堂D Yホールディングス	175,700	1,556.00	273,389,200
ぐるなび	18,200	692.00	12,594,400
タカミヤ	13,300	644.00	8,565,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,500	1,183.00	10,055,500
ファンコミュニケーションズ	35,000	534.00	18,690,000
ライク	5,100	1,886.00	9,618,600
ビジネス・ブレークスルー	5,700	359.00	2,046,300
エスプール	4,900	2,970.00	14,553,000
W D Bホールディングス	5,800	2,473.00	14,343,400
ティア	7,600	622.00	4,727,200
C D G	1,300	1,414.00	1,838,200
バリューコマース	8,200	1,728.00	14,169,600
インフォマート	69,300	1,616.00	111,988,800
J Pホールディングス	36,700	274.00	10,055,800

エコナックホールディングス	24,100	126.00	3,036,600	
E P S ホールディングス	19,100	1,310.00	25,021,000	
レッグス	3,200	1,804.00	5,772,800	
プレステージ・インターナショナル	23,700	1,887.00	44,721,900	
アミューズ	7,700	2,649.00	20,397,300	
ドリームインキュベータ	4,000	1,271.00	5,084,000	
クイック	8,000	1,285.00	10,280,000	
T A C	7,700	194.00	1,493,800	
ケネディクス	120,500	530.00	63,865,000	
電通	130,300	3,645.00	474,943,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,117.00	5,585,000	
ぴあ	3,600	4,190.00	15,084,000	
イオンファンタジー	4,100	2,789.00	11,434,900	
シーティーエス	14,500	722.00	10,469,000	
ネクシィーズグループ	4,500	1,855.00	8,347,500	
みらかホールディングス	35,400	2,428.00	85,951,200	
アルプス技研	11,700	1,499.00	17,538,300	
ダイオーズ	3,000	1,409.00	4,227,000	
日本空調サービス	14,600	698.00	10,190,800	
オリエンタルランド	149,300	15,895.00	2,373,123,500	
ダスキン	32,500	2,762.00	89,765,000	
明光ネットワークジャパン	15,000	897.00	13,455,000	
ファルコホールディングス	7,000	1,622.00	11,354,000	
ラウンドワン	39,300	1,670.00	65,631,000	
リゾートトラスト	53,500	1,629.00	87,151,500	
ビー・エム・エル	16,300	3,010.00	49,063,000	
ワタベウェディング	2,300	562.00	1,292,600	
りらいあコミュニケーションズ	22,900	1,352.00	30,960,800	
リソー教育	64,500	468.00	30,186,000	
早稲田アカデミー	3,800	807.00	3,066,600	
ユー・エス・エス	154,400	2,007.00	309,880,800	
東京個別指導学院	4,600	925.00	4,255,000	
サイバーエージェント	72,700	4,460.00	324,242,000	
楽天	588,900	1,038.00	611,278,200	
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,134.00	8,618,400	
テー・オー・ダブリュー	11,300	722.00	8,158,600	
山田コンサルティンググループ	6,200	1,612.00	9,994,400	
セントラルスポーツ	4,800	3,060.00	14,688,000	
フルキャストホールディングス	12,700	1,997.00	25,361,900	
エン・ジャパン	18,400	3,770.00	69,368,000	
リソルホールディングス	1,400	3,900.00	5,460,000	
テクノプロ・ホールディングス	25,400	6,040.00	153,416,000	

アトラ	3,600	533.00	1,918,800
インターワークス	2,700	555.00	1,498,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	3,890.00	20,228,000
K e e P e r 技研	4,800	1,408.00	6,758,400
ファーストロジック	3,200	640.00	2,048,000
三機サービス	2,800	892.00	2,497,600
G u n o s y	8,900	1,403.00	12,486,700
デザインワン・ジャパン	3,100	284.00	880,400
イー・ガーディアン	6,500	1,704.00	11,076,000
リブセンス	8,700	256.00	2,227,200
ジャパンマテリアル	34,700	1,193.00	41,397,100
ベクトル	15,900	999.00	15,884,100
ウチヤマホールディングス	6,600	484.00	3,194,400
チャーム・ケア・コーポレーション	4,100	2,003.00	8,212,300
ライクキッズネクスト	3,200	923.00	2,953,600
キャリアリンク	4,900	565.00	2,768,500
I B J	8,600	1,167.00	10,036,200
アサンテ	5,100	1,966.00	10,026,600
N・フィールド	8,900	613.00	5,455,700
バリューHR	2,700	2,867.00	7,740,900
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	6,470.00	29,115,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,538.00	8,151,400
E R Iホールディングス	3,800	770.00	2,926,000
アビスト	2,000	2,504.00	5,008,000
シグマクシス	6,200	1,236.00	7,663,200
ウィルグループ	8,400	834.00	7,005,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,100	225.00	4,072,500
リクルートホールディングス	904,900	3,220.00	2,913,778,000
エラン	8,400	1,757.00	14,758,800
土木管理総合試験所	5,900	418.00	2,466,200
ネットマーケティング	4,700	761.00	3,576,700
日本郵政	1,035,500	962.00	996,151,000
ベルシステム24ホールディングス	21,300	1,599.00	34,058,700
鎌倉新書	9,400	1,693.00	15,914,200
ソネット・メディア・ネットワークス	1,900	610.00	1,159,000
一蔵	1,600	574.00	918,400
L I T A L I C O	3,000	1,917.00	5,751,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	839.00	1,761,900
エボラブルアジア	5,700	2,040.00	11,628,000
アトラエ	3,300	2,572.00	8,487,600
ストライク	4,800	2,815.00	13,512,000
ソラスト	31,000	1,292.00	40,052,000

セラク	4,200	730.00	3,066,000
インソース	6,225	2,518.00	15,674,550
ベikalレント・コンサルティング	9,000	4,605.00	41,445,000
Orchestra Holdings	2,600	1,115.00	2,899,000
アイモバイル	4,200	743.00	3,120,600
キャリアインデックス	4,700	449.00	2,110,300
MS - Japan	5,200	1,346.00	6,999,200
船場	2,200	901.00	1,982,200
グレイステクノロジー	4,600	2,954.00	13,588,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,000	2,661.00	26,610,000
フルテック	1,900	1,229.00	2,335,100
グリーズ	4,900	1,345.00	6,590,500
ツナググループ・ホールディングス	1,800	575.00	1,035,000
ソウルドアウト	2,000	1,405.00	2,810,000
MS & Consulting	2,200	900.00	1,980,000
日総工産	8,500	1,012.00	8,602,000
キュービーネットホールディングス	7,800	2,195.00	17,121,000
RPAホールディングス	5,400	1,632.00	8,812,800
スプリックス	4,300	1,497.00	6,437,100
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	797.00	4,144,400
リログループ	69,100	2,646.00	182,838,600
東祥	7,900	2,295.00	18,130,500
エイチ・アイ・エス	19,700	2,628.00	51,771,600
ラックランド	2,600	2,251.00	5,852,600
共立メンテナンス	19,400	4,165.00	80,801,000
イチネンホールディングス	13,300	1,051.00	13,978,300
建設技術研究所	8,800	1,533.00	13,490,400
スペース	8,300	1,185.00	9,835,500
長大	4,800	890.00	4,272,000
燦ホールディングス	2,800	2,080.00	5,824,000
スバル興業	900	6,190.00	5,571,000
東京テアトル	5,100	1,354.00	6,905,400
タナベ経営	2,600	1,255.00	3,263,000
ナガワ	3,600	5,120.00	18,432,000
よみうりランド	2,800	4,505.00	12,614,000
東京都競馬	8,300	3,165.00	26,269,500
カナモト	20,700	2,649.00	54,834,300
東京ドーム	47,400	981.00	46,499,400
西尾レントオール	12,900	2,782.00	35,887,800
トランス・コスモス	14,100	2,520.00	35,532,000
乃村工藝社	59,200	1,350.00	79,920,000
藤田観光	5,600	2,675.00	14,980,000

KNT-CTホールディングス	6,700	1,435.00	9,614,500	
日本管財	13,600	1,874.00	25,486,400	
トーカイ	12,300	2,273.00	27,957,900	
白洋舎	1,500	2,793.00	4,189,500	
セコム	134,100	9,129.00	1,224,198,900	
セントラル警備保障	6,100	5,280.00	32,208,000	
丹青社	24,000	1,284.00	30,816,000	
メイテック	15,700	5,330.00	83,681,000	
応用地質	13,700	1,064.00	14,576,800	
船井総研ホールディングス	26,200	2,343.00	61,386,600	
進学会ホールディングス	6,100	445.00	2,714,500	
オオバ	10,200	603.00	6,150,600	
いであ	2,500	1,107.00	2,767,500	
学究社	4,300	1,215.00	5,224,500	
ベネッセホールディングス	46,300	2,729.00	126,352,700	
イオンディライト	15,600	3,260.00	50,856,000	
ナック	8,200	950.00	7,790,000	
ニチイ学館	18,100	1,663.00	30,100,300	
ダイセキ	21,200	2,602.00	55,162,400	
ステップ	4,700	1,401.00	6,584,700	
合 計	154,982,562		290,428,937,158	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,392,770,712

	2019年 9月 5日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,330,138,022
国債証券	384,675,293,358
派生商品評価勘定	7,346,180
未収入金	6,705,855,525
未収利息	2,103,578,948
前払金	1,015,382
前払費用	212,985,622
差入委託証拠金	298,960,819
流動資産合計	399,727,944,568
資産合計	399,727,944,568
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,291,455
未払金	10,702,561,786
未払解約金	91,773,881
未払利息	2,965
その他未払費用	9
流動負債合計	10,797,630,096
負債合計	10,797,630,096
純資産の部	
元本等	
元本	138,627,060,591
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	250,303,253,881
元本等合計	388,930,314,472
純資産合計	388,930,314,472
負債純資産合計	399,727,944,568

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

2019年 9月 5日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,627,060,591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 2.8056円 (1万口当たり純資産額) (28,056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 9月 5日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年 9月 5日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	94,658,753,152円
期中追加設定元本額	59,949,195,117円
期中一部解約元本額	15,980,887,678円
期末元本額	138,627,060,591円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,764,597,746円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	711,599,059円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,023,539,780円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,859,628円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,166,341,733円
世界経済インデックスファンド	6,726,827,958円
D C マイセレクション 2 5	1,697,496,655円
D C マイセレクション 5 0	1,289,980,276円
D C マイセレクション 7 5	819,756,725円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,894,072,377円
D C マイセレクション S 2 5	683,659,837円
D C マイセレクション S 5 0	527,654,268円
D C マイセレクション S 7 5	235,386,434円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	47,884,484円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	65,985,909円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	31,318,274円
D C 世界経済インデックスファンド	5,844,713,169円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	625,535,476円

区分	2019年 9月 5日現在
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	41,983,279円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,776,276円
マイセクション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）	49,493,986円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	95,189,151円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	171,996,968円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	154,919,096円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	396,875,923円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,128,873,978円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	606,209,905円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,152,961,383円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	838,291,167円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	84,877,252円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	613,258,333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）	235,246,077円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	295,235,484円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	971,537,122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）	2,059,154,239円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	838,905,195円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,061,931円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,378,191,685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	1,534,924,838円
分散投資コア戦略ファンドS	3,712,943,090円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	269,157,677円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,698,989,116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）	234,986,905円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	113,100,026円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,054,583,236円
SMT インデックスバランス・オープン	234,235,380円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	24,502,014,108円
SMT 世界経済インデックス・オープン	71,358,713円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	95,343,758円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	133,489,028円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,338,033円
グローバル経済コア	986,715,532円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,005,969円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	84,685円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	207,518,790円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,767,871円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	16,800円

区分	2019年 9月 5日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	837,622,455円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,585,763,242円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	351,143,013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）	40,423,990,733円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		18,910,235,000
合計		18,910,235,000

(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 9月 5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	3,735,122,876	-	3,734,107,494	1,015,382
	合計	3,735,122,876	-	3,734,107,494	1,015,382

(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 9月 5日現在）

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

市場取引以外の取引	買建	4,714,538,802	-	4,719,628,293	5,089,491
	アメリカドル	2,346,248,281	-	2,349,271,500	3,023,219
	カナダドル	193,197,888	-	193,739,900	542,012
	ユーロ	1,836,500,518	-	1,837,153,500	652,982
	イギリスポンド	315,641,700	-	316,361,700	720,000
	マレーシアリンギット	22,950,415	-	23,101,693	151,278
	売建	112,768,947	-	112,788,331	19,384
	アメリカドル	69,807,977	-	69,794,855	13,122
	シンガポールドル	8,921,610	-	8,996,789	75,179
	南アフリカランド	34,039,360	-	33,996,687	42,673
合計	4,827,307,749	-	4,832,416,624	5,070,107	

(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	6,458,740.21	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,737,027.35	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,967,773.45	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,782,390.63	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,483,867.20	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,534,537.09	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,961,328.10	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,967,558.58	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,476,992.23	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,683,757.85	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,006,445.30	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,504,199.22	
		T 1.375% 09/30/20	15,970,000.00	15,916,974.64	

T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	8,013,437.52	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,980,195.32	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,511,777.35	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,842,656.25	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,022,656.24	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,296,937.50	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,220,550.76	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,535,410.16	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,397,280.51	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,052,148.45	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,519,921.87	
T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,117,187.50	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,496,337.90	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,105,820.29	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,257,261.77	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,049,285.17	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,651,748.02	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,522,656.25	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,641,396.46	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,311,562.52	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,837,851.57	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,759,765.62	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,646,992.18	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,077,382.83	
T 1.75% 06/30/24	12,600,000.00	12,851,015.68	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,464,126.52	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,272,117.18	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,207,906.29	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,159,935.58	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,214,093.75	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,133,593.72	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,529,394.52	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,568,105.45	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,584,707.08	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,130,429.71	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,060,937.52	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,889,779.33	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,454,632.82	
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,031,640.60	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,022,089.84	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,412,812.50	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,660,156.25	

T 2.125% 05/15/22	10,000,000.00	10,197,265.60
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,502,031.28
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,586,425.80
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,145,199.22
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,980,750.00
T 2.125% 08/15/21	14,950,000.00	15,140,378.97
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,525,898.47
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,444,441.43
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,309,375.04
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	13,090,614.03
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,804,238.23
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,454,662.50
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,156,250.00
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,408,650.00
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,491,894.57
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,082,942.37
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,221,875.00
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,540,878.91
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,624,023.40
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,044,296.89
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,089,050.82
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	20,395,500.09
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,585,468.75
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,612,697.29
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,627,906.27
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,587,371.16
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,940,234.37
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,791,125.00
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,510,937.50
T 2.375% 03/15/21	10,000,000.00	10,123,437.50
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,652,285.18
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,514,781.25
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	20,084,472.74
T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	19,488,789.91
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,121,093.75
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,109,355.51
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,379,687.50
T 2.5% 01/31/21	10,000,000.00	10,124,609.40
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,613,031.25
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,300,195.30
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,006,273.41
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	8,126,953.12
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	18,385,898.52

T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,213,582.05	
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	3,053,949.22	
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	17,838,750.08	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,753,505.84	
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,115,039.10	
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	19,364,765.58	
T 2.625% 02/15/29	15,000,000.00	16,538,671.95	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,460,867.18	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,742,207.06	
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,774,655.49	
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,496,437.50	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,420,009.77	
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,126,972.67	
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	12,119,921.87	
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,953,152.30	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,182,812.50	
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,491,187.55	
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,979,109.35	
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	21,020,312.60	
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,310,058.62	
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,319,218.78	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,270,273.41	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,476,484.39	
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	11,659,378.95	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,445,531.25	
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,223,574.19	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,296,750.00	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,866,421.89	
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	10,613,953.12	
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,823,046.90	
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,934,436.00	
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	13,614,921.87	
T 2.875% 05/15/49	3,800,000.00	4,588,500.00	
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,616,156.25	
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,265,947.63	
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,821,693.82	
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,983,773.49	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,038,710.93	
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,614,628.96	
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,178,496.11	
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,680,195.34	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,609,632.81	

T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,537,109.37
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,266,718.72
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,688,421.89
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,025,859.36
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,302,343.80
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,832,359.39
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,250,000.00
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,828,125.00
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,055,781.25
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,742,511.68
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,874,109.39
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,016,113.30
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,718,197.25
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,430,375.00
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,647,164.11
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,523,955.08
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,041,093.76
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,229,562.50
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,888,113.29
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	6,154,296.90
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,442,437.50
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,911,718.75
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	14,849,062.56
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	16,464,375.07
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,990,136.73
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	8,501,596.12
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,941,085.97
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	5,057,725.80
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,426,062.50
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	10,008,984.37
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,661,718.76
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,682,031.26
T 3.75% 11/15/43	8,500,000.00	11,539,414.10
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,282,277.35
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,467,937.50
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	18,483,271.87
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,556,363.29
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,257,695.33
T 3% 05/15/47	12,750,000.00	15,629,707.09
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	14,715,304.68
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,415,625.00
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,955,078.10
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	7,341,769.56

T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,272,796.87	
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	6,205,886.74	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,422,343.75	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,746,539.07	
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,853,265.62	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,889,265.62	
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,418,000.00	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,313,625.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,482,132.82	
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,937,171.87	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,484,460.93	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,661,687.50	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,670,214.85	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,725,953.12	
T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,647,585.95	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,608,843.75	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,184,234.37	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,978,796.87	
T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,797,156.25	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,961,373.05	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,939,128.90	
アメリカドル 小計	1,615,290,000.00	1,728,652,281.07 (183,963,175,751)	
カナダドル			
CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,039,751.50	
CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,634,010.40	
CAN 0.75% 09/01/20	5,320,000.00	5,279,115.80	
CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,669,706.00	
CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	464,862.20	
CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,234,304.00	
CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,356,315.50	
CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	610,257.00	
CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,070,920.00	
CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,716,767.00	
CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,952,890.55	
CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,488,720.00	
CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,407,490.50	
CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	4,034,118.00	
CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,155,495.20	
CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,248,434.80	
CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,106,129.95	
CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,796,708.65	
CAN 2.75% 12/01/64	1,190,000.00	1,735,918.45	

	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,296,765.70
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,175,230.65
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,122,332.95
	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,098,580.00
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,811,145.25
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,850,794.35
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	4,052,111.70
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,084,882.85
	CAN 5.75% 06/01/33	2,070,000.00	3,244,393.80
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,647,538.80
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,788,912.00
	カナダドル 小計	81,940,000.00	92,174,603.55 (7,413,603,363)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,485,057.25
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,270,997.20
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	35,843,095.35
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,282,735.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	63,590,000.00	63,169,988.05
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,381,451.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	55,925,682.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,493,528.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,520,834.65
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,731,635.60
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,240,000.00	43,543,843.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	27,055,880.35
	MBONO 8% 09/05/24	18,970,000.00	19,888,148.00
	MBONO 8% 11/07/47	18,970,000.00	20,322,940.40
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,643,392.50
	メキシコペソ 小計	524,610,000.00	549,559,209.95 (2,973,115,325)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,287,395.00
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,407,062.60
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,359,997.00
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,427,017.85
	BGB 0.8% 06/22/28	3,910,000.00	4,332,631.90
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,290,899.60
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,006,510.50
	BGB 1.45% 06/22/37	980,000.00	1,205,939.00
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,942,226.20
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,661,368.75
	BGB 1.9% 06/22/38	1,330,000.00	1,756,078.80
	BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,244,564.80
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,703,800.10

BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,526,275.00
BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,971,406.20
BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,207,728.00
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,832,486.20
BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,939,048.00
BGB 3.75% 09/28/20	3,270,000.00	3,426,682.05
BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,223,073.70
BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	6,189,358.85
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,597,760.50
BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,808,059.85
BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,245,328.90
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,487,484.50
BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,420,686.40
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,224,515.80
BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,364,094.40
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,999,856.40
BTPS 0.05% 04/15/21	7,190,000.00	7,237,274.25
BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,399,347.75
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,614,301.10
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,418,403.00
BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,296,893.60
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,569,134.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,272,013.30
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,610,355.00
BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,706,765.00
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,500,655.75
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,053,545.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	3,012,882.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,440,748.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,098,310.50
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,379,560.00
BTPS 1.5% 06/01/25	4,210,000.00	4,479,313.70
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,873,888.00
BTPS 1.65% 03/01/32	5,250,000.00	5,622,671.25
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,288,480.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,153,850.00
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,712,752.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,280,333.75
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,635,937.50
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	7,067,875.50
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	3,024,272.75
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,844,868.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,915,562.50

BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,332,497.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,321,847.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	7,130,496.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,645,840.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,273,237.45	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,760,798.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,547,915.80	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,837,456.50	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,455,723.25	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,349,264.65	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,638,707.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	3,390,000.00	4,348,217.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	3,465,695.20	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	8,103,439.65	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,034,270.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,810,867.90	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,600,795.55	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,518,843.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,302,623.00	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,537,304.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,541,079.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,758,088.80	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,530,493.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,961,166.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,343,755.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,736,139.40	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	4,700,486.70	
BTPS 4% 02/01/37	5,470,000.00	7,619,600.60	
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,589,420.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,815,586.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,794,900.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,966,950.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	4,049,937.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	6,143,100.90	
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,451,928.00	
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	7,087,190.50	
BTPS 5% 08/01/34	4,240,000.00	6,376,112.00	
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,393,709.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	7,520,000.00	11,037,066.40	
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,415,472.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,057,055.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,093,664.00	

DBR 0.25% 02/15/27	4,690,000.00	5,081,403.95
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,839,694.30
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,541,680.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,090,471.20
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,460,150.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,466,922.10
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,149,317.00
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,266,205.60
DBR 0% 08/15/29	1,810,000.00	1,936,410.40
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,423,219.50
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,723,325.40
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,222,196.50
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,557,769.70
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,008,362.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,851,778.50
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,625,026.00
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,512,400.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,492,737.20
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,794,126.75
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,074,010.25
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,035,995.50
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,738,406.40
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	9,128,574.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,528,591.00
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,307,226.00
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,970,554.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,797,611.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,360,000.00	7,873,833.00
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	5,285,209.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,838,617.00
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,505,510.95
DBR 4.75% 07/04/40	3,210,000.00	6,781,879.35
DBR 5.5% 01/04/31	3,900,000.00	6,740,604.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,821,942.10
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,637,380.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,185,687.50
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,035,030.75
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,062,150.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,206,118.75
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,367,718.15
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	11,195,028.00
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,607,740.00
FRTR 0.75% 05/25/28	9,010,000.00	9,986,278.55

FRTR 0.75% 11/25/28	8,510,000.00	9,446,482.95
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,072,180.00
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,330,055.00
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,633,456.20
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,626,165.30
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,158,773.50
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,680,341.75
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,719,736.50
FRTR 1.25% 05/25/36	6,420,000.00	7,721,751.30
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,659,366.90
FRTR 1.5% 05/25/50	3,020,000.00	3,915,399.80
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,037,433.20
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,670,104.40
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,309,044.80
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,855,974.70
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,457,443.00
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,954,560.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,694,233.50
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,306,251.00
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,415,620.20
FRTR 2.5% 10/25/20	6,520,000.00	6,762,967.80
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,370,175.00
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,940,584.20
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,771,378.85
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,811,310.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,270,555.95
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,230,083.65
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,397,389.60
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,586,656.25
FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000.00	13,200,389.30
FRTR 4.75% 04/25/35	4,880,000.00	8,569,646.00
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	6,162,761.00
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,463,585.75
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,520,431.20
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,411,433.50
FRTR 5.75% 10/25/32	6,340,000.00	11,383,248.10
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,693,905.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,346,195.00
IRISH 0.8% 03/15/22	2,180,000.00	2,259,766.20
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,867,388.40
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,366,840.20
IRISH 1.1% 05/15/29	910,000.00	1,011,929.10

IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	889,812.30
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,017,763.95
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,038,084.00
IRISH 1.7% 05/15/37	1,050,000.00	1,275,009.75
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,224,130.40
IRISH 2.4% 05/15/30	1,630,000.00	2,044,272.65
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,961,229.40
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,734,761.70
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,497,948.00
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,141,245.40
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	244,677.45
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	3,054,240.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,726,368.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,467,859.20
NETHER 0.5% 07/15/26	3,070,000.00	3,332,377.55
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	5,039,172.00
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,850,083.20
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,572,870.00
NETHER 0% 01/15/24	3,410,000.00	3,536,204.10
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,255,974.00
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,812,238.60
NETHER 2.5% 01/15/33	2,430,000.00	3,405,183.30
NETHER 2.75% 01/15/47	2,680,000.00	4,867,617.00
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,434,063.85
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,156,943.15
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,675,757.65
NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,557,676.00
NETHER 4% 01/15/37	3,000,000.00	5,315,340.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,740,557.70
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	257,563.00
OBL 0.25% 10/16/20	6,360,000.00	6,439,786.20
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,156,443.50
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,513,234.50
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,297,300.40
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,592,518.75
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,650,479.00
OBL 0% 10/13/23	3,710,000.00	3,856,619.20
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	1,005,633.60
RAGB 0.5% 02/20/29	1,190,000.00	1,295,160.30
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,272,945.50
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,179,974.35
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,630,093.55
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,545,420.00

RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,126,823.50
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,910,138.40
RAGB 1.5% 02/20/47	1,130,000.00	1,530,963.55
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	983,200.00
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,100,571.00
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,577,504.25
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,994,990.00
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,144,301.00
RAGB 3.15% 06/20/44	1,330,000.00	2,329,840.80
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,898,202.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,360,786.40
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,583,504.00
RAGB 3.8% 01/26/62	680,000.00	1,609,420.60
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,605,981.60
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,899,036.40
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	201,475.30
RFGB 0.375% 09/15/20	1,390,000.00	1,406,346.40
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,258,299.90
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,137,942.75
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	729,887.95
RFGB 0.5% 09/15/29	580,000.00	633,043.90
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	979,985.40
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	755,070.45
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	868,113.50
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,506,026.50
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	924,950.95
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	748,041.25
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	704,561.00
RFGB 1.625% 09/15/22	1,430,000.00	1,536,427.75
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,486,025.40
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,188,989.60
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	678,144.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	856,040.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,448,264.50
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,631,896.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,761,311.50
SPGB 0.25% 07/30/24	1,790,000.00	1,841,176.10
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,920,794.90
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,362,934.80
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,935,300.50
SPGB 0.6% 10/31/29	2,330,000.00	2,437,238.25
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,255,704.00

	SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,602,054.00
	SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	6,976,821.25
	SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,604,961.50
	SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,377,904.80
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,911,688.00
	SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,413,453.25
	SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,421,425.60
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,873,081.50
	SPGB 1.95% 04/30/26	4,820,000.00	5,491,594.70
	SPGB 1.95% 07/30/30	3,650,000.00	4,339,904.75
	SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,855,903.45
	SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,453,390.80
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,273,868.00
	SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,096,982.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	4,969,521.20
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,850,000.00	3,161,890.50
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,953,265.40
	SPGB 4.2% 01/31/37	3,490,000.00	5,569,691.00
	SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,100,212.50
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,116,952.85
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	7,079,166.30
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,749,822.50
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,198,850.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	5,935,000.50
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,747,879.80
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,590,000.00	5,046,886.95
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,835,474.90
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,582,455.10
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,273,944.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,943,870.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,932,030.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,635,065.25
	ユーロ 小計	1,019,570,000.00	1,249,832,863.85 (146,717,879,887)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,763,921.60
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,027,548.50
	UKT 0.875% 10/22/29	1,430,000.00	1,484,418.65
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,242,804.00
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,166,566.00
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,429,619.50
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,658,105.60
	UKT 1.625% 10/22/28	5,750,000.00	6,366,773.75
	UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,589,263.55

UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,568,712.00	
UKT 1.75% 01/22/49	2,310,000.00	2,754,328.50	
UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,471,380.00	
UKT 1.75% 09/07/22	4,170,000.00	4,348,955.55	
UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,648,406.00	
UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,186,583.90	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,692,275.00	
UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,650,607.90	
UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,745,678.25	
UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,392,294.80	
UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,949,030.05	
UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,249,328.00	
UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,401,233.95	
UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,847,420.00	
UKT 3.75% 09/07/20	8,060,000.00	8,327,390.50	
UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,026,360.00	
UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,598,127.25	
UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,343,970.00	
UKT 4.25% 09/07/39	2,450,000.00	3,956,652.00	
UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	883,910.90	
UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	5,004,165.50	
UKT 4.25% 12/07/46	3,950,000.00	7,017,866.25	
UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	4,017,169.10	
UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,517,236.60	
UKT 4.5% 09/07/34	3,170,000.00	4,885,810.05	
UKT 4.5% 12/07/42	3,910,000.00	6,798,062.85	
UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,971,748.90	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,218,904.00	
UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	6,011,554.25	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,129,604.75	
UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,138,075.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,887,281.25	
UKT 8% 06/07/21	740,000.00	839,089.70	
イギリスポンド 小計	139,210,000.00	185,208,233.90 (24,119,668,300)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,275,101.80
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,432,186.40
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	18,225,173.25
	SGB 1% 11/12/26	11,970,000.00	13,327,278.30
	SGB 2.5% 05/12/25	12,740,000.00	15,065,304.80
	SGB 3.5% 03/30/39	8,580,000.00	14,235,163.80
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,661,750.20

	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	20,247,126.10
スウェーデンクローナ 小計		101,520,000.00	117,469,084.65 (1,283,937,095)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,669,514.10
	NGB 1.75% 02/17/27	7,460,000.00	7,830,016.00
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	6,017,703.00
	NGB 1.75% 09/06/29	5,140,000.00	5,458,551.50
	NGB 2% 04/26/28	6,190,000.00	6,663,101.70
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,881,302.40
	NGB 3.75% 05/25/21	16,540,000.00	17,279,668.80
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,789,183.00
ノルウェークローネ 小計		71,980,000.00	75,589,040.50 (891,194,787)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,527,934.00
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	19,345,767.30
	DGB 0.5% 11/15/29	7,190,000.00	8,071,458.05
	DGB 1.5% 11/15/23	13,990,000.00	15,428,801.55
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	13,103,220.15
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	14,087,131.20
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	50,068,213.15
デンマーククローネ 小計		96,720,000.00	129,632,525.40 (2,040,415,949)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,810,000.00	7,838,389.35
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,790,070.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,028,357.80
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,057,713.75
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,745,710.05
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	7,104,133.35
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,520,000.00	6,989,863.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,960,000.00	3,194,520.80
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,611,627.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,749,924.65
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,798,818.75
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,110,000.00	3,248,877.05
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	809,103.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,750,000.00	5,329,500.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,697,789.00
ポーランドズロチ 小計		77,890,000.00	81,994,398.55 (2,217,128,536)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	2,470,000.00	2,612,938.90
	ACGB 1.75% 11/21/20	6,310,000.00	6,378,779.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,432,718.95
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,065,131.30

	ACGB 2.5% 05/21/30	3,540,000.00	4,097,125.20
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,615,096.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	997,084.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,753,594.70
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,591,023.75
	ACGB 2.75% 11/21/28	5,410,000.00	6,274,031.10
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,243,711.20
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,797,302.40
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,654,790.00
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,960,433.80
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,570,000.00	2,088,366.90
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,233,117.20
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,296,143.20
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,773,311.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,805,294.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,278,392.10
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,682,380.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,257,486.90
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,085,900.60
	オーストラリアドル 小計	90,090,000.00	104,974,152.20 (7,593,830,170)
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	982,431.45
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	803,640.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	782,433.60
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	877,863.00
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,092.50
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	735,532.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	656,888.40
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	278,643.30
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,132,099.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,515,485.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	830,000.00	948,358.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,667,048.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	620,440.80
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	746,493.90
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	416,824.45
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,504.50
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,086,756.20
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,140,000.00	1,358,104.80
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,345,788.85
	SIGB 3% 09/01/24	1,570,000.00	1,674,664.05
	シンガポールドドル 小計	19,110,000.00	20,385,092.70 (1,566,390,523)

マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,520,937.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,729,079.00
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,736,354.75
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,722,253.10
	MGS 3.659% 10/15/20	2,360,000.00	2,375,446.20
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,339,611.00
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	357,047.25
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,529,182.50
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,231,352.80
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	3,095,965.60
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	764,227.50
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,061,801.25
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,170,352.30
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,051,173.85
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,697,558.40
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,802,208.50
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,090,333.75
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,973,986.00
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,174,281.25
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,773,204.50
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,615,712.25
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,146,340.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,513,708.00
	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,363,993.80
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,327,173.60
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,686,405.00
	MGS 4.736% 03/15/46	2,270,000.00	2,638,057.80
	MGS 4.762% 04/07/37	3,370,000.00	3,912,839.60
MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	948,592.00	
MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,856,923.25	
MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,710,518.40	
MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	686,067.00	
マレーシアリンギット 小計		65,780,000.00	69,602,687.70 (1,765,124,160)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	46,150,000.00	52,166,114.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	8,107,469.10
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,599,364.25
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,730,923.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,885,120.00
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	14,023,224.20
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	24,114,461.80
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	24,662,761.50

	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,638,913.30	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	40,675,134.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	20,283,762.50	
	SAGB 8% 01/31/30	29,930,000.00	28,340,866.65	
	SAGB 9% 01/31/40	19,620,000.00	18,405,522.00	
	南アフリカランド 小計	315,260,000.00	296,633,636.80 (2,129,829,512)	
	合計		384,675,293,358 (384,675,293,358)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	47.8%
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 300銘柄	100.0%	38.1%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,070,351,806
コール・ローン	270,869,022
株式	329,014,675,847
投資信託受益証券	275,536,609
投資証券	9,649,060,717
派生商品評価勘定	82,302,971
未収入金	1,391,935
未収配当金	683,919,999
前払金	13,007,411
差入委託証拠金	2,099,075,242
流動資産合計	349,160,191,559
資産合計	349,160,191,559
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	93,869,934
未払解約金	32,800,033
未払利息	603
流動負債合計	126,670,570
負債合計	126,670,570
純資産の部	
元本等	
元本	137,809,914,504
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	211,223,606,485
元本等合計	349,033,520,989
純資産合計	349,033,520,989
負債純資産合計	349,160,191,559

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月 5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>

	2019年 9月 5日現在
	<p>(3)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>(1)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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,809,914,504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 2.5327円 (1万口当たり純資産額) (25,327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 9月 5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 9月 5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

	2019年 9月 5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>「(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> <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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	136,773,118,514円
期中追加設定元本額	18,084,991,443円
期中一部解約元本額	17,048,195,453円
期末元本額	137,809,914,504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）	2,470,239,169円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,735,531円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,283,158,065円
世界経済インデックスファンド	7,638,285,637円

区分	2019年 9月 5日現在
外国株式インデックス・オープン	908,385,078円
DCマイセレクション25	1,100,049,191円
DCマイセレクション50	4,847,477,078円
DCマイセレクション75	5,058,272,544円
DC外国株式インデックス・オープン	8,679,312,410円
DCマイセレクションS25	440,511,543円
DCマイセレクションS50	1,975,615,253円
DCマイセレクションS75	1,449,961,172円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	108,769,525円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	190,307,775円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	125,087,615円
DC世界経済インデックスファンド	6,628,576,668円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,987,162,701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）	40,532,804円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	47,117,084円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	192,568,575円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	36,443,520円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	280,180,364円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	712,900,678円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	367,328,674円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,392,815,593円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,897,810,463円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	82,343,183円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	348,623,810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）	123,087,372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）	2,094,806,561円
外国株式ファンド・シリーズ1	875,446,655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	2,346,017,482円
分散投資コア戦略ファンドS	5,021,477,738円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	931,641,778円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,037,952,934円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,158,981,299円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	818,214,522円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,627,996円
SMT インデックスバランス・オープン	273,704,414円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,686,624,729円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,319,596,616円

区分	2019年 9月 5日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	82,093,268円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	331,222,396円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	51,798,660円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,476,464円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	47,392,948円
グローバル経済コア	1,067,750,608円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	6,960,441円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	433,105円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	384,207,146円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	78,275,757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）	1,367,952,530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）	1,176,938,783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）	360,732,678円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	33,131,536円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	11,251,822,189
投資信託受益証券	18,766,573
投資証券	693,135,875
合計	11,963,724,637

(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 9月 5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	9,988,621,061	-	9,975,613,650	13,007,411
	合計	9,988,621,061	-	9,975,613,650	13,007,411

(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 9月 5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	212,378,542	-	213,805,930	1,427,388
	アメリカドル	148,274,000	-	148,974,000	700,000
	ユーロ	30,808,370	-	31,108,350	299,980
	イギリスポンド	12,556,740	-	12,761,560	204,820
	スイスフラン	10,733,800	-	10,843,000	109,200
	ノルウェークローネ	10,005,632	-	10,119,020	113,388
	売建	73,305,200	-	73,292,140	13,060
	アメリカドル	58,839,200	-	58,828,140	11,060
	オーストラリアドル	14,466,000	-	14,464,000	2,000
合計		285,683,742	-	287,098,070	1,440,448

(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	22.04	755,376.92	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	22.61	1,003,884.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.13	614,607.27	
	CHENIERE ENERGY INC	19,927	60.40	1,203,590.80	

CHEVRON CORP	162,402	117.25	19,041,634.50
CIMAREX ENERGY CO	7,599	42.18	320,525.82
CONCHO RESOURCES INC	17,481	72.97	1,275,588.57
CONOCOPHILLIPS	96,515	53.30	5,144,249.50
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	29.31	224,133.57
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	22.84	864,745.24
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	97.82	1,319,298.34
EOG RESOURCES INC	49,600	75.57	3,748,272.00
EXXON MOBIL	360,671	69.29	24,990,893.59
HALLIBURTON CO	76,620	18.76	1,437,391.20
HELMERICH & PAYNE	8,315	37.09	308,403.35
HESS CORP	22,081	65.04	1,436,148.24
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	45.81	646,379.10
KINDER MORGAN INC	174,156	20.33	3,540,591.48
MARATHON OIL CORP	74,537	12.11	902,643.07
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	50.66	2,924,095.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	20.69	627,134.59
NOBLE ENERGY INC	38,291	22.52	862,313.32
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	43.58	3,337,879.36
ONEOK INC	34,074	71.04	2,420,616.96
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	17.67	361,793.25
PHILLIPS 66	38,115	99.69	3,799,684.35
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	124.18	1,795,021.90
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	22.19	219,459.10
SCHLUMBERGER	118,363	32.98	3,903,611.74
TARGA RESOURCES CORP	20,002	36.30	726,072.60
TECHNIPFMC PLC	36,005	25.39	914,166.95
VALERO ENERGY CORP	35,352	74.78	2,643,622.56
WILLIAMS COS	103,730	23.70	2,458,401.00
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,806	227.42	4,276,860.52
ALBEMARLE CORP	8,647	61.31	530,147.57
AMCOR PLC	138,214	9.71	1,342,057.94
AVERY DENNISON CORP	7,457	114.35	852,707.95
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	29.01	510,750.06
BALL CORP	27,142	80.78	2,192,530.76
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	113.82	1,258,052.46
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	47.76	910,830.96
CORTEVA INC	64,411	28.43	1,831,204.73
CROWN HOLDINGS INC	11,700	66.05	772,785.00
DOW INC	65,790	42.54	2,798,706.60
DUPONT DE NEMOURS INC	64,206	68.48	4,396,826.88
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	65.08	771,718.64

ECOLAB INC	21,748	206.83	4,498,138.84
FMC CORP	12,118	86.71	1,050,751.78
FREEMPORT-MCMORAN INC	124,849	9.29	1,159,847.21
INT'L PAPER CO	33,803	38.66	1,306,823.98
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	111.90	970,620.60
LINDE PLC	46,307	187.56	8,685,340.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	75.82	1,744,390.74
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	260.70	1,399,176.90
MOSAIC CO/THE	31,911	18.16	579,503.76
NEWMONT GOLDCORP CORP	69,458	41.02	2,849,167.16
NUCOR CORP	26,204	49.30	1,291,857.20
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	100.14	890,244.60
PPG INDUSTRIES INC	19,958	111.52	2,225,716.16
SEALED AIR CORP	14,689	39.60	581,684.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,101	534.67	3,796,691.67
STEEL DYNAMICS INC	18,273	27.07	494,650.11
VULCAN MATERIALS CO	10,740	143.13	1,537,216.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	57.80	199,699.00
WESTROCK CO	21,244	33.99	722,083.56
3 M COMPANY	49,185	160.07	7,873,042.95
ACUITY BRANDS INC	3,505	124.60	436,723.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	53.77	609,214.10
ALLEGION PLC	7,435	96.76	719,410.60
AMETEK INC	19,001	85.17	1,618,315.17
ARCONIC INC	36,550	25.98	949,569.00
BOEING CO	45,573	356.53	16,248,141.69
CATERPILLAR	48,214	119.10	5,742,287.40
CUMMINS INC	12,585	148.97	1,874,787.45
DEERE&CO	25,734	151.72	3,904,362.48
DOVER CORP	12,008	93.25	1,119,746.00
EATON CORP	36,194	79.17	2,865,478.98
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	59.61	3,133,220.82
FASTENAL CO	46,922	29.96	1,405,783.12
FLOWSERVE CORP	10,826	41.99	454,583.74
FLUOR CORP	11,267	18.86	212,495.62
FORTIVE CORP	25,813	66.96	1,728,438.48
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	49.91	639,347.10
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	190.71	4,008,914.91
GENERAL ELECTRIC CO	744,434	8.80	6,551,019.20
GRAINGER (WW) INC	3,976	268.17	1,066,243.92
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	39.19	596,706.94
HEICO CORP	3,640	144.17	524,778.80

HEICO CORP-CLASS A	6,449	109.86	708,487.14
HONEYWELL INTL INC	62,077	167.14	10,375,549.78
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	208.56	734,548.32
IDEX CORP	6,916	162.96	1,127,031.36
ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	146.79	4,114,230.12
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	119.39	2,426,243.58
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	90.87	1,092,802.62
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	55.24	1,110,324.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	31.70	649,850.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	42.40	2,886,676.80
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,859	213.65	4,029,225.35
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	252.81	729,356.85
LOCKHEED MARTIN CORP	21,716	389.08	8,449,261.28
MASCO CORP	24,547	40.66	998,081.02
MIDDLEBY CORP	4,364	110.55	482,440.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,775	372.06	5,125,126.50
OWENS CORNING	7,979	55.74	444,749.46
PACCAR INC	30,075	65.46	1,968,709.50
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	163.21	1,850,801.40
PENTAIR PLC	13,583	35.50	482,196.50
RAYTHEON COMPANY	23,520	183.40	4,313,568.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	149.83	1,574,863.13
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	368.80	3,215,936.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	45.94	635,258.32
SMITH (A.O.) CORP	12,146	46.30	562,359.80
SNAP-ON INC	4,900	148.85	729,365.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	80.65	683,992.65
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	130.10	1,721,743.40
TEXTRON	18,220	44.45	809,879.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	536.58	2,184,953.76
UNITED RENTALS INC	6,446	112.80	727,108.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	69,887	131.05	9,158,691.35
WABCO HOLDINGS INC	3,841	133.64	513,311.24
WABTEC CORP	15,679	66.30	1,039,517.70
XYLEM INC	16,060	75.31	1,209,478.60
CINTAS CORP	7,616	264.01	2,010,700.16
COPART INC	17,540	75.66	1,327,076.40
COSTAR GROUP INC	3,008	614.15	1,847,363.20
EQUIFAX INC	10,799	146.42	1,581,189.58
IHS MARKIT LTD	32,775	66.48	2,178,882.00
MANPOWER GROUP	5,123	81.12	415,577.76
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	20.58	566,032.32

REPUBLIC SERVICES INC	18,461	89.83	1,658,351.63
ROBERT HALF INTL INC	9,566	52.90	506,041.40
ROLLINS INC	10,546	33.58	354,134.68
TRANSUNION	15,344	83.73	1,284,753.12
VERISK ANALYTICS INC	13,480	162.84	2,195,083.20
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	91.80	2,112,134.40
WASTE MANAGEMENT INC	36,280	120.65	4,377,182.00
AMERCO	602	351.05	211,332.10
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	27.00	267,840.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	82.76	947,436.48
CSX CORP	64,710	67.50	4,367,925.00
DELTA AIR LINES INC	15,095	57.23	863,886.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	71.18	982,497.54
FEDEX CORP	21,165	159.06	3,366,504.90
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	108.83	776,393.22
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	127.50	1,114,732.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	34.88	373,216.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	171.57	3,914,197.98
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	161.31	846,070.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	52.10	597,326.50
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	31.99	503,810.51
UNION PACIFIC CORP	60,776	160.08	9,729,022.08
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	83.91	503,711.73
UNITED PARCEL SERVICE B	59,531	119.47	7,112,168.57
XPO LOGISTICS INC	8,001	68.46	547,748.46
APTIV PLC	22,107	84.19	1,861,188.33
AUTOLIV INC	6,639	69.45	461,078.55
BORGWARNER INC	15,953	33.21	529,799.13
FORD MOTOR COMPANY	335,147	9.20	3,083,352.40
GENERAL MOTORS CO	109,074	38.24	4,170,989.76
HARLEY-DAVIDSON	14,677	31.48	462,031.96
LEAR CORP	5,287	113.33	599,175.71
TESLA INC	10,812	220.68	2,385,992.16
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	26.46	305,533.62
DR HORTON INC	28,998	50.50	1,464,399.00
GARMIN LTD	11,464	82.55	946,353.20
HANESBRANDS INC	31,136	13.62	424,072.32
HASBRO INC	10,617	109.57	1,163,304.69
LEGGETT & PLATT INC	10,594	36.77	389,541.38
LENNAR CORP-CL A	23,545	51.99	1,224,104.55
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	180.70	1,715,927.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	115.01	582,180.62

NEWELL BRANDS INC	37,563	16.98	637,819.74
NIKE B	107,215	86.35	9,258,015.25
NVR INC	294	3,671.00	1,079,274.00
POLARIS INC	4,691	80.07	375,608.37
PULTE GROUP INC	21,959	34.46	756,707.14
PVH CORP	7,252	81.08	587,992.16
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	89.80	411,104.40
ROKU INC	7,065	168.91	1,193,349.15
TAPESTRY INC	25,989	21.49	558,503.61
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	18.95	302,252.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	17.24	280,718.92
VF CORP	28,754	82.11	2,360,990.94
WHIRLPOOL CORP	5,324	137.68	733,008.32
ARAMARK	19,980	41.57	830,568.60
BLOCK H & R INC	16,984	24.18	410,673.12
CARNIVAL CORPORATION	35,126	43.89	1,541,680.14
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	838.28	1,891,997.96
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	122.12	1,224,985.72
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	239.06	825,474.18
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	92.30	2,171,172.90
LAS VEGAS SANDS CORP	28,379	55.07	1,562,831.53
MARRIOTT INTL A	23,516	125.69	2,955,726.04
MCDONALD'S CORP	65,110	218.50	14,226,535.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	20.88	368,782.56
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.48	1,227,146.88
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	51.04	910,451.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	104.74	1,601,579.34
STARBUCKS CORP	103,316	96.11	9,929,700.76
VAIL RESORTS INC	3,574	239.78	856,973.72
WYNN RESORTS LTD	8,052	108.92	877,023.84
YUM BRANDS INC	26,166	117.89	3,084,709.74
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,500	53.50	3,504,250.00
ALPHABET INC-CL A	25,523	1,182.27	30,175,077.21
ALPHABET INC-CL C	26,716	1,181.41	31,562,549.56
ALTICE USA INC- A	12,457	29.00	361,253.00
CBS CORP-CL B	28,628	41.67	1,192,928.76
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	419.47	5,718,215.04
COMCAST CORP-CL A	386,179	45.52	17,578,868.08
DISCOVERY INC - A	12,804	27.04	346,220.16
DISCOVERY INC-C	31,156	25.54	795,724.24
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	34.17	622,509.06
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	97.95	2,492,533.65

FACEBOOK INC-A	204,769	187.14	38,320,470.66
FOX CORP - CLASS A	30,270	33.56	1,015,861.20
FOX CORP- CLASS B	15,092	33.21	501,205.32
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	255.09	1,714,459.89
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	20.14	681,416.76
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	107.27	929,280.01
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.28	423,276.48
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,606	26.69	1,137,154.14
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	42.25	789,779.25
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.37	630,189.21
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.93	261,297.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	70.50	890,908.50
NETFLIX INC	37,291	291.52	10,871,072.32
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.89	465,023.31
OMNICOM GROUP	19,030	76.63	1,458,268.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.21	804,226.05
SNAP INC - A	57,914	15.80	915,041.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	132.74	1,267,932.48
THE WALT DISNEY CO	153,426	137.89	21,155,911.14
TRIPADVISOR INC	10,393	37.70	391,816.10
TWITTER INC	61,378	43.36	2,661,350.08
VIACOM INC-CLASS B	31,895	24.82	791,633.90
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	32.23	321,075.26
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	141.89	877,731.54
AMAZON.COM	35,663	1,800.62	64,215,511.06
AUTOZONE INC	2,085	1,122.72	2,340,871.20
BEST BUY COMPANY INC	20,711	63.93	1,324,054.23
BOOKING HOLDINGS INC	3,695	1,958.79	7,237,729.05
BURLINGTON STORES INC	6,004	201.22	1,208,124.88
CARMAX INC	14,253	84.97	1,211,077.41
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	157.80	3,523,674.00
DOLLAR TREE INC	19,630	105.00	2,061,150.00
EBAY	71,876	39.64	2,849,164.64
EXPEDIA GROUP INC	12,028	128.70	1,548,003.60
GAP	21,891	16.11	352,664.01
GENUINE PARTS CO	12,722	91.59	1,165,207.98
GRUBHUB INC	8,261	58.70	484,920.70
HOME DEPOT	94,028	224.15	21,076,376.20
KOHL'S CORP	14,645	47.09	689,633.05
L BRANDS INC	19,499	16.12	314,323.88
LKQ CORP	24,693	26.41	652,142.13
LOWES COMPANIES	67,906	111.92	7,600,039.52

MACY'S INC	25,926	14.91	386,556.66
MERCADOLIBRE INC	3,727	590.00	2,198,930.00
NORDSTROM INC	10,094	29.51	297,873.94
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	388.61	2,603,298.39
QURATE RETAIL INC	35,071	10.60	371,752.60
ROSS STORES INC	31,827	105.97	3,372,707.19
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,758	107.36	4,697,858.88
TIFFANY & CO	9,326	84.53	788,326.78
TJX COMPANIES INC	103,117	54.40	5,609,564.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,497	100.30	952,549.10
ULTA BEAUTY INC	4,911	228.76	1,123,440.36
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	118.10	629,118.70
COSTCO WHOLESALE CORP	37,514	296.12	11,108,645.68
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	6.96	235,944.00
KROGER CO	68,147	24.66	1,680,505.02
SYSCO CORP	41,755	75.07	3,134,547.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	51.43	3,466,742.01
WALMART INC	122,245	115.91	14,169,417.95
ALTRIA GROUP INC	158,456	44.30	7,019,600.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	38.24	1,827,795.52
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	60.49	1,599,295.11
BUNGE LIMITED	11,767	53.90	634,241.30
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	45.07	634,225.04
COCA-COLA CO	345,522	55.77	19,269,761.94
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	56.26	1,140,390.20
CONAGRA BRANDS INC	39,943	28.89	1,153,953.27
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	210.18	2,946,303.24
GENERAL MILLS INC	50,246	54.31	2,728,860.26
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	161.40	2,020,889.40
HORMEL FOODS CORP	23,465	42.53	997,966.45
INGREDION INC	5,835	78.74	459,447.90
JM SMUCKER CO	9,442	106.28	1,003,495.76
KELLOGG CO	21,051	63.34	1,333,370.34
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	26.26	1,512,077.06
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	72.38	935,439.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	165.17	1,647,735.92
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	53.13	802,263.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	56.20	6,869,550.80
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	58.06	2,028,151.92
PEPSICO INC	119,526	139.15	16,632,042.90
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,697	73.02	9,689,534.94
TYSON FOODS INC	24,363	86.06	2,096,679.78

CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	80.19	1,705,160.16
CLOROX COMPANY	10,995	164.36	1,807,138.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	69,644	74.87	5,214,246.28
COTY INC-CL A	30,534	9.39	286,714.26
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,739	202.72	3,798,770.08
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	142.68	4,198,073.64
PROCTER & GAMBLE CO	213,814	123.21	26,344,022.94
ABBOTT LABORATORIES	150,743	84.22	12,695,575.46
ABIOMED INC	3,502	183.38	642,196.76
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	176.38	1,104,844.32
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	85.18	1,094,307.46
ANTHEM INC	21,803	254.23	5,542,976.69
BAXTER INTERNATIONAL	40,492	87.50	3,543,050.00
BECTON DICKINSON & CO	23,072	254.71	5,876,669.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,988	42.05	5,003,445.40
CARDINAL HEALTH	25,252	44.35	1,119,926.20
CENTENE CORP	35,914	45.61	1,638,037.54
CERNER CORP	27,944	67.28	1,880,072.32
CIGNA CORP	32,466	152.94	4,965,350.04
CVS HEALTH CORP	111,087	61.66	6,849,624.42
DANAHER CORP	55,089	140.26	7,726,783.14
DAVITA INC	9,056	59.15	535,662.40
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	51.33	1,036,250.04
DEXCOM INC	7,827	169.63	1,327,694.01
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	219.86	3,922,082.54
HCA HEALTHCARE INC	22,986	121.31	2,788,431.66
HENRY SCHEIN INC	12,492	61.06	762,761.52
HOLOGIC INC	24,459	48.65	1,189,930.35
HUMANA INC	11,566	274.18	3,171,165.88
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	288.90	2,081,524.50
INTUITIVE SURGICAL INC	9,879	496.22	4,902,157.38
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	168.19	1,484,613.13
MCKESSON CORP	16,655	140.54	2,340,693.70
MEDTRONIC PLC	114,560	107.66	12,333,529.60
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	102.73	1,189,613.40
RESMED INC	12,398	137.83	1,708,816.34
STERIS PLC	7,229	152.37	1,101,482.73
STRYKER CORP	28,773	219.00	6,301,287.00
TELEFLEX INC	3,971	355.78	1,412,802.38
THE COOPER COS INC	4,135	301.23	1,245,586.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,179	226.73	18,405,714.67
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	146.26	1,060,092.48

VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	105.07	865,461.59
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	156.51	1,718,792.82
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	268.15	1,180,664.45
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	138.01	2,393,369.42
ABBVIE INC	126,373	66.38	8,388,639.74
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	70.86	1,940,642.82
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	97.53	1,857,751.44
ALKERMES PLC	12,547	19.84	248,932.48
ALLERGAN PLC	27,804	161.69	4,495,628.76
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	82.33	789,133.05
AMGEN	52,414	206.32	10,814,056.48
BEIGENE LTD-ADR	3,149	140.56	442,623.44
BIOGEN INC	16,410	219.29	3,598,548.90
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	72.74	1,177,806.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	139,879	48.12	6,730,977.48
CELGENE CORP	59,466	96.97	5,766,418.02
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	26.36	808,223.96
EXACT SCIENCES CORP	10,748	120.84	1,298,788.32
GILEAD SCIENCES INC	108,729	63.27	6,879,283.83
ILLUMINA INC	12,589	271.71	3,420,557.19
INCYTE CORP	16,120	77.62	1,251,234.40
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	62.19	698,766.84
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	151.46	2,159,062.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	126.59	629,278.89
JOHNSON & JOHNSON	226,749	128.86	29,218,876.14
LILLY (ELI) & CO	74,693	113.25	8,458,982.25
MERCK & CO	219,928	86.05	18,924,804.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,025	660.17	1,336,844.25
MYLAN NV	42,644	19.74	841,792.56
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	16.96	229,078.72
PERKINELMER INC	9,475	81.95	776,476.25
PERRIGO CO PLC	11,333	46.61	528,231.13
PFIZER	474,281	35.83	16,993,488.23
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	286.50	1,982,866.50
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	86.13	555,366.24
SEATTLE GENETICS INC	9,601	71.40	685,511.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	7.10	673,321.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,187	285.90	9,774,063.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	176.83	3,825,540.22
WATERS CORP	5,663	212.19	1,201,631.97
ZOETIS INC	40,953	127.59	5,225,193.27
BANK OF AMERICA CORP	770,049	27.49	21,168,647.01

BB&T CORP	64,191	47.31	3,036,876.21
CIT GROUP INC	7,038	41.68	293,343.84
CITIGROUP	197,425	64.28	12,690,479.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	33.25	1,330,332.50
COMERICA INC	14,360	60.53	869,210.80
EAST WEST BANCORP INC	13,827	40.48	559,716.96
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	25.95	1,635,187.35
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	88.60	1,251,563.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	13.05	1,117,902.15
JPMORGAN CHASE & CO	276,504	109.87	30,379,494.48
KEY CORP	87,033	16.40	1,427,341.20
M & T BANK CORP	10,559	143.98	1,520,284.82
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	14.51	532,807.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,554	128.57	4,956,887.78
REGIONS FINL CORP	83,851	14.44	1,210,808.44
SIGNATURE BANK	4,354	113.72	495,136.88
SUNTRUST BANKS	38,353	61.08	2,342,601.24
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	192.10	843,319.00
US BANCORP	129,084	52.46	6,771,746.64
WELLS FARGO & CO	364,038	46.50	16,927,767.00
ZIONS BANCORPORATION	15,186	40.01	607,591.86
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	76.03	337,040.99
ALLY FINANCIAL INC	36,028	31.78	1,144,969.84
AMERICAN EXPRESS	60,573	118.40	7,171,843.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	129.27	1,531,849.50
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	20.54	466,134.76
BANK NEW YORK CO	71,617	41.92	3,002,184.64
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110,807	202.19	22,404,067.33
BLACKROCK INC	9,909	415.64	4,118,576.76
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	85.96	3,397,139.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	119.18	1,128,634.60
CME GROUP INC	30,553	221.06	6,754,046.18
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,947	79.33	2,137,705.51
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	41.62	878,514.96
EATON VANCE CORP	10,061	42.48	427,391.28
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	270.95	883,297.00
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.23	683,816.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	201.73	5,674,664.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,352	94.26	4,463,399.52
INVESCO LTD	30,943	15.60	482,710.80
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	18.63	478,902.78
KKR & CO INC -A	42,145	25.79	1,086,919.55

MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	408.61	1,312,455.32
MOODY'S CORP	14,592	213.70	3,118,310.40
MORGAN STANLEY	108,193	41.53	4,493,255.29
MSCI INC	7,262	230.20	1,671,712.40
NASDAQ INC	9,996	99.91	998,700.36
NORTHERN TRUST CORP	17,320	87.96	1,523,467.20
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	110.98	2,226,924.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	78.03	853,804.26
S&P GLOBAL INC	20,750	259.20	5,378,400.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	38.67	3,938,346.15
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	57.38	619,818.76
STATE STREET CORP	32,349	50.88	1,645,917.12
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	32.30	1,714,968.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	44.95	1,052,009.80
VOYA FINANCIAL INC	12,505	49.58	619,997.90
AFLAC	63,745	50.79	3,237,608.55
ALLEGHANY CORP	1,276	761.57	971,763.32
ALLSTATE CORP	28,490	103.90	2,960,111.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	102.44	718,411.72
AMERICAN INT'L GROUP	74,317	54.40	4,042,844.80
AON PLC	20,104	195.40	3,928,321.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	40.82	1,410,371.82
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	90.02	1,347,779.44
ASSURANT INC	4,769	123.80	590,402.20
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	38.37	512,124.39
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	35.07	365,289.12
CHUBB LTD	38,690	159.85	6,184,596.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	113.66	1,512,359.96
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	218.12	472,447.92
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	246.36	826,045.08
FNF GROUP	24,961	44.79	1,118,003.19
GLOBE LIFE INC	8,473	88.76	752,063.48
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	59.71	1,893,404.10
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	52.71	937,710.90
LOEWS CORP	22,051	48.65	1,072,781.15
MARKEL CORP	1,132	1,152.48	1,304,607.36
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	99.97	4,367,089.48
METLIFE INC	67,515	44.49	3,003,742.35
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	52.56	1,217,026.80
PROGRESSIVE CORP	49,905	76.26	3,805,755.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	79.65	2,766,403.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	153.90	835,830.90

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	190.80	729,237.60
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	150.16	3,311,178.16
UNUM GROUP	18,574	25.33	470,479.42
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	196.52	2,147,963.60
MR BERKLEY CORP	12,637	72.00	909,864.00
CBRE GROUP INC-A	26,855	52.58	1,412,035.90
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.89	581,343.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	134.27	602,066.68
WEYERHAEUSER CO	62,107	26.62	1,653,288.34
ACCENTURE PLC-CL A	54,403	197.71	10,756,017.13
ADOBE INC	41,615	284.60	11,843,629.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	90.88	1,288,496.64
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	123.33	495,293.28
ANSYS INC	6,865	212.49	1,458,743.85
AUTODESK INC	18,836	144.34	2,718,788.24
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	169.71	6,244,140.03
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	129.78	1,252,377.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	68.50	1,651,535.00
CDK GLOBAL INC	10,687	43.20	461,678.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	106.26	1,147,714.26
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	93.17	1,057,665.84
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	62.41	3,018,334.83
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	114.29	354,299.00
DOCUSIGN INC	8,693	46.85	407,267.05
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	18.38	298,619.86
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	32.38	760,865.24
EPAM SYSTEMS INC	4,620	191.44	884,452.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,366	137.72	7,211,845.52
FISERV INC	49,096	106.29	5,218,413.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	298.11	2,173,818.12
FORTINET INC	12,963	78.22	1,013,965.86
GARTNER INC	7,761	134.98	1,047,579.78
GLOBAL PAYMENTS INC	13,420	169.85	2,279,387.00
GODADDY INC - CLASS A	14,919	63.54	947,953.26
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,631	136.32	10,310,017.92
INTUIT INC	22,128	286.31	6,335,467.68
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	145.83	970,936.14
LEIDOS HOLDINGS	10,999	87.62	963,732.38
MASTERCARD INC-CLASS A	77,481	286.10	22,167,314.10
MICROSOFT CORP	620,342	137.63	85,377,669.46
MONGODB INC	3,652	158.66	579,426.32
OKTA INC	8,635	127.94	1,104,761.90

ORACLE CORP	204,053	52.97	10,808,687.41
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	200.49	1,616,751.36
PAYCHEX INC	27,697	82.39	2,281,955.83
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	247.88	1,050,515.44
PAYPAL HOLDINGS INC	95,208	108.73	10,351,965.84
PTC INC	9,984	64.22	641,172.48
SABRE CORP	24,114	23.33	562,579.62
SALESFORCE.COM INC	70,919	152.46	10,812,310.74
SERVICENOW INC	15,779	268.52	4,236,977.08
SPLUNK INC	12,887	109.70	1,413,703.90
SQUARE INC - A	27,989	61.17	1,712,087.13
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	47.20	927,244.00
SYMANTEC CORP	53,148	23.31	1,238,879.88
SYNOPSYS INC	12,264	141.52	1,735,601.28
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	137.38	1,953,268.84
TWILIO INC - A	9,579	132.32	1,267,493.28
VERISIGN INC	9,194	203.53	1,871,254.82
VISA INC-CLASS A SHARES	148,232	181.77	26,944,130.64
VMWARE INC-CLASS A	6,787	145.43	987,033.41
WESTERN UNION CO	38,757	22.27	863,118.39
WIX.COM LTD	3,961	136.75	541,666.75
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	173.67	2,407,066.20
AMPHENOL CORPORATION	25,582	86.70	2,217,959.40
APPLE INC	392,086	209.19	82,020,470.34
ARISTA NETWORKS INC	4,324	226.23	978,218.52
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	69.73	464,820.18
CDW CORP/DE	12,482	118.06	1,473,624.92
CISCO SYSTEMS	366,517	47.32	17,343,584.44
COGNEX CORP	16,230	44.72	725,805.60
CORNING	66,228	27.40	1,814,647.20
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	51.20	711,168.00
F5 NETWORKS INC	5,350	127.87	684,104.50
FLEX LTD	40,465	9.81	396,961.65
FLIR SYSTEMS INC	11,686	49.16	574,483.76
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	13.75	1,541,443.75
HP INC	124,838	18.36	2,292,025.68
IPG PHOTONICS CORP	3,207	124.69	399,880.83
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	23.09	722,809.36
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	95.84	1,519,351.52
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	178.92	2,493,429.12
NETAPP INC	20,586	49.15	1,011,801.90
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	52.17	1,191,354.12

TE CONNECTIVITY LTD	28,434	90.94	2,585,787.96
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	37.29	768,994.38
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	59.33	1,398,823.41
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	29.31	490,004.58
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	200.60	922,760.00
AT&T INC	622,137	35.72	22,222,733.64
CENTURYLINK INC	83,301	11.66	971,289.66
SPRINT CORP	64,825	6.76	438,217.00
T-MOBILE US INC	28,273	77.61	2,194,267.53
VERIZON COMMUNICATIONS	352,577	58.18	20,512,929.86
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	33.75	688,432.50
AES CORP	52,646	15.29	804,957.34
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	53.51	1,030,388.56
AMEREN CORPORATION	21,002	78.49	1,648,446.98
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	93.05	3,854,317.10
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	128.75	1,991,891.25
ATMOS ENERGY CORP	9,385	110.96	1,041,359.60
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	28.15	1,204,594.80
CMS ENERGY CORP	24,527	64.48	1,581,500.96
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	90.85	2,497,829.90
DOMINION ENERGY INC	68,162	79.15	5,395,022.30
DTE ENERGY COMPANY	15,603	132.06	2,060,532.18
DUKE ENERGY CORP	62,154	93.97	5,840,611.38
EDISON INTL	30,299	73.18	2,217,280.82
ENERGY CORP	15,636	115.57	1,807,052.52
EVERGY INC	21,330	65.80	1,403,514.00
EVERSOURCE ENERGY	27,188	82.49	2,242,738.12
EXELON CORP	82,975	48.00	3,982,800.00
FIRSTENERGY CORP	45,526	46.84	2,132,437.84
NEXTERA ENERGY INC	40,857	224.12	9,156,870.84
NISOURCE INC	32,308	30.21	976,024.68
NRG ENERGY INC	23,078	37.21	858,732.38
OGE ENERGY CORP	15,686	43.41	680,929.26
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	95.92	903,182.72
PPL CORPORATION	59,613	29.69	1,769,909.97
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	61.39	2,655,363.06
SEMPRA ENERGY	23,257	144.00	3,349,008.00
SOUTHERN CO	88,512	60.11	5,320,456.32
UGI CORP	18,019	48.02	865,272.38
VISTRA ENERGY CORP	29,561	25.22	745,528.42
WEC ENERGY GROUP INC	26,996	97.65	2,636,159.40
XCEL ENERGY INC	44,029	65.82	2,897,988.78

	ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	30.95	2,721,185.90
	ANALOG DEVICES	31,611	109.19	3,451,605.09
	APPLIED MATERIALS	80,718	49.51	3,996,348.18
	BROADCOM INC	33,768	283.02	9,557,019.36
	INTEL CORP	381,705	48.92	18,673,008.60
	KLA CORP	13,856	150.65	2,087,406.40
	LAM RESEARCH CORP	12,864	221.60	2,850,662.40
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	24.03	1,315,330.11
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	55.43	1,298,336.89
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	86.52	1,794,770.88
	MICRON TECHNOLOGY	95,275	46.81	4,459,822.75
	NVIDIA CORP	49,363	168.76	8,330,499.88
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	101.85	2,554,194.30
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	17.86	642,888.56
	QORVO INC	10,609	72.37	767,773.33
	QUALCOMM	103,733	77.09	7,996,776.97
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	76.02	1,103,050.20
	TEXAS INSTRUMENTS	80,031	124.59	9,971,062.29
	XILINX INC	21,744	102.29	2,224,193.76
	アメリカドル 小計	25,759,072		2,125,921,456.77 (226,240,561,429)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	11.71	336,182.39
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	31.32	3,236,232.96
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	11.52	1,113,592.32
	ENBRIDGE	172,807	44.51	7,691,639.57
	ENCANA CORP	138,637	5.88	815,185.56
	HUSKY ENERGY INC	31,439	8.87	278,863.93
	IMPERIAL OIL	24,763	32.85	813,464.55
	INTER PIPELINE LTD	35,455	24.79	878,929.45
	KEYERA CORP	18,607	33.07	615,333.49
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	48.92	2,068,141.92
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	17.04	312,684.00
	SUNCOR ENERGY	134,430	38.37	5,158,079.10
	TC ENERGY CORP	79,239	68.68	5,442,134.52
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	12.88	257,149.20
	VERMILION ENERGY INC	10,067	19.22	193,487.74
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	84.91	1,822,083.69
	BARRICK GOLD CORP	149,092	26.30	3,921,119.60
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	57.52	755,755.28
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	8.69	494,461.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	133.54	2,237,863.32
	KINROSS GOLD CORP	107,615	6.96	749,000.40

KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	67.55	1,150,579.15
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.47	402,712.21
METHANEX CORP	7,099	42.82	303,979.18
NUTRIEN LTD	51,428	66.07	3,397,847.96
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.79	1,040,978.83
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	45.67	197,614.09
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	40.75	1,501,148.50
BOMBARDIER B	151,366	1.78	269,431.48
CAE INC	25,999	33.65	874,866.35
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	15.50	228,051.50
WSP GLOBAL INC	9,471	70.68	669,410.28
THOMSON REUTERS CORP	16,142	92.24	1,488,938.08
AIR CANADA	11,591	43.57	505,019.87
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	121.20	7,414,288.80
CP RAILWAY LIMITED	11,825	313.97	3,712,695.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	66.70	1,866,132.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	49.23	869,352.57
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	99.19	2,119,194.35
STARS GROUP INC/THE	20,487	20.86	427,358.82
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.85	453,720.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.79	927,073.13
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	134.65	728,321.85
DOLLARAMA INC	26,700	50.74	1,354,758.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	82.34	2,977,249.72
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	37.17	566,954.01
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	73.77	1,152,139.86
METRO INC	22,050	56.87	1,253,983.50
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	110.00	757,130.00
SAPUTO INC	20,412	40.32	823,011.84
AURORA CANNABIS INC	53,000	7.40	392,200.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	32.54	533,656.00
CRONOS GROUP INC	15,900	14.63	232,617.00
BANK MONTREAL	54,609	90.18	4,924,639.62
BANK NOVA SCOTIA	104,375	71.02	7,412,712.50
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	101.94	3,872,700.60
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	62.27	1,757,757.56
ROYAL BANK OF CANADA	122,426	99.38	12,166,695.88
TORONTO-DOMINION BANK	156,017	71.69	11,184,858.73
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	72,274	69.36	5,012,924.64
CI FINANCIAL CORP	18,671	18.71	349,334.41
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.12	277,582.20
ONEX CORP	6,603	77.85	514,043.55

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	588.66	1,356,861.30
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	28.27	672,486.76
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	55.60	457,588.00
	INTACT FINANCIAL CORP	11,102	129.49	1,437,597.98
	MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	21.91	3,691,221.52
	POWER CORP OF CANADA	29,774	28.18	839,031.32
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	28.37	588,393.80
	SUN LIFE FINANCIAL INC	48,943	54.86	2,685,012.98
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	22.39	279,091.35
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	9.15	360,510.00
	CGI INC - CL A	21,192	104.50	2,214,564.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,298.96	2,209,530.96
	OPEN TEXT CORP	24,643	53.36	1,314,950.48
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,392	511.33	4,291,081.36
	BCE INC	12,539	63.22	792,715.58
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	65.41	2,099,333.95
	TELUS CORP	16,454	48.66	800,651.64
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	18.53	452,039.35
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	47.52	249,052.32
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.73	399,848.52
	EMERA INC	20,611	58.04	1,196,262.44
	FORTIS INC	38,447	56.08	2,156,107.76
	HYDRO ONE LTD	32,299	24.79	800,692.21
	カナダドル 小計	3,441,476		158,601,674.04 (12,756,332,643)
ユーロ	ENI	217,599	13.67	2,974,578.33
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	12.91	514,682.97
	NESTE OIL OYJ	36,438	29.15	1,062,167.70
	OMV AG	12,139	46.25	561,428.75
	REPSOL SA	129,100	13.56	1,750,596.00
	TENARIS SA	40,648	9.78	397,781.32
	TOTAL SA	204,013	45.40	9,263,210.26
	VOPAK	6,360	43.14	274,370.40
	AIR LIQUIDE	36,297	125.90	4,569,792.30
	AKZO NOBEL	19,742	81.14	1,601,865.88
	ARCELORMITTAL	53,985	13.44	725,558.40
	ARKEMA	5,335	80.58	429,894.30
	BASF SE	77,211	60.21	4,648,874.31
	COVESTRO AG	15,098	40.56	612,374.88
	CRH PLC	71,124	30.86	2,194,886.64
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	23.07	310,383.78
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	31.70	182,655.40

HEIDELBERGCEMENT AG	11,833	62.80	743,112.40
IMERYSA SA	3,000	35.98	107,940.00
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	116.35	1,772,475.90
LANXESS	7,293	54.72	399,072.96
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	27.42	536,472.30
SOLVAY SA	6,906	91.10	629,136.60
STORA ENSO OYJ R	47,237	10.27	485,123.99
SYMRISE AG	11,581	85.98	995,734.38
THYSSEN KRUPP	33,044	10.99	363,318.78
UMICORE	17,605	31.00	545,755.00
UPM KYMMENE OYJ	43,990	24.70	1,086,553.00
VOESTALPINE AG	8,140	20.86	169,800.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	34.77	754,335.15
AIRBUS SE	49,825	126.20	6,287,915.00
ALSTOM	13,816	38.99	538,685.84
ANDRITZ AG	5,242	33.02	173,090.84
BOUYGUES ORD	19,381	33.55	650,232.55
BRENTAG AG	11,626	44.37	515,845.62
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	9.36	871,095.46
DASSAULT AVIATION SA	213	1,324.00	282,012.00
EIFFAGE	6,079	94.08	571,912.32
FERROVIAL SA	39,067	26.20	1,023,555.40
GEA GROUP AG	13,382	23.98	320,900.36
HOCHTIEF AG	2,222	99.30	220,644.60
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	41.50	490,239.50
KION GROUP AG	5,887	45.00	264,915.00
KNORR-BREMSE AG	4,123	85.29	351,650.67
KONE OYJ-B	30,120	53.90	1,623,468.00
LEGRAND SA	21,794	64.34	1,402,225.96
LEONARDO SPA	35,425	11.25	398,531.25
METSO OYJ	9,561	34.18	326,794.98
MTU AERO ENGINES AG	4,753	253.40	1,204,410.20
PRYSMIAN SPA	21,155	20.68	437,485.40
SAFRAN SA	27,984	131.30	3,674,299.20
SAINT-GOBAIN	40,731	32.84	1,337,606.04
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,063	74.74	3,442,748.62
SIEMENS	65,307	91.20	5,955,998.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.47	218,200.22
THALES SA	9,665	110.00	1,063,150.00
VINCI S.A.	43,091	100.70	4,339,263.70
WARTSILA OYJ	34,386	10.79	371,196.87
BUREAU VERITAS SA	25,073	22.00	551,606.00

EDENRED	18,941	44.20	837,192.20
RANDSTAD NV	9,588	43.20	414,201.60
SOCIETE BIC SA	2,424	58.10	140,834.40
TELEPERFORMANCE	5,057	202.40	1,023,536.80
WOLTERS KLUWER	22,886	66.46	1,521,003.56
ADP	2,382	160.90	383,263.80
AENA SME SA	5,610	165.85	930,418.50
ATLANTIA SPA	42,039	24.03	1,010,197.17
BOLLORE	61,805	3.81	235,847.88
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	13.88	323,131.72
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	29.94	2,544,905.77
FRAPORT AG	3,561	77.32	275,336.52
GETLINK	36,478	12.90	470,566.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	61.09	1,768,311.14
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	50.20	250,548.20
CONTINENTAL AG	9,928	111.98	1,111,737.44
DAIMLER AG	77,754	43.97	3,418,843.38
FAURECIA	5,945	42.12	250,403.40
FERRARI NV	9,947	145.55	1,447,785.85
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	12.22	1,177,751.38
MICHELIN	14,695	96.96	1,424,827.20
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	24.83	255,550.36
PEUGEOT SA	52,883	20.71	1,095,206.93
PIRELLI & C SPA	39,097	4.97	194,429.38
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	58.28	817,551.84
RENAULT SA	17,362	53.70	932,339.40
VALEO SA	19,350	26.90	520,515.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	147.96	2,367,212.04
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	150.90	391,434.60
ADIDAS AG	15,411	273.05	4,207,973.55
ESSILORLUXOTTICA	24,247	135.45	3,284,256.15
HERMES INTERNATIONAL	2,600	635.40	1,652,040.00
HUGO BOSS AG	4,852	50.38	244,443.76
KERING	6,332	446.25	2,825,655.00
LVMH	23,706	368.50	8,735,661.00
MONCLER SPA	15,736	35.06	551,704.16
PUMA SE	7,720	67.70	522,644.00
SEB SA	2,075	141.80	294,235.00
ACCOR	17,931	39.92	715,805.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	77.36	552,582.48
SODEXO	8,135	105.40	857,429.00
AXEL SPRINGER SE-TEND	3,827	62.50	239,187.50

EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	16.10	192,813.60
JC DECAUX SA	4,674	24.14	112,830.36
PUBLICIS GROUPE	17,601	43.59	767,227.59
RTL GROUP	3,513	43.00	151,059.00
SES	31,369	13.95	437,597.55
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.88	219,312.24
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	72.54	495,448.20
VIVENDI	77,307	25.33	1,958,186.31
DELIVERY HERO SE	8,671	44.79	388,374.09
INDITEX	93,820	27.80	2,608,196.00
ZALANDO SE	9,155	44.94	411,425.70
CARREFOUR	53,759	15.70	844,285.09
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	41.00	151,167.00
COLRUYT SA	4,160	48.05	199,888.00
JERONIMO MARTINS	20,234	15.88	321,315.92
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	21.59	2,120,872.06
METRO AG	13,712	14.19	194,573.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,052	85.67	5,573,004.84
DANONE (GROUPE)	52,307	82.00	4,289,174.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.71	370,401.46
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	91.80	982,351.80
HEINEKEN NV	22,649	98.68	2,235,003.32
KERRY GROUP PLC-A	13,146	109.40	1,438,172.40
PERNOD-RICARD	18,169	176.55	3,207,736.95
REMY COINTREAU	1,575	139.60	219,870.00
BEIERSDORF AG	9,190	116.35	1,069,256.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	85.10	733,391.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	92.76	1,459,671.36
LOREAL	21,584	254.80	5,499,603.20
UNILEVER NV	123,171	57.56	7,089,722.76
BIOMERIEUX	3,246	72.50	235,335.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	108.30	371,469.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	61.40	1,104,954.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	44.66	1,641,304.75
KONINKLIJKE PHILIPS	79,182	42.98	3,403,638.27
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	180.40	585,578.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.90	448,750.00
BAYER	79,624	67.51	5,375,416.24
EUROFINS SCIENTIFIC	971	417.20	405,101.20
GRIFOLS SA	27,685	28.47	788,191.95
IPSEN	2,722	96.20	261,856.40
MERCK KGAA	10,480	97.98	1,026,830.40

ORION OYJ-CLASS B	7,975	34.16	272,426.00
QIAGEN N.V.	21,801	31.29	682,153.29
RECORDATI SPA	7,493	40.52	303,616.36
SANOFI	96,027	81.10	7,787,789.70
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	142.40	427,769.60
UCB (GROUPE)	10,465	67.32	704,503.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.08	533,679.12
AIB GROUP PLC	70,200	2.34	164,689.20
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	4.31	2,398,584.37
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.75	333,461.04
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	3.40	4,655,253.25
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	3.54	297,360.00
BANKIA SA	110,053	1.58	173,883.74
BANKINTER SA	58,881	5.23	308,418.67
BNP PARIBAS	94,302	41.25	3,890,429.01
CAIXABANK	286,347	2.05	587,584.04
COMMERZBANK AG	80,494	5.25	423,156.95
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.38	963,616.92
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	29.03	800,066.80
FINECOBANK SPA	53,120	9.57	508,677.12
ING GROEP NV-CVA	332,029	8.76	2,911,230.27
INTESA SANPAOLO	1,286,795	2.02	2,608,976.86
KBC GROEP NV	21,492	53.10	1,141,225.20
MEDIOBANCA	53,990	9.26	500,055.38
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	19.71	246,240.35
SOCIETE GENERALE	63,719	23.36	1,488,475.84
UNICREDIT SPA	172,440	10.33	1,781,305.20
AMUNDI SA	4,764	59.00	281,076.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.74	1,086,513.75
DEUTSCHE BOERSE	15,674	137.95	2,162,228.30
EURAZEO SA	3,357	60.35	202,594.95
EXOR NV	10,345	62.26	644,079.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	85.68	535,242.96
NATIXIS	69,996	3.50	244,986.00
WENDEL	2,023	127.60	258,134.80
AEGON	166,267	3.44	572,291.01
AGEAS	16,065	49.15	789,594.75
ALLIANZ SE-REG	36,222	201.00	7,280,622.00
ASSICURAZIONI GENERALI	89,649	16.83	1,509,240.91
AXA	165,661	21.02	3,482,194.22
CNP ASSURANCES	11,830	16.56	195,904.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	147.80	695,546.80

MAPFRE SA	90,939	2.39	218,162.66
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	221.70	2,807,830.50
NN GROUP NV	27,631	30.09	831,416.79
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.09	464,493.15
SAMPO OYJ-A SHS	38,075	35.94	1,368,415.50
SCOR SE	13,354	35.79	477,939.66
AROUNDTOWN SA	79,006	7.30	576,743.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	31.67	918,715.03
VONOVIA SE	43,528	44.25	1,926,114.00
ADYEN NV	884	652.80	577,075.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	67.40	2,460,774.00
ATOS SE	7,634	68.76	524,913.84
CAPGEMINI SA	13,238	108.00	1,429,704.00
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	129.30	1,461,090.00
SAP SE	83,843	109.22	9,157,332.46
WIRECARD AG	9,864	151.05	1,489,957.20
WORLDLINE SA	7,022	61.95	435,012.90
INGENICO GROUP	4,681	89.60	419,417.60
NOKIA OYJ	489,813	4.44	2,177,463.69
1&1 DRILLISCH AG	3,773	25.04	94,475.92
CELLNEX TELECOM SA	16,559	37.59	622,452.81
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	15.19	4,246,263.86
ELISA A	11,722	46.25	542,142.50
ILIAD SA	2,053	84.10	172,657.30
KPN (KON.)	308,450	2.90	895,430.35
ORANGE	170,925	13.78	2,356,201.12
PROXIMUS	13,141	26.48	347,973.68
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.49	419,967.11
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.47	221,909.38
TELEFONICA	400,024	6.43	2,574,954.48
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.29	153,488.36
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	28.93	275,211.09
E.ON SE	183,255	8.52	1,561,515.85
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	11.18	556,048.48
ENAGAS	18,299	20.08	367,443.92
ENDESA	24,774	23.85	590,859.90
ENEL	694,781	6.73	4,681,434.37
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.53	833,008.80
ENGIE	156,560	13.85	2,169,138.80
FORTUM OYJ	38,328	20.89	800,671.92
IBERDROLA SA	512,842	9.49	4,870,973.31
INNOGY SE	11,000	45.78	503,580.00

	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	23.80	550,494.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	18.30	725,265.60
	RWE STAMM	47,044	27.11	1,275,362.84
	SNAM SPA	163,694	4.64	759,540.16
	SUEZ	28,043	14.29	400,734.47
	TERNA SPA	130,230	5.82	758,459.52
	UNIPER SE	14,751	28.66	422,763.66
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	22.74	1,040,173.08
	VERBUND AG	7,463	55.25	412,330.75
	ASML HOLDING NV	36,326	204.70	7,435,932.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	16.04	1,720,354.16
	STMICROELECTRONICS	57,598	16.31	939,423.38
	ユーロ 小計	16,451,299		326,038,559.79 (38,273,666,533)
イギリスポンド	BP PLC	1,735,604	5.07	8,799,512.28
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	372,635	22.92	8,542,657.37
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	319,578	22.80	7,286,378.40
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	3.57	193,050.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	18.18	1,589,277.42
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.60	308,648.44
	BHP GROUP PLC	180,556	18.06	3,261,563.58
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	47.02	470,152.98
	EVRAZ PLC	43,000	4.99	214,699.00
	FRESNILLO PLC	17,743	7.67	136,124.29
	GLENCORE PLC	941,686	2.42	2,286,884.45
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	30.80	518,918.40
	MONDI PLC	42,009	15.97	671,093.77
	RIO TINTO PLC REG	96,995	42.07	4,081,064.62
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	22.93	963,541.53
	BAE SYSTEMS PLC	274,735	5.57	1,530,273.95
	BUNZL PLC	27,712	20.50	568,096.00
	DCC PLC	9,127	71.24	650,207.48
	FERGUSON PLC	19,208	63.64	1,222,397.12
	MEGGITT PLC	66,268	6.31	418,548.68
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.85	757,741.53
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.69	1,146,002.25
	SMITHS GROUP PLC	37,146	16.79	623,681.34
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	80.25	503,729.25
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	14.44	268,381.84
	EXPERIAN PLC	77,938	26.05	2,030,284.90
	G4S PLC	132,555	1.77	234,754.90
	INTERTEK GROUP PLC	12,722	56.14	714,213.08

RELX PLC	163,442	19.98	3,265,571.16
RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.56	720,554.14
EASYJET PLC	11,633	9.28	107,954.24
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.99	578,428.12
BURBERRY GROUP PLC	35,328	22.24	785,694.72
PERSIMMON PLC	26,389	18.66	492,550.68
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.48	400,752.67
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	38.34	406,365.66
CARNIVAL PLC	13,721	34.70	476,118.70
COMPASS GROUP PLC	136,301	21.37	2,912,752.37
GVC HOLDINGS PLC	42,500	6.74	286,450.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	51.50	826,111.50
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.51	293,917.47
TUI AG-DI	37,945	8.46	321,090.59
WHITBREAD PLC	11,623	44.53	517,572.19
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.10	408,211.02
INFORMA PLC	100,899	8.64	871,767.36
ITV PLC	295,435	1.16	343,886.34
PEARSON	66,305	8.46	561,470.74
WPP PLC	113,065	9.65	1,091,755.64
KINGFISHER PLC	170,994	1.95	333,438.30
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.93	261,192.85
NEXT PLC	11,202	60.00	672,120.00
OCADO GROUP PLC	38,762	13.32	516,309.84
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.85	387,643.00
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.99	296,595.83
TESCO	856,393	2.27	1,948,294.07
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	23.66	682,472.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	195,779	29.04	5,686,401.05
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	28.36	509,345.60
DIAGEO	204,601	36.10	7,386,096.10
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	21.47	1,787,270.15
RECKITT BENCKISER PLC	60,485	64.99	3,930,920.15
UNILEVER PLC	94,764	53.07	5,029,125.48
NMC HEALTH PLC	9,509	25.96	246,853.64
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	19.78	1,484,508.78
ASTRAZENECA	111,905	73.91	8,270,898.55
GLAXOSMITHKLINE	425,577	17.45	7,427,169.80
BARCLAYS	1,471,691	1.37	2,021,514.75
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,725,998	6.04	10,426,753.91
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.49	2,960,189.65
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	1.84	727,961.92

	STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.43	1,502,461.24
	3I GROUP PLC	79,251	11.32	897,517.57
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	19.15	517,452.15
	INVESTEC PLC	54,280	4.29	233,132.60
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	71.36	1,876,482.56
	SCHRODERS PLC	8,614	27.90	240,330.60
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.24	413,848.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.48	480,244.66
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.95	340,542.25
	AVIVA PIC	348,023	3.55	1,236,873.74
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.79	318,288.28
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.24	1,098,611.38
	PRUDENTIAL	217,306	13.97	3,036,851.35
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.22	451,901.43
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	11.06	321,691.42
	SAGE GROUP PLC	89,321	7.11	635,250.95
	HALMA PLC	32,374	19.96	646,346.91
	BT GROUP PLC	730,298	1.66	1,215,069.81
	VODAFONE GROUP PLC	2,283,635	1.56	3,584,393.49
	CENTRICA PLC	440,558	0.69	307,861.93
	NATIONAL GRID PLC	291,880	8.66	2,529,723.96
	SEVERN TRENT PLC	18,112	20.55	372,201.60
	SSE PLC	93,277	11.69	1,090,408.13
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.10	477,126.78
	イギリスポンド 小計	25,433,297		152,478,543.07 (19,857,280,664)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.38	319,862.23
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	580.00	389,760.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,667.00	2,168,271.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	46.52	1,876,337.68
	SIKA AG-BR	10,500	141.00	1,480,500.00
	ABB LTD	153,407	18.63	2,857,972.41
	GEBERIT AG-REG	3,021	451.10	1,362,773.10
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	225.00	332,775.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	227.10	855,712.80
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	52.90	699,549.60
	SGS SA	437	2,465.00	1,077,205.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	144.25	730,914.75
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	75.88	3,395,174.72
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	265.30	658,739.90
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.00	196,900.00
	DUFREY AG-REG	3,825	79.80	305,235.00

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	2,034.00	325,440.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,600.00	644,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,215.00	750,360.00
	NESTLE SA - REGISTERED	261,093	112.00	29,242,416.00
	ALCON INC	35,606	59.59	2,121,761.54
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	230.10	1,174,430.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	799.00	715,105.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	353.90	2,302,827.30
	NOVARTIS	183,180	87.73	16,070,381.40
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,906	270.95	16,231,530.70
	VIFOR PHARMA AG	3,601	156.50	563,556.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	11.64	2,547,553.68
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	39.29	832,044.33
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	72.75	247,131.75
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	810.20	1,302,801.60
	UBS GROUP AG	329,974	10.30	3,398,732.20
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	165.60	642,031.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	470.90	1,388,684.10
	SWISS RE LTD	26,239	97.76	2,565,124.64
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,930	357.90	4,627,647.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	98.85	620,481.45
	TEMENOS AG - REG	5,252	169.95	892,577.40
	SWISSCOM	2,064	491.20	1,013,836.80
	スイスフラン 小計	1,495,880		108,928,938.18 (11,811,164,766)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	301.00	4,271,491.00
	BOLIDEN AB	23,903	217.45	5,197,707.35
	ALFA LAVAL AB	25,639	177.90	4,561,178.10
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	211.10	18,150,378.00
	ATLAS COPCO A	59,675	295.40	17,627,995.00
	ATLAS COPCO B	36,538	264.60	9,667,954.80
	EPIROC AB-A	53,833	100.00	5,383,300.00
	EPIROC AB-B	29,972	95.36	2,858,129.92
	SANDVIK AB	100,730	142.85	14,389,280.50
	SKANSKA B	28,530	192.30	5,486,319.00
	SKF AB-B	28,335	157.15	4,452,845.25
	VOLVO B	125,906	135.55	17,066,558.30
	SECURITAS B	22,844	147.45	3,368,347.80
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	214.20	3,892,014.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	76.92	2,977,727.04
	HENNES & MAURITZ B	69,119	185.54	12,824,339.26
	ICA GRUPPEN AB	7,959	485.00	3,860,115.00

	SWEDISH MATCH AB	15,149	398.40	6,035,361.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	307.20	16,000,512.00	
	NORDEA BANK ABP	254,073	60.64	15,406,986.72	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	83.26	11,548,994.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	85.48	11,658,275.28	
	SWEDBANK AB-A	80,216	124.50	9,986,892.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	208.90	2,672,248.80	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	463.20	18,730,881.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	272.60	4,935,150.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	373.60	2,719,808.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	75.66	20,334,003.30	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	434.20	9,337,036.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	499.20	3,092,044.80	
	TELE2 AB-B SHS	38,012	141.35	5,372,996.20	
	TELIA CO AB	235,437	43.48	10,236,800.76	
	スウェーデンクローナ 小計	2,095,171		284,103,673.18 (3,105,253,147)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	240.00	2,474,640.00	
	EQUINOR ASA	80,907	155.10	12,548,675.70	
	NORSK HYDRO	106,150	29.65	3,147,347.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	399.00	5,374,530.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	259.40	1,808,277.40	
	MOWI ASA	40,968	218.00	8,931,024.00	
	ORKLA	69,804	82.54	5,761,622.16	
	DNB ASA	80,217	146.00	11,711,682.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	174.70	3,244,877.80	
	TELENOR ASA	60,821	187.90	11,428,265.90	
	ノルウェークローネ 小計	488,193		66,430,942.46 (783,220,811)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	581.00	5,274,899.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	294.70	5,212,358.90	
	VESTAS WIND SYSYEMS	15,201	499.60	7,594,419.60	
	ISS A/S	14,253	170.95	2,436,550.35	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	6,925.00	2,070,575.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,370.00	3,743,960.00	
	DSV A/S	18,714	686.80	12,852,775.20	
	PANDORA A/S	8,431	293.40	2,473,655.40	
	CARLSBERG AS-B	9,692	1,024.00	9,924,608.00	
	COLOPLAST-B	10,223	816.20	8,344,012.60	
	DEMANT A/S	7,420	200.00	1,484,000.00	
	GENMAB A/S	5,595	1,440.00	8,056,800.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	245.50	1,195,830.50	

	NOVO NORDISK A/S-B	150,997	362.15	54,683,563.55	
	DANSKE BANK A/S	59,378	86.04	5,108,883.12	
	TRYG A/S	9,828	205.00	2,014,740.00	
	ORSTED A/S	15,908	668.80	10,639,270.40	
	デンマーククローネ 小計	358,084		143,110,901.62 (2,252,565,591)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	24.02	495,508.58	
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.90	819,588.90	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.38	1,222,091.10	
	SANTOS	156,437	7.17	1,121,653.29	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.46	262,153.98	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	31.19	2,607,172.10	
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	12.01	415,497.96	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.16	368,189.28	
	BHP GROUP LTD	251,513	36.32	9,134,952.16	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.65	623,999.20	
	BORAL LIMITED	81,732	4.32	353,082.24	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	8.00	1,077,408.00	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.07	462,338.93	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.40	836,931.20	
	NEWCREST MINING LIMITED	66,006	37.96	2,505,587.76	
	ORICA LTD	29,211	21.31	622,486.41	
	RIO TINTO LTD	32,522	88.41	2,875,270.02	
	SOUTH32 LTD	408,172	2.68	1,093,900.96	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	29.37	270,791.40	
	BRAMBLES LTD	129,297	11.27	1,457,177.19	
	SEEK LTD	26,358	20.64	544,029.12	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.91	942,568.17	
	TRANSURBAN GROUP	229,164	14.91	3,416,835.24	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	28.80	1,519,257.60	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	11.99	363,632.72	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	48.07	156,852.41	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.66	777,502.36	
	REA GROUP LTD	3,593	105.03	377,372.79	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.40	198,717.20	
	WESFARMERS LTD	97,071	38.54	3,741,116.34	
COLES GROUP LTD	93,277	14.22	1,326,398.94		
WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	36.68	3,952,306.68		
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.94	504,662.20		
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	18.67	1,089,861.25		
COCHLEAR LIMITED	4,811	215.92	1,038,791.12		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	64.38	788,526.24		

	SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	29.29	1,141,987.81	
	CSL LIMITED	38,683	236.45	9,146,595.35	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	242,083	26.58	6,434,566.14	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	8.99	320,044.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.74	455,741.16	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,067	78.69	11,887,462.23	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	27.32	6,495,630.52	
	WESTPAC BANKING	294,403	28.25	8,316,884.75	
	AMP LTD	244,230	1.65	402,979.50	
	ASX LTD	15,814	85.51	1,352,255.14	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	6.43	283,357.24	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	122.94	3,296,881.98	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	51.60	563,059.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	8.01	1,676,933.55	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.40	729,340.80	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.14	1,372,949.02	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.58	1,397,667.18	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	15.02	666,527.52	
	TELSTRA CORP	342,339	3.57	1,222,150.23	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.21	195,459.75	
	AGL ENERGY LTD	51,344	19.00	975,536.00	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.78	214,009.40	
	オーストラリアドル 小計	5,931,661		107,912,229.51 (7,806,370,682)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	4.60	352,562.40	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.71	824,864.50	
	A2 MILK CO LTD	66,854	14.72	984,090.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	16.85	766,809.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.40	486,647.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.54	660,338.46	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.38	594,726.72	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,670,040.56 (316,301,847)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	68.90	16,122,324.40	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	13.68	2,229,840.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	56.75	6,753,250.00	
	MTR CORP	133,000	47.35	6,297,550.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	21.25	1,455,625.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	51.80	9,686,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.22	821,184.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	36.85	7,473,180.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.23	806,540.00	

	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.68	1,013,760.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	16.36	2,303,488.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	37.80	2,419,200.00	
	WH GROUP LTD	829,500	6.82	5,657,190.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	20.05	2,188,658.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	27.10	8,401,000.00	
	HANG SENG BANK	68,000	171.70	11,675,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	248.00	25,345,600.00	
	AIA GROUP LTD	1,031,200	79.40	81,877,280.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	56.20	12,138,975.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.88	3,266,240.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	38.70	4,846,323.60	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	32.55	1,920,450.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	26.45	1,706,025.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.60	5,209,900.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.64	3,671,256.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	118.50	16,175,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	77.85	3,152,925.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	27.00	2,597,400.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	17.78	1,617,980.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	46.30	4,398,500.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	47.15	3,064,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.30	1,535,100.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	52.90	2,645,000.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	81.85	11,540,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.52	13,929,262.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	52.55	5,833,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	90.20	2,137,740.00	
	香港ドル 小計	7,608,384		293,914,846.28 (3,991,363,612)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.89	661,447.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.15	230,050.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.96	431,640.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.94	187,906.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.52	419,580.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	8.86	383,930.38	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.80	245,760.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.89	378,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	1.96	249,116.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.72	304,128.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.26	108,940.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.84	685,824.00	

	DBS GROUP	156,300	24.54	3,835,602.00	
	OCBC BANK	264,200	10.71	2,829,582.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,300	25.10	2,592,830.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.35	520,205.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.49	780,015.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.35	291,720.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.33	348,175.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.94	383,958.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.20	2,135,817.60	
	シンガポールドル 小計	3,530,276		18,004,475.98 (1,383,463,934)	
イスラエルシ ケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	15.90	1,077,320.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	573.50	1,230,731.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	26.58	2,613,079.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.05	3,382,752.75	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	14.28	1,420,860.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	81.25	1,015,868.75	
	AZRIELI GROUP	4,323	254.60	1,100,635.80	
	NICE LTD	4,894	541.00	2,647,654.00	
	イスラエルシケル 小計	430,087		14,488,902.50 (437,130,188)	
	合 計	93,589,146		329,014,675,847 (329,014,675,847)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	102,205	1,108,924.25	
		LENDLEASE GROUP	44,009	737,150.75	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	757,519.80	
		オーストラリアドル 小計	236,074	2,603,594.80 (188,344,047)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,658,160.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,762,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,420,660.00 (87,192,562)	
		投資信託受益証券合計	831,574	275,536,609 (275,536,609)	
投資証券	アメリカド ル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	688,348.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,497,518.26	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,711	9,090,990.77	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,031,441.21	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,536,205.28	
	BOSTON PROPERTIES	13,590	1,762,894.80	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	966,328.48	
	CROWN CASTLE INTL CORP	35,498	5,291,686.86	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,255,615.10	
	DUKE REALTY CORP	29,929	1,009,804.46	
	EQUINIX INC	7,183	4,011,633.67	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	1,003,800.15	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,698,633.46	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,851,908.31	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,352,667.52	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	801,857.00	
	HCP INC	41,014	1,476,093.86	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,106,365.06	
	INVITATION HOMES INC	38,000	1,103,520.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,669	812,103.48	
	KIMCO REALTY CORP	35,407	666,359.74	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	622,546.52	
	MACERICH CO/THE	10,128	292,699.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,315,966.35	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	818,017.76	
	PROLOGIS INC	53,238	4,544,928.06	
	PUBLIC STORAGE	13,426	3,545,403.82	
	REALTY INCOME CORP	27,116	2,074,102.84	
	REGENCY CENTERS CORP	14,271	948,736.08	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	2,522,076.48	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,938	3,894,590.70	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	651,813.60	
	SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,109,831.85	
	UDR INC	24,799	1,207,711.30	
	VENTAS INC	30,413	2,281,583.26	
	VEREIT INC	77,798	770,978.18	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	946,792.80	
	WELLTOWER INC	34,628	3,201,704.88	
	WP CAREY INC	14,644	1,341,390.40	
	アメリカドル 小計	1,014,528	75,106,650.35 (7,992,849,730)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	215,763.10	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	415,441.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	180,135.69	

カナダドル 小計		30,576	811,340.59 (65,256,123)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	346,350.40
	GECINA SA	4,459	634,515.70
	ICADE	2,845	230,018.25
	KLEPIERRE	17,225	478,855.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,406,944.80
ユーロ 小計		39,995	3,096,684.15 (363,519,752)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	410,411.55
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	453,879.60
	SEGRO PLC	94,451	748,996.43
イギリスポンド 小計		232,415	1,613,287.58 (210,098,441)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,202,470.20
	GOODMAN GROUP	140,271	1,993,250.91
	GPT GROUP	167,884	1,064,384.56
	MIRVAC GROUP	306,089	961,119.46
	SCENTRE GROUP	486,663	1,932,052.11
	STOCKLAND	207,412	925,057.52
	VICINITY CENTERS	291,115	742,343.25
オーストラリアドル 小計		1,693,524	8,820,678.01 (638,087,847)
香港ドル	LINK REIT	179,500	16,433,225.00
香港ドル 小計		179,500	16,433,225.00 (223,163,195)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	632,000.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	524,880.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	538,807.00
	SUNTEC REIT	173,000	335,620.00
シンガポールドル 小計		813,800	2,031,307.00 (156,085,629)
投資証券合計		4,004,338	9,649,060,717 (9,649,060,717)
合計			9,924,597,326 (9,924,597,326)

(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	96.6%			66.7%
	投資証券 39銘柄			3.4%	2.4%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.1%			11.3%
	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%			5.9%
	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%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	90.4%			2.3%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			7.4%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 37銘柄	92.8%			1.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.2%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	89.9%			0.4%
	投資証券 4銘柄			10.1%	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。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,717,995,243
投資証券	113,688,327,020
派生商品評価勘定	243,319,020
未収入金	1,910,547,464
未収配当金	1,322,886,119
差入委託証拠金	59,251,500
流動資産合計	118,942,326,366
資産合計	118,942,326,366
負債の部	
流動負債	
前受金	243,319,020
未払金	32,684,688
未払解約金	1,792,504,305
未払利息	3,829
その他未払費用	3
流動負債合計	2,068,511,845
負債合計	2,068,511,845
純資産の部	
元本等	
元本	56,676,784,641
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,197,029,880
元本等合計	116,873,814,521
純資産合計	116,873,814,521
負債純資産合計	118,942,326,366

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 9月 5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	(1) 受取配当金

	2019年 9月 5日現在
	<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 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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,676,784,641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 2.0621円 (1万口当たり純資産額) (20,621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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	63,794,633,470円
期中追加設定元本額	9,037,136,681円

区分	2019年 9月 5日現在
期中一部解約元本額	16,154,985,510円
期末元本額	56,676,784,641円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,675,972,638円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,579,642円
SMT J-REITインデックス・オープン	11,877,462,766円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,832,784,271円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,184,162,683円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,506,130,796円
分散投資コア戦略ファンドA	2,102,788,062円
分散投資コア戦略ファンドS	3,364,174,759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	32,115,596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	2,031,455円
グローバル経済コア	344,638,838円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	4,690,484円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	301,801,141円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	37,029,074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）	955,698,582円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	945,441,060円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	400,326,168円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	488,386,850円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		16,355,386,699
合計		16,355,386,699

(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 9月 5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	不動産投信指数先物取引 買建				
		2,833,369,980	-	3,076,689,000	243,319,020
合計		2,833,369,980	-	3,076,689,000	243,319,020

(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	1,097	126,374,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	1,549	186,809,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,551	2,396,925,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	12,677	1,410,950,100	
	森ヒルズリート投資法人	12,296	2,037,447,200	
	産業ファンド投資法人	13,150	1,976,445,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,895	3,423,670,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,651	1,360,794,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,355	2,800,665,000	
	G L P 投資法人	26,619	3,564,284,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,450	1,535,250,000	
	日本プロロジスリート投資法人	15,355	4,429,917,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,626	902,430,000	
	O n e リート投資法人	1,666	507,297,000	
	イオンリート投資法人	11,535	1,605,672,000	
	ヒューリックリート投資法人	8,687	1,629,681,200	
	日本リート投資法人	3,471	1,518,562,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	68,662	1,367,060,420	
	日本ヘルスケア投資法人	518	94,017,000	
	積水ハウス・リート投資法人	31,249	2,853,033,700	
トーセイ・リート投資法人	1,965	254,860,500		
ケネディクス商業リート投資法人	3,917	1,121,828,800		

ヘルスケア&メディカル投資法人	2,280	309,396,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,140	266,430,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,330	6,236,043,000	
いちごホテルリート投資法人	1,771	223,854,400	
ラサールロジポート投資法人	8,869	1,309,064,400	
スターアジア不動産投資法人	3,547	401,875,100	
マリモ地方創生リート投資法人	919	110,555,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,632	1,126,496,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,816	159,444,800	
さくら総合リート投資法人	2,312	220,102,400	
投資法人みらい	11,593	663,119,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,508	348,361,200	
三菱地所物流リート投資法人	1,707	541,972,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,500	192,600,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,551	205,197,300	
タカラレーベン不動産投資法人	3,033	344,852,100	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,653	179,846,400	
日本ビルファンド投資法人	10,349	8,041,173,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,687	7,651,892,000	
日本リートールファンド投資法人	20,199	4,280,168,100	
オリックス不動産投資法人	21,295	4,897,850,000	
日本プライムリアルティ投資法人	6,765	3,311,467,500	
プレミア投資法人	9,653	1,469,186,600	
東急リアル・エステート投資法人	7,165	1,455,928,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,421	1,129,476,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,997	4,844,994,300	
森トラスト総合リート投資法人	7,638	1,523,017,200	
インヴィンシブル投資法人	46,880	3,056,576,000	
フロンティア不動産投資法人	3,796	1,725,282,000	
平和不動産リート投資法人	6,655	895,763,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,983	1,912,643,700	
福岡リート投資法人	5,527	992,096,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,306	2,694,390,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,276	872,290,400	
大和証券オフィス投資法人	2,468	2,063,248,000	
阪急阪神リート投資法人	4,827	758,321,700	
スターツプロシード投資法人	1,664	327,475,200	
大和ハウスリート投資法人	14,409	4,207,428,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,429	2,795,634,800	
日本賃貸住宅投資法人	12,021	1,208,110,500	
ジャパンエクセレント投資法人	9,570	1,630,728,000	
合計	615,082	113,688,327,020	

(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 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	416,121,659
コール・ローン	45,026,637
投資証券	78,508,982,325
派生商品評価勘定	186,700
未収入金	5,964,900
未収配当金	54,626,469
流動資産合計	79,030,908,690
資産合計	79,030,908,690
負債の部	
流動負債	
未払金	251,322,511
未払解約金	3,089,125
未払利息	100
流動負債合計	254,411,736
負債合計	254,411,736
純資産の部	
元本等	
元本	40,906,320,235
剰余金	
剰余金又は欠損金()	37,870,176,719
元本等合計	78,776,496,954
純資産合計	78,776,496,954
負債純資産合計	79,030,908,690

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2019年 9月 5日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>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 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,906,320,235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) 1.9258円 (19,258円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

	2019年 9月 5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 9月 5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 9月 5日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 9月 6日
期首元本額	37,634,708,275円
期中追加設定元本額	8,167,163,153円
期中一部解約元本額	4,895,551,193円
期末元本額	40,906,320,235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）	1,639,423,527円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,417,236円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,113,357,127円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,056,160,772円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,055,767,143円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,449,414,823円
分散投資コア戦略ファンドA	946,403,436円
分散投資コア戦略ファンドS	2,152,762,784円

区分	2019年 9月 5日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	484,111,071円
SMT インデックスバランス・オープン	184,725,229円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	529,571,646円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,977,431円
グローバル経済コア	350,047,794円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	4,686,341円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	157,607,199円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,305,101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）	939,381,228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）	572,637,043円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		7,680,419,104
合計		7,680,419,104

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 9月 5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	38,127,600	-	38,307,600	180,000
	アメリカドル	38,127,600	-	38,307,600	180,000
	売建	40,043,900	-	40,037,200	6,700
	アメリカドル	23,408,000	-	23,403,600	4,400
	オーストラリアドル	16,635,900	-	16,633,600	2,300
合計		78,171,500	-	78,344,800	186,700

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,910	1,324,269.30	
		AGREE REALTY CORP	25,170	1,912,920.00	
		ALEXANDER'S INC	2,050	794,272.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64,940	9,909,194.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,970	1,282,153.80	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	81,030	3,839,201.40	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	31,600	386,152.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	153,120	3,916,809.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	112,270	4,191,039.10	
		APARTMENT INVEST & MGMT	84,610	4,350,646.20	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,993	1,964,198.21	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	130,264.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,990	17,506,798.40	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	111,510.00	
		BOSTON PROPERTIES	88,810	11,520,433.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	129,195.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	101,518	1,477,086.90	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	169,340	3,222,540.20	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	42,700	808,738.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	71,150.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	55,700	6,124,772.00	
		CARETRUST REIT INC	57,290	1,380,689.00	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	89,905.92	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	123,641.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	23,860	406,574.40	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	34,960	906,163.20	
		CITY OFFICE REIT INC	20,000	271,000.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	76,577.00			
COLONY CAPITAL INC	282,000	1,356,420.00			

COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,630	1,549,356.90	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	418,652.00	
CORECIVIC INC	68,050	1,182,709.00	
CORESITE REALTY CORP	20,530	2,426,030.10	
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,720	1,941,552.00	
COUSINS PROPERTIES INC	82,193	2,889,905.88	
CUBESMART	109,640	3,981,028.40	
CYRUSONE INC	65,900	4,909,550.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	1,156,306.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	119,910	15,162,619.50	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	94,500	3,995,460.00	
DUKE REALTY CORP	209,470	7,067,517.80	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	45,300	954,924.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,700	2,740,710.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	82,810	1,151,059.00	
EPR PROPERTIES	44,390	3,508,585.60	
EQUITY COMMONWEALTH	72,020	2,450,120.40	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,390	7,218,818.10	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	215,850	18,625,696.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,510	1,041,723.90	
ESSEX PROPERTY TRUST	37,880	12,326,530.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,930	9,131,833.60	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	123,880.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,270	5,754,910.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,790	2,784,170.70	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	37,890	1,106,766.90	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	409,418.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	297,540.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	114,470	4,513,552.10	
GEO GROUP INC/THE	69,850	1,227,963.00	
GETTY REALTY CORP	19,000	603,060.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	346,350.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,000	58,100.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,500	103,645.00	
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	1,007,379.00	
HCP INC	273,990	9,860,900.10	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	74,700	2,525,607.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	122,300	3,549,146.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	249,543.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61,100	2,673,125.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	92,450	2,279,817.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	432,650	7,069,501.00	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	91,770	3,133,945.50	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	700,000.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	813,804.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,040	599,456.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	452,724.54	
INVITATION HOMES INC	246,790	7,166,781.60	
IRON MOUNTAIN INC	168,610	5,550,641.20	
JBG SMITH PROPERTIES	68,500	2,672,870.00	
KILROY REALTY CORPORATION	57,310	4,464,449.00	
KIMCO REALTY CORP	247,650	4,660,773.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	735,468.90	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	125,366	1,311,328.36	
LIBERTY PROPERTY TRUST	87,040	4,583,526.40	
LIFE STORAGE INC	27,070	2,862,652.50	
LTC PROPERTIES INC	23,290	1,158,444.60	
MACERICH CO/THE	59,540	1,720,706.00	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	1,136,986.80	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	740,080	673,472.80	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	250,200	4,776,318.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,830	8,590,996.50	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	738,172.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	93,550	5,395,964.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	31,620	1,096,581.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,730	2,077,320.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	262,400.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	613,990.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	507,884.16	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	770,961.30	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	122,626	5,095,110.30	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	215,840.00	
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	1,608,682.50	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	118,330	2,806,787.60	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,640	2,103,267.60	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	178,392.60	
PHYSICIANS REALTY TRUST	104,360	1,821,082.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,810	1,353,487.60	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	316,710.00	
PROLOGIS INC	365,460	31,199,320.20	
PS BUSINESS PARKS INC	11,900	2,201,500.00	
PUBLIC STORAGE	87,350	23,066,514.50	
QTS REALTY TRUST INC	33,510	1,671,813.90	
REALTY INCOME CORP	182,660	13,971,663.40	

REGENCY CENTERS CORP	96,890	6,441,247.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,140	1,087,069.20	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	129,080	1,494,746.40	
RETAIL VALUE	8,630	321,294.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	65,480	2,904,038.00	
RLJ LODGING TRUST	99,770	1,634,232.60	
RPT REALTY	51,580	644,750.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,830	2,308,706.40	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	113,520	2,520,144.00	
SAFEHOLD INC	4,700	135,595.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	341,901.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	143,800	1,245,308.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	15,700	627,529.00	
SIMON PROPERTY GROUP	179,720	26,984,958.00	
SITE CENTERS CORP	84,059	1,191,116.03	
SL GREEN REALTY CORP	48,540	3,922,032.00	
SPIRIT MTA REIT	23,901	200,529.39	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	51,730	2,510,974.20	
STAG INDUSTRIAL INC	74,400	2,181,408.00	
STORE CAPITAL CORP	117,680	4,556,569.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	726,062.30	
SUN COMMUNITIES INC	52,920	7,974,514.80	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	137,090	1,815,071.60	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	820,377.90	
TAUBMAN CENTERS INC	34,900	1,404,376.00	
TERRENO REALTY CORP	34,490	1,759,334.90	
UDR INC	163,470	7,960,989.00	
UMH PROPERTIES INC	20,000	263,600.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	761,029.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	1,244,671.10	
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	358,050.00	
VENTAS INC	214,130	16,064,032.60	
VEREIT INC	565,380	5,602,915.80	
VICI PROPERTIES INC	237,740	5,273,073.20	
VORNADO REALTY TRUST	99,150	6,099,708.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	349,430.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	1,259,390.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,570	1,817,361.00	
WELLTOWER INC	234,370	21,669,850.20	
WHITESTONE REIT	22,610	283,077.20	
WP CAREY INC	99,830	9,144,428.00	

	XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	1,381,951.90	
	アメリカドル 小計	13,246,011	546,085,614.09 (58,114,431,051)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,590	1,783,629.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	550,066.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	622,576.80	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	47,070	2,541,780.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	83,590	1,186,142.10	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	662,500.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,867	346,591.95	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	31,000	457,870.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	59,940	872,127.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	430,612.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	521,502.20	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,100	913,962.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	83,630	1,908,436.60	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,000	547,400.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	520,710.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	106,536.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	154,407.30	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	470,813.84	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	33,000	385,440.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	82,380	2,209,431.60	
SLATE OFFICE REI	17,000	97,920.00		
SLATE RETAIL REIT	10,300	131,634.00		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,810	1,241,531.90		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	33,000	429,000.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	98,850.00		
	カナダドル 小計	855,640	19,191,470.79 (1,543,569,995)	
ユーロ	AEDIFICA	13,866	1,447,610.40	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	90,000	1,376,100.00	
	ALTAREA	2,000	369,600.00	
	BEFIMMO S.C.A.	11,960	645,840.00	
	COFINIMMO	14,310	1,828,818.00	
	COVIVIO(FP)	38,160	3,693,888.00	
	EUROCOMMERCIAL	21,040	476,345.60	

	GECINA SA	31,760	4,519,448.00
	GREEN REIT PLC	377,170	718,131.68
	HAMBORNER REIT AG	44,000	414,084.00
	HIBERNIA REIT PLC	402,550	593,358.70
	ICADE	25,220	2,039,037.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	183,817.60
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	162,460	1,738,322.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	375,375.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	225,021	388,386.24
	KLEPIERRE	116,480	3,238,144.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	232,750.00
	MERCIALYS	34,020	371,498.40
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,470	2,563,016.40
	MONTEA	5,900	452,530.00
	NSI NV	11,700	459,225.00
	RETAIL ESTATES	4,200	350,700.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	79,660	9,427,761.00
	VASTNED RETAIL	8,500	227,800.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	10,300	1,767,480.00
	WERELDHAVE NV	24,970	445,464.80
	ユーロ 小計	2,049,807	40,344,531.82 (4,736,044,590)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	1,400,150	988,505.90
	BIG YELLOW GROUP PLC	92,570	984,019.10
	BRITISH LAND CO PLC	571,830	2,955,217.44
	CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	42,050.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	368,000	302,128.00
	DERWENT LONDON PLC	62,900	1,986,382.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	310,000	290,780.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	153,000	1,079,874.00
	HAMMERSON PLC	431,120	1,002,785.12
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	251,982.48
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	187,383.64
	LAND SECURITIES GROUP PLC	445,720	3,455,221.44
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	474,110	975,718.38
	LXI REIT PLC	297,000	387,882.00
	NEWRIVER REIT PL	173,000	293,408.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	320,000	278,400.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	653,700	898,183.80
	RDI REIT PLC	154,400	161,193.60
	REGIONAL REIT LTD	232,000	242,208.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	844,440.00

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	135,500.00	
	SEGRO PLC	631,660	5,009,063.80	
	SHAFTESBURY PLC	132,430	1,131,614.35	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	188,230.09	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,018,700	1,446,554.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	354,000	288,864.00	
	UNITE GROUP PLC	165,020	1,732,710.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,420	627,157.20	
	イギリスポンド 小計	10,186,556	28,167,456.34 (3,668,247,839)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	214,440	844,893.60	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	220,500.00	
	ARENA REIT	141,000	401,850.00	
	BWP TRUST	298,560	1,158,412.80	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	130,800	495,732.00	
	CHARTER HALL GROUP	271,600	3,457,468.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	165,846	975,174.48	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	192,380	829,157.80	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,117,623	1,391,440.63	
	DEXUS	622,590	7,956,700.20	
	GDI PROPERTY GROUP	286,500	441,210.00	
	GOODMAN GROUP	923,710	13,125,919.10	
	GPT GROUP	1,139,210	7,222,591.40	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	142,860	624,298.20	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	279,240.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	124,000	489,800.00	
	MIRVAC GROUP	2,326,360	7,304,770.40	
	NATIONAL STORAGE REIT	380,000	687,800.00	
	RURAL FUNDS GROUP	189,816	392,919.12	
	SCENTRE GROUP	3,063,440	12,161,856.80	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	514,230	1,321,571.10		
STOCKLAND	1,433,580	6,393,766.80		
VICINITY CENTERS	1,897,480	4,838,574.00		
VIVA ENERGY REIT	290,000	841,000.00		
	オーストラリアドル 小計	16,019,025	73,856,646.43 (5,342,789,802)	
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	730,125.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	580,000	1,261,500.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	850,000	1,394,000.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	615,000	1,150,050.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	228,000	535,800.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	500,518.20	
		2,955,460	5,571,993.20	

ニュージーランドドル 小計			(377,391,099)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,133,000	6,129,530.00	
	FORTUNE REIT	813,000	7,593,420.00	
	LINK REIT	1,231,000	112,698,050.00	
	PROSPERITY REIT	782,000	2,361,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	3,370,800.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	740,000	3,899,800.00	
香港ドル 小計		5,335,000	136,053,240.00	(1,847,602,999)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	340,000	489,600.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	465,450.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,512,966	4,841,491.20	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	691,000	905,210.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	711,000	522,585.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,554,528	3,357,780.48	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,639,600	4,410,524.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	399,429	619,114.95	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	742,446.00	
	ESR REIT	1,130,579	576,595.29	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	326,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	354,900.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	366,829	1,041,794.36	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	360,000	612,000.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	324,300.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	977,820	1,202,718.60	
	KEPPEL DC REIT	519,460	950,611.80	
	KEPPEL REIT	1,074,800	1,343,500.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	219,420.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,035,830	2,330,617.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	774,860	1,836,418.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,387,152	2,177,828.64	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,251,800	1,702,448.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	923,644	480,294.88	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	770,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	220,128.40	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	321,200	175,054.00	
SPH REIT	322,300	354,530.00		
STARHILL GLOBAL REIT	706,300	529,725.00		

	SUNTEC REIT	1,334,500	2,588,930.00	
	シンガポールドル 小計	23,189,437	36,472,416.30 (2,802,540,468)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	142,450,000.00	
	韓国ウォン 小計	17,500	142,450,000.00 (12,606,825)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	104,000	2,113,280.00	
	イスラエルシェケル 小計	104,000	2,113,280.00 (63,757,657)	
	合計	73,958,436	78,508,982,325 (78,508,982,325)	

(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%	6.0%
イギリスポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	4.7%
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%	3.6%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【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9月6日から2020年3月5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。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2019年 9月 5日現在）	第3期中間計算期間 （2020年 3月 5日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,205,669	4,483,984
親投資信託受益証券	85,959,198	113,230,622
流動資産合計	88,164,867	117,714,606
資産合計	88,164,867	117,714,606
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,007	2,031
未払受託者報酬	20,487	28,516
未払委託者報酬	184,348	256,549
未払利息	4	8
その他未払費用	1,991	2,795
流動負債合計	207,837	289,899
負債合計	207,837	289,899
純資産の部		
元本等		
元本	86,335,448	113,042,537
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,621,582	4,382,170
（分配準備積立金）	2,215,367	2,107,210
元本等合計	87,957,030	117,424,707
純資産合計	87,957,030	117,424,707
負債純資産合計	88,164,867	117,714,606

（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 9月 6日 至 2019年 3月 5日	第3期中間計算期間 自 2019年 9月 6日 至 2020年 3月 5日
営業収益		
受取利息	-	3
有価証券売買等損益	930,174	1,367,282
営業収益合計	930,174	1,367,285
営業費用		
支払利息	252	608
受託者報酬	13,961	28,516
委託者報酬	125,591	256,549
その他費用	1,332	2,795
営業費用合計	141,136	288,468
営業利益又は営業損失（ ）	789,038	1,078,817
経常利益又は経常損失（ ）	789,038	1,078,817
中間純利益又は中間純損失（ ）	789,038	1,078,817
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（ ）	20,149	185,011
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	112,402	1,621,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,061	1,988,908
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,061	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,988,908
剰余金減少額又は欠損金増加額	534,863	122,126
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	122,126
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	534,863	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	144,685	4,382,170

(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 9月 5日現在)	第3期中間計算期間 (2020年 3月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,335,448口	113,042,537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) 1.0188円 (10,188円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0388円 (10,388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 3月 5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 3月 5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 9月 6日 至 2019年 9月 5日	第3期中間計算期間 自 2019年 9月 6日 至 2020年 3月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	41,952,087円	86,335,448円
期中追加設定元本額	54,949,184円	31,773,070円
期中一部解約元本額	10,565,823円	5,065,981円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,307,852,391
国債証券	466,366,664,800

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
地方債証券	30,693,150,967
特殊債券	38,320,101,029
社債券	24,016,360,930
未収入金	607,889,400
未収利息	1,336,182,967
前払費用	49,728,123
流動資産合計	562,697,930,607
資産合計	562,697,930,607
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	100,330
未払金	400,000,000
未払解約金	1,186,690,722
未払利息	2,610
流動負債合計	1,586,793,662
負債合計	1,586,793,662
純資産の部	
元本等	
元本	392,233,672,458
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	168,877,464,487
元本等合計	561,111,136,945
純資産合計	561,111,136,945
負債純資産合計	562,697,930,607

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月 5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> <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>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 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	392,233,672,458口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 102,744,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4306円 (1万口当たり純資産額) (14,306円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 3月 5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。

（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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	343,586,564,686円
期中追加設定元本額	60,050,467,348円
期中一部解約元本額	11,403,359,576円
期末元本額	392,233,672,458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）	3,822,194,323円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,616,783円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,398,830,523円
世界経済インデックスファンド	1,904,554,168円
D Cマイセレクション25	21,433,728,798円
D Cマイセレクション50	23,260,533,446円
D Cマイセレクション75	6,468,836,893円
D C日本債券インデックス・オープン	454,581,665円
D C日本債券インデックス・オープンS	89,200,303,868円
D C日本債券インデックス・オープンP	69,206,354,047円
D CマイセレクションS25	8,907,521,470円
D CマイセレクションS50	9,663,747,329円
D CマイセレクションS75	1,864,838,214円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,072,827,899円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	1,439,419,128円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	495,539,764円
D C世界経済インデックスファンド	2,526,768,942円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	69,212,927円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,705,448円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	41,886,651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）	159,202,900円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	232,449,634円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,292,480円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	100,674,547円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,048,916,619円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	925,257,612円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,504,248,430円

区分	2020年 3月 5日現在
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	780,946,624円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	91,524,631円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,193,235,572円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	26,105,565円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,351,133,634円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,723,121,197円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	155,700,309円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,195,126,498円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,558,216,376円
分散投資コア戦略ファンドA	12,178,991,438円
分散投資コア戦略ファンドS	11,077,706,346円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	81,689,485円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	895,633,004円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,533,234円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,059,101円
SMT インデックスバランス・オープン	57,298,743円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,577,888円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	23,880,932円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	38,870,924円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,938,518円
グローバル経済コア	221,017,722円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,351,894円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,314,366円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	162,450円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	43,499円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	16,778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）	76,156,048,072円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	20,417,445円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 3月 5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	154,010,000	-	153,910,000	100,000
	合計	154,010,000	-	153,910,000	100,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 3月 5日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,809,114,087
株式	288,372,045,680
派生商品評価勘定	2,690,350
未収配当金	599,120,548
前払金	257,236,100
差入委託証拠金	164,017,500
流動資産合計	292,204,224,265
資産合計	
292,204,224,265	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	259,951,750
未払解約金	258,633,937
未払利息	5,607
流動負債合計	518,591,294
負債合計	
518,591,294	
純資産の部	
元本等	
元本	206,358,207,690
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,327,425,281
元本等合計	291,685,632,971
純資産合計	
291,685,632,971	
負債純資産合計	
292,204,224,265	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	2020年 3月 5日現在
	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。
先物取引	

2020年 3月 5日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2020年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	206,358,207,690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 1.4135円 (1万口当たり純資産額) (14,135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 3月 5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 3月 5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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	207,624,577,796円
期中追加設定元本額	20,582,447,352円
期中一部解約元本額	21,848,817,458円
期末元本額	206,358,207,690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）	553,234,049円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,976,595,863円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,214,359円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,309,577,511円
世界経済インデックスファンド	2,121,562,049円
日本株式インデックス・オープン	4,406,714,843円
DCマイセレクション25	6,773,714,774円
DCマイセレクション50	19,125,197,520円
DCマイセレクション75	17,635,395,412円
DC日本株式インデックス・オープン	5,632,057,215円
DCマイセレクションS25	2,773,070,597円
DCマイセレクションS50	7,919,448,306円
DCマイセレクションS75	5,168,521,492円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,734,373,699円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	337,872,096円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	677,877,873円

区分	2020年 3月 5日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	457,339,748円
DC世界経済インデックスファンド	2,813,033,337円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,080,564,602円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,842,828円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	35,949,326円
マイセクション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)	276,843,461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)	74,433,690円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	260,379,554円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	59,586,709円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	351,948,694円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,592,205,778円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	678,319,700円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,964,241,951円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	638,155,991円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,793,818円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	737,846,680円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	35,933,709円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	419,050,952円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	530,174,349円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,451,125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)	806,446,127円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,929,050,546円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,679,137,318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	6,357,273,573円
分散投資コア戦略ファンドS	18,222,622,901円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	299,633,544円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	304,782,854円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	205,649,399円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,665,386円
SMT インデックスバランス・オープン	68,563,063円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	12,964,688,973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	19,729,998円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	67,245,535円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	11,864,879円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,021,288円
グローバル経済コア	266,065,871円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,177,435円

区分	2020年 3月 5日現在
i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	42,589,292円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,464,409円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	301,479,988円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,642,992円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	124,963円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	41,910円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,716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）	47,745,999,033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）	556,476,978円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	21,215,842円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	15,131,522円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 3月 5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	3,653,076,100	-	3,395,840,000	257,236,100
合計		3,653,076,100	-	3,395,840,000	257,236,100

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	416,483,125
コール・ローン	2,538,093,550
国債証券	406,640,043,016
派生商品評価勘定	23,684,007
未収入金	1,280,693
未収利息	2,490,814,748
前払費用	132,851,918
差入委託証拠金	346,951,146

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	412,590,202,203
資産合計	412,590,202,203
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,946,549
前受金	23,032,696
未払金	121,905,808
未払解約金	698,719,649
未払利息	5,066
流動負債合計	877,609,768
負債合計	877,609,768
純資産の部	
元本等	
元本	141,528,620,746
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	270,183,971,689
元本等合計	411,712,592,435
純資産合計	411,712,592,435
負債純資産合計	412,590,202,203

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月 5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>

	2020年 3月 5日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,528,620,746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 2.9090円 (1万口当たり純資産額) (29,090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 3月 5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。

	2020年 3月 5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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	138,627,060,591円
期中追加設定元本額	11,609,143,039円
期中一部解約元本額	8,707,582,884円
期末元本額	141,528,620,746円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,664,465,734円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	637,104,195円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	471,049,301円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,027,617,625円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,877,224円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,595,841,139円
世界経済インデックスファンド	6,820,391,184円
D C マイセレクション 2 5	1,719,335,485円
D C マイセレクション 5 0	1,307,293,904円
D C マイセレクション 7 5	943,572,809円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,955,490,636円
D C マイセレクション S 2 5	708,952,590円
D C マイセレクション S 5 0	545,193,950円
D C マイセレクション S 7 5	274,080,839円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	43,402,143円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	69,136,740円

区分	2020年 3月 5日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	33,052,158円
DC世界経済インデックスファンド	9,107,136,262円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	610,193,917円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	31,946,360円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,561,602円
マイセクション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)	46,304,198円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	88,710,280円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	136,117,832円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	142,702,368円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	281,612,619円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,975,062,940円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	587,581,661円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,114,970,979円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	796,285,520円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	71,272,064円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	588,836,955円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	32,192,171円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	220,249,357円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	281,117,574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)	2,036,863,288円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	819,433,028円
外国債券ファンド・シリーズ1	561,862,545円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,159,911,068円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,862,187,924円
分散投資コア戦略ファンドA	1,760,732,893円
分散投資コア戦略ファンドS	6,617,455,463円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	313,140,721円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,950,182,733円
コア投資戦略ファンド(切替型)	563,477,235円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,960,429円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	105,635,751円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,059,782,436円
SMT インデックスバランス・オープン	211,196,369円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	22,895,158,835円
SMT 世界経済インデックス・オープン	97,818,960円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	106,912,394円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	173,902,435円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,681,653円
グローバル経済コア	906,967,748円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,881,148円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	146,441円

区分	2020年 3月 5日現在
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	229,028,148円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,162,672円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	117,085円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,609円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	39,326円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	686,709,850円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,815,075,788円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	347,503,575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)	40,049,964,401円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	90,751,640円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2020年 3月 5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	3,085,140,514	-	3,108,173,210	23,032,696
	合計	3,085,140,514	-	3,108,173,210	23,032,696

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2020年 3月 5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	3,161,942,952	-	3,128,647,600	33,295,352
	アメリカドル	1,602,426,741	-	1,578,734,300	23,692,441
	カナダドル	131,099,262	-	128,352,000	2,747,262
	ユーロ	1,206,754,342	-	1,204,383,200	2,371,142
	イギリスポンド	221,662,607	-	217,178,100	4,484,507
	売建	78,115,304	-	78,115,190	114

	アメリカドル	69,219,102	-	69,219,102	-
	シンガポールドル	8,896,202	-	8,896,088	114
	合計	3,240,058,256	-	3,206,762,790	33,295,238

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,761,177,976
コール・ローン	1,034,060,969
株式	359,763,756,179
投資信託受益証券	268,981,628
投資証券	10,460,570,616
派生商品評価勘定	1,559,937
未収入金	1,491,089
未収配当金	688,825,538
前払金	525,324,368
差入委託証拠金	1,520,449,600
流動資産合計	382,026,197,900
資産合計	382,026,197,900
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	527,308,307
未払金	43,695,756
未払解約金	1,191,962,982
未払利息	2,064
流動負債合計	1,762,969,109
負債合計	1,762,969,109
純資産の部	
元本等	
元本	140,707,044,029
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	239,556,184,762
元本等合計	380,263,228,791
純資産合計	380,263,228,791
負債純資産合計	382,026,197,900

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 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>(1) 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2020年 3月 5日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,707,044,029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 2.7025円 (1万口当たり純資産額) (27,025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 3月 5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。

	2020年 3月 5日現在

（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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	137,809,914,504円
期中追加設定元本額	17,636,114,616円
期中一部解約元本額	14,738,985,091円
期末元本額	140,707,044,029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）	2,364,538,070円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,862,709円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,138,913,262円
世界経済インデックスファンド	7,425,256,493円
外国株式インデックス・オープン	742,571,875円
D C マイセレクション 2 5	1,058,782,929円
D C マイセレクション 5 0	4,681,639,498円
D C マイセレクション 7 5	4,577,396,348円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,911,620,159円
D C マイセレクション S 2 5	430,398,379円
D C マイセレクション S 5 0	1,942,581,175円
D C マイセレクション S 7 5	1,359,191,431円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	90,459,499円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	181,541,247円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	122,501,846円
D C 世界経済インデックスファンド	9,813,963,071円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,905,431,739円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,079,232円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	37,970,563円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	38,143,995円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	138,575,975円

区分	2020年 3月 5日現在
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	31,286,400円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	184,811,376円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	597,283,944円
バランス B (3 7 . 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	321,347,277円
バランス C (5 0) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,170,910,227円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	1,710,943,583円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	65,645,589円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	306,339,561円
グローバルバランスファンド V A 3 5 (適格機関投資家専用)	7,869,049円
バランス E (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	101,524,340円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,719,821,170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)	1,821,323,964円
外国株式ファンド・シリーズ 1	999,211,189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	2,504,692,706円
分散投資コア戦略ファンド S	7,559,269,080円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,042,150,888円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	1,121,008,829円
コア投資戦略ファンド (切替型)	1,067,133,567円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	718,770,295円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	40,120,455円
S M T インデックスバランス・オープン	238,311,273円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	1,165,998,351円
外国株式 S M T B セレクション (S M A 専用)	29,405,345,946円
S M T 世界経済インデックス・オープン	97,330,645円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	331,855,572円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	58,489,379円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	1,758,259円
i - S M T グローバル株式インデックス (ノーロード)	59,980,635円
グローバル経済コア	883,006,099円
S B I 資産設計オープン (つみたて N I S A 対応型)	8,894,853円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	626,187円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	599,530,328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・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 3 0	402,015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	144,829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	107,240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	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)	1,122,162,317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)	808,838,344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)	2,106,234,212円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	104,276,622円

区分	2020年 3月 5日現在
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	73,804,044円
S M T A M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
S M T A M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 3月 5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	9,300,949,032	-	8,775,624,664	525,324,368
合計		9,300,949,032	-	8,775,624,664	525,324,368

（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 3月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	1,110,583,658	-	1,111,007,660	424,002
	アメリカドル	746,460,950	-	746,669,200	208,250
	カナダドル	42,341,288	-	42,291,750	49,538
	ユーロ	94,700,893	-	94,698,520	2,373
	イギリスポンド	62,378,034	-	62,541,050	163,016
	スイスフラン	87,267,408	-	87,268,960	1,552
	オーストラリアドル	31,263,813	-	31,372,740	108,927
	香港ドル	25,674,048	-	25,668,480	5,568
	シンガポールドル	20,497,224	-	20,496,960	264
合計		1,110,583,658	-	1,111,007,660	424,002

（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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,745,710,452
投資証券	116,934,628,190
未収入金	52,710,189
未収配当金	1,490,817,086
前払金	65,139,200
差入委託証拠金	234,821,000
流動資産合計	120,523,826,117
資産合計	120,523,826,117
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	65,139,200
未払金	225,755,740
未払解約金	175,393,578
未払利息	3,484
流動負債合計	466,292,002
負債合計	466,292,002
純資産の部	
元本等	
元本	57,045,995,319
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	63,011,538,796
元本等合計	120,057,534,115
純資産合計	120,057,534,115
負債純資産合計	120,523,826,117

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月 5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>

2020年 3月 5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)

2020年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,045,995,319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 2.1046円 (1万口当たり純資産額) (21,046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 3月 5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。

	2020年 3月 5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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	56,676,784,641円
期中追加設定元本額	6,042,954,512円
期中一部解約元本額	5,673,743,834円
期末元本額	57,045,995,319円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,596,896,237円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,296,659円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	13,174,305,919円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	25,983,599,112円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,887,761,646円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,756,491,131円
分散投資コア戦略ファンド A	2,212,262,307円
分散投資コア戦略ファンド S	4,812,059,565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	29,503,064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	2,332,658円
グローバル経済コア	273,979,788円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	5,934,709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

区分	2020年 3月 5日現在
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	828,779,660円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	4,474,253円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	929,357,035円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	393,526,604円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	319,941,387円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2020年 3月 5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	3,128,717,200	-	3,063,578,000	65,139,200
	合計	3,128,717,200	-	3,063,578,000	65,139,200

(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 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	378,139,123
コール・ローン	343,197,845
投資証券	92,210,735,251
派生商品評価勘定	89,514
未収入金	86,886,251
未収配当金	97,819,279
流動資産合計	93,116,867,263
資産合計	93,116,867,263
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,450
未払金	305,714,242
未払解約金	289,285,753
未払利息	685
流動負債合計	595,007,130
負債合計	595,007,130

	2020年 3月 5日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	47,225,420,713
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,296,439,420
元本等合計	92,521,860,133
純資産合計	92,521,860,133
負債純資産合計	93,116,867,263

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		47,225,420,713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)	1.9592円 (19,592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 3月 5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>	

（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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2019年 9月 6日

期首元本額	40,906,320,235円
期中追加設定元本額	9,887,654,317円
期中一部解約元本額	3,568,553,839円
期末元本額	47,225,420,713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）	126,399,962円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,605,735,426円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,379,275円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	9,857,037,652円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	21,802,849,218円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,287,583,942円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,737,672,185円
分散投資コア戦略ファンドA	1,510,563,007円
分散投資コア戦略ファンドS	4,678,744,812円
コア投資戦略ファンド（切替型）	626,292,502円
SMT インデックスバランス・オープン	167,839,100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	2,382,138円
グローバル経済コア	289,136,402円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	6,018,126円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	331,973,532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）	817,647,026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）	688,424,656円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	43,093,182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 3月 5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	128,352,199	-	128,426,000	73,801
	アメリカドル	74,106,700	-	74,186,600	79,900
	カナダドル	19,264,440	-	19,260,000	4,440
	ユーロ	14,366,640	-	14,366,400	240
	イギリスポンド	12,452,949	-	12,453,300	351
	香港ドル	8,161,470	-	8,159,700	1,770

	売建	41,981,863	-	41,972,600	9,263
	オーストラリアドル	41,981,863	-	41,972,600	9,263
	合計	170,334,062	-	170,398,600	83,064

(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】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	109,792,085円
負債総額	41,984円
純資産総額（ - ）	109,750,101円
発行済口数	117,042,596口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9377円
（1万口当たり純資産額）	（9,377円）

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(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）

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）

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）

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）

J-REIT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REIT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）

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します。

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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 6月 5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変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

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

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

（*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

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

（4）有価証券及び投資有価証券

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

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

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

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位：千円）

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,432,867	-	13,731	
	英ポンド		2,575,513	-	50,256	
	カナダドル		40,963	-	566	
	スイスフラン		34,448	-	132	
	香港ドル		566,113	-	2,528	
	人民元		1,725,146	-	9,137	
	ユーロ		262,583	-	6,080	
	買建					
	ユーロ		6,313	-	86	
	合計		8,643,951	-	82,081	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

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

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

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

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

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

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

(2)実施した会計処理の概要

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	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
	英ポンド	52	-	0
	カナダドル	2	-	0
	スイスフラン	6	-	0
	香港ドル	195	-	0
	ユーロ	155	-	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 6月 5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。

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11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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2018年9月6日から2019年9月5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、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2019年9月5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. X B R L 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5月1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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2019年9月6日から2020年3月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2020年3月5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9月6日から2020年3月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。