ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書
（請求目論見書）

平成28年 7月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※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。

ＳＭＴ　インデックスバランス・オープンの募集については、委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を平成 28 年 7 月 20 日に関東財務局長に提出しており、平成 28 年 7 月 21 日にその届出の効力が生じております。

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	：	取締役社長　鈴木　郁也
本店の所在の場所	：	東京都港区芝３丁目３３番１号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	：	該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】 1
（１）【ファンドの名称】 1
（２）【内国投資信託受益証券の形態等】 1
（３）【発行（売出）価額の総額】 1
（４）【発行（売出）価格】 1
（５）【申込手数料】 1
（６）【申込単位】 1
（７）【申込期間】 2
（８）【申込取扱場所】 2
（９）【払込期日】 2
（１０）【払込取扱場所】 2
（１１）【振替機関に関する事項】 2
（１２）【その他】 2
第二部【ファンド情報】 4
第１【ファンドの状況】 4
１【ファンドの性格】 4
２【投資方針】 14
３【投資リスク】 29
４【手数料等及び税金】 32
５【運用状況】 35
第２【管理及び運営】 65
１【申込（販売）手続等】 65
２【換金（解約）手続等】 66
３【資産管理等の概要】 68
４【受益者の権利等】 72
第３【ファンドの経理状況】 73
１【財務諸表】 75
２【ファンドの現況】 302
第４【内国投資信託受益証券事務の概要】 306
第三部【委託会社等の情報】 307
第１【委託会社等の概況】 307
１【委託会社等の概況】 307
２【事業の内容及び営業の概況】 308
３【委託会社等の経理状況】 308
４【利害関係人との取引制限】 324
５【その他】 324
約款

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10 兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24％（税抜　3.0％）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は１円以上１円単位です。

（7）【申込期間】

平成 28 年 7 月 21 日から平成 29 年 1 月 20 日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

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

（9）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後 3 時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜申込みコース＞

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の 2 つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型）） 資産複合 （　　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　）	グローバル（日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （　　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経 225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

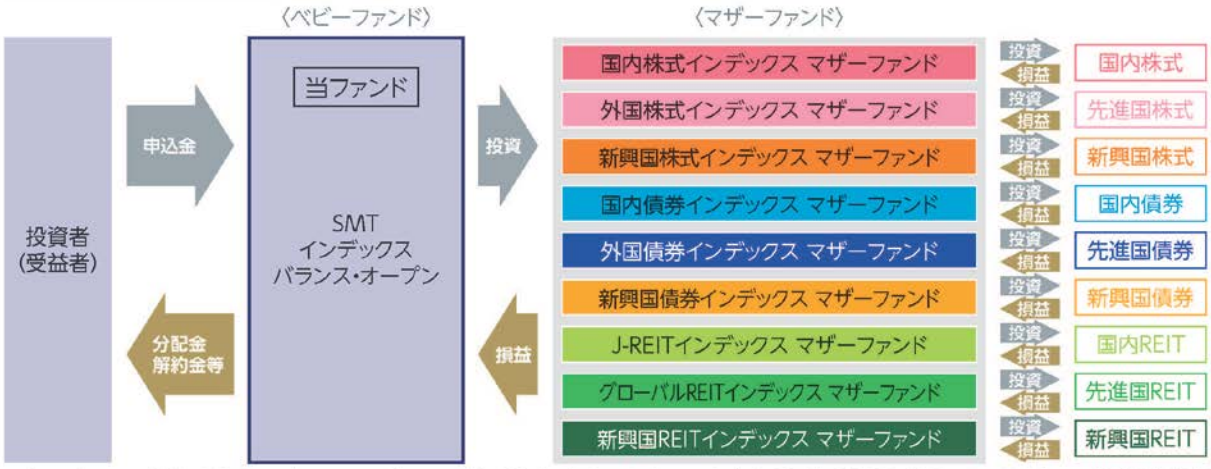
[特殊型]
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

＜ファンドの特色＞

特色1 世界の株式（DR（預託証券）を含みます。）、債券及び不動産投資信託証券（REIT）に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

ファンドのしくみ



※各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

ファミリーファンド方式とは

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

DR（預託証券）とは

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

REITとは

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

ポートフォリオ構築プロセス

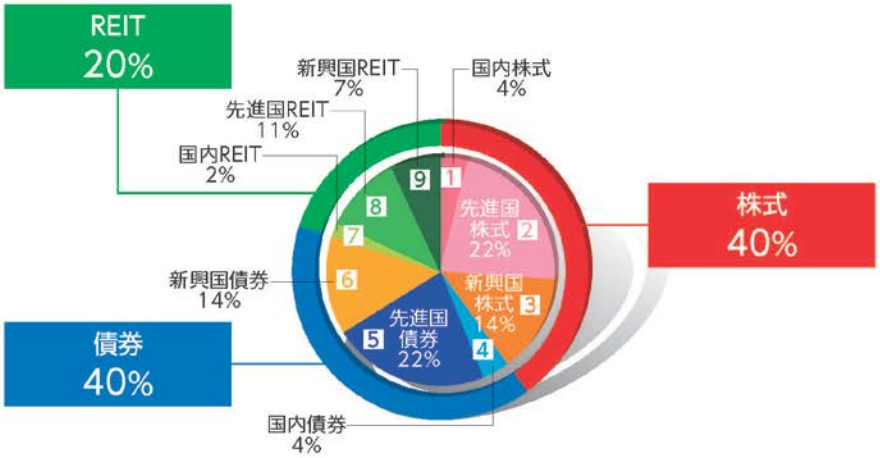
ファンドマネジャーは基本資産配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で資産配分比率を調整します。

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

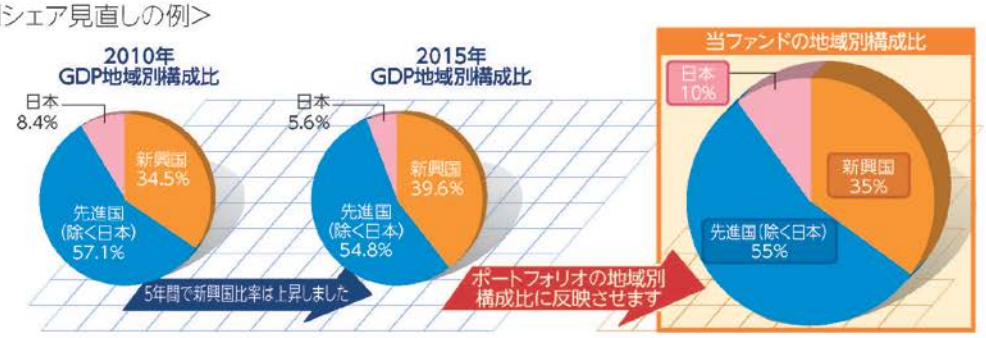
「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
「MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知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。
「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
「NOMURA-BPI総合」とは、野村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。
「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLC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すべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLC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。
「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス−エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)はSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。
「S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)」とは、SPDJIが公表する指数で、新興国に上場する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新興国REIT指数(以下「当インデックス」)はSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はS&Pの登録商標で、Dow Jones®は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。

特色3 世界経済全体の発展を享受します。

●地域別の基本組入比率は、地域別(国内、先進国及び新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

●地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。

<地域別シェア見直しの例>



(出所)IMF「世界経済見通し2015年10月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※地域別構成比は、あくまでも例示であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

分配方針

●年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

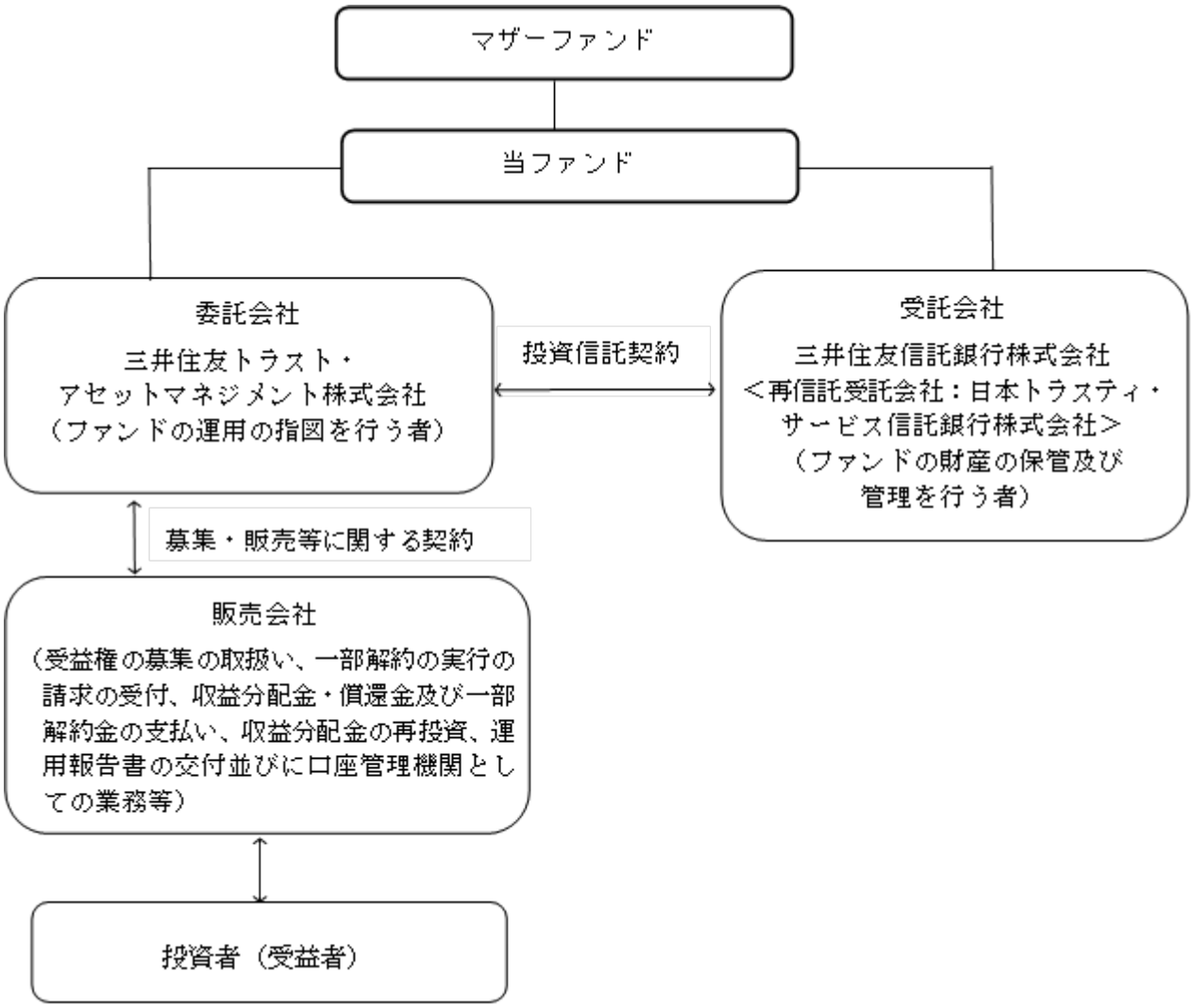
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

平成 26 年 11 月 28 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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（平成 28 年 5 月 31 日現在）

イ．資本金の額：3 億円

ロ．委託会社の沿革

昭和 61 年 11 月 1 日：　住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和 62 年 2 月 20 日：　投資顧問業の登録

昭和 62 年 9 月 9 日：　投資一任契約に係る業務の認可

平成 2 年 10 月 1 日：　住信投資顧問株式会社に商号変更

平成 11 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

平成 11 年 3 月 25 日：　証券投資信託委託業の認可

平成 19 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）

平成 24 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

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】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

②投資対象

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

③投資態度

イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。

ロ．株式、債券及び REIT の基本資産配分比率は、原則として株式 40%、債券 40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。

ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）の GDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域の GDP シェアの変化に応じて、原則として年 1 回見直しを行う予定です。

ホ．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。

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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1.有価証券

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

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井

住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス　マザーファンド」、「国内債券インデックス　マザーファンド」、「外国株式インデックス　マザーファンド」、「外国債券インデックス　マザーファンド」、「新興国株式インデックス　マザーファンド」、「新興国債券インデックス　マザーファンド」、「J-REIT インデックス　マザーファンド」、「グローバル REIT インデックス　マザーファンド」及び「新興国 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書
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。

③金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記②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②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100％に近い状態を維持します。

③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

⑤国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

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

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号

の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「外国株式インデックス 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

①原則として MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。
②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。
③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
④投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、

上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

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

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

④国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

「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、シティ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

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

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

⑥投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

ます。

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

「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

①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。

②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。

③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。

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

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②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。

③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。

④外貨建資産への投資は行いません。

⑤一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。

⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバル REIT インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取

引所及び金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①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。

②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。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②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。

③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。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一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。

「新興国 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、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している REIT に投資し、S&P 新興国 REIT 指数（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

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）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

①主として、新興国の REIT に投資し、S&P 新興国 REIT 指数（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運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社から投資助言を受けます。

③REIT への投資割合は、原則として高位を維持します。

④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。

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

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②株式への投資は行いません。

③同一銘柄の REIT 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 新興国 REIT 指数（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 新興国 REIT 指数（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。

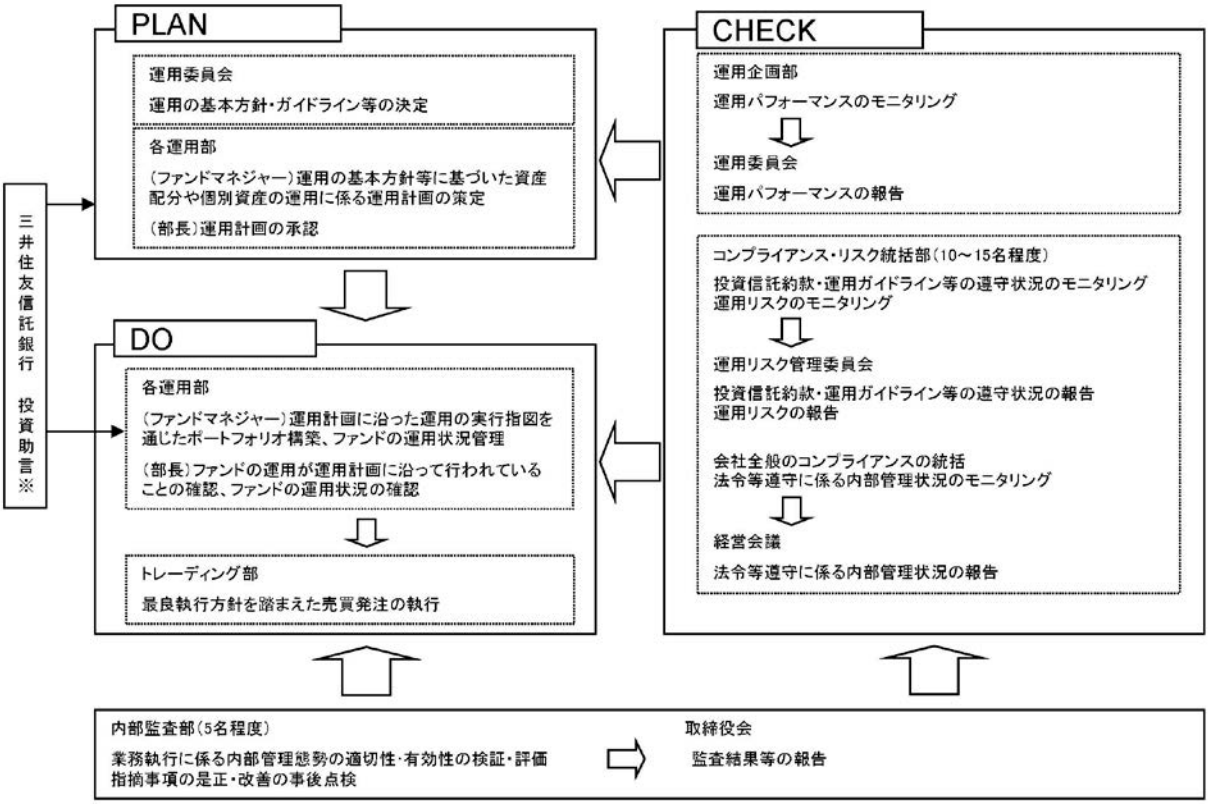
④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一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。

⑥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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

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



※三井住友信託銀行は各マザーファンド（「J-REIT インデックス　マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 60%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並び

に委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

（ヘ）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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

（ニ）委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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たときは、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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

（ハ）上記（ロ）の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

（ニ）上記（ロ）においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

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

券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥カントリーリスク

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

⑦流動性リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

①運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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。

②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。

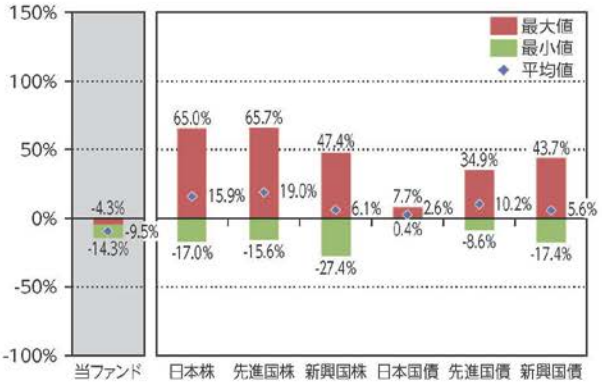
〔参考情報〕

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2015年11月～2016年5月の7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2011年6月～2016年5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

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)※1
先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)※2
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)※3
日本国債… NOMURA-BPI国債※4
先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)※5
新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)※6

(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。

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

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

※3 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。

※4 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。

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLC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すべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※6 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.

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜　3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.54%（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　0.216%　　（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　0.27%　　（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　0.054%　　（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

②信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（4）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託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。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税　率（内　訳）
平成 49 年 12 月 31 日まで	20.315%（所得税 15.315%、住民税 5%）
平成 50 年 1 月 1 日以降	20%（所得税 15%、住民税 5%）

（平成 49 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税
一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。
ハ．損益通算について
一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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

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

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

②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）
平成 49 年 12 月 31 日まで	15.315%
平成 50 年 1 月 1 日以降	15%

（平成 49 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。）

③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「④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。）

④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。

※上記は、平成 28 年 5 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、平成 28 年 5 月 31 日現在の状況について記載してあります。

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,373,996,539	98.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	36,864,755	1.53
合計(純資産総額)		2,410,861,294	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	276,731,698	1.8711	517,795,037	1.8977	525,153,743	21.78
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	194,889,276	2.6491	516,298,116	2.6669	519,750,210	21.56
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス　マザーファンド	218,040,348	1.5316	333,959,506	1.4812	322,961,363	13.40
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	157,642,713	2.1128	333,083,216	2.0354	320,865,978	13.31
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	167,728,858	1.6125	270,477,510	1.6301	273,414,811	11.34
日本	親投資信託受益証券	新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	203,858,016	0.8315	169,509,920	0.7665	156,257,169	6.48
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	74,674,865	1.4123	105,470,504	1.4119	105,433,441	4.37
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	79,876,800	1.1735	93,741,057	1.1873	94,837,724	3.93
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	33,944,104	1.6171	54,891,248	1.6298	55,322,100	2.29

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.47
合計	98.47

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末　（平成27年 4月20日）	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末　（平成27年10月20日）	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末　（平成28年 4月20日）	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
平成27年 5月末日	1,300,726,364	—	10,266	—
6月末日	1,444,504,122	—	9,913	—
7月末日	1,571,761,133	—	9,976	—
8月末日	1,567,902,510	—	9,365	—
9月末日	1,611,800,071	—	9,014	—
10月末日	1,860,578,244	—	9,561	—
11月末日	1,886,327,322	—	9,574	—
12月末日	1,964,434,768	—	9,331	—
平成28年 1月末日	2,012,334,477	—	8,919	—
2月末日	2,090,334,055	—	8,574	—
3月末日	2,301,579,540	—	9,114	—
4月末日	2,350,714,866	—	9,005	—
5月末日	2,410,861,294	—	8,932	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成26年11月28日～平成27年 4月20日	0
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	0
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	平成26年11月28日～平成27年 4月20日	0.1
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	△5.0
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	△5.1

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

(注 2)小数第2位を四捨五入しております。

（4）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成26年11月28日～平成27年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848

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

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	149,389,417,310	97.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,087,193,974	2.02
合計(純資産総額)		152,476,611,284	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	3,125,790,000	2.05

(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	909,000	5,681.00	5,164,029,000	5,783.00	5,256,747,000	3.45
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	5,787,900	546.00	3,160,193,400	553.80	3,205,339,020	2.10
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	557,600	4,846.00	2,702,129,600	4,855.00	2,707,148,000	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	408,700	6,175.00	2,523,722,500	6,228.00	2,545,383,600	1.67
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	732,800	3,193.00	2,339,830,400	3,237.00	2,372,073,600	1.56
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	484,200	4,383.00	2,122,248,600	4,402.00	2,131,448,400	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	577,600	3,529.00	2,038,350,400	3,617.00	2,089,179,200	1.37
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	657,700	3,122.00	2,053,339,400	3,151.00	2,072,412,700	1.36
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,224,900	172.10	1,759,705,290	174.40	1,783,222,560	1.17
日本	株式	ソニー	電気機器	515,700	3,082.00	1,589,387,400	3,100.00	1,598,670,000	1.05
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	539,000	2,744.50	1,479,285,500	2,779.00	1,497,881,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	304,900	4,819.00	1,469,313,100	4,797.00	1,462,605,300	0.96
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	301,800	4,702.00	1,419,063,600	4,744.00	1,431,739,200	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	133,600	10,080.00	1,346,688,000	10,135.00	1,354,036,000	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	857,200	1,493.50	1,280,228,200	1,517.00	1,300,372,400	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,500	19,300.00	1,264,150,000	19,630.00	1,285,765,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	74,800	16,735.00	1,251,778,000	16,980.00	1,270,104,000	0.83
日本	株式	キヤノン	電気機器	393,500	3,160.00	1,243,460,000	3,212.00	1,263,922,000	0.83
日本	株式	花王	化学	205,900	6,086.00	1,253,107,400	6,101.00	1,256,195,900	0.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,600	69,330.00	1,150,878,000	70,400.00	1,168,640,000	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,020,000	1,105.00	1,127,100,000	1,125.00	1,147,500,000	0.75
日本	株式	三菱地所	不動産業	536,000	2,125.00	1,139,000,000	2,139.50	1,146,772,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	292,300	3,840.00	1,122,432,000	3,839.00	1,122,139,700	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	541,300	1,936.50	1,048,227,450	1,967.00	1,064,737,100	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	780,000	1,314.00	1,024,920,000	1,339.50	1,044,810,000	0.69
日本	株式	三井不動産	不動産業	383,000	2,673.50	1,023,950,500	2,721.50	1,042,334,500	0.68
日本	株式	ダイキン工業	機械	106,400	9,395.00	999,628,000	9,496.00	1,010,374,400	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	77,100	12,740.00	982,254,000	12,950.00	998,445,000	0.65
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	258,300	3,734.00	964,492,200	3,826.00	988,255,800	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	231,000	4,120.00	951,720,000	4,150.00	958,650,000	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.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.16
		食料品	5.01
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.12
		医薬品	5.58
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.19
		非鉄金属	0.85
		金属製品	0.63
		機械	4.72
		電気機器	11.52
		輸送用機器	9.34
		精密機器	1.56
		その他製品	1.61
		電気・ガス業	1.91
		陸運業	4.44
		海運業	0.22
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.25
		卸売業	4.10
		小売業	4.76
		銀行業	7.47
		証券、商品先物取引業	1.00
		保険業	2.26
		その他金融業	1.28
		不動産業	2.72
		サービス業	3.78
		小計	97.98
合計			97.98

(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	227	円	3,103,781,000	3,125,790,000	2.05

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

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

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	261,043,042,300	81.52
	ポーランド	201,310,000	0.06
	メキシコ	100,858,000	0.03
	小計	261,345,210,300	81.61
地方債証券	日本	18,396,449,670	5.74
特殊債券	日本	24,592,379,631	7.68
社債券	日本	12,823,338,550	4.00
	オーストラリア	403,527,000	0.13
	フランス	301,022,000	0.09
	オランダ	201,950,000	0.06
	スウェーデン	200,929,000	0.06
	アメリカ	100,590,000	0.03
	小計	14,031,356,550	4.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,869,133,744	0.58
合計(純資産総額)		320,234,529,895	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	日本	608,120,000	0.19

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１１３回利付国債（５年）	4,390,000,000	101.12	4,439,343,600	101.14	4,440,177,700	0.300	2018/6/20	1.39
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,100,000,000	102.17	4,189,299,900	102.18	4,189,421,000	0.100	2026/3/20	1.31
日本	国債証券	第１１６回利付国債（５年）	3,830,000,000	101.14	3,873,776,900	101.15	3,874,236,500	0.200	2018/12/20	1.21
日本	国債証券	第１２５回利付国債（５年）	3,610,000,000	101.43	3,661,767,400	101.47	3,663,319,700	0.100	2020/9/20	1.14
日本	国債証券	第１２２回利付国債（５年）	3,560,000,000	101.20	3,602,720,000	101.23	3,603,966,000	0.100	2019/12/20	1.13
日本	国債証券	第１１７回利付国債（５年）	3,520,000,000	101.25	3,564,140,800	101.26	3,564,598,400	0.200	2019/3/20	1.11
日本	国債証券	第１１８回利付国債（５年）	3,510,000,000	101.35	3,557,455,200	101.38	3,558,508,200	0.200	2019/6/20	1.11
日本	国債証券	第１２６回利付国債（５年）	3,480,000,000	101.51	3,532,826,400	101.56	3,534,427,200	0.100	2020/12/20	1.10
日本	国債証券	第１０６回利付国債（５年）	3,260,000,000	100.58	3,278,973,200	100.59	3,279,364,400	0.200	2017/9/20	1.02
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	3,080,000,000	105.09	3,236,926,000	105.09	3,236,864,400	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第１２３回利付国債（５年）	3,140,000,000	101.26	3,179,721,000	101.30	3,180,882,800	0.100	2020/3/20	0.99
日本	国債証券	第１２０回利付国債（５年）	3,080,000,000	101.46	3,125,122,000	101.49	3,126,107,600	0.200	2019/9/20	0.98
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	2,950,000,000	104.15	3,072,690,500	104.15	3,072,661,000	0.300	2025/12/20	0.96
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	2,840,000,000	105.14	2,985,976,000	105.13	2,985,919,200	0.400	2025/9/20	0.93
日本	国債証券	第１２４回利付国債（５年）	2,810,000,000	101.34	2,847,906,900	101.39	2,849,059,000	0.100	2020/6/20	0.89
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	2,600,000,000	106.54	2,770,222,000	106.54	2,770,144,000	0.600	2024/6/20	0.87
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	2,560,000,000	106.29	2,721,228,800	106.29	2,721,177,600	0.600	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	2,490,000,000	102.72	2,557,752,900	102.73	2,558,026,800	1.500	2017/12/20	0.80
日本	国債証券	第１２７回利付国債（５年）	2,500,000,000	101.61	2,540,284,000	101.62	2,540,625,000	0.100	2021/3/20	0.79
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	2,360,000,000	107.42	2,535,119,300	107.41	2,535,064,800	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	2,390,000,000	105.82	2,529,121,900	105.81	2,529,074,100	0.500	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第１１５回利付国債（５年）	2,450,000,000	101.03	2,475,259,500	101.05	2,475,798,500	0.200	2018/9/20	0.77
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	106.65	2,442,422,400	106.65	2,442,376,600	0.800	2022/9/20	0.76
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	2,210,000,000	105.04	2,321,494,500	105.04	2,321,450,300	0.400	2025/3/20	0.72
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	2,160,000,000	105.48	2,278,389,600	105.49	2,278,713,600	1.300	2019/12/20	0.71
日本	国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	2,060,000,000	106.42	2,192,313,800	106.42	2,192,252,000	0.600	2024/3/20	0.68

日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	2,100,000,000	104.03	2,184,651,000	104.03	2,184,798,000	1.500	2018/9/20	0.68
日本	国債証券	第３６４回利付国債（２年）	2,160,000,000	100.67	2,174,523,700	100.67	2,174,601,600	0.100	2018/5/15	0.68
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	102.55	2,143,315,900	102.55	2,143,483,100	1.700	2017/9/20	0.67
日本	国債証券	第３２４回利付国債（１０年）	1,810,000,000	106.38	1,925,586,600	106.38	1,925,532,300	0.800	2022/6/20	0.60

(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	81.61
地方債証券	5.74
特殊債券	7.68
社債券	4.38
合計	99.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	4	円	608,120,648	608,120,000	0.19

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

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	149,810,233,345	56.03
	イギリス	19,463,007,895	7.28
	スイス	10,220,577,906	3.82
	カナダ	9,412,048,800	3.52
	フランス	9,293,508,601	3.48
	ドイツ	9,192,964,545	3.44
	オーストラリア	6,241,177,887	2.33
	アイルランド	4,211,310,330	1.58
	オランダ	4,210,626,036	1.57
	スペイン	3,216,537,830	1.20
	スウェーデン	2,868,622,465	1.07
	香港	2,225,634,395	0.83
	デンマーク	2,082,090,929	0.78
	イタリア	1,946,213,707	0.73
	シンガポール	1,690,072,069	0.63
	ベルギー	1,521,086,323	0.57
	ジャージー	1,151,764,046	0.43
	フィンランド	974,686,738	0.36
	キュラソー	915,701,648	0.34
	バミューダ	911,674,695	0.34
	イスラエル	650,168,011	0.24
	ノルウェー	620,706,299	0.23
	ケイマン	576,767,810	0.22
	ルクセンブルク	212,824,037	0.08
	ニュージーランド	186,415,810	0.07
	ポルトガル	176,025,023	0.07
	パナマ	165,265,898	0.06
	オーストリア	165,215,548	0.06
	リベリア	112,955,207	0.04
	英ヴァージン諸島	64,535,662	0.02
	パプアニューギニア	55,892,569	0.02
	マン島	25,985,350	0.01
	モーリシャス	12,809,249	0.00
	小計	244,585,106,663	91.48
投資信託受益証券	オーストラリア	196,138,616	0.07
	香港	51,712,449	0.02

	シンガポール	22,821,633	0.01
	小計	270,672,698	0.10
投資証券	アメリカ	4,908,873,379	1.84
	オーストラリア	654,649,058	0.24
	フランス	409,504,630	0.15
	イギリス	353,487,633	0.13
	香港	119,174,454	0.04
	シンガポール	97,707,973	0.04
	カナダ	59,279,009	0.02
	小計	6,602,676,136	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	15,895,872,682	5.95
合計(純資産総額)		267,354,328,179	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	10,179,507,712	3.81
	買建	カナダ	783,674,214	0.29
	買建	ドイツ	2,556,782,832	0.96
	買建	イギリス	1,545,897,304	0.58
	買建	オーストラリア	658,778,406	0.25

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	257,954,400	△0.10

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	427,536	11,132.82	4,759,685,179	11,132.82	4,759,685,179	1.78
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,738	5,804.38	3,376,628,878	5,804.38	3,376,628,878	1.26
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	318,846	9,985.70	3,183,903,499	9,985.70	3,183,903,499	1.19
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	211,951	12,542.87	2,658,475,196	12,542.87	2,658,475,196	0.99
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	722,989	3,341.51	2,415,876,998	3,341.51	2,415,876,998	0.90
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	30,530	79,015.90	2,412,355,598	79,015.90	2,412,355,598	0.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	174,120	13,244.01	2,306,048,275	13,244.01	2,306,048,275	0.86
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	371,816	5,641.29	2,097,525,229	5,641.29	2,097,525,229	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	282,107	7,258.80	2,047,759,476	7,258.80	2,047,759,476	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	471,373	4,325.55	2,038,947,763	4,325.55	2,038,947,763	0.76
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,547	8,307.08	2,031,473,938	8,295.90	2,028,737,946	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	23,850	81,281.30	1,938,559,015	81,281.30	1,938,559,015	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	208,455	9,033.84	1,883,149,993	9,033.84	1,883,149,993	0.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	22,345	82,938.74	1,853,266,235	82,938.74	1,853,266,235	0.69
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	473,152	3,839.63	1,816,730,222	3,839.63	1,816,730,222	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	311,799	5,615.78	1,750,995,461	5,615.78	1,750,995,461	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	144,279	11,318.09	1,632,963,977	11,318.09	1,632,963,977	0.61
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	53,915	29,469.19	1,588,831,486	29,312.55	1,580,386,672	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	316,666	4,967.89	1,573,162,868	4,967.89	1,573,162,868	0.59
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	174,656	8,905.64	1,555,424,857	8,900.05	1,554,447,831	0.58
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	90,921	15,903.24	1,445,939,302	15,903.24	1,445,939,302	0.54
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,262	14,859.30	1,445,245,587	14,859.30	1,445,245,587	0.54
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	214,289	6,265.89	1,342,711,559	6,265.89	1,342,711,559	0.50
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	120,395	11,126.17	1,339,535,550	11,126.17	1,339,535,550	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	190,391	6,975.90	1,328,149,948	6,975.90	1,328,149,948	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,422	8,837.48	1,320,513,996	8,837.48	1,320,513,996	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	798,744	1,650.78	1,318,556,371	1,650.78	1,318,556,371	0.49
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	118,803	11,003.02	1,307,192,878	11,003.02	1,307,192,878	0.49

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	362,362	3,502.37	1,269,127,900	3,502.37	1,269,127,900	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	111,745	11,311.44	1,263,997,131	11,311.44	1,263,997,131	0.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	6.74
		素材	4.28
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.49
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.75
		小売	3.76
		食品・生活必需品小売り	2.02
		食品・飲料・タバコ	6.20
		家庭用品・パーソナル用品	2.18
		ヘルスケア機器・サービス	3.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.12
		銀行	8.11
		各種金融	3.71
		保険	4.04
		不動産	0.66
		ソフトウェア・サービス	8.24
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.38
		電気通信サービス	3.15
		公益事業	3.26
		半導体・半導体製造装置	1.98
		小計	91.48
投資信託受益証券	—	—	0.10
投資証券	—	—	2.47
合計			94.05

(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 FUTU	買建	175	アメリカドル	91,756,875	10,179,507,712	91,756,875	10,179,507,712	3.81
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	56	カナダドル	9,240,000	785,769,600	9,215,360	783,674,214	0.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	65	スイスフラン	5,388,500	602,865,380	5,384,600	602,429,048	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	513	ユーロ	15,723,450	1,944,204,592	15,805,530	1,954,353,784	0.73
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	61	オーストラリアドル	8,250,250	658,534,955	8,253,300	658,778,406	0.25
	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	152	イギリスポンド	9,501,520	1,545,897,304	9,501,520	1,545,897,304	0.58

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	1,120,000.00	124,132,400	124,241,600	△0.05
	ユーロ	売建	870,000.00	107,063,980	107,566,800	△0.04
	スイスフラン	売建	100,000.00	11,131,000	11,188,000	△0.00
	デンマーククローネ	売建	900,000.00	14,877,000	14,958,000	△0.01

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

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

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	89,487,609,777	41.84
	イタリア	20,776,609,616	9.71
	フランス	20,511,509,139	9.59
	イギリス	17,110,878,594	8.00
	ドイツ	15,481,386,827	7.24
	スペイン	11,550,311,259	5.40
	ベルギー	5,417,245,233	2.53
	オランダ	4,996,641,387	2.34
	カナダ	4,345,707,591	2.03
	オーストラリア	3,744,498,195	1.75
	オーストリア	3,235,971,096	1.51
	メキシコ	1,939,870,599	0.91
	アイルランド	1,702,754,893	0.80
	デンマーク	1,422,335,921	0.67
	フィンランド	1,287,087,681	0.60
	ポーランド	1,223,911,998	0.57
	スウェーデン	1,040,741,497	0.49
	マレーシア	966,425,765	0.45
	南アフリカ	860,159,037	0.40
	シンガポール	745,615,250	0.35
	ノルウェー	640,097,327	0.30
	スイス	592,032,778	0.28
	小計	209,079,401,460	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,797,181,190	2.24
合計(純資産総額)		213,876,582,650	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	706,897,568	0.33
	買建	ドイツ	1,116,652,237	0.52

(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	—	2,488,175,000	1.16

(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 2.125% 05/15/25	12,450,000	11,374.38	1,416,110,750	11,374.38	1,416,110,750	2.125	2025/5/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,300,000	11,247.19	1,383,404,677	11,247.19	1,383,404,677	2.000	2025/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.5% 12/31/18	11,500,000	11,236.79	1,292,231,065	11,236.79	1,292,231,065	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/17	11,600,000	11,113.28	1,289,140,999	11,113.28	1,289,140,999	0.875	2017/4/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	10,300,000	11,661.26	1,201,110,541	11,661.26	1,201,110,541	2.875	2043/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	10,000,000	11,144.05	1,114,405,302	11,144.05	1,114,405,302	1.375	2020/4/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,036.14	1,103,614,657	11,036.14	1,103,614,657	0.625	2018/4/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	10,000,000	11,021.19	1,102,119,563	11,021.19	1,102,119,563	1.250	2021/3/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	11,421.40	1,039,347,675	11,421.40	1,039,347,675	2.750	2017/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,071.89	996,470,878	11,071.89	996,470,878	1.000	2019/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,609.26	986,787,462	11,609.26	986,787,462	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,722.80	984,715,576	11,722.80	984,715,576	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	11,106.35	977,358,864	11,106.35	977,358,864	0.875	2017/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	11,112.20	946,759,537	11,112.20	946,759,537	1.250	2020/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	11,268.64	946,566,083	11,268.64	946,566,083	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	11,497.02	937,007,477	11,497.02	937,007,477	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/18	8,000,000	11,415.76	913,261,550	11,415.76	913,261,550	2.625	2018/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	11,317.39	905,391,742	11,317.39	905,391,742	2.750	2017/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	11,238.95	899,116,700	11,238.95	899,116,700	1.500	2019/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	7,650,000	11,614.89	888,539,697	11,614.89	888,539,697	2.875	2045/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	11,242.85	888,185,857	11,242.85	888,185,857	1.875	2017/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	11,278.82	845,912,086	11,278.82	845,912,086	1.625	2019/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/23	7,550,000	11,168.32	843,208,246	11,168.32	843,208,246	1.750	2023/1/31	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000	16,233.14	836,006,862	16,200.68	834,335,269	4.250	2023/10/25	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	4,350,000	18,949.42	824,299,958	18,936.75	823,748,634	6.000	2031/5/1	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	11,919.98	822,478,828	11,919.98	822,478,828	2.750	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	11,099.20	793,592,822	11,099.20	793,592,822	1.625	2022/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	6,500,000	12,205.35	793,347,757	12,205.35	793,347,757	3.125	2044/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	7,000,000	11,224.44	785,710,880	11,224.44	785,710,880	1.750	2022/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,000,000	11,159.43	781,160,611	11,159.43	781,160,611	1.750	2023/5/15	0.37

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.76
合計	97.76

(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	26	アメリカドル	3,122,843.88	346,448,300	3,122,843.88	346,448,300	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカドル	1,945,546.95	215,838,978	1,945,546.95	215,838,978	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	8	アメリカドル	1,303,500	144,610,290	1,303,500	144,610,290	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,789,600	221,284,040	1,789,440	221,264,256	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	19	ユーロ	2,497,170	308,775,070	2,495,460	308,563,629	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	29	ユーロ	4,756,000	588,079,400	4,745,850	586,824,352	0.27

(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	10,020,000.00	1,108,913,400	1,111,017,600	0.52
	カナダドル	買建	1,170,000.00	99,052,200	99,438,300	0.05
	ユーロ	買建	8,690,000.00	1,068,001,000	1,074,431,600	0.50
	イギリスポンド	買建	1,250,000.00	202,150,000	203,287,500	0.10

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

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

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	韓国	3,739,401,348	14.26
	台湾	3,084,105,168	11.76
	中国	2,701,407,124	10.30
	インド	2,261,733,878	8.63
	ケイマン	2,111,730,474	8.05
	南アフリカ	1,584,523,545	6.04
	ブラジル	1,572,791,405	6.00
	香港	1,100,786,032	4.20
	メキシコ	1,051,929,141	4.01
	ロシア	1,009,110,719	3.85
	マレーシア	783,621,362	2.99
	インドネシア	647,642,546	2.47
	タイ	614,642,333	2.34
	フィリピン	384,848,980	1.47
	トルコ	361,119,451	1.38
	ポーランド	335,904,796	1.28
	チリ	316,593,774	1.21
	バミューダ	252,636,578	0.96
	アラブ首長国連邦	233,212,235	0.89
	カタール	218,137,472	0.83
	コロンビア	134,039,097	0.51
	オランダ	116,755,992	0.45
	ハンガリー	80,530,631	0.31
	チェコ	70,766,721	0.27
	エジプト	44,377,222	0.17
	アメリカ	27,147,635	0.10
	マルタ共和国	23,391,616	0.09
	ペルー	17,880,599	0.07
	マン島	14,412,395	0.05
	小計	24,895,180,269	94.96
投資信託受益証券	ブラジル	52,240,036	0.20
投資証券	南アフリカ	80,446,591	0.31
	メキシコ	33,751,294	0.13
	トルコ	13,798,101	0.05
	小計	127,995,986	0.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,141,909,244	4.36

合計(純資産総額)	26,217,325,535	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,125,264,420	4.29

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	17,395,383	0.07
	売建	—	766,972	△0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	361,200	2,177.11	786,372,424	2,426.17	876,333,326	3.34
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,563,389	485.19	758,551,220	533.79	834,537,048	3.18
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,520	123,934.21	808,051,066	119,424.00	778,644,480	2.97
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	389,500	1,289.98	502,449,771	1,256.64	489,461,280	1.87
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	27,657	14,657.09	405,371,289	15,955.70	441,287,066	1.68
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	5,314,620	78.52	417,332,686	70.97	377,187,085	1.44
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	31,674	9,126.08	289,059,668	8,982.81	284,521,581	1.09
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,654,515	68.32	318,028,444	58.54	272,512,544	1.04
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	117,097	1,879.11	220,038,894	2,104.21	246,397,381	0.94
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ	895,829	289.59	259,428,007	270.30	242,142,579	0.92

			ジー・ハードウェアおよび機器						
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,978,200	50.22	250,015,603	45.12	224,640,279	0.86
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	399,588	461.14	184,268,808	496.01	198,200,738	0.76
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	95,319	1,962.22	187,037,295	2,048.35	195,247,341	0.74
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	8,646	23,153.36	200,184,020	20,525.00	177,459,231	0.68
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	189,529	851.16	161,320,842	922.77	174,893,381	0.67
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	291,100	579.10	168,577,410	594.99	173,201,735	0.66
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	178,167	684.79	122,008,749	940.43	167,555,084	0.64
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	330,000	637.69	210,439,054	484.09	159,750,360	0.61
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,155,000	123.54	142,699,647	132.23	152,728,884	0.58
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	33,685	4,309.02	145,149,645	4,517.47	152,171,206	0.58
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,953,040	79.10	154,491,205	69.17	135,101,737	0.52
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	178,728	610.24	109,067,101	745.67	133,273,895	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	30,202	4,090.78	123,549,770	4,376.42	132,176,758	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,323	104,736.52	138,566,424	97,685.09	129,237,387	0.49
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	10,030	15,192.90	152,384,828	12,735.44	127,736,563	0.49
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	79,350	1,594.55	126,527,768	1,608.04	127,598,133	0.49
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	36,846	3,128.98	115,290,453	3,423.60	126,146,334	0.48
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,599,400	75.64	120,985,331	76.39	122,190,961	0.47
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	496,000	384.70	190,814,755	243.61	120,833,933	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	1,807	59,544.08	107,596,154	66,243.00	119,701,101	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	7.49
		素材	6.39
		資本財	4.47
		商業・専門サービス	0.12

		運輸	1.57
		自動車・自動車部品	3.30
		耐久消費財・アパレル	1.45
		消費者サービス	0.80
		メディア	2.47
		小売	1.53
		食品・生活必需品小売り	1.61
		食品・飲料・タバコ	4.50
		家庭用品・パーソナル用品	1.56
		ヘルスケア機器・サービス	0.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.96
		銀行	16.86
		各種金融	3.05
		保険	3.51
		不動産	2.23
		ソフトウェア・サービス	8.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.70
		電気通信サービス	6.40
		公益事業	3.11
		半導体・半導体製造装置	4.71
		小計	94.96
投資信託受益証券	—	—	0.20
投資証券	—	—	0.49
合計			95.64

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	252	アメリカドル	10,334,814	1,146,544,265	10,143,000	1,125,264,420	4.29

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

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

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	156,814.07	17,365,857	17,395,383	0.07
	ブラジルレアル	売建	24,685.33	756,357	766,972	△0.00

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

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

新興国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	ポーランド	2,026,184,891	9.99
	ブラジル	2,024,739,485	9.98
	インドネシア	1,992,195,060	9.82
	マレーシア	1,977,495,174	9.75
	メキシコ	1,896,543,983	9.35
	トルコ	1,838,949,324	9.07
	タイ	1,809,409,979	8.92
	南アフリカ	1,694,867,030	8.36
	コロンビア	1,257,400,980	6.20
	ハンガリー	1,091,299,379	5.38
	ロシア	1,030,092,571	5.08
	ペルー	358,308,671	1.77
	フィリピン	101,359,923	0.50
	チリ	16,849,509	0.08
	小計	19,115,695,959	94.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,168,711,977	5.76
合計(純資産総額)		20,284,407,936	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	18,000,000,000	3.69	664,562,650	3.61	651,343,275	7.750	2021/4/14	3.21

コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	10,950,000,000	3.00	329,156,120	2.97	326,037,339	4.375	2023/3/21	1.61
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	93,700,000	332.39	311,454,533	330.80	309,963,798	3.875	2019/6/13	1.53
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	40,800,000	788.15	321,566,719	750.61	306,249,155	10.500	2026/12/21	1.51
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/21	10,650,000	2,563.14	272,974,478	2,837.18	302,160,669	10.000	2021/1/1	1.49
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	86,800,000	333.67	289,633,738	339.05	294,297,309	3.650	2021/12/17	1.45
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	33,500,000,000	0.80	269,201,475	0.83	280,285,555	8.375	2024/3/15	1.38
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	6,830,000,000	4.15	283,954,121	4.09	280,020,366	9.850	2027/6/28	1.38
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	62,150,000	392.53	243,962,934	397.55	247,078,133	4.875	2029/6/22	1.22
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/17	8,350,000	2,450.11	204,584,238	2,716.95	226,865,871	0.000	2017/7/1	1.12
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	28,950,000	767.35	222,149,129	760.90	220,282,886	10.000	2024/12/5	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/18	9,100,000	2,121.35	193,043,007	2,419.08	220,136,483	0.000	2018/7/1	1.09
インドネシア	国債証券	INDOGB 9% 03/15/29	24,000,000,000	0.81	196,362,873	0.87	209,934,504	9.000	2029/3/15	1.03
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	59,000,000	337.49	199,120,871	342.69	202,192,218	3.625	2023/6/16	1.00
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/19	9,350,000	1,841.41	172,172,133	2,148.35	200,870,789	0.000	2019/7/1	0.99
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/19	8,800,000	1,977.91	174,056,682	2,279.86	200,628,286	0.000	2019/1/1	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 12/13/18	30,600,000	662.56	202,746,403	651.37	199,321,000	8.500	2018/12/13	0.98
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	7,200,000	2,385.78	171,776,495	2,745.38	197,667,853	10.000	2023/1/1	0.97
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	7,400,000	2,307.66	170,767,194	2,667.11	197,366,533	10.000	2025/1/1	0.97
ポーランド	国債証券	POLGB 3.75% 04/25/18	6,400,000	2,942.33	188,309,421	2,926.68	187,307,993	3.750	2018/4/25	0.92
トルコ	国債証券	TURKGB 9.4% 07/08/20	4,900,000	3,634.09	178,070,756	3,734.34	182,983,043	9.400	2020/7/8	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	56,300,000	319.26	179,746,441	316.59	178,244,674	3.250	2017/6/16	0.88
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	5,950,000	2,703.39	160,851,779	2,944.27	175,184,377	10.000	2019/1/1	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 4% 10/25/23	5,700,000	3,048.91	173,787,998	3,040.38	173,302,165	4.000	2023/10/25	0.85
タイ	国債証券	THAIGB 3.85% 12/12/25	48,400,000	346.61	167,763,000	357.11	172,845,203	3.850	2025/12/12	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	6,000,000	2,901.54	174,092,901	2,874.32	172,459,405	3.250	2025/7/25	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	5,100,000	3,356.49	171,181,000	3,328.00	169,728,205	5.750	2022/9/23	0.84
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 07/15/21	19,900,000,000	0.81	162,722,447	0.83	165,965,254	8.250	2021/7/15	0.82
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 10/25/19	5,200,000	3,172.93	164,992,549	3,145.48	163,565,092	5.500	2019/10/25	0.81
ハンガリー	国債証券	HGB 6.5% 06/24/19	362,000,000	45.02	162,983,977	44.85	162,387,935	6.500	2019/6/24	0.80

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	94.24
合計	94.24

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	73,363,344,900	98.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,036,825,194	1.39
合計(純資産総額)		74,400,170,094	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	871,930,000	1.17

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

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

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	8,733	568,042.59	4,960,715,988	659,000	5,755,047,000	7.74
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,098	553,685.02	4,483,741,355	649,000	5,255,602,000	7.06
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	15,784	233,966.09	3,692,920,823	257,700	4,067,536,800	5.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	23,019	155,798.97	3,586,336,494	175,000	4,028,325,000	5.41

日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	17,016	166,800.45	2,838,276,472	175,000	2,977,800,000	4.00
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	11,392	225,131.95	2,564,703,282	240,400	2,738,636,800	3.68
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	14,975	162,277.35	2,430,103,374	175,300	2,625,117,500	3.53
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,399	401,583.68	2,168,150,319	474,500	2,561,825,500	3.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,040	269,445.53	2,166,342,095	280,500	2,255,220,000	3.03
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,709	507,920.97	1,883,878,896	566,000	2,099,294,000	2.82
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	16,042	119,954.65	1,924,312,497	127,400	2,043,750,800	2.75
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	20,545	88,449.19	1,817,188,732	96,300	1,978,483,500	2.66
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,993	614,348.47	1,838,744,979	659,000	1,972,387,000	2.65
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,827	151,319.92	1,638,340,879	165,800	1,795,116,600	2.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	22,734	72,640.89	1,651,418,015	76,300	1,734,604,200	2.33
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	8,164	212,035.61	1,731,058,742	211,400	1,725,869,600	2.32
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,068	492,228.03	1,510,155,609	542,000	1,662,856,000	2.24
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,504	545,291.14	1,365,409,015	630,000	1,577,520,000	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,997	425,757.19	1,275,994,316	457,000	1,369,629,000	1.84
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,442	229,490.07	1,248,884,986	244,400	1,330,024,800	1.79
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,169	499,851.81	1,084,178,576	599,000	1,299,231,000	1.75
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,625	248,241.04	1,148,114,855	272,000	1,258,000,000	1.69
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,180	549,057.85	1,196,946,134	572,000	1,246,960,000	1.68
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	7,820	133,809.79	1,046,392,566	149,400	1,168,308,000	1.57
日本	投資証券	プレミア投資法人	8,145	118,503.11	965,207,863	141,300	1,150,888,500	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	8,099	141,830.65	1,148,686,469	141,200	1,143,578,800	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	5,919	168,566.33	997,744,127	189,800	1,123,426,200	1.51
日本	投資証券	福岡リート投資法人	4,620	195,206.86	901,855,704	203,400	939,708,000	1.26
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	6,046	147,571.6	892,217,951	152,700	923,224,200	1.24
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	10,143	81,204.03	823,652,526	86,200	874,326,600	1.18

(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	98.61
合計	98.61

(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	460	円	869,995,400	871,930,000	1.17

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

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

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	41,724,108,793	71.36
	オーストラリア	4,762,865,448	8.15
	イギリス	3,604,284,600	6.16
	フランス	2,663,352,367	4.56
	シンガポール	1,733,209,659	2.96
	カナダ	1,163,539,782	1.99
	香港	939,202,240	1.61
	ベルギー	398,486,583	0.68
	オランダ	322,976,150	0.55
	ニュージーランド	289,751,270	0.50
	スペイン	260,023,316	0.44
	アイルランド	142,652,146	0.24
	ドイツ	113,774,074	0.19
	イタリア	60,695,008	0.10
	マン島	50,540,933	0.09
	ガーンジー	39,677,649	0.07
	イスラエル	24,148,334	0.04
	小計	58,293,288,352	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	175,470,530	0.30
合計(純資産総額)		58,468,758,882	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	34,610,050	0.06

(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	SIMON PROPERTY GROUP	153,020	21,256.10	3,252,609,034	21,940.60	3,357,351,193	5.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	72,750	25,317.61	1,841,856,666	28,315.21	2,059,931,979	3.52
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	48,430	29,781.10	1,442,298,794	30,263.33	1,465,653,435	2.51
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	180,130	8,453.62	1,522,752,012	7,623.79	1,373,274,518	2.35
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	258,830	4,537.44	1,174,427,148	5,278.52	1,366,240,677	2.34
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,580	18,946.33	1,280,393,198	19,985.84	1,350,643,135	2.31
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	175,190	6,572.08	1,151,363,677	7,684.81	1,346,302,530	2.30
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	165,180	5,547.00	916,253,460	7,356.43	1,215,135,339	2.08
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	76,230	13,621.41	1,038,360,547	13,912.98	1,060,586,877	1.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,643,790	320.87	848,329,817	372.75	985,497,574	1.69
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	86,990	10,524.87	915,559,120	10,562.59	918,840,348	1.57
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	285,740	2,956.55	844,804,882	2,989.83	854,314,881	1.46
アメリカ	投資証券	HCP INC	228,370	3,676.55	839,614,089	3,665.45	837,080,552	1.43
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	123,200	5,183.11	638,559,990	6,645.30	818,701,699	1.40
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,070	24,014.07	770,131,302	25,172.28	807,275,212	1.38
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	941,430	785.42	739,426,235	854.07	804,050,886	1.38
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	398,770	2,072.48	826,446,442	1,932.87	770,772,962	1.32
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	72,560	7,969.96	578,300,340	10,501.58	761,994,674	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	1,116,500	648.04	723,539,889	673.30	751,741,683	1.29
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	62,490	8,516.88	532,220,170	10,309.65	644,250,291	1.10
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	202,500	2,834.51	573,989,692	3,118.52	631,500,988	1.08
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	368,200	1,897.07	698,502,646	1,697.38	624,976,052	1.07
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	500,750	1,332.51	667,255,885	1,236.52	619,187,390	1.06
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,960	15,862.13	554,540,249	17,040.38	595,731,825	1.02
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	49,900	12,685.95	633,029,053	11,158.34	556,801,425	0.95
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	63,640	8,610.05	547,943,799	8,452.51	537,918,284	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	130,490	3,778.61	493,071,654	4,011.59	523,472,431	0.90
フランス	投資証券	KLEPIERRE	93,350	5,103.65	476,426,078	5,145.69	480,350,605	0.82
アメリカ	投資証券	VEREIT INC	450,960	894.03	403,172,715	1,056.14	476,280,863	0.81
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	116,550	3,489.51	406,703,525	4,082.59	475,826,098	0.81

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.70
合計	99.70

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

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	290,000.00	32,111,700	32,169,700	0.06
	イギリスポンド	買建	15,000.00	2,426,985	2,440,350	0.00

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

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

新興国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	南アフリカ	154,290,746	41.30
	メキシコ	122,211,366	32.72
	マレーシア	28,453,242	7.62
	タイ	27,696,136	7.41
	トルコ	26,428,985	7.08
	台湾	10,112,212	2.71
	小計	369,192,687	98.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,355,773	1.17
合計(純資産総額)		373,548,460	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	投資比率(%)
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	277,600	217.34	60,336,114	238.35	66,167,792	17.71
南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	229,650	176.95	40,637,093	167.52	38,472,093	10.30
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	479,160	79.14	37,925,134	76.69	36,750,278	9.84
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	36,970	845.77	31,268,145	927.46	34,288,488	9.18
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	203,390	105.62	21,483,426	101.73	20,691,556	5.54
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,210	838.56	18,624,554	844.37	18,753,531	5.02
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	80,600	219.16	17,664,372	203.25	16,382,611	4.39
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	64,600	177.71	11,480,175	185.70	11,996,801	3.21
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	82,200	128.75	10,583,356	142.85	11,742,903	3.14
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	177,000	55.27	9,784,003	59.09	10,458,930	2.80
タイ	投資証券	TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	178,100	42.22	7,520,491	49.44	8,806,867	2.36
台湾	投資証券	CATHAY NO 1 REIT	120,000	58.25	6,991,117	57.63	6,915,600	1.85
マレーシア	投資証券	KLCCP STAPLED GROUP	32,100	189.75	6,091,113	198.30	6,365,526	1.70
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	50,810	127.48	6,477,744	120.28	6,111,595	1.64
南アフリカ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	164,470	34.09	5,608,026	35.22	5,792,683	1.55
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	127,800	35.82	4,578,800	42.35	5,413,429	1.45
南アフリカ	投資証券	EMIRA PROPERTY FUND LTD	49,170	119.87	5,894,435	109.45	5,382,006	1.44
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	122,000	42.15	5,142,787	43.97	5,365,242	1.44
タイ	投資証券	SAMUI AIRPORT PROPERTY FUND	69,800	62.31	4,349,924	74.32	5,188,164	1.39
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	30,200	154.44	4,664,214	169.42	5,116,541	1.37
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	47,700	94.46	4,506,016	87.14	4,156,817	1.11
マレーシア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	90,300	42.00	3,793,219	45.86	4,141,700	1.11
マレーシア	投資証券	CAPITALAND MALAYSIA MALL TRU	94,600	37.80	3,576,274	40.73	3,853,985	1.03
メキシコ	投資証券	FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOB	35,000	100.19	3,506,669	96.76	3,386,635	0.91
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	73,100	44.78	3,274,012	45.32	3,313,360	0.89
メキシコ	投資証券	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	40,800	80.09	3,267,812	79.93	3,261,266	0.87
タイ	投資証券	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	75,000	37.00	2,775,466	43.22	3,242,175	0.87
台湾	投資証券	CATHAY NO 2 REIT	58,000	52.62	3,052,296	55.11	3,196,612	0.86
トルコ	投資証券	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	46,203	50.37	2,327,570	63.81	2,948,583	0.79
南アフリカ	投資証券	REBOSIS PROPERTY FUND LTD	41,384	75.02	3,104,799	67.83	2,807,470	0.75

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.83
合計	98.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2014年11月28日
作成基準日：2016年５月31日

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,932円
純資産総額	24.11億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額:0円

決算期	2015年4月	2015年10月	2016年4月	－	－
分配金	0円	0円	0円	－	－

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	21.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
外国債券インデックスマザーファンド	21.6%	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%
		T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.1%
新興国債券インデックスマザーファンド	13.4%	COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	国債	-	7.750%	2021/04/14	0.4%
		COLOM 4.375% 03/21/23	コロンビア	国債	-	4.375%	2023/03/21	0.2%
新興国株式インデックスマザーファンド	13.3%	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.4%
グローバルREITインデックスマザーファンド	11.3%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
新興国REITインデックスマザーファンド	6.5%	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	1.1%
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	南アフリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
国内債券インデックスマザーファンド	4.4%	第113回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.1%
		第342回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/03/20	0.1%
国内株式インデックスマザーファンド	3.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%
J-REITインデックスマザーファンド	2.3%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※2014年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://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（http://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前 9 時から午後 5 時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（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。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（http://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：http://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。（平成 26 年 11 月 28 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 4 月 21 日から 10 月 20 日まで及び 10 月 21 日から翌年 4 月 20 日までとします。
ただし、第 1 計算期間は平成 26 年 11 月 28 日から平成 27 年 4 月 20 日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又は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。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

②収益分配金は、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ます。）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。

③上記②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。

④上記②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。

⑤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

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 3 期計算期間(平成 27 年 10 月 21 日から平成 28 年 4 月 20 日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成２８年6月２０日

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

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　青木裕晃　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている SMT インデックスバランス・オープンの平成２７年１０月２１日から平成２８年４月２０日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの平成２８年４月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

1【財務諸表】

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第２期 （平成27年10月20日現在）	第３期 （平成28年 4月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	23,873,327
コール・ローン	34,894,583	17,785,244
親投資信託受益証券	1,731,561,505	2,311,156,185
未収利息	54	－
流動資産合計	1,766,456,142	2,352,814,756
資産合計	1,766,456,142	2,352,814,756
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,862,578	2,025,802
未払受託者報酬	394,875	546,562
未払委託者報酬	3,553,830	4,918,990
未払利息	－	51
その他未払費用	39,436	54,802
流動負債合計	7,850,719	7,546,207
負債合計	7,850,719	7,546,207
純資産の部		
元本等		
元本	1,849,380,439	2,598,746,848
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△90,775,016	△253,478,299
（分配準備積立金）	30,903,296	52,641,479
元本等合計	1,758,605,423	2,345,268,549
純資産合計	1,758,605,423	2,345,268,549
負債純資産合計	1,766,456,142	2,352,814,756

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第２期 自　平成27年４月21日 至　平成27年10月20日	第３期 自　平成27年10月21日 至　平成28年４月20日
営業収益		
受取利息	9,597	8,003
有価証券売買等損益	△73,862,949	△86,858,749
営業収益合計	△73,853,352	△86,850,746
営業費用		
支払利息	－	81
受託者報酬	394,875	546,562
委託者報酬	3,553,830	4,918,990
その他費用	39,436	54,802
営業費用合計	3,988,141	5,520,435
営業利益又は営業損失（△）	△77,841,493	△92,371,181
経常利益又は経常損失（△）	△77,841,493	△92,371,181
当期純利益又は当期純損失（△）	△77,841,493	△92,371,181
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（△）	△4,799,107	△8,877,132
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,248,453	△90,775,016
剰余金増加額又は欠損金減少額	－	17,381,901
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	17,381,901
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,981,083	96,591,135
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	446,749	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,534,334	96,591,135
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△90,775,016	△253,478,299

（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２期 （平成 27 年 10 月 20 日現在）		第３期 （平成 28 年 4 月 20 日現在）	
１．計算期間の末日における受益権の総数		1,849,380,439 口		2,598,746,848 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	90,775,016 円	元本の欠損	253,478,299 円
３．計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	0.9509 円 （9,509 円）	1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	0.9025 円 （9,025 円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第２期
自 平成 27 年 4 月 21 日
至 平成 27 年 10 月 20 日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	20,220,914 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	17,774,275 円
分配準備積立金額	D	10,682,382 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	48,677,571 円
当ファンドの期末残存口数	F	1,849,380,439 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	263 円
1 万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第３期
自 平成 27 年 10 月 21 日
至 平成 28 年 4 月 20 日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	26,040,231 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	43,416,960 円
分配準備積立金額	D	26,601,248 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	96,058,439 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,598,746,848 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	369 円
1 万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第3期 （平成28年 4月20日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第2期 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	第3期 自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,067,935,269円	1,849,380,439円
期中追加設定元本額	1,116,037,756円	1,083,752,766円
期中一部解約元本額	334,592,586円	334,386,357円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第2期 （平成27年10月20日現在）	第3期 （平成28年 4月20日現在）
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△73,297,681	△85,734,466
合計	△73,297,681	△85,734,466

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	32,907,605	53,191,852	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	161,902,055	261,131,824	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	151,672,221	321,211,429	
	国内株式インデックス　マザーファンド	76,905,999	90,349,167	
	外国株式インデックス　マザーファンド	266,486,384	499,102,348	
	国内債券インデックス　マザーファンド	72,320,132	102,166,650	
	外国債券インデックス　マザーファンド	187,951,150	498,070,547	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	210,234,706	322,352,874	
	新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	196,209,061	163,579,494	
合計		1,356,589,313	2,311,156,185	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	766,958,583
コール・ローン	571,371,772
株式	147,234,139,750
派生商品評価勘定	53,759,740
未収入金	677,840
未収配当金	1,442,469,277
差入委託証拠金	118,000,000
流動資産合計	150,187,376,962
資産合計	150,187,376,962
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,466,560
前受金	45,338,000
未払解約金	178,019,747
未払利息	1,662
その他未払費用	7,530
流動負債合計	231,833,499
負債合計	231,833,499
純資産の部	
元本等	
元本	127,638,299,673
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,317,243,790
元本等合計	149,955,543,463
純資産合計	149,955,543,463
負債純資産合計	150,187,376,962

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	127,638,299,673 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　1.1748 円 (1 万口当たり純資産額)　(11,748 円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	116,654,450,151 円
期中追加設定元本額	19,486,626,814 円
期中一部解約元本額	8,502,777,292 円
期末元本額	127,638,299,673 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）	1,117,011,552 円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,690,028,112 円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	30,651,058 円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	8,269,696,188 円
世界経済インデックスファンド	814,112,852 円
マイセレクション２５	30,801,060 円
マイセレクション５０	74,616,050 円
マイセレクション７５	71,415,780 円
日本株式インデックス・オープン	16,968,691,831 円
ＤＣマイセレクション２５	5,561,690,870 円
ＤＣマイセレクション５０	17,393,796,927 円

ＤＣマイセレクション７５	15,409,525,846 円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	4,792,951,348 円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,413,033,183 円
ＤＣマイセレクションＳ５０	6,669,276,066 円
ＤＣマイセレクションＳ７５	4,110,146,484 円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	3,388,986,635 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	497,951,475 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	565,138,968 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	296,168,233 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,085,254,230 円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	394,459,191 円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	48,616,159 円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	136,975,192 円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	77,528,615 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）	856,405,392 円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,113,947 円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	309,375,692 円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,090,160,484 円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	186,616,037 円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,126,310,597 円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,772,567,304 円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,299,723,122 円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,174,126,792 円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,173,481,050 円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,015,044,028 円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,471,092,003 円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	2,692,763,829 円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	807,923,683 円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,155,796,761 円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	92,575,405 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）	1,857,474,616 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,066,936,993 円
日本株式ファンド・シリーズ２	678,967,181 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	58,761,454 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	85,420,198 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	190,083,481 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,490,283 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	76,905,999 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）	2,475,659,437 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成 28 年 4 月 20 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△27,563,880,089
合計	△27,563,880,089

(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

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,733,186,820	－	2,778,480,000	45,293,180
合計		2,733,186,820	－	2,778,480,000	45,293,180

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	35,000	264.00	9,240,000	
日本水産	94,100	593.00	55,801,300	
マルハニチロ	16,700	2,448.00	40,881,600	
サカタのタネ	12,100	2,673.00	32,343,300	
ホクト	8,300	2,073.00	17,205,900	
ホクリヨウ	800	1,073.00	858,400	
住石ホールディングス	24,000	94.00	2,256,000	
日鉄鉱業	23,000	414.00	9,522,000	
三井松島産業	53,000	114.00	6,042,000	
国際石油開発帝石	430,400	869.00	374,017,600	
日本海洋掘削	2,400	2,438.00	5,851,200	
石油資源開発	12,900	2,517.00	32,469,300	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,500	1,311.00	7,210,500	
ショーボンドホールディングス	8,600	4,945.00	42,527,000	
ミライト・ホールディングス	25,100	980.00	24,598,000	
タマホーム	6,100	432.00	2,635,200	
サンヨーホームズ	1,700	500.00	850,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	1,199.00	2,278,100	
安藤・間	54,600	572.00	31,231,200	

東急建設	26,600	917.00	24,392,200	
コムシスホールディングス	35,100	1,707.00	59,915,700	
ミサワホーム	10,200	745.00	7,599,000	
高松コンストラクショングループ	6,200	2,436.00	15,103,200	
東建コーポレーション	3,400	8,770.00	29,818,000	
ヤマウラ	4,200	494.00	2,074,800	
大成建設	424,000	765.00	324,360,000	
大林組	245,000	1,114.00	272,930,000	
清水建設	250,000	1,006.00	251,500,000	
飛島建設	65,600	187.00	12,267,200	
長谷工コーポレーション	95,400	1,040.00	99,216,000	
松井建設	9,100	828.00	7,534,800	
錢高組	12,000	468.00	5,616,000	
鹿島建設	383,000	714.00	273,462,000	
不動テトラ	57,900	146.00	8,453,400	
大末建設	3,100	741.00	2,297,100	
鉄建建設	51,000	286.00	14,586,000	
西松建設	94,000	497.00	46,718,000	
三井住友建設	313,000	100.00	31,300,000	
大豊建設	32,000	492.00	15,744,000	
前田建設工業	50,000	879.00	43,950,000	
佐田建設	6,200	418.00	2,591,600	
ナカノフドー建設	6,700	530.00	3,551,000	
奥村組	78,000	588.00	45,864,000	
東鉄工業	9,800	3,290.00	32,242,000	
イチケン	10,000	296.00	2,960,000	
淺沼組	26,000	278.00	7,228,000	
戸田建設	95,000	546.00	51,870,000	
熊谷組	120,000	308.00	36,960,000	
青木あすなろ建設	5,400	703.00	3,796,200	
北野建設	18,000	269.00	4,842,000	
植木組	11,000	223.00	2,453,000	
三井ホーム	11,000	524.00	5,764,000	
矢作建設工業	11,100	813.00	9,024,300	
ピーエス三菱	10,100	422.00	4,262,200	
日本ハウスホールディングス	16,600	385.00	6,391,000	

大東建託	30,500	15,875.00	484,187,500	
新日本建設	9,900	522.00	5,167,800	
ＮＩＰＰＯ	19,000	1,903.00	36,157,000	
東亜道路工業	15,000	375.00	5,625,000	
前田道路	26,000	2,017.00	52,442,000	
日本道路	24,000	553.00	13,272,000	
東亜建設工業	71,000	264.00	18,744,000	
若築建設	47,000	159.00	7,473,000	
東洋建設	25,600	502.00	12,851,200	
五洋建設	90,700	521.00	47,254,700	
大林道路	9,500	792.00	7,524,000	
世紀東急工業	12,800	492.00	6,297,600	
福田組	13,000	1,201.00	15,613,000	
住友林業	56,300	1,311.00	73,809,300	
日本基礎技術	9,100	446.00	4,058,600	
日成ビルド工業	23,000	408.00	9,384,000	
巴コーポレーション	10,800	355.00	3,834,000	
パナホーム	31,000	817.00	25,327,000	
大和ハウス工業	241,300	3,026.00	730,173,800	
ライト工業	15,700	1,256.00	19,719,200	
積水ハウス	273,100	1,972.50	538,689,750	
日特建設	8,900	477.00	4,245,300	
北陸電気工事	3,000	808.00	2,424,000	
ユアテック	13,000	894.00	11,622,000	
西部電気工業	7,000	456.00	3,192,000	
四電工	6,000	362.00	2,172,000	
中電工	11,800	2,203.00	25,995,400	
関電工	33,000	804.00	26,532,000	
きんでん	49,400	1,356.00	66,986,400	
東京エネシス	9,000	839.00	7,551,000	
トーエネック	11,000	702.00	7,722,000	
住友電設	6,500	1,423.00	9,249,500	
日本電設工業	13,300	2,239.00	29,778,700	
協和エクシオ	32,000	1,268.00	40,576,000	
新日本空調	6,900	1,009.00	6,962,100	
ＮＤＳ	13,000	293.00	3,809,000	

九電工	15,000	2,830.00	42,450,000	
三機工業	18,100	887.00	16,054,700	
日揮	82,000	1,869.00	153,258,000	
中外炉工業	25,000	188.00	4,700,000	
ヤマト	7,400	483.00	3,574,200	
太平電業	12,000	879.00	10,548,000	
高砂熱学工業	24,400	1,420.00	34,648,000	
三晃金属工業	9,000	356.00	3,204,000	
朝日工業社	10,000	447.00	4,470,000	
明星工業	14,800	460.00	6,808,000	
大氣社	10,000	2,669.00	26,690,000	
ダイダン	11,000	732.00	8,052,000	
日比谷総合設備	9,800	1,520.00	14,896,000	
東芝プラントシステム	13,300	1,408.00	18,726,400	
ＯＳＪＢホールディングス	16,600	268.00	4,448,800	
東洋エンジニアリング	44,000	307.00	13,508,000	
千代田化工建設	59,000	860.00	50,740,000	
新興プランテック	16,800	834.00	14,011,200	
日本製粉	54,000	851.00	45,954,000	
日清製粉グループ本社	89,600	1,811.00	162,265,600	
日東富士製粉	6,000	348.00	2,088,000	
昭和産業	34,000	491.00	16,694,000	
鳥越製粉	6,500	637.00	4,140,500	
中部飼料	7,600	860.00	6,536,000	
フィード・ワン	49,400	123.00	6,076,200	
東洋精糖	13,000	104.00	1,352,000	
日本甜菜製糖	42,000	188.00	7,896,000	
三井製糖	32,000	503.00	16,096,000	
塩水港精糖	8,900	263.00	2,340,700	
日新製糖	3,500	1,347.00	4,714,500	
森永製菓	74,000	528.00	39,072,000	
中村屋	19,000	452.00	8,588,000	
江崎グリコ	18,900	5,220.00	98,658,000	
名糖産業	3,600	1,305.00	4,698,000	
不二家	47,000	191.00	8,977,000	
山崎製パン	60,000	2,515.00	150,900,000	

第一屋製パン	13,000	107.00	1,391,000	
モロゾフ	13,000	431.00	5,603,000	
亀田製菓	4,600	4,380.00	20,148,000	
寿スピリッツ	5,800	2,208.00	12,806,400	
カルビー	30,300	4,240.00	128,472,000	
森永乳業	73,000	568.00	41,464,000	
六甲バター	3,700	1,823.00	6,745,100	
ヤクルト本社	43,800	5,420.00	237,396,000	
明治ホールディングス	48,400	8,680.00	420,112,000	
雪印メグミルク	19,200	2,560.00	49,152,000	
プリマハム	52,000	288.00	14,976,000	
日本ハム	60,000	2,445.00	146,700,000	
丸大食品	42,000	451.00	18,942,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,100	2,718.00	13,861,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	48,800	816.00	39,820,800	
サッポロホールディングス	125,000	593.00	74,125,000	
アサヒグループホールディングス	153,300	3,573.00	547,740,900	
キリンホールディングス	331,100	1,635.00	541,348,500	
宝ホールディングス	59,200	926.00	54,819,200	
オエノンホールディングス	22,000	215.00	4,730,000	
養命酒製造	2,500	1,929.00	4,822,500	
コカ・コーラウエスト	27,700	2,784.00	77,116,800	
コカ・コーライーストジャパン	28,900	1,820.00	52,598,000	
サントリー食品インターナショナル	56,000	4,935.00	276,360,000	
ダイドードリンコ	4,100	5,370.00	22,017,000	
伊藤園	24,200	3,515.00	85,063,000	
キーコーヒー	7,200	1,822.00	13,118,400	
ユニカフェ	2,200	891.00	1,960,200	
ジャパンフーズ	1,100	1,165.00	1,281,500	
日清オイリオグループ	43,000	453.00	19,479,000	
不二製油グループ本社	21,800	2,029.00	44,232,200	
かどや製油	800	2,755.00	2,204,000	
Ｊ－オイルミルズ	34,000	341.00	11,594,000	
キッコーマン	62,000	3,695.00	229,090,000	
味の素	171,800	2,571.00	441,697,800	
キユーピー	41,600	2,848.00	118,476,800	

ハウス食品グループ本社	27,900	2,097.00	58,506,300	
カゴメ	29,300	2,319.00	67,946,700	
焼津水産化学工業	3,900	992.00	3,868,800	
アリアケジャパン	6,700	6,350.00	42,545,000	
ピエトロ	800	1,802.00	1,441,600	
エバラ食品工業	2,000	1,949.00	3,898,000	
ニチレイ	87,000	968.00	84,216,000	
東洋水産	40,200	3,915.00	157,383,000	
イートアンド	900	2,098.00	1,888,200	
日清食品ホールディングス	34,600	5,290.00	183,034,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,121.00	8,968,000	
一正蒲鉾	2,900	1,005.00	2,914,500	
フジッコ	7,900	2,352.00	18,580,800	
ロック・フィールド	4,300	3,490.00	15,007,000	
日本たばこ産業	483,000	4,709.00	2,274,447,000	
ケンコーマヨネーズ	2,700	2,434.00	6,571,800	
わらべや日洋	4,400	2,093.00	9,209,200	
なとり	4,100	1,679.00	6,883,900	
北の達人コーポレーション	1,200	519.00	622,800	
ユーグレナ	27,700	1,587.00	43,959,900	
ミヨシ油脂	28,000	122.00	3,416,000	
理研ビタミン	2,400	4,095.00	9,828,000	
片倉工業	9,700	1,201.00	11,649,700	
グンゼ	62,000	321.00	19,902,000	
東洋紡	303,000	195.00	59,085,000	
ユニチカ	222,000	57.00	12,654,000	
富士紡ホールディングス	37,000	211.00	7,807,000	
倉敷紡績	78,000	205.00	15,990,000	
シキボウ	47,000	112.00	5,264,000	
日本毛織	23,500	780.00	18,330,000	
トーア紡コーポレーション	3,200	481.00	1,539,200	
ダイドーリミテッド	8,700	482.00	4,193,400	
帝国繊維	8,000	1,531.00	12,248,000	
帝人	312,000	407.00	126,984,000	
東レ	554,000	954.30	528,682,200	
サカイオーベックス	21,000	170.00	3,570,000	

住江織物	22,000	278.00	6,116,000	
日本フエルト	4,200	441.00	1,852,200	
イチカワ	6,000	272.00	1,632,000	
芦森工業	23,000	157.00	3,611,000	
アツギ	59,000	111.00	6,549,000	
ダイニック	14,000	148.00	2,072,000	
セーレン	19,000	1,168.00	22,192,000	
東海染工	11,000	131.00	1,441,000	
小松精練	12,600	625.00	7,875,000	
ワコールホールディングス	45,000	1,336.00	60,120,000	
ホギメディカル	4,800	5,800.00	27,840,000	
レナウン	20,600	126.00	2,595,600	
クラウディア	3,500	534.00	1,869,000	
ＴＳＩホールディングス	34,100	721.00	24,586,100	
三陽商会	45,000	265.00	11,925,000	
オンワードホールディングス	51,000	761.00	38,811,000	
ルック	18,000	153.00	2,754,000	
ゴールドウイン	3,400	4,325.00	14,705,000	
デサント	17,400	1,584.00	27,561,600	
キング	3,800	368.00	1,398,400	
ヤマトインターナショナル	4,700	391.00	1,837,700	
特種東海製紙	44,000	361.00	15,884,000	
王子ホールディングス	313,000	472.00	147,736,000	
日本製紙	39,500	2,133.00	84,253,500	
三菱製紙	116,000	81.00	9,396,000	
北越紀州製紙	47,400	695.00	32,943,000	
中越パルプ工業	30,000	210.00	6,300,000	
巴川製紙所	12,000	184.00	2,208,000	
大王製紙	33,800	1,007.00	34,036,600	
レンゴー	68,000	596.00	40,528,000	
トーモク	24,000	279.00	6,696,000	
ザ・パック	5,400	2,648.00	14,299,200	
クラレ	120,500	1,427.00	171,953,500	
旭化成	476,000	777.50	370,090,000	
共和レザー	5,000	855.00	4,275,000	
昭和電工	508,000	115.00	58,420,000	

住友化学	562,000	504.00	283,248,000	
日本化成	14,000	112.00	1,568,000	
住友精化	16,000	557.00	8,912,000	
日産化学工業	45,900	3,020.00	138,618,000	
ラサ工業	29,000	108.00	3,132,000	
クレハ	58,000	371.00	21,518,000	
多木化学	5,000	645.00	3,225,000	
テイカ	13,000	501.00	6,513,000	
石原産業	137,000	77.00	10,549,000	
片倉コープアグリ	9,000	220.00	1,980,000	
日東エフシー	4,500	914.00	4,113,000	
日本曹達	49,000	574.00	28,126,000	
東ソー	206,000	502.00	103,412,000	
トクヤマ	127,000	176.00	22,352,000	
セントラル硝子	83,000	614.00	50,962,000	
東亞合成	47,800	971.00	46,413,800	
大阪ソーダ	33,000	420.00	13,860,000	
関東電化工業	18,000	819.00	14,742,000	
デンカ	158,000	485.00	76,630,000	
信越化学工業	137,000	6,158.00	843,646,000	
日本カーバイド工業	26,000	160.00	4,160,000	
堺化学工業	31,000	316.00	9,796,000	
エア・ウォーター	63,000	1,713.00	107,919,000	
大陽日酸	58,800	1,073.00	63,092,400	
日本化学工業	28,000	212.00	5,936,000	
日本パーカライジング	39,000	1,001.00	39,039,000	
高圧ガス工業	11,000	634.00	6,974,000	
チタン工業	9,000	180.00	1,620,000	
四国化成工業	11,000	937.00	10,307,000	
戸田工業	15,000	316.00	4,740,000	
ステラ　ケミファ	3,900	2,330.00	9,087,000	
保土谷化学工業	23,000	217.00	4,991,000	
日本触媒	11,100	5,920.00	65,712,000	
大日精化工業	29,000	452.00	13,108,000	
カネカ	103,000	966.00	99,498,000	
三菱瓦斯化学	131,000	611.00	80,041,000	

三井化学	324,000	373.00	120,852,000	
ＪＳＲ	71,700	1,612.00	115,580,400	
東京応化工業	15,300	3,110.00	47,583,000	
大阪有機化学工業	5,500	655.00	3,602,500	
三菱ケミカルホールディングス	511,600	571.10	292,174,760	
日本合成化学工業	18,000	650.00	11,700,000	
ダイセル	107,400	1,422.00	152,722,800	
住友ベークライト	71,000	458.00	32,518,000	
積水化学工業	173,400	1,411.00	244,667,400	
日本ゼオン	66,000	751.00	49,566,000	
アイカ工業	23,000	2,407.00	55,361,000	
宇部興産	409,000	213.00	87,117,000	
積水樹脂	11,800	1,506.00	17,770,800	
タキロン	18,000	535.00	9,630,000	
旭有機材	25,000	206.00	5,150,000	
日立化成	37,700	1,936.00	72,987,200	
ニチバン	8,000	630.00	5,040,000	
リケンテクノス	12,300	399.00	4,907,700	
大倉工業	18,000	286.00	5,148,000	
積水化成品工業	20,000	316.00	6,320,000	
群栄化学工業	20,000	302.00	6,040,000	
タイガースポリマー	3,800	603.00	2,291,400	
ミライアル	2,800	766.00	2,144,800	
ダイキアクシス	1,400	876.00	1,226,400	
ダイキョーニシカワ	9,800	1,610.00	15,778,000	
日本化薬	50,000	1,208.00	60,400,000	
カーリットホールディングス	7,100	490.00	3,479,000	
日本精化	6,300	769.00	4,844,700	
扶桑化学工業	4,800	1,716.00	8,236,800	
ＡＤＥＫＡ	37,500	1,614.00	60,525,000	
日油	58,000	839.00	48,662,000	
ハリマ化成グループ	6,600	516.00	3,405,600	
花王	205,400	5,884.00	1,208,573,600	
第一工業製薬	17,000	343.00	5,831,000	
ニイタカ	1,100	1,405.00	1,545,500	
三洋化成工業	24,000	832.00	19,968,000	

大日本塗料	44,000	196.00	8,624,000	
日本ペイントホールディングス	58,900	2,864.00	168,689,600	
関西ペイント	86,400	1,980.00	171,072,000	
神東塗料	6,000	168.00	1,008,000	
中国塗料	22,000	776.00	17,072,000	
日本特殊塗料	5,300	869.00	4,605,700	
藤倉化成	10,400	506.00	5,262,400	
太陽ホールディングス	5,600	3,670.00	20,552,000	
ＤＩＣ	302,000	268.00	80,936,000	
サカタインクス	15,600	1,293.00	20,170,800	
東洋インキＳＣホールディングス	75,000	444.00	33,300,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	919.00	5,146,400	
富士フイルムホールディングス	174,800	4,289.00	749,717,200	
資生堂	144,900	2,546.50	368,987,850	
ライオン	88,000	1,392.00	122,496,000	
高砂香料工業	5,000	2,533.00	12,665,000	
マンダム	7,100	5,030.00	35,713,000	
ミルボン	4,500	4,770.00	21,465,000	
ファンケル	17,700	1,544.00	27,328,800	
コーセー	12,300	10,760.00	132,348,000	
コタ	2,600	1,125.00	2,925,000	
シーズ・ホールディングス	9,800	2,259.00	22,138,200	
シーボン	900	2,295.00	2,065,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,800	9,320.00	72,696,000	
ノエビアホールディングス	4,800	3,110.00	14,928,000	
アジュバンコスメジャパン	1,500	919.00	1,378,500	
エステー	5,200	1,086.00	5,647,200	
アグロ　カネショウ	3,000	1,044.00	3,132,000	
コニシ	12,000	1,397.00	16,764,000	
長谷川香料	9,700	1,789.00	17,353,300	
星光ＰＭＣ	4,200	1,261.00	5,296,200	
小林製薬	11,600	9,290.00	107,764,000	
荒川化学工業	6,500	957.00	6,220,500	
メック	5,900	818.00	4,826,200	
日本高純度化学	2,200	2,053.00	4,516,600	
ＪＣＵ	2,200	3,595.00	7,909,000	

新田ゼラチン	5,000	753.00	3,765,000	
ＯＡＴアグリオ	700	1,442.00	1,009,400	
デクセリアルズ	17,100	1,067.00	18,245,700	
アース製薬	5,500	4,610.00	25,355,000	
イハラケミカル工業	11,800	1,398.00	16,496,400	
北興化学工業	8,000	323.00	2,584,000	
大成ラミック	2,100	2,846.00	5,976,600	
クミアイ化学工業	15,800	954.00	15,073,200	
日本農薬	17,400	586.00	10,196,400	
アキレス	63,000	142.00	8,946,000	
有沢製作所	11,300	576.00	6,508,800	
日東電工	59,000	6,225.00	367,275,000	
レック	2,400	1,339.00	3,213,600	
きもと	12,600	161.00	2,028,600	
藤森工業	6,600	2,620.00	17,292,000	
前澤化成工業	5,300	1,007.00	5,337,100	
ＪＳＰ	5,000	1,925.00	9,625,000	
エフピコ	6,800	4,850.00	32,980,000	
天馬	5,900	1,775.00	10,472,500	
信越ポリマー	15,000	606.00	9,090,000	
東リ	20,000	297.00	5,940,000	
ニフコ	14,600	5,120.00	74,752,000	
日本バルカー工業	30,000	287.00	8,610,000	
ユニ・チャーム	154,600	2,507.00	387,582,200	
協和発酵キリン	91,400	1,930.00	176,402,000	
武田薬品工業	304,100	5,369.00	1,632,712,900	
アステラス製薬	855,100	1,518.00	1,298,041,800	
大日本住友製薬	54,000	1,454.00	78,516,000	
塩野義製薬	111,300	5,645.00	628,288,500	
田辺三菱製薬	89,000	1,927.00	171,503,000	
わかもと製薬	9,000	266.00	2,394,000	
あすか製薬	9,700	1,446.00	14,026,200	
日本新薬	17,500	4,860.00	85,050,000	
ビオフェルミン製薬	1,200	3,650.00	4,380,000	
中外製薬	76,000	3,735.00	283,860,000	
科研製薬	13,200	6,820.00	90,024,000	

エーザイ	94,000	7,057.00	663,358,000	
ロート製薬	37,400	1,967.00	73,565,800	
小野薬品工業	173,400	5,200.00	901,680,000	
久光製薬	23,700	5,490.00	130,113,000	
有機合成薬品工業	5,000	250.00	1,250,000	
持田製薬	5,300	8,390.00	44,467,000	
参天製薬	140,600	1,696.00	238,457,600	
扶桑薬品工業	26,000	258.00	6,708,000	
日本ケミファ	11,000	478.00	5,258,000	
ツムラ	24,000	2,916.00	69,984,000	
日医工	17,900	2,712.00	48,544,800	
キッセイ薬品工業	13,500	2,672.00	36,072,000	
生化学工業	14,600	1,752.00	25,579,200	
栄研化学	6,400	2,239.00	14,329,600	
日水製薬	3,100	1,284.00	3,980,400	
鳥居薬品	5,200	2,637.00	13,712,400	
ＪＣＲファーマ	5,900	2,826.00	16,673,400	
東和薬品	3,500	5,100.00	17,850,000	
富士製薬工業	2,100	1,959.00	4,113,900	
沢井製薬	13,000	7,170.00	93,210,000	
ゼリア新薬工業	15,600	1,408.00	21,964,800	
第一三共	256,800	2,634.50	676,539,600	
キョーリン製薬ホールディングス	20,400	2,297.00	46,858,800	
大幸薬品	3,800	1,470.00	5,586,000	
ダイト	3,200	3,150.00	10,080,000	
大塚ホールディングス	164,200	4,343.00	713,120,600	
大正製薬ホールディングス	18,400	9,160.00	168,544,000	
ペプチドリーム	9,400	6,830.00	64,202,000	
日本コークス工業	61,600	77.00	4,743,200	
昭和シェル石油	76,800	1,124.00	86,323,200	
ニチレキ	9,300	827.00	7,691,100	
東燃ゼネラル石油	115,000	1,032.00	118,680,000	
ユシロ化学工業	4,100	1,230.00	5,043,000	
ビーピー・カストロール	3,100	1,265.00	3,921,500	
富士石油	17,700	339.00	6,000,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,400	1,151.00	2,762,400	

出光興産	39,800	2,241.00	89,191,800	
ＪＸホールディングス	903,900	472.10	426,731,190	
コスモエネルギーホールディングス	23,000	1,369.00	31,487,000	
横浜ゴム	46,100	1,808.00	83,348,800	
東洋ゴム工業	34,600	1,571.00	54,356,600	
ブリヂストン	257,700	4,080.00	1,051,416,000	
住友ゴム工業	71,500	1,694.00	121,121,000	
藤倉ゴム工業	6,400	440.00	2,816,000	
オカモト	24,000	885.00	21,240,000	
フコク	2,800	876.00	2,452,800	
ニッタ	8,200	2,737.00	22,443,400	
住友理工	16,500	968.00	15,972,000	
三ツ星ベルト	19,000	885.00	16,815,000	
バンドー化学	28,000	539.00	15,092,000	
日東紡績	51,000	358.00	18,258,000	
旭硝子	403,000	654.00	263,562,000	
日本板硝子	368,000	89.00	32,752,000	
石塚硝子	11,000	197.00	2,167,000	
日本山村硝子	32,000	165.00	5,280,000	
日本電気硝子	158,000	602.00	95,116,000	
オハラ	3,200	516.00	1,651,200	
住友大阪セメント	151,000	491.00	74,141,000	
太平洋セメント	477,000	300.00	143,100,000	
デイ・シイ	8,200	329.00	2,697,800	
日本ヒューム	7,600	586.00	4,453,600	
日本コンクリート工業	16,300	288.00	4,694,400	
三谷セキサン	3,800	1,655.00	6,289,000	
アジアパイルホールディングス	9,600	431.00	4,137,600	
東海カーボン	67,000	290.00	19,430,000	
日本カーボン	38,000	232.00	8,816,000	
東洋炭素	4,200	1,433.00	6,018,600	
ノリタケカンパニーリミテド	43,000	245.00	10,535,000	
ＴＯＴＯ	56,100	3,805.00	213,460,500	
日本碍子	96,000	2,143.00	205,728,000	
日本特殊陶業	65,800	2,240.00	147,392,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,800	2,940.00	8,232,000	

品川リフラクトリーズ	20,000	202.00	4,040,000	
黒崎播磨	18,000	256.00	4,608,000	
ヨータイ	5,000	289.00	1,445,000	
イソライト工業	5,800	219.00	1,270,200	
東京窯業	10,200	170.00	1,734,000	
ニッカトー	3,200	378.00	1,209,600	
フジミインコーポレーテッド	6,700	1,496.00	10,023,200	
ニチアス	39,000	721.00	28,119,000	
ニチハ	10,200	1,705.00	17,391,000	
新日鐵住金	344,300	2,426.50	835,443,950	
神戸製鋼所	1,403,000	116.00	162,748,000	
合同製鐵	44,000	208.00	9,152,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	208,700	1,742.00	363,555,400	
日新製鋼	35,000	1,405.00	49,175,000	
東京製鐵	42,400	689.00	29,213,600	
共英製鋼	8,200	1,700.00	13,940,000	
大和工業	16,900	2,567.00	43,382,300	
東京鐵鋼	16,000	363.00	5,808,000	
大阪製鐵	4,900	1,744.00	8,545,600	
淀川製鋼所	11,400	2,508.00	28,591,200	
東洋鋼鈑	18,600	357.00	6,640,200	
丸一鋼管	25,600	3,290.00	84,224,000	
モリ工業	13,000	294.00	3,822,000	
大同特殊鋼	128,000	402.00	51,456,000	
日本高周波鋼業	38,000	76.00	2,888,000	
日本冶金工業	61,000	140.00	8,540,000	
山陽特殊製鋼	46,000	499.00	22,954,000	
愛知製鋼	45,000	435.00	19,575,000	
日立金属	87,500	1,245.00	108,937,500	
日本金属	20,000	100.00	2,000,000	
大平洋金属	54,000	337.00	18,198,000	
新日本電工	44,300	172.00	7,619,600	
栗本鐵工所	38,000	168.00	6,384,000	
虹技	14,000	165.00	2,310,000	
日本鋳鉄管	10,000	167.00	1,670,000	
三菱製鋼	55,000	188.00	10,340,000	

日亜鋼業	11,800	236.00	2,784,800	
日本精線	6,000	418.00	2,508,000	
シンニッタン	7,100	630.00	4,473,000	
新家工業	18,000	124.00	2,232,000	
大紀アルミニウム工業所	12,000	273.00	3,276,000	
日本軽金属ホールディングス	172,900	193.00	33,369,700	
三井金属鉱業	195,000	197.00	38,415,000	
東邦亜鉛	40,000	299.00	11,960,000	
三菱マテリアル	476,000	353.00	168,028,000	
住友金属鉱山	211,000	1,240.00	261,640,000	
ＤＯＷＡホールディングス	98,000	718.00	70,364,000	
古河機械金属	119,000	160.00	19,040,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,600	1,530.00	11,628,000	
東邦チタニウム	12,900	833.00	10,745,700	
ＵＡＣＪ	107,000	224.00	23,968,000	
古河電気工業	240,000	263.00	63,120,000	
住友電気工業	305,600	1,321.50	403,850,400	
フジクラ	106,000	561.00	59,466,000	
昭和電線ホールディングス	91,000	67.00	6,097,000	
東京特殊電線	1,300	879.00	1,142,700	
タツタ電線	16,600	355.00	5,893,000	
沖電線	11,000	201.00	2,211,000	
カナレ電気	1,300	1,911.00	2,484,300	
平河ヒューテック	3,800	892.00	3,389,600	
リョービ	47,000	435.00	20,445,000	
アーレスティ	8,900	674.00	5,998,600	
アサヒホールディングス	11,500	1,494.00	17,181,000	
稲葉製作所	4,100	1,338.00	5,485,800	
宮地エンジニアリンググループ	28,000	156.00	4,368,000	
トーカロ	5,500	2,039.00	11,214,500	
アルファＣｏ	3,100	1,023.00	3,171,300	
ＳＵＭＣＯ	60,900	684.00	41,655,600	
川田テクノロジーズ	1,700	3,515.00	5,975,500	
東洋製罐グループホールディングス	54,200	2,179.00	118,101,800	
ホッカンホールディングス	22,000	323.00	7,106,000	
コロナ	4,000	1,070.00	4,280,000	

横河ブリッジホールディングス	14,700	1,288.00	18,933,600	
駒井ハルテック	17,000	241.00	4,097,000	
高田機工	8,000	208.00	1,664,000	
三和ホールディングス	77,100	866.00	66,768,600	
文化シヤッター	21,300	939.00	20,000,700	
三協立山	10,500	1,549.00	16,264,500	
アルインコ	4,300	1,059.00	4,553,700	
東洋シヤッター	2,900	567.00	1,644,300	
ＬＩＸＩＬグループ	106,400	2,349.00	249,933,600	
日本フイルコン	7,000	424.00	2,968,000	
ノーリツ	15,000	1,852.00	27,780,000	
長府製作所	8,200	2,540.00	20,828,000	
リンナイ	14,200	9,950.00	141,290,000	
ダイニチ工業	3,900	603.00	2,351,700	
日東精工	12,000	288.00	3,456,000	
三洋工業	11,000	170.00	1,870,000	
岡部	16,200	827.00	13,397,400	
ジーテクト	8,300	1,178.00	9,777,400	
東プレ	14,700	2,262.00	33,251,400	
高周波熱錬	14,400	761.00	10,958,400	
サンコール	4,500	468.00	2,106,000	
モリテック　スチール	4,800	253.00	1,214,400	
パイオラックス	3,900	5,730.00	22,347,000	
日本発條	71,800	988.00	70,938,400	
中央発條	11,000	270.00	2,970,000	
アドバネクス	2,100	1,249.00	2,622,900	
立川ブラインド工業	3,200	709.00	2,268,800	
三益半導体工業	5,600	1,035.00	5,796,000	
日本ドライケミカル	1,000	2,294.00	2,294,000	
日本製鋼所	126,000	378.00	47,628,000	
三浦工業	34,100	2,151.00	73,349,100	
タクマ	28,000	994.00	27,832,000	
ツガミ	22,000	460.00	10,120,000	
オークマ	50,000	886.00	44,300,000	
東芝機械	42,000	352.00	14,784,000	
アマダホールディングス	111,300	1,134.00	126,214,200	

アイダエンジニアリング	20,000	1,030.00	20,600,000	
滝澤鉄工所	24,000	123.00	2,952,000	
富士機械製造	24,900	1,176.00	29,282,400	
牧野フライス製作所	38,000	708.00	26,904,000	
オーエスジー	34,800	2,045.00	71,166,000	
ダイジェット工業	12,000	132.00	1,584,000	
旭ダイヤモンド工業	20,800	1,102.00	22,921,600	
ＤＭＧ森精機	42,500	1,297.00	55,122,500	
ソディック	14,500	873.00	12,658,500	
ディスコ	9,700	9,850.00	95,545,000	
日東工器	4,400	2,167.00	9,534,800	
パンチ工業	3,000	747.00	2,241,000	
豊和工業	4,600	555.00	2,553,000	
ＯＫＫ	34,000	107.00	3,638,000	
東洋機械金属	5,600	328.00	1,836,800	
島精機製作所	10,800	1,874.00	20,239,200	
ＮＣホールディングス	2,500	1,351.00	3,377,500	
フリュー	1,100	2,856.00	3,141,600	
日阪製作所	9,600	832.00	7,987,200	
やまびこ	14,000	808.00	11,312,000	
ペガサスミシン製造	7,900	500.00	3,950,000	
ナブテスコ	39,700	2,570.00	102,029,000	
三井海洋開発	8,900	1,647.00	14,658,300	
レオン自動機	6,400	648.00	4,147,200	
ＳＭＣ	22,900	27,760.00	635,704,000	
新川	6,800	432.00	2,937,600	
ホソカワミクロン	13,000	570.00	7,410,000	
ユニオンツール	3,300	3,035.00	10,015,500	
オイレス工業	9,900	1,780.00	17,622,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,800	2,183.00	6,112,400	
サトーホールディングス	10,300	2,293.00	23,617,900	
日本エアーテック	2,700	624.00	1,684,800	
日精樹脂工業	6,000	671.00	4,026,000	
ワイエイシイ	3,100	1,000.00	3,100,000	
小松製作所	374,100	1,945.00	727,624,500	
住友重機械工業	223,000	471.00	105,033,000	

日立建機	34,100	1,879.00	64,073,900	
日工	12,000	331.00	3,972,000	
巴工業	3,100	1,514.00	4,693,400	
井関農機	79,000	236.00	18,644,000	
ＴＯＷＡ	7,400	720.00	5,328,000	
丸山製作所	17,000	176.00	2,992,000	
北川鉄工所	36,000	208.00	7,488,000	
タカキタ	1,900	512.00	972,800	
クボタ	366,400	1,671.50	612,437,600	
荏原実業	2,300	1,241.00	2,854,300	
三菱化工機	27,000	218.00	5,886,000	
月島機械	14,500	933.00	13,528,500	
帝国電機製作所	5,500	830.00	4,565,000	
新東工業	17,300	964.00	16,677,200	
澁谷工業	6,400	1,349.00	8,633,600	
アイチ　コーポレーション	10,800	868.00	9,374,400	
小森コーポレーション	18,600	1,293.00	24,049,800	
鶴見製作所	5,700	1,515.00	8,635,500	
住友精密工業	12,000	333.00	3,996,000	
酒井重工業	15,000	189.00	2,835,000	
荏原製作所	169,000	523.00	88,387,000	
石井鐵工所	14,000	152.00	2,128,000	
酉島製作所	8,100	1,045.00	8,464,500	
北越工業	8,200	668.00	5,477,600	
ダイキン工業	106,200	8,839.00	938,701,800	
オルガノ	13,000	427.00	5,551,000	
トーヨーカネツ	41,000	239.00	9,799,000	
栗田工業	45,900	2,665.00	122,323,500	
椿本チエイン	43,000	750.00	32,250,000	
大同工業	17,000	187.00	3,179,000	
木村化工機	7,600	373.00	2,834,800	
アネスト岩田	12,300	1,152.00	14,169,600	
ダイフク	39,200	1,989.00	77,968,800	
サムコ	1,200	923.00	1,107,600	
加藤製作所	18,000	440.00	7,920,000	
油研工業	16,000	178.00	2,848,000	

タダノ	35,200	1,088.00	38,297,600	
フジテック	21,200	1,126.00	23,871,200	
ＣＫＤ	20,300	907.00	18,412,100	
キトー	9,200	763.00	7,019,600	
平和	22,600	2,380.00	53,788,000	
理想科学工業	8,000	1,738.00	13,904,000	
ＳＡＮＫＹＯ	20,300	4,300.00	87,290,000	
日本金銭機械	6,700	913.00	6,117,100	
マースエンジニアリング	4,100	1,964.00	8,052,400	
福島工業	4,500	2,594.00	11,673,000	
オーイズミ	3,100	463.00	1,435,300	
ダイコク電機	3,000	1,292.00	3,876,000	
竹内製作所	10,800	1,590.00	17,172,000	
アマノ	22,600	1,803.00	40,747,800	
ＪＵＫＩ	10,800	966.00	10,432,800	
サンデンホールディングス	44,000	312.00	13,728,000	
蛇の目ミシン工業	7,100	607.00	4,309,700	
マックス	11,000	1,140.00	12,540,000	
グローリー	24,900	3,755.00	93,499,500	
新晃工業	5,100	1,626.00	8,292,600	
大和冷機工業	11,700	947.00	11,079,900	
セガサミーホールディングス	78,400	1,242.00	97,372,800	
日本ピストンリング	3,000	1,447.00	4,341,000	
リケン	34,000	366.00	12,444,000	
ＴＰＲ	9,000	2,819.00	25,371,000	
ツバキ・ナカシマ	6,800	1,541.00	10,478,800	
ホシザキ電機	16,000	9,640.00	154,240,000	
大豊工業	5,900	1,095.00	6,460,500	
日本精工	149,800	1,006.00	150,698,800	
ＮＴＮ	181,000	353.00	63,893,000	
ジェイテクト	77,700	1,509.00	117,249,300	
不二越	68,000	363.00	24,684,000	
日本トムソン	25,000	389.00	9,725,000	
ＴＨＫ	48,500	2,277.00	110,434,500	
ユーシン精機	2,800	1,897.00	5,311,600	
前澤給装工業	3,000	1,420.00	4,260,000	

イーグル工業	9,000	1,481.00	13,329,000	
前澤工業	5,300	300.00	1,590,000	
日本ピラー工業	7,400	948.00	7,015,200	
キッツ	35,200	467.00	16,438,400	
日立工機	19,500	762.00	14,859,000	
マキタ	47,500	7,050.00	334,875,000	
日立造船	58,100	566.00	32,884,600	
三菱重工業	1,298,000	418.10	542,693,800	
ＩＨＩ	562,000	243.00	136,566,000	
日清紡ホールディングス	40,500	1,219.00	49,369,500	
イビデン	44,700	1,476.00	65,977,200	
コニカミノルタ	182,100	981.00	178,640,100	
ブラザー工業	94,300	1,339.00	126,267,700	
ミネベア	118,000	932.00	109,976,000	
日立製作所	1,860,000	527.20	980,592,000	
東芝	1,535,000	234.00	359,190,000	
三菱電機	778,000	1,230.50	957,329,000	
富士電機	220,000	406.00	89,320,000	
東洋電機製造	14,000	317.00	4,438,000	
安川電機	90,600	1,336.00	121,041,600	
シンフォニアテクノロジー	47,000	147.00	6,909,000	
明電舎	67,000	544.00	36,448,000	
オリジン電気	11,000	270.00	2,970,000	
山洋電気	19,000	535.00	10,165,000	
デンヨー	6,700	1,233.00	8,261,100	
東芝テック	52,000	431.00	22,412,000	
芝浦メカトロニクス	12,000	225.00	2,700,000	
マブチモーター	20,900	5,280.00	110,352,000	
日本電産	87,800	7,762.00	681,503,600	
東光高岳	4,100	1,574.00	6,453,400	
ダブル・スコープ	2,200	5,700.00	12,540,000	
ダイヘン	43,000	531.00	22,833,000	
田淵電機	8,300	501.00	4,158,300	
ヤーマン	900	2,244.00	2,019,600	
ＪＶＣケンウッド	53,600	282.00	15,115,200	
ミマキエンジニアリング	5,000	557.00	2,785,000	

第一精工	3,100	1,241.00	3,847,100	
日新電機	17,100	1,355.00	23,170,500	
大崎電気工業	13,000	767.00	9,971,000	
オムロン	82,300	3,535.00	290,930,500	
日東工業	11,700	1,773.00	20,744,100	
ＩＤＥＣ	9,500	1,022.00	9,709,000	
不二電機工業	700	1,411.00	987,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	141,000	476.00	67,116,000	
サクサホールディングス	18,000	203.00	3,654,000	
メルコホールディングス	4,000	2,425.00	9,700,000	
テクノメディカ	1,700	2,304.00	3,916,800	
日本電気	1,002,000	279.00	279,558,000	
富士通	703,000	409.00	287,527,000	
沖電気工業	316,000	156.00	49,296,000	
岩崎通信機	34,000	72.00	2,448,000	
電気興業	19,000	506.00	9,614,000	
サンケン電気	40,000	372.00	14,880,000	
ナカヨ	7,000	329.00	2,303,000	
アイホン	4,100	1,854.00	7,601,400	
ルネサスエレクトロニクス	37,800	659.00	24,910,200	
セイコーエプソン	108,600	1,889.00	205,145,400	
ワコム	57,500	475.00	27,312,500	
アルバック	13,400	3,510.00	47,034,000	
アクセル	3,300	848.00	2,798,400	
ＥＩＺＯ	7,200	2,792.00	20,102,400	
ジャパンディスプレイ	136,300	206.00	28,077,800	
日本信号	20,100	904.00	18,170,400	
京三製作所	17,000	346.00	5,882,000	
能美防災	8,300	1,644.00	13,645,200	
ホーチキ	5,300	1,294.00	6,858,200	
エレコム	6,300	2,125.00	13,387,500	
日本無線	21,000	281.00	5,901,000	
パナソニック	833,000	1,004.50	836,748,500	
シャープ	616,000	136.00	83,776,000	
アンリツ	43,800	624.00	27,331,200	
富士通ゼネラル	22,000	1,819.00	40,018,000	

日立国際電気	16,700	1,283.00	21,426,100	
ソニー	514,500	3,027.00	1,557,391,500	
ＴＤＫ	44,000	6,630.00	291,720,000	
帝国通信工業	17,000	161.00	2,737,000	
ミツミ電機	27,800	556.00	15,456,800	
タムラ製作所	28,000	297.00	8,316,000	
アルプス電気	61,900	1,889.00	116,929,100	
池上通信機	23,000	135.00	3,105,000	
パイオニア	118,000	312.00	36,816,000	
日本電波工業	6,600	731.00	4,824,600	
鈴木	2,200	525.00	1,155,000	
日本トリム	2,000	5,900.00	11,800,000	
ローランド　ディー．ジー．	3,600	2,198.00	7,912,800	
フォスター電機	9,100	2,367.00	21,539,700	
クラリオン	38,000	337.00	12,806,000	
ＳＭＫ	21,000	556.00	11,676,000	
ヨコオ	5,300	510.00	2,703,000	
東光	15,000	392.00	5,880,000	
ホシデン	22,100	716.00	15,823,600	
ヒロセ電機	11,800	13,720.00	161,896,000	
日本航空電子工業	21,000	1,286.00	27,006,000	
ＴＯＡ	8,600	1,101.00	9,468,600	
日立マクセル	12,100	1,766.00	21,368,600	
古野電気	8,700	646.00	5,620,200	
ユニデンホールディングス	23,000	126.00	2,898,000	
アルパイン	17,400	1,252.00	21,784,800	
スミダコーポレーション	6,000	689.00	4,134,000	
アイコム	4,000	2,155.00	8,620,000	
リオン	2,800	1,641.00	4,594,800	
船井電機	7,400	1,028.00	7,607,200	
横河電機	73,000	1,232.00	89,936,000	
新電元工業	26,000	401.00	10,426,000	
アズビル	23,800	2,929.00	69,710,200	
東亜ディーケーケー	3,100	528.00	1,636,800	
日本光電工業	30,500	2,829.00	86,284,500	
チノー	2,600	1,002.00	2,605,200	

共和電業	8,900	406.00	3,613,400	
日本電子材料	2,900	419.00	1,215,100	
堀場製作所	13,500	4,185.00	56,497,500	
アドバンテスト	49,700	1,048.00	52,085,600	
小野測器	3,600	706.00	2,541,600	
エスペック	7,600	1,506.00	11,445,600	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	6,400	582.00	3,724,800	
キーエンス	16,500	65,320.00	1,077,780,000	
日置電機	3,800	2,285.00	8,683,000	
シスメックス	56,600	7,070.00	400,162,000	
日本マイクロニクス	9,500	1,067.00	10,136,500	
メガチップス	7,600	1,219.00	9,264,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,700	4,155.00	19,528,500	
澤藤電機	4,000	179.00	716,000	
コーセル	10,100	1,108.00	11,190,800	
新日本無線	5,300	399.00	2,114,700	
オプテックス	5,400	3,830.00	20,682,000	
千代田インテグレ	3,900	2,250.00	8,775,000	
アイ・オー・データ機器	2,300	624.00	1,435,200	
レーザーテック	8,600	1,533.00	13,183,800	
スタンレー電気	52,300	2,363.00	123,584,900	
岩崎電気	25,000	191.00	4,775,000	
ウシオ電機	44,300	1,590.00	70,437,000	
岡谷電機産業	4,000	372.00	1,488,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	6,300	382.00	2,406,600	
日本セラミック	4,200	2,058.00	8,643,600	
遠藤照明	3,700	978.00	3,618,600	
日本デジタル研究所	6,100	1,564.00	9,540,400	
古河電池	5,000	692.00	3,460,000	
双信電機	3,700	265.00	980,500	
山一電機	6,400	568.00	3,635,200	
図研	5,300	1,213.00	6,428,900	
日本電子	29,000	510.00	14,790,000	
カシオ計算機	73,100	2,156.00	157,603,600	
ファナック	74,600	18,505.00	1,380,473,000	
日本シイエムケイ	15,800	431.00	6,809,800	

エンプラス	3,700	3,670.00	13,579,000	
大真空	13,000	242.00	3,146,000	
ローム	35,900	4,900.00	175,910,000	
浜松ホトニクス	56,900	3,145.00	178,950,500	
三井ハイテック	10,600	689.00	7,303,400	
新光電気工業	27,600	632.00	17,443,200	
京セラ	119,700	5,360.00	641,592,000	
太陽誘電	35,500	1,113.00	39,511,500	
村田製作所	76,500	14,605.00	1,117,282,500	
ユーシン	9,700	698.00	6,770,600	
双葉電子工業	12,400	1,686.00	20,906,400	
北陸電気工業	30,000	135.00	4,050,000	
ニチコン	23,000	776.00	17,848,000	
日本ケミコン	59,000	146.00	8,614,000	
ＫＯＡ	10,100	820.00	8,282,000	
市光工業	18,000	239.00	4,302,000	
小糸製作所	43,700	4,785.00	209,104,500	
ミツバ	12,400	1,632.00	20,236,800	
スター精密	13,900	1,376.00	19,126,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	75,000	917.00	68,775,000	
キヤノン電子	6,700	1,655.00	11,088,500	
キヤノン	392,500	3,333.00	1,308,202,500	
リコー	236,100	1,140.00	269,154,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	9,000	227.00	2,043,000	
東京エレクトロン	59,800	7,435.00	444,613,000	
トヨタ紡織	25,600	1,946.00	49,817,600	
鬼怒川ゴム工業	17,000	765.00	13,005,000	
ユニプレス	15,200	1,881.00	28,591,200	
豊田自動織機	66,400	4,900.00	325,360,000	
モリタホールディングス	12,800	1,329.00	17,011,200	
三櫻工業	9,800	600.00	5,880,000	
デンソー	180,100	4,328.00	779,472,800	
東海理化電機製作所	21,400	2,018.00	43,185,200	
三井造船	282,000	169.00	47,658,000	
川崎重工業	567,000	322.00	182,574,000	
名村造船所	22,300	815.00	18,174,500	

サノヤスホールディングス	11,200	225.00	2,520,000	
日本車輌製造	30,000	263.00	7,890,000	
ニチユ三菱フォークリフト	8,400	503.00	4,225,200	
近畿車輛	11,000	309.00	3,399,000	
日産自動車	1,023,500	1,016.00	1,039,876,000	
いすゞ自動車	211,300	1,193.00	252,080,900	
トヨタ自動車	906,800	5,643.00	5,117,072,400	
日野自動車	104,100	1,221.00	127,106,100	
三菱自動車工業	289,500	733.00	212,203,500	
エフテック	4,200	1,058.00	4,443,600	
レシップホールディングス	2,400	765.00	1,836,000	
ＧＭＢ	1,600	757.00	1,211,200	
ファルテック	1,600	1,313.00	2,100,800	
武蔵精密工業	7,800	2,101.00	16,387,800	
日産車体	35,600	1,088.00	38,732,800	
新明和工業	32,000	765.00	24,480,000	
極東開発工業	14,500	1,130.00	16,385,000	
日信工業	16,300	1,546.00	25,199,800	
トピー工業	61,000	214.00	13,054,000	
ティラド	28,000	168.00	4,704,000	
曙ブレーキ工業	36,900	289.00	10,664,100	
タチエス	11,600	1,542.00	17,887,200	
ＮＯＫ	35,400	1,867.00	66,091,800	
フタバ産業	23,500	449.00	10,551,500	
ＫＹＢ	82,000	337.00	27,634,000	
大同メタル工業	10,300	826.00	8,507,800	
プレス工業	38,900	377.00	14,665,300	
ミクニ	8,000	345.00	2,760,000	
カルソニックカンセイ	56,000	773.00	43,288,000	
太平洋工業	16,200	1,027.00	16,637,400	
ケーヒン	16,800	1,638.00	27,518,400	
河西工業	9,300	1,109.00	10,313,700	
アイシン精機	74,700	4,185.00	312,619,500	
富士機工	8,500	435.00	3,697,500	
マツダ	230,900	1,694.00	391,144,600	
ダイハツ工業	87,000	1,489.00	129,543,000	

今仙電機製作所	6,700	979.00	6,559,300	
本田技研工業	656,200	3,050.00	2,001,410,000	
スズキ	152,400	3,019.00	460,095,600	
富士重工業	230,400	3,669.00	845,337,600	
安永	3,200	473.00	1,513,600	
ヤマハ発動機	103,000	1,852.00	190,756,000	
ショーワ	19,000	960.00	18,240,000	
ＴＢＫ	9,300	380.00	3,534,000	
エクセディ	9,900	2,375.00	23,512,500	
豊田合成	26,500	2,054.00	54,431,000	
愛三工業	12,800	896.00	11,468,800	
盟和産業	1,000	1,005.00	1,005,000	
ヨロズ	6,800	2,260.00	15,368,000	
エフ・シー・シー	11,900	1,790.00	21,301,000	
シマノ	29,400	17,570.00	516,558,000	
テイ・エス　テック	16,900	2,508.00	42,385,200	
ジャムコ	3,400	2,762.00	9,390,800	
テルモ	111,800	4,240.00	474,032,000	
クリエートメディック	2,400	865.00	2,076,000	
日機装	26,600	840.00	22,344,000	
島津製作所	94,000	1,720.00	161,680,000	
ＪＭＳ	14,000	288.00	4,032,000	
長野計器	4,600	632.00	2,907,200	
ブイ・テクノロジー	1,700	4,790.00	8,143,000	
東京計器	23,000	160.00	3,680,000	
愛知時計電機	10,000	303.00	3,030,000	
オーバル	7,200	231.00	1,663,200	
東京精密	14,100	2,331.00	32,867,100	
マニー	6,700	1,884.00	12,622,800	
ニコン	136,200	1,702.00	231,812,400	
トプコン	24,500	1,449.00	35,500,500	
オリンパス	108,600	4,365.00	474,039,000	
理研計器	5,900	1,071.00	6,318,900	
タムロン	5,900	1,832.00	10,808,800	
ＨＯＹＡ	164,900	4,303.00	709,564,700	
ノーリツ鋼機	6,600	669.00	4,415,400	

エー・アンド・デイ	6,700	388.00	2,599,600	
シチズンホールディングス	89,800	662.00	59,447,600	
リズム時計工業	32,000	147.00	4,704,000	
大研医器	5,800	887.00	5,144,600	
メニコン	3,700	3,800.00	14,060,000	
松風	3,600	1,366.00	4,917,600	
セイコーホールディングス	47,000	430.00	20,210,000	
ニプロ	54,400	1,095.00	59,568,000	
スノーピーク	600	3,610.00	2,166,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,700	4,095.00	31,531,500	
トランザクション	1,100	675.00	742,500	
ＳＨＯ－ＢＩ	2,400	397.00	952,800	
ニホンフラッシュ	2,100	1,039.00	2,181,900	
前田工繊	8,000	1,205.00	9,640,000	
永大産業	10,000	406.00	4,060,000	
アートネイチャー	5,800	916.00	5,312,800	
ダンロップスポーツ	4,600	988.00	4,544,800	
バンダイナムコホールディングス	75,400	2,491.00	187,821,400	
アイフィスジャパン	1,200	483.00	579,600	
共立印刷	12,100	282.00	3,412,200	
ＳＨＯＥＩ	3,500	1,725.00	6,037,500	
フランスベッドホールディングス	10,200	1,024.00	10,444,800	
パイロットコーポレーション	12,700	4,465.00	56,705,500	
萩原工業	1,500	2,776.00	4,164,000	
トッパン・フォームズ	13,000	1,230.00	15,990,000	
フジシールインターナショナル	8,900	3,860.00	34,354,000	
タカラトミー	24,000	783.00	18,792,000	
廣済堂	6,800	333.00	2,264,400	
Ａｓ－ｍｅエステール	1,900	635.00	1,206,500	
アーク	30,700	85.00	2,609,500	
タカノ	3,200	625.00	2,000,000	
プロネクサス	6,800	1,124.00	7,643,200	
ホクシン	5,800	120.00	696,000	
ウッドワン	13,000	252.00	3,276,000	
大建工業	28,000	325.00	9,100,000	
凸版印刷	206,000	969.00	199,614,000	

大日本印刷	216,000	1,061.00	229,176,000	
図書印刷	14,000	546.00	7,644,000	
共同印刷	25,000	326.00	8,150,000	
日本写真印刷	12,200	1,732.00	21,130,400	
光村印刷	7,000	206.00	1,442,000	
宝印刷	3,600	1,374.00	4,946,400	
アシックス	67,900	2,270.00	154,133,000	
ツツミ	3,600	2,318.00	8,344,800	
小松ウオール工業	2,500	1,747.00	4,367,500	
ヤマハ	53,600	3,295.00	176,612,000	
河合楽器製作所	2,700	1,986.00	5,362,200	
クリナップ	8,500	770.00	6,545,000	
ピジョン	41,300	2,970.00	122,661,000	
兼松日産農林	8,000	152.00	1,216,000	
キングジム	6,100	848.00	5,172,800	
リンテック	17,300	2,152.00	37,229,600	
ＴＡＳＡＫＩ	1,400	1,644.00	2,301,600	
イトーキ	15,300	767.00	11,735,100	
任天堂	44,900	17,220.00	773,178,000	
三菱鉛筆	5,500	5,200.00	28,600,000	
タカラスタンダード	30,000	973.00	29,190,000	
コクヨ	37,900	1,349.00	51,127,100	
ナカバヤシ	15,000	283.00	4,245,000	
グローブライド	3,500	1,349.00	4,721,500	
岡村製作所	25,400	1,030.00	26,162,000	
美津濃	39,000	534.00	20,826,000	
アデランス	12,600	578.00	7,282,800	
東京電力ホールディングス	618,500	608.00	376,048,000	
中部電力	223,100	1,487.00	331,749,700	
関西電力	297,500	993.10	295,447,250	
中国電力	100,800	1,434.00	144,547,200	
北陸電力	71,400	1,542.00	110,098,800	
東北電力	182,200	1,380.00	251,436,000	
四国電力	65,700	1,449.00	95,199,300	
九州電力	161,000	1,133.00	182,413,000	
北海道電力	68,200	936.00	63,835,200	

沖縄電力	7,700	2,865.00	22,060,500	
電源開発	62,200	3,410.00	212,102,000	
ファーストエスコ	3,000	546.00	1,638,000	
イーレックス	1,600	1,559.00	2,494,400	
東京瓦斯	814,000	516.40	420,349,600	
大阪瓦斯	755,000	418.20	315,741,000	
東邦瓦斯	184,000	779.00	143,336,000	
北海道瓦斯	18,000	273.00	4,914,000	
広島ガス	12,700	366.00	4,648,200	
西部瓦斯	82,000	257.00	21,074,000	
静岡ガス	20,700	773.00	16,001,100	
メタウォーター	4,700	2,902.00	13,639,400	
ＳＢＳホールディングス	7,200	714.00	5,140,800	
東武鉄道	390,000	578.00	225,420,000	
相鉄ホールディングス	125,000	718.00	89,750,000	
東京急行電鉄	424,000	973.00	412,552,000	
京浜急行電鉄	200,000	1,006.00	201,200,000	
小田急電鉄	234,000	1,254.00	293,436,000	
京王電鉄	204,000	1,030.00	210,120,000	
京成電鉄	109,000	1,625.00	177,125,000	
富士急行	20,000	1,500.00	30,000,000	
新京成電鉄	9,000	442.00	3,978,000	
東日本旅客鉄道	133,300	10,250.00	1,366,325,000	
西日本旅客鉄道	70,200	6,863.00	481,782,600	
東海旅客鉄道	65,300	20,285.00	1,324,610,500	
西武ホールディングス	58,100	2,361.00	137,174,100	
鴻池運輸	10,300	1,299.00	13,379,700	
西日本鉄道	94,000	691.00	64,954,000	
ハマキョウレックス	5,600	1,894.00	10,606,400	
サカイ引越センター	2,900	2,722.00	7,893,800	
近鉄グループホールディングス	734,000	463.00	339,842,000	
阪急阪神ホールディングス	489,000	711.00	347,679,000	
南海電気鉄道	164,000	610.00	100,040,000	
京阪ホールディングス	163,000	830.00	135,290,000	
神戸電鉄	18,000	363.00	6,534,000	
名古屋鉄道	265,000	568.00	150,520,000	

山陽電気鉄道	27,000	501.00	13,527,000	
日本通運	282,000	502.00	141,564,000	
ヤマトホールディングス	134,800	2,274.00	306,535,200	
山九	96,000	515.00	49,440,000	
丸運	3,900	240.00	936,000	
丸全昭和運輸	24,000	405.00	9,720,000	
センコー	33,000	706.00	23,298,000	
トナミホールディングス	15,000	281.00	4,215,000	
ニッコンホールディングス	23,900	2,050.00	48,995,000	
日本石油輸送	8,000	229.00	1,832,000	
福山通運	44,000	562.00	24,728,000	
セイノーホールディングス	51,700	1,171.00	60,540,700	
神奈川中央交通	9,000	648.00	5,832,000	
日立物流	15,200	1,869.00	28,408,800	
丸和運輸機関	1,600	2,641.00	4,225,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,000	812.00	5,684,000	
日本郵船	655,000	228.00	149,340,000	
商船三井	355,000	262.00	93,010,000	
川崎汽船	319,000	241.00	76,879,000	
ＮＳユナイテッド海運	38,000	158.00	6,004,000	
飯野海運	38,800	446.00	17,304,800	
共栄タンカー	13,000	147.00	1,911,000	
乾汽船	6,000	847.00	5,082,000	
日本航空	139,600	4,102.00	572,639,200	
ＡＮＡホールディングス	1,353,000	314.60	425,653,800	
パスコ	7,000	407.00	2,849,000	
トランコム	2,100	6,000.00	12,600,000	
日新	30,000	319.00	9,570,000	
三菱倉庫	52,000	1,487.00	77,324,000	
三井倉庫ホールディングス	42,000	294.00	12,348,000	
住友倉庫	53,000	549.00	29,097,000	
澁澤倉庫	19,000	280.00	5,320,000	
東陽倉庫	12,000	225.00	2,700,000	
日本トランスシティ	17,000	362.00	6,154,000	
ケイヒン	13,000	136.00	1,768,000	
中央倉庫	4,200	910.00	3,822,000	

安田倉庫	5,700	712.00	4,058,400	
東洋埠頭	21,000	146.00	3,066,000	
宇徳	5,900	325.00	1,917,500	
上組	87,000	1,033.00	89,871,000	
サンリツ	1,800	487.00	876,600	
キムラユニティー	1,800	1,070.00	1,926,000	
キユーソー流通システム	2,000	2,819.00	5,638,000	
郵船ロジスティクス	6,700	1,354.00	9,071,800	
近鉄エクスプレス	13,000	1,436.00	18,668,000	
東海運	3,900	271.00	1,056,900	
エーアイテイー	3,400	920.00	3,128,000	
内外トランスライン	1,800	1,004.00	1,807,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	9,000	1,739.00	15,651,000	
システナ	7,000	1,819.00	12,733,000	
デジタルアーツ	3,500	2,335.00	8,172,500	
新日鉄住金ソリューションズ	12,000	2,063.00	24,756,000	
キューブシステム	3,100	643.00	1,993,300	
コア	3,000	1,298.00	3,894,000	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	855.00	2,223,000	
ＩＴホールディングス	23,900	2,527.00	60,395,300	
ネオス	2,200	506.00	1,113,200	
電算システム	2,500	1,584.00	3,960,000	
グリー	43,700	660.00	28,842,000	
コーエーテクモホールディングス	17,100	1,727.00	29,531,700	
三菱総合研究所	2,800	3,460.00	9,688,000	
ボルテージ	1,400	1,277.00	1,787,800	
電算	800	2,410.00	1,928,000	
ＡＧＳ	1,200	968.00	1,161,600	
ファインデックス	4,700	1,449.00	6,810,300	
ヒト・コミュニケーションズ	1,600	2,063.00	3,300,800	
ブレインパッド	1,100	768.00	844,800	
ＫＬａｂ	11,100	638.00	7,081,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4,800	934.00	4,483,200	
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	568.00	908,800	
ネクソン	68,900	1,730.00	119,197,000	

アイスタイル	11,600	1,077.00	12,493,200	
エムアップ	1,900	548.00	1,041,200	
エイチーム	2,700	1,630.00	4,401,000	
テクノスジャパン	800	5,910.00	4,728,000	
コロプラ	20,000	2,510.00	50,200,000	
モバイルクリエイト	4,800	469.00	2,251,200	
ブロードリーフ	7,400	1,170.00	8,658,000	
ハーツユナイテッドグループ	2,200	2,394.00	5,266,800	
メディアドゥ	1,500	1,729.00	2,593,500	
ブイキューブ	3,500	1,234.00	4,319,000	
サイバーリンクス	800	1,020.00	816,000	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	1,600	1,409.00	2,254,400	
オプティム	500	5,340.00	2,670,000	
ベリサーブ	800	4,660.00	3,728,000	
ティーガイア	7,200	1,391.00	10,015,200	
日本アジアグループ	6,100	508.00	3,098,800	
豆蔵ホールディングス	5,700	645.00	3,676,500	
テクマトリックス	3,100	2,056.00	6,373,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	125,800	302.00	37,991,600	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	6,300	7,670.00	48,321,000	
ザッパラス	4,100	386.00	1,582,600	
インターネットイニシアティブ	11,600	2,257.00	26,181,200	
さくらインターネット	3,600	1,485.00	5,346,000	
ＧＭＯクラウド	1,600	1,251.00	2,001,600	
ＳＲＡホールディングス	4,100	2,592.00	10,627,200	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	1,100	875.00	962,500	
朝日ネット	6,600	481.00	3,174,600	
コムチュア	1,200	2,615.00	3,138,000	
ｇｕｍｉ	7,400	834.00	6,171,600	
パイプドＨＤ	900	1,333.00	1,199,700	
フェイス	1,900	1,285.00	2,441,500	
ハイマックス	1,000	1,127.00	1,127,000	
野村総合研究所	50,400	3,975.00	200,340,000	
サイバネットシステム	5,900	777.00	4,584,300	
ＣＥホールディングス	1,100	1,040.00	1,144,000	
インテージホールディングス	3,800	1,412.00	5,365,600	

東邦システムサイエンス	2,200	617.00	1,357,400	
ソースネクスト	3,600	519.00	1,868,400	
ティー・ワイ・オー	10,000	170.00	1,700,000	
クレスコ	1,600	1,683.00	2,692,800	
フジ・メディア・ホールディングス	75,000	1,276.00	95,700,000	
オービック	24,800	6,100.00	151,280,000	
ジャストシステム	13,100	921.00	12,065,100	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	3,200	609.00	1,948,800	
ヤフー	515,800	506.00	260,994,800	
トレンドマイクロ	34,900	4,295.00	149,895,500	
インフォメーション・ディベロプメント	1,400	828.00	1,159,200	
日本オラクル	11,500	6,220.00	71,530,000	
アルファシステムズ	2,400	1,664.00	3,993,600	
フューチャー	8,700	834.00	7,255,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,400	855.00	4,617,000	
ソフトバンク・テクノロジー	1,900	1,720.00	3,268,000	
トーセ	2,000	725.00	1,450,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,700	4,715.00	17,445,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	16,300	2,161.00	35,224,300	
アイティフォー	9,400	509.00	4,784,600	
東計電算	1,300	2,043.00	2,655,900	
エックスネット	700	1,518.00	1,062,600	
大塚商会	19,400	5,570.00	108,058,000	
サイボウズ	9,600	339.00	3,254,400	
ソフトブレーン	10,600	165.00	1,749,000	
電通国際情報サービス	4,400	2,198.00	9,671,200	
ＥＭシステムズ	2,400	1,270.00	3,048,000	
ウェザーニューズ	2,400	3,685.00	8,844,000	
ＣＩＪ	6,600	458.00	3,022,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,371.00	959,700	
日本エンタープライズ	7,400	255.00	1,887,000	
ＷＯＷＯＷ	3,400	2,444.00	8,309,600	
フュージョンパートナー	4,500	552.00	2,484,000	
日本コロムビア	2,400	437.00	1,048,800	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	6,100	399.00	2,433,900	
ネットワンシステムズ	31,200	585.00	18,252,000	

アルゴグラフィックス	3,300	1,725.00	5,692,500	
マーベラス	12,200	945.00	11,529,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,300	1,443.00	19,191,900	
日本ユニシス	19,900	1,396.00	27,780,400	
兼松エレクトロニクス	4,500	1,952.00	8,784,000	
東京放送ホールディングス	43,100	1,638.00	70,597,800	
日本テレビホールディングス	65,700	1,887.00	123,975,900	
朝日放送	7,100	676.00	4,799,600	
テレビ朝日ホールディングス	19,700	1,917.00	37,764,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	54,600	623.00	34,015,800	
テレビ東京ホールディングス	6,500	1,987.00	12,915,500	
日本ＢＳ放送	1,200	999.00	1,198,800	
Ｕ－ＮＥＸＴ	1,700	960.00	1,632,000	
コネクシオ	6,300	1,263.00	7,956,900	
日本通信	38,300	205.00	7,851,500	
クロップス	1,300	501.00	651,300	
日本電信電話	556,200	4,960.00	2,758,752,000	
ＫＤＤＩ	731,000	3,197.00	2,337,007,000	
光通信	8,700	8,430.00	73,341,000	
ＮＴＴドコモ	555,000	2,705.00	1,501,275,000	
エムティーアイ	9,300	805.00	7,486,500	
ＧＭＯインターネット	26,700	1,348.00	35,991,600	
カドカワ	22,500	1,602.00	36,045,000	
学研ホールディングス	24,000	249.00	5,976,000	
ゼンリン	9,500	2,350.00	22,325,000	
昭文社	4,000	602.00	2,408,000	
インプレスホールディングス	5,900	134.00	790,600	
アイネット	4,000	1,149.00	4,596,000	
松竹	47,000	1,096.00	51,512,000	
東宝	51,400	2,883.00	148,186,200	
東映	27,000	877.00	23,679,000	
ＡＯＩ　Ｐｒｏ.	3,600	888.00	3,196,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,500	5,690.00	253,205,000	
ピー・シー・エー	900	1,301.00	1,170,900	
ビジネスブレイン太田昭和	1,100	924.00	1,016,400	
ＤＴＳ	8,000	2,155.00	17,240,000	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,500	3,015.00	91,957,500	
シーイーシー	4,700	1,600.00	7,520,000	
カプコン	18,400	2,717.00	49,992,800	
アイ・エス・ビー	900	829.00	746,100	
ジャステック	4,600	905.00	4,163,000	
ＳＣＳＫ	17,100	4,170.00	71,307,000	
日本システムウエア	2,700	1,001.00	2,702,700	
アイネス	10,200	1,172.00	11,954,400	
ＴＫＣ	6,700	2,982.00	19,979,400	
富士ソフト	10,700	2,574.00	27,541,800	
ＮＳＤ	15,300	1,722.00	26,346,600	
コナミホールディングス	32,500	3,520.00	114,400,000	
福井コンピュータホールディングス	1,600	1,513.00	2,420,800	
ＪＢＣＣホールディングス	6,000	677.00	4,062,000	
ミロク情報サービス	5,300	1,213.00	6,428,900	
ソフトバンクグループ	407,700	6,002.00	2,447,015,400	
ホウスイ	6,000	124.00	744,000	
高千穂交易	2,800	876.00	2,452,800	
伊藤忠食品	1,800	4,120.00	7,416,000	
エレマテック	3,400	1,966.00	6,684,400	
ＪＡＬＵＸ	2,300	2,075.00	4,772,500	
あらた	3,200	2,510.00	8,032,000	
トーメンデバイス	1,100	1,792.00	1,971,200	
東京エレクトロン　デバイス	2,600	1,487.00	3,866,200	
フィールズ	4,700	1,895.00	8,906,500	
双日	453,300	227.00	102,899,100	
アルフレッサ　ホールディングス	90,500	2,155.00	195,027,500	
横浜冷凍	17,800	1,058.00	18,832,400	
神栄	10,000	108.00	1,080,000	
山下医科器械	600	1,829.00	1,097,400	
ラサ商事	3,400	558.00	1,897,200	
アルコニックス	4,100	1,627.00	6,670,700	
神戸物産	4,700	2,415.00	11,350,500	
あい　ホールディングス	12,800	3,235.00	41,408,000	
ディーブイエックス	1,900	1,117.00	2,122,300	
ダイワボウホールディングス	65,000	219.00	14,235,000	

マクニカ・富士エレホールディングス	13,000	1,294.00	16,822,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12,500	903.00	11,287,500	
八洲電機	5,600	564.00	3,158,400	
ＵＫＣホールディングス	4,600	2,123.00	9,765,800	
ＯＣＨＩホールディングス	2,100	1,049.00	2,202,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	31,600	606.00	19,149,600	
三洋貿易	4,000	1,455.00	5,820,000	
ウイン・パートナーズ	2,600	1,467.00	3,814,200	
ミタチ産業	1,900	637.00	1,210,300	
シップヘルスケアホールディングス	14,600	2,848.00	41,580,800	
明治電機工業	2,300	1,109.00	2,550,700	
デリカフーズ	1,500	925.00	1,387,500	
スターティア	1,400	499.00	698,600	
富士興産	2,800	411.00	1,150,800	
協栄産業	10,000	125.00	1,250,000	
小野建	6,300	1,154.00	7,270,200	
佐鳥電機	5,700	733.00	4,178,100	
エコートレーディング	1,700	570.00	969,000	
伯東	5,500	901.00	4,955,500	
コンドーテック	5,700	925.00	5,272,500	
中山福	4,500	744.00	3,348,000	
ナガイレーベン	10,400	2,284.00	23,753,600	
三菱食品	7,900	2,871.00	22,680,900	
松田産業	5,200	1,193.00	6,203,600	
第一興商	12,700	4,725.00	60,007,500	
メディパルホールディングス	72,000	1,811.00	130,392,000	
アドヴァン	7,300	1,051.00	7,672,300	
ＳＰＫ	1,700	2,004.00	3,406,800	
萩原電気	1,800	1,977.00	3,558,600	
アズワン	5,600	4,075.00	22,820,000	
スズデン	2,300	998.00	2,295,400	
尾家産業	2,300	866.00	1,991,800	
シモジマ	5,000	1,107.00	5,535,000	
ドウシシャ	8,500	2,042.00	17,357,000	
小津産業	1,600	2,214.00	3,542,400	
高速	4,300	859.00	3,693,700	

たけびし	2,500	977.00	2,442,500	
黒田電気	13,400	1,708.00	22,887,200	
丸文	6,400	775.00	4,960,000	
ハピネット	6,500	950.00	6,175,000	
橋本総業ホールディングス	1,500	1,517.00	2,275,500	
エクセル	3,500	1,428.00	4,998,000	
マルカキカイ	2,300	1,305.00	3,001,500	
ガリバーインターナショナル	19,400	1,149.00	22,290,600	
日本エム・ディ・エム	6,000	614.00	3,684,000	
進和	4,300	1,428.00	6,140,400	
エスケイジャパン	1,800	321.00	577,800	
ダイトエレクトロン	3,300	686.00	2,263,800	
シークス	4,600	3,360.00	15,456,000	
田中商事	2,200	635.00	1,397,000	
オーハシテクニカ	4,100	1,229.00	5,038,900	
白銅	2,100	1,043.00	2,190,300	
伊藤忠商事	564,700	1,413.00	797,921,100	
丸紅	708,200	582.90	412,809,780	
高島	14,000	174.00	2,436,000	
長瀬産業	43,300	1,257.00	54,428,100	
蝶理	4,600	1,492.00	6,863,200	
豊田通商	80,200	2,634.00	211,246,800	
三共生興	10,900	380.00	4,142,000	
兼松	153,000	165.00	25,245,000	
ツカモトコーポレーション	13,000	115.00	1,495,000	
三井物産	650,800	1,338.50	871,095,800	
日本紙パルプ商事	37,000	325.00	12,025,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,000	3,270.00	81,750,000	
カメイ	9,400	1,037.00	9,747,800	
東都水産	12,000	174.00	2,088,000	
ＯＵＧホールディングス	10,000	230.00	2,300,000	
スターゼン	2,600	3,200.00	8,320,000	
山善	27,600	878.00	24,232,800	
椿本興業	8,000	293.00	2,344,000	
住友商事	453,000	1,186.00	537,258,000	
内田洋行	18,000	456.00	8,208,000	

三菱商事	540,000	1,935.50	1,045,170,000	
第一実業	16,000	494.00	7,904,000	
キヤノンマーケティングジャパン	20,500	1,904.00	39,032,000	
西華産業	24,000	224.00	5,376,000	
佐藤商事	6,400	636.00	4,070,400	
菱洋エレクトロ	8,300	1,336.00	11,088,800	
東京産業	7,200	382.00	2,750,400	
ユアサ商事	6,800	2,521.00	17,142,800	
神鋼商事	16,000	200.00	3,200,000	
小林産業	4,800	187.00	897,600	
阪和興業	72,000	499.00	35,928,000	
カナデン	6,900	850.00	5,865,000	
菱電商事	11,000	646.00	7,106,000	
フルサト工業	4,000	1,687.00	6,748,000	
岩谷産業	85,000	644.00	54,740,000	
すてきナイスグループ	31,000	137.00	4,247,000	
昭光通商	26,000	72.00	1,872,000	
ニチモウ	11,000	179.00	1,969,000	
極東貿易	10,000	222.00	2,220,000	
イワキ	11,000	215.00	2,365,000	
三愛石油	18,000	786.00	14,148,000	
稲畑産業	17,300	1,098.00	18,995,400	
ＧＳＩクレオス	19,000	114.00	2,166,000	
明和産業	6,700	376.00	2,519,200	
ワキタ	15,300	791.00	12,102,300	
東邦ホールディングス	23,000	2,603.00	59,869,000	
サンゲツ	25,300	2,020.00	51,106,000	
ミツウロコグループホールディングス	11,600	540.00	6,264,000	
シナネンホールディングス	15,000	426.00	6,390,000	
伊藤忠エネクス	18,500	897.00	16,594,500	
サンリオ	22,200	2,168.00	48,129,600	
サンワテクノス	4,600	712.00	3,275,200	
リョーサン	11,400	2,704.00	30,825,600	
新光商事	8,500	1,092.00	9,282,000	
トーホー	3,200	2,455.00	7,856,000	
三信電気	10,000	921.00	9,210,000	

東陽テクニカ	10,300	1,154.00	11,886,200	
モスフードサービス	9,400	2,907.00	27,325,800	
加賀電子	6,500	1,343.00	8,729,500	
ソーダニッカ	7,400	460.00	3,404,000	
立花エレテック	5,300	1,175.00	6,227,500	
フォーバル	2,800	777.00	2,175,600	
ＰＡＬＴＡＣ	11,500	1,928.00	22,172,000	
三谷産業	7,700	345.00	2,656,500	
ヤマタネ	33,000	150.00	4,950,000	
丸紅建材リース	6,000	188.00	1,128,000	
日鉄住金物産	47,000	384.00	18,048,000	
トラスコ中山	8,200	4,610.00	37,802,000	
オートバックスセブン	27,600	1,890.00	52,164,000	
加藤産業	11,200	2,721.00	30,475,200	
イノテック	6,600	439.00	2,897,400	
イエローハット	6,800	2,288.00	15,558,400	
ＪＫホールディングス	7,200	471.00	3,391,200	
日伝	3,000	2,977.00	8,931,000	
北沢産業	6,000	160.00	960,000	
杉本商事	4,100	1,179.00	4,833,900	
因幡電機産業	10,100	3,605.00	36,410,500	
バイテックホールディングス	2,200	932.00	2,050,400	
ミスミグループ本社	80,800	1,636.00	132,188,800	
アルテック	6,100	149.00	908,900	
タキヒヨー	12,000	424.00	5,088,000	
蔵王産業	1,200	1,293.00	1,551,600	
スズケン	32,800	3,880.00	127,264,000	
ジェコス	5,000	1,031.00	5,155,000	
ルネサスイーストン	4,500	415.00	1,867,500	
ローソン	27,300	8,670.00	236,691,000	
サンエー	4,900	5,270.00	25,823,000	
ダイユーエイト	2,300	687.00	1,580,100	
カワチ薬品	5,600	2,110.00	11,816,000	
エービーシー・マート	9,300	7,360.00	68,448,000	
ハードオフコーポレーション	3,500	1,509.00	5,281,500	
アスクル	8,800	4,610.00	40,568,000	

ゲオホールディングス	12,000	1,854.00	22,248,000	
アダストリア	13,300	3,705.00	49,276,500	
ジーフット	4,400	778.00	3,423,200	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	10,000	97.00	970,000	
くらコーポレーション	4,200	4,925.00	20,685,000	
キャンドゥ	3,800	1,617.00	6,144,600	
パル	4,200	2,654.00	11,146,800	
エディオン	30,600	887.00	27,142,200	
サーラコーポレーション	6,200	554.00	3,434,800	
ワッツ	2,900	894.00	2,592,600	
ハローズ	2,400	2,108.00	5,059,200	
あみやき亭	1,400	4,270.00	5,978,000	
ひらまつ	10,000	695.00	6,950,000	
ゲンキー	1,400	3,565.00	4,991,000	
サッポロドラッグストアー	800	2,083.00	1,666,400	
大黒天物産	1,700	4,905.00	8,338,500	
ハニーズ	6,300	1,075.00	6,772,500	
ファーマライズホールディングス	2,300	541.00	1,244,300	
アルペン	6,500	1,866.00	12,129,000	
クオール	7,300	1,633.00	11,920,900	
ジェイアイエヌ	4,900	3,850.00	18,865,000	
ビックカメラ	37,200	1,160.00	43,152,000	
ＤＣＭホールディングス	35,500	816.00	28,968,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	25,400	3,420.00	86,868,000	
東京一番フーズ	1,400	551.00	771,400	
ダイヤモンドダイニング	1,300	991.00	1,288,300	
きちり	2,000	653.00	1,306,000	
アークランドサービス	2,300	3,010.00	6,923,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	91,100	1,464.00	133,370,400	
ドトール・日レスホールディングス	12,600	1,969.00	24,809,400	
マツモトキヨシホールディングス	14,800	5,800.00	85,840,000	
ブロンコビリー	2,800	3,100.00	8,680,000	
スタートトゥデイ	21,900	4,800.00	105,120,000	
トレジャー・ファクトリー	2,000	1,101.00	2,202,000	
物語コーポレーション	1,900	5,280.00	10,032,000	
ココカラファイン	7,500	4,890.00	36,675,000	

三越伊勢丹ホールディングス	143,200	1,236.00	176,995,200	
ウエルシアホールディングス	6,200	6,460.00	40,052,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,600	2,752.00	29,171,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	8,400	364.00	3,057,600	
ミサワ	1,000	515.00	515,000	
エー・ピーカンパニー	1,300	1,142.00	1,484,600	
チムニー	1,800	2,932.00	5,277,600	
シュッピン	2,100	1,305.00	2,740,500	
ネクステージ	1,400	596.00	834,400	
ジョイフル本田	11,700	2,487.00	29,097,900	
キリン堂ホールディングス	2,500	1,105.00	2,762,500	
ホットランド	1,900	1,042.00	1,979,800	
すかいらーく	22,100	1,449.00	32,022,900	
綿半ホールディングス	2,100	1,397.00	2,933,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	23,900	990.00	23,661,000	
ブックオフコーポレーション	4,300	893.00	3,839,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,600	1,018.00	1,628,800	
あさひ	5,400	1,611.00	8,699,400	
日本調剤	1,900	3,665.00	6,963,500	
コスモス薬品	3,600	20,030.00	72,108,000	
トーエル	3,600	824.00	2,966,400	
一六堂	2,100	348.00	730,800	
セブン&アイ・ホールディングス	301,000	4,684.00	1,409,884,000	
薬王堂	1,000	3,495.00	3,495,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19,400	1,102.00	21,378,800	
ツルハホールディングス	16,500	11,020.00	181,830,000	
サンマルクホールディングス	5,700	2,972.00	16,940,400	
フェリシモ	2,100	1,036.00	2,175,600	
トリドール	8,800	1,995.00	17,556,000	
クスリのアオキ	6,400	6,130.00	39,232,000	
メディカルシステムネットワーク	8,600	680.00	5,848,000	
総合メディカル	3,500	3,455.00	12,092,500	
はるやま商事	3,200	761.00	2,435,200	
カッパ・クリエイト	10,100	1,193.00	12,049,300	
ライトオン	5,400	1,578.00	8,521,200	

良品計画	8,300	25,760.00	213,808,000	
三城ホールディングス	9,000	452.00	4,068,000	
アルビス	2,000	1,975.00	3,950,000	
コナカ	8,600	532.00	4,575,200	
ハウス　オブ　ローゼ	1,000	1,419.00	1,419,000	
Ｇ－７ホールディングス	2,200	1,237.00	2,721,400	
イオン北海道	4,900	521.00	2,552,900	
コジマ	11,100	252.00	2,797,200	
ヒマラヤ	2,400	1,005.00	2,412,000	
コーナン商事	10,500	1,866.00	19,593,000	
エコス	3,000	1,476.00	4,428,000	
マルシェ	1,900	825.00	1,567,500	
ドンキホーテホールディングス	46,500	3,925.00	182,512,500	
西松屋チェーン	14,200	1,200.00	17,040,000	
ゼンショーホールディングス	37,000	1,408.00	52,096,000	
幸楽苑ホールディングス	4,700	1,475.00	6,932,500	
ハークスレイ	2,100	1,056.00	2,217,600	
サイゼリヤ	11,800	1,950.00	23,010,000	
ＶＴホールディングス	24,400	580.00	14,152,000	
魚力	2,300	1,238.00	2,847,400	
ポプラ	1,800	463.00	833,400	
ユナイテッドアローズ	10,300	4,265.00	43,929,500	
ハイデイ日高	6,600	2,627.00	17,338,200	
京都きもの友禅	4,900	836.00	4,096,400	
コロワイド	24,000	1,754.00	42,096,000	
ピーシーデポコーポレーション	6,000	1,163.00	6,978,000	
壱番屋	3,300	6,620.00	21,846,000	
トップカルチャー	3,200	471.00	1,507,200	
ＰＬＡＮＴ	1,800	1,212.00	2,181,600	
スギホールディングス	12,900	5,650.00	72,885,000	
スクロール	10,900	472.00	5,144,800	
ヨンドシーホールディングス	5,500	2,767.00	15,218,500	
ファミリーマート	22,100	6,010.00	132,821,000	
木曽路	8,800	2,234.00	19,659,200	
サトレストランシステムズ	8,500	802.00	6,817,000	
千趣会	14,300	733.00	10,481,900	

タカキュー	6,300	193.00	1,215,900	
ケーヨー	12,200	519.00	6,331,800	
上新電機	17,000	866.00	14,722,000	
日本瓦斯	8,300	2,675.00	22,202,500	
ベスト電器	23,200	117.00	2,714,400	
ロイヤルホールディングス	12,000	2,140.00	25,680,000	
東天紅	5,000	131.00	655,000	
いなげや	8,000	1,389.00	11,112,000	
島忠	18,600	2,463.00	45,811,800	
チヨダ	8,500	2,899.00	24,641,500	
ライフコーポレーション	4,800	2,821.00	13,540,800	
リンガーハット	6,500	2,266.00	14,729,000	
ＭｒＭａｘ	7,600	285.00	2,166,000	
テンアライド	6,600	364.00	2,402,400	
ＡＯＫＩホールディングス	16,400	1,286.00	21,090,400	
オークワ	11,000	1,148.00	12,628,000	
コメリ	11,100	2,545.00	28,249,500	
青山商事	13,800	4,045.00	55,821,000	
しまむら	8,400	14,120.00	118,608,000	
はせがわ	2,900	426.00	1,235,400	
高島屋	105,000	833.00	87,465,000	
松屋	15,300	893.00	13,662,900	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	36,900	1,871.00	69,039,900	
近鉄百貨店	28,000	296.00	8,288,000	
ニッセンホールディングス	10,600	135.00	1,431,000	
パルコ	7,000	957.00	6,699,000	
丸井グループ	88,300	1,655.00	146,136,500	
アクシアル　リテイリング	5,600	3,525.00	19,740,000	
イオン	296,100	1,646.00	487,380,600	
ユニーグループ・ホールディングス	69,500	829.00	57,615,500	
イズミ	14,300	4,510.00	64,493,000	
東武ストア	9,000	307.00	2,763,000	
平和堂	14,700	2,326.00	34,192,200	
フジ	8,300	2,405.00	19,961,500	
ヤオコー	8,200	4,785.00	39,237,000	
ゼビオホールディングス	9,800	1,771.00	17,355,800	

ケーズホールディングス	15,200	3,775.00	57,380,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	4,600	574.00	2,640,400	
日産東京販売ホールディングス	12,700	264.00	3,352,800	
アインホールディングス	8,700	5,690.00	49,503,000	
元気寿司	2,100	2,121.00	4,454,100	
ヤマダ電機	218,900	582.00	127,399,800	
アークランドサカモト	12,200	1,151.00	14,042,200	
ニトリホールディングス	31,100	10,460.00	325,306,000	
グルメ杵屋	5,000	988.00	4,940,000	
愛眼	5,700	216.00	1,231,200	
ケーユーホールディングス	3,800	710.00	2,698,000	
吉野家ホールディングス	26,600	1,392.00	37,027,200	
松屋フーズ	3,500	2,836.00	9,926,000	
サガミチェーン	9,700	1,227.00	11,901,900	
関西スーパーマーケット	6,100	773.00	4,715,300	
王将フードサービス	5,300	3,430.00	18,179,000	
プレナス	8,100	1,987.00	16,094,700	
ミニストップ	5,300	1,764.00	9,349,200	
アークス	13,500	2,721.00	36,733,500	
バローホールディングス	15,500	2,771.00	42,950,500	
藤久	700	1,734.00	1,213,800	
ベルク	3,600	4,385.00	15,786,000	
大庄	3,400	1,441.00	4,899,400	
ファーストリテイリング	14,400	29,425.00	423,720,000	
サンドラッグ	15,200	8,280.00	125,856,000	
サックスバー　ホールディングス	6,800	1,442.00	9,805,600	
ヤマザワ	1,600	1,660.00	2,656,000	
やまや	1,500	2,083.00	3,124,500	
ベルーナ	18,000	556.00	10,008,000	
島根銀行	1,500	1,173.00	1,759,500	
じもとホールディングス	51,600	145.00	7,482,000	
足利ホールディングス	52,800	329.00	17,371,200	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,900	2,742.00	27,145,800	
九州フィナンシャルグループ	110,200	604.00	66,560,800	
ゆうちょ銀行	138,300	1,396.00	193,066,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	501,200	521.70	261,476,040	

新生銀行	623,000	157.00	97,811,000	
あおぞら銀行	455,000	386.00	175,630,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,773,900	538.80	3,110,977,320	
りそなホールディングス	841,900	411.00	346,020,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,503,000	351.70	528,605,100	
三井住友フィナンシャルグループ	576,200	3,598.00	2,073,167,600	
第四銀行	91,000	387.00	35,217,000	
北越銀行	78,000	188.00	14,664,000	
西日本シティ銀行	234,000	199.00	46,566,000	
千葉銀行	277,000	578.00	160,106,000	
常陽銀行	260,000	394.00	102,440,000	
群馬銀行	160,000	465.00	74,400,000	
武蔵野銀行	11,500	2,921.00	33,591,500	
千葉興業銀行	19,700	500.00	9,850,000	
筑波銀行	29,900	303.00	9,059,700	
七十七銀行	113,000	398.00	44,974,000	
青森銀行	53,000	330.00	17,490,000	
秋田銀行	47,000	300.00	14,100,000	
山形銀行	40,000	426.00	17,040,000	
岩手銀行	5,000	4,105.00	20,525,000	
東邦銀行	64,000	363.00	23,232,000	
東北銀行	37,000	143.00	5,291,000	
みちのく銀行	36,000	176.00	6,336,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	311,000	384.00	119,424,000	
静岡銀行	211,000	841.00	177,451,000	
十六銀行	90,000	334.00	30,060,000	
スルガ銀行	68,300	2,065.00	141,039,500	
八十二銀行	130,200	500.00	65,100,000	
山梨中央銀行	45,000	421.00	18,945,000	
大垣共立銀行	96,000	344.00	33,024,000	
福井銀行	61,000	211.00	12,871,000	
北國銀行	80,000	314.00	25,120,000	
清水銀行	2,400	2,350.00	5,640,000	
富山銀行	1,400	3,705.00	5,187,000	
滋賀銀行	68,000	483.00	32,844,000	
南都銀行	69,000	314.00	21,666,000	

百五銀行	65,000	414.00	26,910,000	
京都銀行	137,000	781.00	106,997,000	
紀陽銀行	28,200	1,305.00	36,801,000	
三重銀行	32,000	202.00	6,464,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	490,000	147.00	72,030,000	
広島銀行	212,000	416.00	88,192,000	
山陰合同銀行	43,600	727.00	31,697,200	
中国銀行	51,000	1,177.00	60,027,000	
鳥取銀行	23,000	166.00	3,818,000	
伊予銀行	77,000	735.00	56,595,000	
百十四銀行	79,000	324.00	25,596,000	
四国銀行	56,000	213.00	11,928,000	
阿波銀行	59,000	549.00	32,391,000	
大分銀行	41,000	338.00	13,858,000	
宮崎銀行	48,000	283.00	13,584,000	
佐賀銀行	44,000	214.00	9,416,000	
十八銀行	44,000	256.00	11,264,000	
沖縄銀行	5,700	3,640.00	20,748,000	
琉球銀行	14,800	1,252.00	18,529,600	
セブン銀行	269,600	479.00	129,138,400	
みずほフィナンシャルグループ	10,163,100	171.10	1,738,906,410	
高知銀行	28,000	112.00	3,136,000	
山口フィナンシャルグループ	67,000	1,035.00	69,345,000	
長野銀行	24,000	189.00	4,536,000	
名古屋銀行	60,000	375.00	22,500,000	
北洋銀行	108,400	291.00	31,544,400	
愛知銀行	2,400	4,755.00	11,412,000	
第三銀行	41,000	151.00	6,191,000	
中京銀行	30,000	211.00	6,330,000	
大光銀行	25,000	202.00	5,050,000	
愛媛銀行	42,000	227.00	9,534,000	
トマト銀行	28,000	144.00	4,032,000	
みなと銀行	65,000	158.00	10,270,000	
京葉銀行	59,000	414.00	24,426,000	
関西アーバン銀行	10,000	1,058.00	10,580,000	
栃木銀行	39,000	423.00	16,497,000	

北日本銀行	2,200	2,779.00	6,113,800	
東和銀行	101,000	87.00	8,787,000	
福島銀行	89,000	84.00	7,476,000	
大東銀行	43,000	178.00	7,654,000	
トモニホールディングス	55,200	314.00	17,332,800	
フィデアホールディングス	44,000	173.00	7,612,000	
池田泉州ホールディングス	76,300	415.00	31,664,500	
ＦＰＧ	21,500	1,363.00	29,304,500	
ＳＢＩホールディングス	86,600	1,156.00	100,109,600	
ジャフコ	12,100	3,480.00	42,108,000	
大和証券グループ本社	673,000	675.30	454,476,900	
野村ホールディングス	1,384,700	508.00	703,427,600	
岡三証券グループ	61,000	597.00	36,417,000	
丸三証券	21,400	1,012.00	21,656,800	
東洋証券	28,000	257.00	7,196,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,600	589.00	48,651,400	
光世証券	19,000	136.00	2,584,000	
水戸証券	22,400	304.00	6,809,600	
いちよし証券	16,100	936.00	15,069,600	
松井証券	36,400	946.00	34,434,400	
だいこう証券ビジネス	3,600	734.00	2,642,400	
マネックスグループ	84,800	284.00	24,083,200	
カブドットコム証券	63,900	359.00	22,940,100	
極東証券	9,700	1,298.00	12,590,600	
岩井コスモホールディングス	6,800	1,064.00	7,235,200	
藍澤證券	10,200	582.00	5,936,400	
マネースクウェアＨＤ	2,600	987.00	2,566,200	
マネーパートナーズグループ	7,100	738.00	5,239,800	
かんぽ生命保険	22,000	2,616.00	57,552,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	159,900	3,035.00	485,296,500	
アニコム　ホールディングス	4,900	2,898.00	14,200,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	215,100	2,945.00	633,469,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	68,900	1,465.00	100,938,500	
第一生命保険	461,100	1,373.50	633,320,850	
東京海上ホールディングス	291,500	3,692.00	1,076,218,000	

Ｔ＆Ｄホールディングス	262,300	1,115.00	292,464,500	
全国保証	18,700	4,045.00	75,641,500	
クレディセゾン	54,600	2,052.00	112,039,200	
アクリーティブ	5,900	502.00	2,961,800	
芙蓉総合リース	8,200	4,725.00	38,745,000	
興銀リース	13,500	1,901.00	25,663,500	
東京センチュリーリース	16,900	3,920.00	66,248,000	
日本証券金融	31,700	443.00	14,043,100	
アイフル	120,500	391.00	47,115,500	
ポケットカード	7,200	544.00	3,916,800	
リコーリース	5,700	3,205.00	18,268,500	
イオンフィナンシャルサービス	47,200	2,395.00	113,044,000	
アコム	144,600	584.00	84,446,400	
ジャックス	40,000	425.00	17,000,000	
オリエントコーポレーション	311,100	226.00	70,308,600	
日立キャピタル	17,000	2,428.00	41,276,000	
アプラスフィナンシャル	34,500	103.00	3,553,500	
オリックス	509,600	1,632.50	831,922,000	
三菱ＵＦＪリース	182,500	497.00	90,702,500	
日本取引所グループ	211,300	1,733.00	366,182,900	
イー・ギャランティ	2,300	2,535.00	5,830,500	
アサックス	1,200	1,344.00	1,612,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,900	1,586.00	4,599,400	
いちごグループホールディングス	59,800	523.00	31,275,400	
日本駐車場開発	78,900	121.00	9,546,900	
ヒューリック	150,000	1,085.00	162,750,000	
三栄建築設計	2,900	1,207.00	3,500,300	
野村不動産ホールディングス	47,700	2,031.00	96,878,700	
三重交通グループホールディングス	12,800	560.00	7,168,000	
サムティ	3,900	1,068.00	4,165,200	
ディア・ライフ	3,700	386.00	1,428,200	
エー・ディー・ワークス	50,100	43.00	2,154,300	
日本商業開発	2,400	2,173.00	5,215,200	
プレサンスコーポレーション	2,400	3,960.00	9,504,000	
ユニゾホールディングス	4,500	4,655.00	20,947,500	
日本管理センター	4,700	1,652.00	7,764,400	

サンセイランディック	1,700	955.00	1,623,500	
エストラスト	1,300	532.00	691,600	
フージャースホールディングス	10,100	513.00	5,181,300	
オープンハウス	10,400	2,380.00	24,752,000	
東急不動産ホールディングス	174,100	776.00	135,101,600	
飯田グループホールディングス	66,700	2,128.00	141,937,600	
ムゲンエステート	1,000	2,123.00	2,123,000	
パーク２４	36,300	3,240.00	117,612,000	
パラカ	2,500	1,451.00	3,627,500	
三井不動産	382,000	2,741.00	1,047,062,000	
三菱地所	535,000	2,142.50	1,146,237,500	
平和不動産	13,600	1,326.00	18,033,600	
東京建物	78,600	1,520.00	119,472,000	
ダイビル	18,600	932.00	17,335,200	
京阪神ビルディング	12,000	584.00	7,008,000	
住友不動産	172,000	3,241.00	557,452,000	
大京	134,000	172.00	23,048,000	
テーオーシー	27,900	884.00	24,663,600	
東京楽天地	12,000	484.00	5,808,000	
レオパレス２１	84,800	675.00	57,240,000	
スターツコーポレーション	8,300	2,360.00	19,588,000	
フジ住宅	9,200	677.00	6,228,400	
空港施設	8,800	488.00	4,294,400	
明和地所	4,000	638.00	2,552,000	
住友不動産販売	5,200	2,121.00	11,029,200	
ゴールドクレスト	5,700	1,552.00	8,846,400	
日本エスリード	2,800	1,002.00	2,805,600	
日神不動産	9,600	369.00	3,542,400	
タカラレーベン	31,400	663.00	20,818,200	
サンヨーハウジング名古屋	4,100	975.00	3,997,500	
イオンモール	46,500	1,621.00	75,376,500	
ファースト住建	2,700	1,311.00	3,539,700	
トーセイ	11,000	798.00	8,778,000	
穴吹興産	8,000	253.00	2,024,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,700	1,023.00	45,728,100	
サンフロンティア不動産	8,700	1,068.00	9,291,600	

エフ・ジェー・ネクスト	6,300	490.00	3,087,000	
ランドビジネス	4,900	259.00	1,269,100	
グランディハウス	6,400	340.00	2,176,000	
日本空港ビルデング	23,000	3,870.00	89,010,000	
日本工営	26,000	354.00	9,204,000	
ネクスト	21,500	1,258.00	27,047,000	
ジェイエイシーリクルートメント	3,500	1,433.00	5,015,500	
日本M&Aセンター	11,800	6,520.00	76,936,000	
ノバレーゼ	2,400	828.00	1,987,200	
アコーディア・ゴルフ	21,500	1,070.00	23,005,000	
中広	1,300	621.00	807,300	
タケエイ	7,200	1,005.00	7,236,000	
トラスト・テック	3,100	1,421.00	4,405,100	
パソナグループ	7,100	649.00	4,607,900	
ＣＤＳ	2,000	909.00	1,818,000	
リンクアンドモチベーション	17,300	139.00	2,404,700	
ＧＣＡサヴィアン	6,800	1,107.00	7,527,600	
エス・エム・エス	9,500	2,048.00	19,456,000	
テンプホールディングス	53,400	1,596.00	85,226,400	
リニカル	4,600	2,114.00	9,724,400	
クックパッド	17,000	1,679.00	28,543,000	
エスクリ	4,400	624.00	2,745,600	
アイ・ケイ・ケイ	4,500	671.00	3,019,500	
学情	2,900	1,235.00	3,581,500	
スタジオアリス	3,500	2,718.00	9,513,000	
シミックホールディングス	3,700	1,332.00	4,928,400	
ＮＪＳ	1,600	1,191.00	1,905,600	
綜合警備保障	25,400	6,260.00	159,004,000	
カカクコム	54,800	2,137.00	117,107,600	
アイロムグループ	2,200	1,178.00	2,591,600	
ルネサンス	4,300	1,220.00	5,246,000	
ディップ	8,400	2,849.00	23,931,600	
オプトホールディング	4,900	650.00	3,185,000	
ツクイ	9,400	1,366.00	12,840,400	
キャリアデザインセンター	2,300	941.00	2,164,300	
エムスリー	65,900	2,860.00	188,474,000	

ツカダ・グローバルホールディング	6,200	744.00	4,612,800	
アウトソーシング	3,600	3,625.00	13,050,000	
ウェルネット	2,900	4,080.00	11,832,000	
ディー・エヌ・エー	34,100	2,011.00	68,575,100	
博報堂ＤＹホールディングス	105,600	1,255.00	132,528,000	
ぐるなび	8,800	2,834.00	24,939,200	
エスアールジータカミヤ	7,400	437.00	3,233,800	
ファンコミュニケーションズ	17,600	857.00	15,083,200	
ジェイコムホールディングス	2,100	2,807.00	5,894,700	
ＷＤＢホールディングス	2,700	937.00	2,529,900	
ティア	3,800	621.00	2,359,800	
バリューコマース	7,600	383.00	2,910,800	
インフォマート	11,000	1,009.00	11,099,000	
ＪＰホールディングス	20,000	399.00	7,980,000	
ＥＰＳホールディングス	8,500	1,345.00	11,432,500	
レッグス	1,300	653.00	848,900	
プレステージ・インターナショナル	6,400	1,309.00	8,377,600	
アミューズ	4,200	2,442.00	10,256,400	
ドリームインキュベータ	2,600	2,303.00	5,987,800	
クイック	4,000	867.00	3,468,000	
ＴＡＣ	8,300	196.00	1,626,800	
ケネディクス	102,300	476.00	48,694,800	
電通	84,900	5,680.00	482,232,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	442.00	2,210,000	
ぴあ	2,300	2,030.00	4,669,000	
イオンファンタジー	2,700	2,348.00	6,339,600	
シーティーエス	2,300	802.00	1,844,600	
ネクシィーズグループ	3,100	1,622.00	5,028,200	
みらかホールディングス	19,400	4,770.00	92,538,000	
アルプス技研	2,800	2,258.00	6,322,400	
ダイオーズ	1,400	1,052.00	1,472,800	
日本空調サービス	7,400	541.00	4,003,400	
オリエンタルランド	82,300	7,686.00	632,557,800	
ダスキン	21,600	2,085.00	45,036,000	
明光ネットワークジャパン	8,800	1,211.00	10,656,800	
ファルコホールディングス	3,500	1,372.00	4,802,000	

ラウンドワン	24,100	664.00	16,002,400	
リゾートトラスト	32,100	2,338.00	75,049,800	
ビー・エム・エル	4,500	4,600.00	20,700,000	
ワタベウェディング	3,300	443.00	1,461,900	
りらいあコミュニケーションズ	12,600	1,107.00	13,948,200	
早稲田アカデミー	1,400	869.00	1,216,600	
ユー・エス・エス	92,200	1,787.00	164,761,400	
東京個別指導学院	3,800	698.00	2,652,400	
サイバーエージェント	18,600	5,390.00	100,254,000	
楽天	356,300	1,284.00	457,489,200	
テー・オー・ダブリュー	4,700	680.00	3,196,000	
セントラルスポーツ	2,800	2,261.00	6,330,800	
フルキャストホールディングス	7,200	757.00	5,450,400	
リゾートソリューション	10,000	305.00	3,050,000	
テクノプロ・ホールディングス	12,300	3,130.00	38,499,000	
インターワークス	1,300	743.00	965,900	
ファーストロジック	300	2,677.00	803,100	
リブセンス	6,000	468.00	2,808,000	
ジャパンマテリアル	3,200	2,811.00	8,995,200	
ベクトル	2,400	2,684.00	6,441,600	
ウチヤマホールディングス	4,900	573.00	2,807,700	
サクセスホールディングス	1,300	1,556.00	2,022,800	
キャリアリンク	1,200	1,881.00	2,257,200	
ＩＢＪ	4,800	559.00	2,683,200	
アサンテ	2,800	1,500.00	4,200,000	
Ｎ・フィールド	2,900	1,930.00	5,597,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	800	1,858.00	1,486,400	
ライドオン・エクスプレス	1,400	1,583.00	2,216,200	
ＥＲＩホールディングス	2,300	873.00	2,007,900	
アビスト	1,000	2,121.00	2,121,000	
ウィルグループ	2,100	1,011.00	2,123,100	
日本ビューホテル	1,000	1,717.00	1,717,000	
リクルートホールディングス	153,600	3,440.00	528,384,000	
エラン	1,000	1,300.00	1,300,000	
日本郵政	168,000	1,537.00	258,216,000	
ベルシステム２４ホールディングス	11,700	978.00	11,442,600	

リロ・ホールディング	2,900	14,920.00	43,268,000	
東祥	2,300	4,115.00	9,464,500	
エイチ・アイ・エス	12,400	2,943.00	36,493,200	
ラックランド	1,200	1,653.00	1,983,600	
共立メンテナンス	5,700	8,920.00	50,844,000	
イチネンホールディングス	8,700	984.00	8,560,800	
建設技術研究所	4,500	1,015.00	4,567,500	
スペース	4,100	1,328.00	5,444,800	
燦ホールディングス	1,700	1,395.00	2,371,500	
スバル興業	6,000	383.00	2,298,000	
東京テアトル	29,000	118.00	3,422,000	
ナガワ	1,400	3,010.00	4,214,000	
よみうりランド	16,000	530.00	8,480,000	
東京都競馬	52,000	217.00	11,284,000	
カナモト	10,700	2,952.00	31,586,400	
東京ドーム	62,000	480.00	29,760,000	
西尾レントオール	6,100	3,005.00	18,330,500	
トランス・コスモス	8,800	2,923.00	25,722,400	
乃村工藝社	16,300	1,877.00	30,595,100	
藤田観光	29,000	519.00	15,051,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	37,000	173.00	6,401,000	
日本管財	6,500	1,690.00	10,985,000	
トーカイ	3,400	3,245.00	11,033,000	
白洋舎	10,000	258.00	2,580,000	
セコム	79,200	8,371.00	662,983,200	
セントラル警備保障	3,400	2,353.00	8,000,200	
丹青社	14,300	908.00	12,984,400	
メイテック	9,500	3,860.00	36,670,000	
アサツー　ディ・ケイ	13,400	2,762.00	37,010,800	
応用地質	7,900	1,248.00	9,859,200	
船井総研ホールディングス	10,600	1,655.00	17,543,000	
進学会	3,600	563.00	2,026,800	
オオバ	4,600	460.00	2,116,000	
学究社	1,400	1,207.00	1,689,800	
ベネッセホールディングス	25,500	3,175.00	80,962,500	
イオンディライト	7,400	3,105.00	22,977,000	

ナック	5,100	869.00	4,431,900	
ニチイ学館	14,000	794.00	11,116,000	
ダイセキ	14,300	2,092.00	29,915,600	
ステップ	2,700	1,051.00	2,837,700	
合　計	120,198,600		147,234,139,750	

(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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,547,966,905
コール・ローン	1,153,210,375
国債証券	274,435,295,900
地方債証券	19,138,976,624
特殊債券	25,748,746,620
社債券	14,662,285,620
派生商品評価勘定	3,717,408
未収入金	10,020,500,030
未収利息	638,001,251
前払費用	15,075,735
差入委託証拠金	480,000
流動資産合計	347,364,256,468
資産合計	347,364,256,468
負債の部	
流動負債	
前受金	3,720,000
未払解約金	6,156,556,211
未払利息	3,354
その他未払費用	18,059
流動負債合計	6,160,297,624
負債合計	6,160,297,624
純資産の部	
元本等	
元本	241,526,030,821
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	99,677,928,023
元本等合計	341,203,958,844
純資産合計	341,203,958,844
負債純資産合計	347,364,256,468

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 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）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	241,526,030,821 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　106,815,000 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　1.4127 円
		(1 万口当たり純資産額)　(14,127 円)

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

（金融商品に関する注記）

1． 金融商品の状況に関する事項

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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コンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	244,054,448,526 円
期中追加設定元本額	24,438,753,869 円
期中一部解約元本額	26,967,171,574 円
期末元本額	241,526,030,821 円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240 円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,805,007,983 円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	24,343,668 円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	7,869,982,847 円
世界経済インデックスファンド	576,720,690 円
マイセレクション２５	69,981,553 円
マイセレクション５０	70,282,671 円
マイセレクション７５	20,521,848 円
ＤＣマイセレクション２５	13,926,072,599 円
ＤＣマイセレクション５０	15,860,864,288 円
ＤＣマイセレクション７５	4,402,510,775 円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	418,268,220 円

ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	62,301,312,018 円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	26,227,717,147 円
ＤＣマイセレクションＳ２５	5,590,695,022 円
ＤＣマイセレクションＳ５０	6,121,047,586 円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,157,112,601 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,197,470,770 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	702,292,148 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	184,819,003 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	692,225,316 円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,061,697,337 円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,057,049 円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	131,765,371 円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	22,130,096 円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	857,124 円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	515,903,680 円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	727,664,200 円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	150,001,237 円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	262,982,364 円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,389,422,132 円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,361,830,674 円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,998,405,966 円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,174,647,593 円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,862,685,557 円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,883,256,404 円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	1,580,141,003 円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,012,185,780 円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,791,305,990 円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	205,464,688 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,049,012,838 円
日本債券ファンド・シリーズ１	11,378,849,397 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	6,918,062,467 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,025,861,875 円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,042,080,651 円
分散投資コア戦略ファンドＳ	951,911,905 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	17,045,199 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	237,954,916 円
国内債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	27,144,922,596 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,111,426,146 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	53,746,906 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,940,286 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	72,320,132 円
債券コア戦略ファンド	489,206 円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	675,918,062 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）	3,446,608,001 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	17,098,048,800
地方債証券	516,803,546
特殊債券	555,336,015
社債券	187,889,120
合計	18,358,077,481

(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）

債券関連

（平成28年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,212,762,592	－	1,216,480,000	3,717,408
合計		1,212,762,592	－	1,216,480,000	3,717,408

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第３５３回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,606,624,000	
	第３５４回利付国債（２年）	550,000,000	552,442,000	
	第３５５回利付国債（２年）	2,710,000,000	2,722,872,500	
	第３５６回利付国債（２年）	1,090,000,000	1,095,580,800	
	第３５７回利付国債（２年）	740,000,000	744,018,200	
	第３６０回利付国債（２年）	600,000,000	603,864,000	
	第３６２回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,611,280,000	
	第１０５回利付国債（５年）	3,500,000,000	3,518,725,000	

	第１０６回利付国債（５年）	3,260,000,000	3,281,483,400	
	第１０７回利付国債（５年）	1,120,000,000	1,128,792,000	
	第１０８回利付国債（５年）	590,000,000	593,646,200	
	第１０９回利付国債（５年）	1,190,000,000	1,198,449,000	
	第１１０回利付国債（５年）	700,000,000	707,658,000	
	第１１１回利付国債（５年）	1,590,000,000	1,610,447,400	
	第１１２回利付国債（５年）	900,000,000	913,104,000	
	第１１３回利付国債（５年）	4,390,000,000	4,444,392,100	
	第１１４回利付国債（５年）	1,210,000,000	1,226,903,700	
	第１１５回利付国債（５年）	2,850,000,000	2,882,889,000	
	第１１６回利付国債（５年）	4,050,000,000	4,101,597,000	
	第１１７回利付国債（５年）	4,220,000,000	4,278,151,600	
	第１１８回利付国債（５年）	3,970,000,000	4,028,835,400	
	第１１９回利付国債（５年）	1,000,000,000	1,011,630,000	
	第１２０回利付国債（５年）	3,580,000,000	3,636,707,200	
	第１２１回利付国債（５年）	630,000,000	637,805,700	
	第１２２回利付国債（５年）	4,260,000,000	4,316,700,600	
	第１２３回利付国債（５年）	3,240,000,000	3,285,392,400	
	第１２４回利付国債（５年）	3,210,000,000	3,257,925,300	
	第１２５回利付国債（５年）	4,410,000,000	4,478,884,200	
	第１２６回利付国債（５年）	3,480,000,000	3,537,454,800	
	第１２７回利付国債（５年）	380,000,000	386,608,200	
	第１回利付国債（４０年）	150,000,000	245,305,500	
	第２回利付国債（４０年）	420,000,000	667,010,400	
	第３回利付国債（４０年）	420,000,000	673,906,800	
	第４回利付国債（４０年）	530,000,000	857,699,000	
	第５回利付国債（４０年）	490,000,000	766,242,400	
	第６回利付国債（４０年）	690,000,000	1,063,924,800	
	第７回利付国債（４０年）	970,000,000	1,437,132,600	
	第８回利付国債（４０年）	700,000,000	966,602,000	
	第２８６回利付国債（１０年）	870,000,000	890,880,000	
	第２８７回利付国債（１０年）	540,000,000	553,586,400	
	第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	2,148,122,900	
	第２８９回利付国債（１０年）	2,490,000,000	2,563,405,200	
	第２９０回利付国債（１０年）	470,000,000	485,063,500	
	第２９１回利付国債（１０年）	840,000,000	865,309,200	

	第２９２回利付国債（１０年）	1,110,000,000	1,151,969,100	
	第２９３回利付国債（１０年）	370,000,000	386,609,300	
	第２９４回利付国債（１０年）	180,000,000	187,689,600	
	第２９５回利付国債（１０年）	100,000,000	103,837,000	
	第２９６回利付国債（１０年）	2,100,000,000	2,190,300,000	
	第２９７回利付国債（１０年）	560,000,000	584,925,600	
	第２９８回利付国債（１０年）	1,660,000,000	1,729,437,800	
	第２９９回利付国債（１０年）	1,310,000,000	1,370,102,800	
	第３００回利付国債（１０年）	830,000,000	872,952,500	
	第３０１回利付国債（１０年）	640,000,000	675,904,000	
	第３０２回利付国債（１０年）	200,000,000	210,582,000	
	第３０３回利付国債（１０年）	1,390,000,000	1,469,216,100	
	第３０４回利付国債（１０年）	480,000,000	505,699,200	
	第３０５回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,284,178,400	
	第３０６回利付国債（１０年）	1,370,000,000	1,459,241,800	
	第３０７回利付国債（１０年）	700,000,000	742,833,000	
	第３０８回利付国債（１０年）	990,000,000	1,054,528,200	
	第３０９回利付国債（１０年）	1,780,000,000	1,881,050,600	
	第３１０回利付国債（１０年）	1,590,000,000	1,678,690,200	
	第３１１回利付国債（１０年）	610,000,000	638,584,600	
	第３１２回利付国債（１０年）	1,670,000,000	1,783,810,500	代用有価証券 100,000,000円
	第３１３回利付国債（１０年）	1,650,000,000	1,776,670,500	
	第３１４回利付国債（１０年）	910,000,000	970,815,300	
	第３１５回利付国債（１０年）	1,350,000,000	1,452,357,000	
	第３１６回利付国債（１０年）	1,090,000,000	1,166,943,100	
	第３１７回利付国債（１０年）	620,000,000	665,929,600	
	第３１８回利付国債（１０年）	1,010,000,000	1,079,275,900	
	第３１９回利付国債（１０年）	750,000,000	808,155,000	
	第３２０回利付国債（１０年）	1,220,000,000	1,307,596,000	
	第３２１回利付国債（１０年）	1,640,000,000	1,762,950,800	
	第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	801,727,500	
	第３２３回利付国債（１０年）	970,000,000	1,039,801,200	
	第３２４回利付国債（１０年）	2,020,000,000	2,152,714,000	
	第３２５回利付国債（１０年）	2,620,000,000	2,799,312,800	
	第３２６回利付国債（１０年）	600,000,000	638,622,000	

	第３２７回利付国債（１０年）	1,240,000,000	1,328,213,600	
	第３２８回利付国債（１０年）	1,720,000,000	1,822,787,200	
	第３２９回利付国債（１０年）	2,760,000,000	2,969,152,800	
	第３３０回利付国債（１０年）	1,640,000,000	1,767,395,200	
	第３３１回利付国債（１０年）	680,000,000	722,840,000	
	第３３２回利付国債（１０年）	2,830,000,000	3,012,025,600	
	第３３３回利付国債（１０年）	2,060,000,000	2,195,074,200	
	第３３４回利付国債（１０年）	2,600,000,000	2,774,876,000	
	第３３５回利付国債（１０年）	2,540,000,000	2,692,146,000	
	第３３６回利付国債（１０年）	990,000,000	1,050,162,300	
	第３３７回利付国債（１０年）	1,550,000,000	1,616,882,500	
	第３３８回利付国債（１０年）	2,860,000,000	3,010,178,600	
	第３３９回利付国債（１０年）	3,480,000,000	3,662,874,000	
	第３４０回利付国債（１０年）	3,040,000,000	3,201,150,400	
	第３４１回利付国債（１０年）	3,050,000,000	3,183,010,500	
	第３４２回利付国債（１０年）	1,470,000,000	1,504,692,000	
	第１回利付国債（３０年）	40,000,000	55,171,200	
	第２回利付国債（３０年）	160,000,000	213,412,800	
	第３回利付国債（３０年）	120,000,000	158,962,800	
	第４回利付国債（３０年）	110,000,000	156,170,300	
	第５回利付国債（３０年）	50,000,000	66,234,500	
	第６回利付国債（３０年）	190,000,000	258,829,400	
	第７回利付国債（３０年）	180,000,000	243,813,600	
	第８回利付国債（３０年）	50,000,000	63,972,500	
	第９回利付国債（３０年）	240,000,000	291,614,400	
	第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	186,449,600	
	第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	114,102,900	
	第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	254,385,300	
	第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	383,965,800	
	第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	419,187,000	
	第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	482,113,200	
	第１６回利付国債（３０年）	370,000,000	525,329,700	
	第１７回利付国債（３０年）	330,000,000	463,534,500	
	第１８回利付国債（３０年）	445,000,000	618,082,750	
	第１９回利付国債（３０年）	280,000,000	389,589,200	
	第２０回利付国債（３０年）	420,000,000	601,087,200	

	第２１回利付国債（３０年）	270,000,000	376,911,900	
	第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	574,500,000	
	第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	619,268,800	
	第２４回利付国債（３０年）	320,000,000	462,083,200	
	第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	492,908,500	
	第２６回利付国債（３０年）	730,000,000	1,046,024,300	
	第２７回利付国債（３０年）	680,000,000	995,023,600	
	第２８回利付国債（３０年）	530,000,000	780,133,500	
	第２９回利付国債（３０年）	940,000,000	1,370,397,800	
	第３０回利付国債（３０年）	610,000,000	880,962,000	
	第３１回利付国債（３０年）	800,000,000	1,145,056,000	
	第３２回利付国債（３０年）	990,000,000	1,447,875,000	
	第３３回利付国債（３０年）	920,000,000	1,288,966,000	
	第３４回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,690,421,600	
	第３５回利付国債（３０年）	1,180,000,000	1,671,434,600	
	第３６回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,708,920,000	
	第３７回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,630,194,400	
	第３８回利付国債（３０年）	790,000,000	1,095,967,000	
	第３９回利付国債（３０年）	1,020,000,000	1,444,381,200	
	第４０回利付国債（３０年）	530,000,000	738,862,400	
	第４１回利付国債（３０年）	580,000,000	794,513,000	
	第４２回利付国債（３０年）	670,000,000	919,856,400	
	第４３回利付国債（３０年）	1,020,000,000	1,405,417,200	
	第４４回利付国債（３０年）	720,000,000	994,320,000	
	第４５回利付国債（３０年）	680,000,000	903,713,200	
	第４６回利付国債（３０年）	750,000,000	998,715,000	
	第４７回利付国債（３０年）	820,000,000	1,116,331,600	
	第４８回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,726,454,400	
	第４９回利付国債（３０年）	630,000,000	825,507,900	
	第５０回利付国債（３０年）	240,000,000	273,686,400	
	第３６回利付国債（２０年）	70,000,000	73,237,500	
	第３７回利付国債（２０年）	70,000,000	73,336,900	
	第３８回利付国債（２０年）	20,000,000	21,138,000	
	第３９回利付国債（２０年）	500,000,000	527,490,000	
	第４０回利付国債（２０年）	100,000,000	106,218,000	
	第４１回利付国債（２０年）	330,000,000	347,024,700	

	第４２回利付国債（２０年）	80,000,000	86,707,200	
	第４３回利付国債（２０年）	140,000,000	155,156,400	
	第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	188,382,100	
	第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	320,215,100	
	第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	187,419,900	
	第４７回利付国債（２０年）	90,000,000	99,801,900	
	第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	146,806,400	
	第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	156,254,000	
	第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	243,355,200	
	第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	111,742,000	
	第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	124,159,200	
	第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	90,772,800	
	第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	228,080,000	
	第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	158,855,200	
	第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	171,066,000	
	第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	272,205,600	
	第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	341,817,000	
	第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	226,348,000	
	第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	388,997,000	
	第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	261,000,000	
	第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	344,124,800	
	第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	229,562,000	
	第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	371,126,400	
	第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	256,251,600	
	第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	381,806,700	
	第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	152,062,300	
	第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	226,829,600	
	第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	462,458,100	
	第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	486,288,000	
	第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	239,824,000	
	第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	753,354,000	
	第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	429,062,400	
	第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	240,128,000	
	第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	156,695,500	
	第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	320,560,200	
	第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	346,929,900	

	第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	202,560,100	
	第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	324,224,100	
	第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	266,228,600	
	第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	470,063,100	
	第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	728,904,000	
	第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	353,457,800	
	第８４回利付国債（２０年）	670,000,000	810,050,100	
	第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	354,565,600	
	第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	260,964,900	
	第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	677,963,000	
	第８８回利付国債（２０年）	550,000,000	686,565,000	
	第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	433,307,000	
	第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	783,304,200	
	第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	564,241,500	
	第９２回利付国債（２０年）	980,000,000	1,213,024,400	
	第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	504,964,200	
	第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	758,016,500	
	第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	774,376,700	
	第９６回利付国債（２０年）	420,000,000	523,706,400	
	第９７回利付国債（２０年）	590,000,000	745,376,500	
	第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	550,805,200	
	第９９回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,256,640,000	
	第１００回利付国債（２０年）	600,000,000	763,572,000	
	第１０１回利付国債（２０年）	385,000,000	499,202,550	
	第１０２回利付国債（２０年）	580,000,000	754,794,600	
	第１０３回利付国債（２０年）	360,000,000	464,083,200	
	第１０４回利付国債（２０年）	300,000,000	379,386,000	
	第１０５回利付国債（２０年）	670,000,000	849,935,200	
	第１０６回利付国債（２０年）	430,000,000	550,851,500	
	第１０７回利付国債（２０年）	150,000,000	190,975,500	
	第１０８回利付国債（２０年）	480,000,000	598,896,000	
	第１０９回利付国債（２０年）	340,000,000	425,316,200	
	第１１０回利付国債（２０年）	850,000,000	1,085,339,500	
	第１１１回利付国債（２０年）	330,000,000	426,957,300	
	第１１２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,126,928,000	
	第１１３回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,490,750,800	

	第１１４回利付国債（２０年）	590,000,000	760,321,200	
	第１１５回利付国債（２０年）	720,000,000	937,699,200	
	第１１６回利付国債（２０年）	550,000,000	718,800,500	
	第１１７回利付国債（２０年）	820,000,000	1,060,260,000	
	第１１８回利付国債（２０年）	850,000,000	1,090,745,500	
	第１１９回利付国債（２０年）	380,000,000	476,862,000	
	第１２０回利付国債（２０年）	330,000,000	404,771,400	
	第１２１回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,386,501,800	
	第１２２回利付国債（２０年）	280,000,000	352,136,400	
	第１２３回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,356,253,600	
	第１２４回利付国債（２０年）	280,000,000	361,051,600	
	第１２５回利付国債（２０年）	530,000,000	700,707,700	
	第１２６回利付国債（２０年）	430,000,000	555,736,300	
	第１２７回利付国債（２０年）	460,000,000	587,677,600	
	第１２８回利付国債（２０年）	770,000,000	985,831,000	
	第１２９回利付国債（２０年）	420,000,000	531,396,600	
	第１３０回利付国債（２０年）	630,000,000	798,632,100	
	第１３１回利付国債（２０年）	380,000,000	475,904,400	
	第１３２回利付国債（２０年）	730,000,000	916,478,500	
	第１３３回利付国債（２０年）	780,000,000	991,364,400	
	第１３４回利付国債（２０年）	420,000,000	535,164,000	
	第１３５回利付国債（２０年）	380,000,000	478,211,000	
	第１３６回利付国債（２０年）	610,000,000	758,040,900	
	第１３７回利付国債（２０年）	290,000,000	365,539,200	
	第１３８回利付国債（２０年）	390,000,000	479,122,800	
	第１３９回利付国債（２０年）	410,000,000	510,245,000	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,360,000,000	1,716,932,000	
	第１４１回利付国債（２０年）	360,000,000	455,151,600	
	第１４２回利付国債（２０年）	920,000,000	1,178,262,400	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,311,891,000	
	第１４４回利付国債（２０年）	590,000,000	727,346,100	
	第１４５回利付国債（２０年）	1,480,000,000	1,876,358,800	
	第１４６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,891,555,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,843,100,700	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,646,021,300	
	第１４９回利付国債（２０年）	1,510,000,000	1,870,391,700	

	第１５０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,916,499,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,409,162,300	
	第１５２回利付国債（２０年）	1,510,000,000	1,788,383,600	
	第１５３回利付国債（２０年）	1,520,000,000	1,828,544,800	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,440,000,000	1,705,910,400	
	第１５５回利付国債（２０年）	1,650,000,000	1,890,784,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	290,000,000	297,966,300	
	第１８回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,849,000	
	第１４回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,440,000	
国債証券合計		241,610,000,000	274,435,295,900	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	117,693,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	117,559,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	140,490,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	138,475,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	125,058,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	126,224,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	249,006,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	247,558,000	
	第６９５回東京都公募公債	100,000,000	105,816,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	106,086,000	
	第７００回東京都公募公債	100,000,000	105,461,000	
	第７０２回東京都公募公債	200,000,000	211,608,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	105,032,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	104,211,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	106,014,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	104,702,000	
	平成１９年度第９回北海道公募公債	110,000,000	112,926,000	
	平成２０年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	104,807,000	
	平成２２年度第１１回北海道公募公債	100,000,000	105,910,000	
	平成２３年度第６回北海道公募公債	200,000,000	210,944,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	104,948,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	144,165,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	127,659,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	123,970,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	119,598,000	
	第１５０回神奈川県公募公債	100,000,000	102,760,000	

	第１７２回神奈川県公募公債	200,000,000	210,326,000	
	第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	206,830,000	
	第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	248,190,000	
	第９１回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	100,185,000	
	第３０７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,703,000	
	第３１１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,991,000	
	第３２２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,283,000	
	第３４５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,336,000	
	第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,524,000	
	第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,172,000	
	第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,708,000	
	第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,679,000	
	第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,943,000	
	平成２２年度第２回京都府公募公債	100,000,000	105,001,000	
	平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	124,176,000	
	平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	105,502,000	
	第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	108,511,000	
	第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	104,283,000	
	第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	112,086,000	
	平成１９年度第９回兵庫県公募公債	100,000,000	102,660,000	
	平成２２年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	105,528,000	
	平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	105,431,000	
	第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	127,644,000	
	平成１９年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	102,282,000	
	平成２０年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	103,875,000	
	平成２１年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	105,390,000	
	平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	109,428,524	
	平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	105,448,000	
	平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	104,474,000	
	平成２０年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	104,406,000	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	127,756,000	
	平成２２年度第３回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	210,978,000	
	平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,822,000	

	平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,047,000	
	平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	105,439,000	
	平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	104,215,000	
	平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	105,000,000	
	平成１９年度第２回広島県公募公債	200,000,000	205,206,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	127,248,000	
	平成２２年度第１回広島県公募公債	100,000,000	105,597,000	
	平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	105,111,000	
	平成２０年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	103,871,000	
	平成２０年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	104,082,000	
	平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	105,867,000	
	平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	204,738,260	
	平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	106,093,000	
	平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	105,511,000	
	平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	104,820,000	
	平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	124,324,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	127,142,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	211,914,000	
	平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	139,592,000	
	第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	124,075,000	
	平成２１年度第１２回千葉県公募公債	100,000,000	105,465,000	
	平成２２年度第８回千葉県公募公債	120,000,000	125,350,800	
	平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	105,901,000	
	平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	104,467,000	
	第５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,393,000	
	第５５回共同発行市場公募地方債	158,400,000	162,828,864	
	第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,723,000	
	第６２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,626,000	
	第６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,734,000	
	第７７回共同発行市場公募地方債	110,000,000	115,584,700	
	第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,735,000	
	第８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,712,000	

	第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,304,000	
	第８９回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,961,296	
	第９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,944,000	
	第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,733,000	
	第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,762,000	
	第９５回共同発行市場公募地方債	250,000,000	265,142,500	
	第９７回共同発行市場公募地方債	356,000,000	380,126,120	
	第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,850,000	
	第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,173,500	
	第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,799,000	
	第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,122,000	
	第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,200,000	
	第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,062,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,598,000	
	第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,526,000	
	第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,715,000	
	第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,794,000	
	第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,774,000	
	第１３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,574,000	
	第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,697,000	
	第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,658,000	
	第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,372,000	
	第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,939,000	
	第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,386,000	
	第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,006,000	
	平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	210,018,000	
	平成２２年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	104,496,000	
	第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	252,410,000	
	平成１９年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	102,546,000	
	平成２２年度第５回大阪市公募公債	100,000,000	105,086,000	
	第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	142,839,000	
	第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	124,496,000	
	第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	132,738,000	
	第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	104,685,000	
	平成２２年度第２回京都市公募公債	102,000,000	106,720,560	

	平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	105,783,000	
	平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	104,903,000	
	平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	105,472,000	
	平成２４年度第６回京都市公募公債	100,000,000	100,207,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	119,450,000	
	第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	125,966,000	
	平成２１年度第１回横浜市公募公債	200,000,000	209,578,000	
	平成２１年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	105,476,000	
	平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	105,563,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	105,092,000	
	平成２５年度第２回札幌市公募公債（５年）	100,000,000	100,639,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	103,234,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	123,625,000	
	第８１回川崎市公募公債	100,000,000	104,546,000	
	第８２回川崎市公募公債	100,000,000	105,143,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	103,420,000	
	平成１９年度第３回福岡市公募公債	100,000,000	102,825,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	208,386,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	106,022,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	157,390,500	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	211,514,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	125,845,000	
地方債証券合計		17,552,990,000	19,138,976,624	
特殊債券	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,412,000	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,574,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	115,684,000	
	第４４回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,775,000	
	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	109,229,000	
	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	218,762,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	112,626,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	110,161,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	139,872,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	126,136,000	

	券			
	第３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	322,015,050	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	160,480,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,901,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	118,945,000	
	第４４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,280,000	
	第４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,854,000	
	第４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,547,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,171,000	
	第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,970,000	
	第５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,700,000	
	第５４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	30,813,300	
	第５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	114,130,200	
	第６０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,953,000	
	第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	188,024,610	
	第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,778,000	
	第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,780,000	
	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	157,038,000	
	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	252,714,000	
	第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,161,000	
	第９８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,805,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,834,000	
	第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,065,000	
	第１０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,394,040	
	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	140,834,000	
	第１１０回政府保証日本高速道路保有・債務	100,000,000	105,467,000	

	返済機構債券			
	第１１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,382,000	
	第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,201,000	
	第１１７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,920,000	
	第１２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,328,000	
	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	211,290,000	
	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	128,121,000	
	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	105,745,000	
	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	106,542,000	
	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	105,823,000	
	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	316,638,000	
	第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	140,208,000	
	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	316,844,640	
	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	211,022,000	
	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	105,511,000	
	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	105,064,000	
	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	314,637,000	
	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	123,586,000	
	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	105,622,000	
	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	316,665,000	
	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	209,154,000	
	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	207,530,000	
	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	312,813,000	
	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	212,628,000	
	第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,036,000	

	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	242,310,000	
	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	105,186,000	
	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	104,888,000	
	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	104,508,000	
	第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,957,000	
	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	308,160,000	
	第１回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	210,073,940	
	第１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,740,000	
	第１回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,293,000	
	第２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,536,000	
	第２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,562,000	
	第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	333,672,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	110,000,000	117,717,600	
	第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	112,167,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	117,005,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	141,152,000	
	第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	126,886,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	46,959,600	
	第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,446,000	
	第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,560,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,698,000	
	第１５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,434,000	
	第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,188,470	
	第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,606,000	
	第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,437,740	
	第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,568,030	
	第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,040,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	122,280,000	
	第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,235,000	
	第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,850,000	
	第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,191,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,531,000	

	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,754,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,245,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,075,000	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,166,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,446,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,878,000	
	第８７５回政府保証公営企業債券	212,000,000	215,924,120	
	第８７６回政府保証公営企業債券	122,000,000	124,716,940	
	第５回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,177,600	
	第１１回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	301,377,000	
	第５回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,493,490	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	127,762,000	
	第４３回都市再生債券	100,000,000	105,626,000	
	第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	118,607,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	110,913,000	
	第３４６回東京交通債券	20,000,000	21,513,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,263,000	29,248,564	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	23,149,000	24,915,731	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	23,756,000	25,776,922	
	第３回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,108,000	
	第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,446,000	30,770,322	
	第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	25,327,000	27,249,319	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	20,303,000	21,470,422	
	第５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,685,000	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	42,532,000	45,885,222	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	24,986,000	26,701,039	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	22,326,000	24,049,343	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	26,363,000	28,159,111	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	21,961,000	23,677,032	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	26,647,000	28,279,928	
	第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	31,878,000	33,275,850	
	第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	32,149,000	33,494,435	

	第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,717,000	41,262,775	
	第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,113,000	42,934,340	
	第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,865,000	43,687,654	
	第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,386,000	49,235,186	
	第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,372,000	52,392,196	
	第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,556,000	53,496,197	
	第３３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,725,000	
	第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,788,000	112,842,005	
	第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,911,000	28,651,603	
	第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,930,000	62,129,345	
	第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,834,000	28,525,347	
	第４１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,464,000	
	第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,136,000	29,498,731	
	第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,940,000	73,442,460	
	第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,981,000	27,101,137	
	第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,275,000	74,012,831	
	第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,124,000	71,729,992	
	第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,595,000	30,024,463	
	第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,404,000	141,043,797	
	第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,548,000	75,882,839	
	第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,525,000	29,712,687	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,307,000	83,684,341	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,011,000	82,309,356	
	第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,507,000	82,914,663	
	第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,546,000	
	第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,534,000	167,756,381	
	第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,132,000	
	第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,262,000	
	第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,316,000	173,074,042	
	第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,698,000	88,036,904	
	第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,004,000	89,263,490	
	第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,632,000	90,080,608	
	第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,555,000	87,641,213	
	第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,858,000	87,196,444	
	第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,463,000	91,238,589	
	第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	189,771,000	

	第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,635,000	90,158,240	
	第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,711,000	94,270,113	
	第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,021,000	95,733,157	
	第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,999,000	96,431,511	
	第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,915,000	
	第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,518,000	195,493,246	
	第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,202,000	97,194,773	
	第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,754,000	195,230,149	
	第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,509,000	99,240,536	
	第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,895,000	99,286,806	
	第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,120,000	100,143,583	
	第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,534,000	203,503,962	
	第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,293,000	101,493,138	
	第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,950,000	103,362,180	
	第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,530,000	
	第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	136,018,000	
	第１４６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,498,000	
	第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	122,901,000	
	第１１回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,261,000	
	い第７５０号商工債	100,000,000	100,479,000	
	い第７５２号商工債	200,000,000	201,058,000	
	い第７５６号商工債	100,000,000	100,610,000	
	い第７７９号商工債	100,000,000	100,803,000	
	い第７４６号農林債	100,000,000	100,433,000	
	い第７４８号農林債	100,000,000	100,487,000	
	い第７４９号農林債	300,000,000	301,314,000	
	い第７５２号農林債	200,000,000	201,018,000	
	い第７８０号農林債	100,000,000	101,023,000	
	第２７４回信金中金債（５年）	100,000,000	100,437,000	
	第２９０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,803,000	
	第２９９回信金中金債（５年）	100,000,000	100,632,000	
	第３００回信金中金債（５年）	300,000,000	302,214,000	
	第３０３回信金中金債（５年）	100,000,000	100,886,000	
	第３０９回信金中金債（５年）	100,000,000	101,002,000	
	第１７５号商工債（３年）	100,000,000	100,207,000	

	第１７８号商工債（３年）	300,000,000	300,717,000	
	第１７９号商工債（３年）	200,000,000	200,458,000	
	第１９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,549,000	
	第２０回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,479,000	
	第２８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,488,000	
	第３３回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	211,672,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,693,000	
	第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	210,464,000	
特殊債券合計		23,944,112,000	25,748,746,620	
社債券	第２回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,178,000	
	第６回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,124,000	
	第１１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,394,000	
	第４回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンＡＢ円貨社債	100,000,000	100,392,000	
	第６回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンＡＢ円貨社債	100,000,000	99,951,000	
	第９回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,654,000	
	第６回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,611,000	
	第９回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,831,000	
	第１１回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,449,000	
	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	100,000,000	100,459,000	
	第９回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	100,665,000	
	第２７回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,126,000	
	第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,385,000	
	第５回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,552,000	
	第３回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,168,000	
	第７回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,495,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,787,000	
	第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	105,264,000	
	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	103,510,000	
	第３回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	104,176,000	

	第１２回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,832,000	
	第４８回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,266,000	
	第８回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,524,000	
	第１４回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,478,000	
	第１回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,515,000	
	第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,657,000	
	第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,882,000	
	第５回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,456,000	
	第１３回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,458,000	
	第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,829,000	
	第２８回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,694,000	
	第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,873,000	
	第９回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,472,000	
	第３６回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	203,322,000	
	第１１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,909,000	
	第１２回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,079,000	
	第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,386,000	
	第２４回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,971,000	
	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,718,000	
	第３７回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,119,000	
	第１回日本生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,624,000	
	第１回Ｂ号明治安田生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,835,000	
	第５７回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,730,000	
	第１２回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,417,000	
	第８回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	101,099,000	
	第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	105,348,000	
	第５３回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,826,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,575,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	123,480,000	
	第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,084,000	
	第７４回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,309,000	
	第７６回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,278,000	

	第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,054,000	
	第３０回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,419,000	
	第３２回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,908,000	
	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	131,705,000	
	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	105,261,000	
	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	107,547,000	
	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	103,295,000	
	第６回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,217,000	
	第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,706,000	
	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）	100,000,000	103,707,000	
	第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,826,000	
	第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,598,000	
	第３回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,771,000	
	第１０回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	206,660,000	
	第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,069,000	
	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	101,557,000	
	第６７回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,361,000	
	第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	106,149,000	
	第１３８回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,198,000	
	第１６７回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,723,000	
	第１９回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,043,000	
	第３９回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,427,000	
	第４０回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,333,000	
	第４３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,027,000	
	第４４回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,681,000	
	第３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,487,000	
	第８４回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,605,000	

	第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,215,000	
	第１１回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,510,000	
	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	105,971,000	
	第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,482,000	
	第３６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,902,000	
	第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,659,000	
	第３０回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,987,000	
	第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,917,000	
	第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,576,000	
	第５６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,454,000	
	第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	253,536,000	
	第８１回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,975,000	
	第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,523,200	
	第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	126,199,000	
	第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,615,800	
	第１６回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,283,000	
	第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	137,805,000	
	第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	132,768,000	
	第９回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,476,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	208,890,000	
	第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	104,930,000	
	第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	104,889,000	
	第４５５回東京電力株式会社社債	120,000,000	125,211,600	
	第４５９回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,637,800	
	第５２１回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,304,000	
	第５２８回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,597,000	
	第５３６回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,372,000	
	第５４２回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,544,000	
	第５４４回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,564,000	
	第５５４回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,627,000	
	第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,962,000	
	第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,782,000	

	第４７３回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,482,000	
	第４９６回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,076,000	
	第３５８回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,189,000	
	第３６２回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,812,000	
	第３７１回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,640,000	
	第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,044,000	
	第２８６回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,059,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,667,000	
	第４６６回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,360,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	226,000,000	241,180,420	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,590,000	
	第２７６回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,812,000	
	第２７９回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,022,000	
	第４１７回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,775,000	
	第４２０回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,457,000	
	第４２３回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,745,000	
	第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,291,000	
	第２６１回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,317,190	
	第３２０回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,980,610	
	第３０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,260,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,259,000	
	第９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,099,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	106,190,000	
	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	102,264,000	
社債券合計		14,027,000,000	14,662,285,620	
合計			333,985,304,764	

(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

注記事項(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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,087,134,340
金銭信託	129,235,557
コール・ローン	96,278,405
株式	243,207,851,974
投資信託受益証券	273,974,770
投資証券	6,547,883,552
派生商品評価勘定	350,446,972
未収入金	2,593,225
未収配当金	374,563,269
差入委託証拠金	2,236,998,059
流動資産合計	261,306,960,123
資産合計	261,306,960,123
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	290,890
前受金	350,425,132
未払解約金	330,159,404
未払利息	280
その他未払費用	721
流動負債合計	680,876,427
負債合計	680,876,427
純資産の部	
元本等	
元本	139,159,347,379
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	121,466,736,317
元本等合計	260,626,083,696
純資産合計	260,626,083,696
負債純資産合計	261,306,960,123

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		139,159,347,379 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	1.8729 円
	(1 万口当たり純資産額)	(18,729 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	131,515,069,003 円
期中追加設定元本額	14,811,675,851 円
期中一部解約元本額	7,167,397,475 円
期末元本額	139,159,347,379 円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,353,442,747 円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	19,605,368 円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,522,056,545 円
世界経済インデックスファンド	2,703,537,047 円
マイセレクション２５	4,768,378 円
マイセレクション５０	20,270,677 円
マイセレクション７５	22,356,911 円
外国株式インデックス・オープン	1,111,745,461 円
ＤＣマイセレクション２５	883,009,689 円
ＤＣマイセレクション５０	4,683,517,982 円
ＤＣマイセレクション７５	4,908,435,445 円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	6,502,360,323 円
ＤＣマイセレクションＳ２５	381,096,265 円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,794,332,051 円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,311,343,300 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	154,891,067 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	175,772,015 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	92,101,922 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,477,582,496 円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,874,670,018 円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,613,796 円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	24,761,313 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）	132,267,250 円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	198,733,504 円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	669,204,409 円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	116,968,175 円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	703,242,009 円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,509,033,748 円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	716,708,734 円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,573,317,662 円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,596,263,861 円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,866,103,209 円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	703,349,808 円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	679,549,530 円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	207,337,762 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,738,050,203 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）	3,697,227,059 円

外国株式ファンド・シリーズ１	961,019,680 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,873,294,111 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,051,733,122 円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,322,416,751 円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,145,067,176 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	200,094,354 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	294,415,770 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,115,097,700 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	641,028,392 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,445,869 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	266,486,384 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,997,974,682 円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	29,432,928,346 円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,648,717,303 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成 28 年 4 月 20 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△9,112,552,181
投資信託受益証券	△12,315,647
投資証券	367,065,064
合計	△8,757,802,764

(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

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,213,324,606	－	10,563,749,738	350,425,132
合計		10,213,324,606	－	10,563,749,738	350,425,132

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	129,735,250	－	130,004,300	△269,050
	アメリカドル	87,296,000	－	87,352,000	△56,000
	カナダドル	12,823,050	－	12,898,500	△75,450
	ユーロ	16,042,520	－	16,127,800	△85,280
	スイスフラン	13,573,680	－	13,626,000	△52,320
合計		129,735,250	－	130,004,300	△269,050

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,467	50.53	1,994,267.51	
	ANTERO RESOURCES CORP	6,631	27.91	185,071.21	

	APACHE CORP	27,976	55.02	1,539,239.52	
	BAKER HUGHES	33,793	46.50	1,571,374.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	36,248	23.48	851,103.04	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	37.12	582,449.92	
	CHEVRON CORP	144,279	100.50	14,500,039.50	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	108.00	820,692.00	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	29,491	25.37	748,186.67	
	CONCHO RESOURCES INC	9,489	110.03	1,044,074.67	
	CONOCOPHILLIPS	93,644	47.06	4,406,886.64	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	36.68	229,800.20	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	116.87	391,047.02	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,356	33.62	1,222,288.72	
	EOG RESOURCES INC	41,704	79.13	3,300,037.52	
	EQT CORPORATION	12,200	68.80	839,360.00	
	EXXON MOBIL	318,846	86.21	27,487,713.66	
	FMC TECHNOLOGIES INC	17,553	29.52	518,164.56	
	HALLIBURTON CO	65,159	40.04	2,608,966.36	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	63.06	524,343.90	
	HESS CORP	22,044	61.17	1,348,431.48	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,448	34.83	433,563.84	
	KINDER MORGAN INC	146,385	19.16	2,804,736.60	
	MARATHON OIL CORP	47,335	13.95	660,323.25	
	MARATHON PETROLEUM CORP	41,706	38.33	1,598,590.98	
	MURPHY OIL CORP	11,085	30.47	337,759.95	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,272	29.22	826,107.84	
	NOBLE ENERGY INC	31,899	34.34	1,095,411.66	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,859	74.86	4,406,184.74	
	OCEANEERING INTL INC	7,126	34.07	242,782.82	
	ONEOK INC	15,568	34.39	535,383.52	
	PHILLIPS 66	40,738	86.42	3,520,577.96	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	12,289	152.17	1,870,017.13	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17,636	9.16	161,545.76	
	RANGE RESOURCES CORP	12,769	38.28	488,797.32	
	SCHLUMBERGER	106,959	79.64	8,518,214.76	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,105	10.63	309,386.15	
	SPECTRA ENERGY CORP	49,756	30.79	1,531,987.24	

	TESORO CORP	9,230	83.44	770,151.20	
	VALERO ENERGY CORP	36,681	60.11	2,204,894.91	
	WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	8.02	424,153.74	
	WILLIAMS COS	56,360	18.01	1,015,043.60	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	15,659	149.20	2,336,322.80	
	AIRGAS INC	5,138	141.75	728,311.50	
	ALBEMARLE CORP	8,689	65.34	567,739.26	
	ALCOA	103,592	10.53	1,090,823.76	
	ASHLAND INC	4,845	114.56	555,043.20	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	73.39	547,269.23	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,076	30.33	335,935.08	
	BALL CORP	9,343	74.99	700,631.57	
	CELANESE CORP-SERIES A	11,407	69.74	795,524.18	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	33.70	583,245.90	
	CROWN HOLDINGS INC	10,494	52.03	546,002.82	
	DOW CHEMICAL CO	86,706	53.05	4,599,753.30	
	DU PONT (E.I) DE NEMOURS	66,918	65.68	4,395,174.24	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	76.70	909,508.60	
	ECOLAB INC	20,412	116.04	2,368,608.48	
	FMC CORP	10,402	41.81	434,907.62	
	FREEPORT-MCMORAN INC	92,169	12.01	1,106,949.69	
	INT'L PAPER CO	30,554	42.92	1,311,377.68	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	122.28	737,103.84	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	91.10	2,650,190.10	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,255	167.60	713,138.00	
	MONSANTO CO	33,726	93.27	3,145,624.02	
	MOSAIC CO/THE	23,240	28.22	655,832.80	
	NEWMONT MINING CORP	39,440	30.91	1,219,090.40	
	NUCOR CORP	24,843	50.46	1,253,577.78	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	63.09	434,500.83	
	PPG INDUSTRIES INC	20,895	116.55	2,435,312.25	
	PRAXAIR INC	21,962	118.82	2,609,524.84	
	SEALED AIR CORP	14,781	50.80	750,874.80	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,175	298.30	1,842,002.50	
	VULCAN MATERIALS CO	10,471	107.81	1,128,878.51	
	WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	49.33	160,815.80	

	WESTROCK CO	18,286	39.79	727,599.94	
	WR GRACE & CO	5,635	77.22	435,134.70	
	3 M COMPANY	47,051	169.65	7,982,202.15	
	ACUITY BRANDS INC	3,505	259.54	909,687.70	
	AERCAP HOLDINGS NV	6,824	40.50	276,372.00	
	AGCO CORP	5,969	52.26	311,939.94	
	AMETEK INC	18,866	50.99	961,977.34	
	B/E AEROSPACE INC	8,805	48.79	429,595.95	
	BOEING CO	48,689	132.68	6,460,056.52	
	CATERPILLAR	44,993	80.39	3,616,987.27	
	CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	36.41	238,048.58	
	CUMMINS INC	13,051	117.75	1,536,755.25	
	DANAHER CORP	47,545	94.83	4,508,692.35	
	DEERE&CO	24,214	82.36	1,994,265.04	
	DOVER CORP	11,832	67.97	804,221.04	
	EATON CORP	35,858	62.77	2,250,806.66	
	EMERSON ELECTRIC CO	50,628	55.65	2,817,448.20	
	FASTENAL CO	21,728	45.74	993,838.72	
	FLOWSERVE CORP	10,826	46.02	498,212.52	
	FLUOR CORP	10,027	53.60	537,447.20	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	58.37	747,719.70	
	GENERAL DYNAMICS CORP	20,489	136.69	2,800,641.41	
	GENERAL ELECTRIC CO	722,989	31.15	22,521,107.35	
	GRAINGER (WW) INC	4,203	230.26	967,782.78	
	HONEYWELL INTL INC	55,783	115.80	6,459,671.40	
	ILLINOIS TOOL WORKS	25,212	105.67	2,664,152.04	
	INGERSOLL-RAND PLC	19,750	63.88	1,261,630.00	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	42.96	416,411.28	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,600	58.49	1,146,404.00	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	123.21	753,675.57	
	LOCKHEED MARTIN CORP	21,047	226.51	4,767,355.97	
	MASCO CORP	25,921	32.40	839,840.40	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	13,203	201.59	2,661,592.77	
	PACCAR INC	26,289	56.12	1,475,338.68	
	PARKER HANNIFIN CORP	10,107	114.05	1,152,703.35	
	PENTAIR PLC	13,583	56.26	764,179.58	

	QUANTA SERVICES INC	14,015	22.89	320,803.35	
	RAYTHEON COMPANY	23,077	126.26	2,913,702.02	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	10,366	116.19	1,204,425.54	
	ROCKWELL COLLIN	10,382	93.69	972,689.58	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	7,442	179.75	1,337,699.50	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,018	38.72	465,336.96	
	SNAP-ON INC	4,317	161.60	697,627.20	
	STANLEY BLACK&DECKER	11,781	109.06	1,284,835.86	
	TEXTRON	21,877	38.05	832,419.85	
	TRANSDIGM GROUP INC	4,129	227.05	937,489.45	
	UNITED RENTALS INC	7,302	61.15	446,517.30	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,776	105.00	6,801,480.00	
	WABCO HOLDINGS INC	3,875	111.65	432,643.75	
	WABTEC CORP	7,158	81.54	583,663.32	
	XYLEM INC	13,941	42.71	595,420.11	
	ADT CORPORATION	13,448	41.78	561,857.44	
	CINTAS CORP	7,407	90.47	670,111.29	
	DUN & BRADSTREET CORP	2,440	108.65	265,106.00	
	EQUIFAX INC	8,759	116.41	1,019,635.19	
	IHS INC-CLASS A	5,122	123.73	633,745.06	
	MANPOWER GROUP	5,272	84.10	443,375.20	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,015	53.96	1,403,769.40	
	REPUBLIC SERVICES INC	18,168	46.45	843,903.60	
	ROBERT HALF INTL INC	9,340	45.12	421,420.80	
	STERICYCLE INC	6,767	125.37	848,378.79	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,433	36.73	1,154,534.09	
	VERISK ANALYTICS INC	12,693	78.60	997,669.80	
	WASTE CONNECTIONS INC	9,606	64.61	620,643.66	
	WASTE MANAGEMENT INC	34,711	57.13	1,983,039.43	
	AMERCO	602	353.48	212,794.96	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	41.34	509,970.24	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	75.23	861,233.04	
	CSX CORP	75,690	26.41	1,998,972.90	
	DELTA AIR LINES INC	15,095	46.87	707,502.65	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	49.82	705,152.28	
	FEDEX CORP	20,425	168.27	3,436,914.75	

	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,229	8.92	269,642.68	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	88.46	631,073.64	
	KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	96.02	839,502.86	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	23,257	82.77	1,924,981.89	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	47.13	622,775.82	
	UNION PACIFIC CORP	65,139	82.24	5,357,031.36	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,417	58.05	430,556.85	
	UNITED PARCEL SERVICE B	53,602	106.84	5,726,837.68	
	AUTOLIV INC	6,636	115.69	767,718.84	
	BORGWARNER INC	15,914	38.51	612,848.14	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	76.77	1,608,638.58	
	FORD MOTOR COMPANY	285,968	13.44	3,843,409.92	
	GENERAL MOTORS CO	108,227	31.97	3,460,017.19	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	32.15	695,308.05	
	HARLEY-DAVIDSON	14,677	45.78	671,913.06	
	JOHNSON CONTROLS INC	50,189	39.20	1,967,408.80	
	LEAR CORP	5,323	112.11	596,761.53	
	TESLA MOTORS INC	7,680	247.37	1,899,801.60	
	COACH INC	22,032	40.07	882,822.24	
	DR HORTON INC	24,329	31.28	761,011.12	
	GARMIN LTD	9,564	42.60	407,426.40	
	HANESBRANDS INC	31,136	28.28	880,526.08	
	HARMAN INTL INDS INC	5,462	84.62	462,194.44	
	HASBRO INC	9,007	87.02	783,789.14	
	LEGGETT & PLATT INC	10,594	47.50	503,215.00	
	LENNAR CORP-CL A	14,466	47.32	684,531.12	
	LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	66.48	563,218.56	
	MATTEL INC	25,250	33.91	856,227.50	
	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	51.98	723,561.60	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	4,739	197.89	937,800.71	
	NEWELL BRANDS INC	33,936	44.87	1,522,708.32	
	NIKE B	104,197	59.56	6,205,973.32	
	POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	94.38	442,736.58	
	PULTE GROUP INC	24,602	18.66	459,073.32	
	PVH CORP	5,867	95.25	558,831.75	
	RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	94.81	434,040.18	

	TOLL BROTHERS INC	14,067	29.38	413,288.46	
	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,365	43.95	587,391.75	
	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	13,365	43.00	574,695.00	
	VF CORP	26,289	64.40	1,693,011.60	
	WHIRLPOOL CORP	6,165	190.15	1,172,274.75	
	ARAMARK	17,044	34.06	580,518.64	
	BLOCK H & R INC	16,984	24.00	407,616.00	
	CARNIVAL CORPORATION	30,652	50.60	1,550,991.20	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,441	455.18	1,111,094.38	
	DARDEN RESTAURANTS INC	8,439	63.19	533,260.41	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,245	22.31	875,555.95	
	LAS VEGAS SANDS CORP	29,549	52.50	1,551,322.50	
	MARRIOTT INTL A	15,364	67.81	1,041,832.84	
	MCDONALD'S CORP	70,193	128.86	9,045,069.98	
	MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	8,400	16.69	140,196.00	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	23.03	832,396.32	
	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12,935	51.50	666,152.50	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,092	79.19	1,036,755.48	
	STARBUCKS CORP	114,061	60.90	6,946,314.90	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,530	80.25	1,005,532.50	
	WYMDHAM WORLDWIDE CORP	9,314	77.29	719,879.06	
	WYNN RESORTS LTD	6,619	99.99	661,833.81	
	YUM BRANDS INC	32,844	82.13	2,697,477.72	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,565	33.56	522,361.40	
	CBS CORP-CL B	33,884	54.96	1,862,264.64	
	CHARTER COMMUNICATION-A	6,584	204.63	1,347,283.92	
	COMCAST CORP-CL A	190,391	62.28	11,857,551.48	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	28.34	362,865.36	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,923	27.68	579,148.64	
	DISH NETWORK CORPORATION-A	16,789	47.32	794,455.48	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	23.41	720,349.11	
	LIBERTY BRAVES GROUP-A	638	18.05	11,515.90	
	LIBERTY BRAVES GROUP-C	1,523	17.50	26,652.50	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	20,119	38.75	779,611.25	
	LIBERTY GLOBAL PLC-C	44,688	37.95	1,695,909.60	
	LIBERTY MEDIA GROUP-A	1,596	19.03	30,371.88	

	LIBERTY MEDIA GROUP-C	3,808	18.02	68,620.16	
	LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	32.07	488,522.31	
	LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	32.53	207,671.52	
	NEWS CORP-CLASS A	27,721	12.54	347,621.34	
	OMNICOM GROUP	18,024	84.74	1,527,353.76	
	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	63.75	405,195.00	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.92	651,616.72	
	TEGNA INC	15,014	24.30	364,840.20	
	THE WALT DISNEY CO	120,395	102.64	12,357,342.80	
	TIME WARNER CABLE-A	21,424	205.93	4,411,844.32	
	TIME WARNER INC	61,347	74.84	4,591,209.48	
	TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	89,479	30.30	2,711,213.70	
	TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	34,104	30.04	1,024,484.16	
	VIACOM INC-CLASS B	27,473	35.64	979,137.72	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,791	160.79	931,134.89	
	AMAZON.COM	30,530	627.90	19,169,787.00	
	AUTONATION INC	5,015	48.23	241,873.45	
	AUTOZONE INC	2,362	777.43	1,836,289.66	
	BED BATH & BEYOND INC	12,615	48.02	605,772.30	
	BEST BUY COMPANY INC	22,277	32.90	732,913.30	
	CARMAX INC	14,601	54.33	793,272.33	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	47.03	298,358.32	
	DOLLAR GENERAL CORP	22,550	83.49	1,882,699.50	
	DOLLAR TREE INC	16,574	82.72	1,371,001.28	
	EXPEDIA INC	9,436	107.56	1,014,936.16	
	FOOT LOCKER INC	10,566	61.76	652,556.16	
	GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	32.45	243,082.95	
	GAP	17,852	23.96	427,733.92	
	GENUINE PARTS CO	11,752	96.88	1,138,533.76	
	HOME DEPOT	97,262	135.44	13,173,165.28	
	KOHLS CORP	14,309	44.85	641,758.65	
	L BRANDS INC	19,081	79.33	1,513,695.73	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	26.32	923,068.72	
	LKQ CORP	22,518	33.35	750,975.30	
	LOWES COMPANIES	69,927	76.41	5,343,122.07	
	MACY'S INC	23,893	41.15	983,196.95	

	NETFLIX INC	30,698	94.34	2,896,049.32	
	NORDSTROM INC	10,094	52.51	530,035.94	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,660	274.31	2,101,214.60	
	PRICELINE GROUP INC/THE	3,811	1,345.78	5,128,767.58	
	ROSS STORES INC	31,869	57.53	1,833,423.57	
	SIGNET JEWELERS LTD	5,419	111.89	606,331.91	
	STAPLES INC	47,470	11.03	523,594.10	
	TARGET (DAYTON HUDSON)	44,608	83.98	3,746,179.84	
	TIFFANY & CO	10,306	71.76	739,558.56	
	TJX COMPANIES INC	50,930	77.72	3,958,279.60	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	89.63	897,285.93	
	TRIPADVISOR INC	8,771	64.54	566,080.34	
	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,504	204.04	918,996.16	
	COSTCO WHOLESALE CORP	33,669	153.68	5,174,251.92	
	CVS HEALTH CORP	85,017	103.46	8,795,858.82	
	KROGER CO	70,675	36.23	2,560,555.25	
	RITE AID CORP	83,480	8.04	671,179.20	
	SYSCO CORP	43,181	46.98	2,028,643.38	
	WAL-MART STORES	123,062	69.77	8,586,035.74	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,012	81.84	5,484,262.08	
	WHOLE FOODS MKT INC	25,128	30.23	759,619.44	
	ALTRIA GROUP INC	150,416	61.71	9,282,171.36	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,789	38.23	1,712,283.47	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,415	96.61	812,973.15	
	BUNGE LIMITED	10,583	59.19	626,407.77	
	CAMPBELL SOUP CO (US)	14,708	61.82	909,248.56	
	COCA-COLA CO	316,666	46.60	14,756,635.60	
	COCA-COLA ENTERPRISES	17,076	53.78	918,347.28	
	CONAGRA	33,882	45.29	1,534,515.78	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,151	157.30	2,068,652.30	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,184	89.59	1,270,744.56	
	GENERAL MILLS INC	45,482	62.38	2,837,167.16	
	HERSHEY FOODS CORPORATION	11,601	94.56	1,096,990.56	
	HORMEL FOODS CORP	21,508	39.47	848,920.76	
	JM SMUCKER CO	9,201	129.53	1,191,805.53	
	KELLOGG CO	20,764	77.60	1,611,286.40	

	KRAFT HEINZ CO/THE	46,065	78.30	3,606,889.50	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,566	94.99	813,684.34	
	MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,072	84.24	1,269,665.28	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	14,436	97.75	1,411,119.00	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,672	43.26	5,263,530.72	
	MONSTER BEVERAGE CORP	10,588	129.31	1,369,134.28	
	PEPSICO INC	111,745	104.32	11,657,238.40	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,803	99.28	11,794,761.84	
	REYNOLDS AMERICAN INC	64,885	48.71	3,160,548.35	
	TYSON FOODS INC	23,213	65.32	1,516,273.16	
	WHITEWAVE FOODS CO	12,395	39.99	495,676.05	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	9,620	94.26	906,781.20	
	CLOROX COMPANY	9,876	126.56	1,249,906.56	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	65,657	71.66	4,704,980.62	
	EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	85.04	383,020.16	
	ESTEE LAUDER CO-CL A	17,252	96.95	1,672,581.40	
	KIMBERLY-CLARK CORP	27,431	137.11	3,761,064.41	
	PROCTER & GAMBLE CO	208,455	83.28	17,360,132.40	
	ABBOTT LABORATORIES	114,892	43.85	5,038,014.20	
	AETNA INC	26,423	111.47	2,945,371.81	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	14,832	89.49	1,327,315.68	
	ANTHEM INC	19,925	144.40	2,877,170.00	
	BARD C R INC	5,711	208.79	1,192,399.69	
	BAXTER INTERNATIONAL	42,622	43.37	1,848,516.14	
	BECTON DICKINSON & CO	15,975	157.99	2,523,890.25	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	102,966	19.67	2,025,341.22	
	CARDINAL HEALTH	25,151	85.59	2,152,674.09	
	CENTENE CORP	9,242	59.15	546,664.30	
	CERNER CORP	22,992	58.04	1,334,455.68	
	CIGNA CORP	19,513	139.87	2,729,283.31	
	DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,384	74.94	1,002,996.96	
	DENTSPLY SIRONA INC	10,467	61.03	638,801.01	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15,954	106.08	1,692,400.32	
	ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	21.98	282,333.10	
	EXPRESS SCRIPTS HOLDING	51,062	72.35	3,694,335.70	
	HCA HOLDINGS INC	25,490	79.78	2,033,592.20	

	HENRY SCHEIN INC	6,510	171.70	1,117,767.00	
	HOLOGIC INC	19,280	36.62	706,033.60	
	HUMANA INC	11,368	174.77	1,986,785.36	
	IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,329	26.74	329,677.46	
	INTUITIVE SURGICAL INC	2,911	623.71	1,815,619.81	
	LABORATORY CRP OF AMER	7,995	118.99	951,325.05	
	MCKESSON CORP	17,523	175.84	3,081,244.32	
	MEDNAX INC	6,946	68.64	476,773.44	
	MEDTRONIC PLC	108,498	78.11	8,474,778.78	
	PATTERSON COMPANIES INC	7,082	45.22	320,248.04	
	QUEST DIAGNOSTICS	11,439	74.37	850,718.43	
	RESMED INC	10,525	59.67	628,026.75	
	ST JUDE MEDICAL INC	20,877	58.60	1,223,392.20	
	STRYKER CORP	25,827	109.73	2,833,996.71	
	THE COOPER COS INC	3,727	157.45	586,816.15	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	73,132	130.50	9,543,726.00	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	125.75	911,436.00	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	85.12	665,808.64	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,684	113.84	1,671,626.56	
	ABBVIE INC	124,533	60.17	7,493,150.61	
	AGILENT TECHNOLOGIES	26,114	41.40	1,081,119.60	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,290	155.44	2,687,557.60	
	ALKERMES PLC	10,522	40.45	425,614.90	
	ALLERGAN PLC	30,247	225.67	6,825,840.49	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	66.81	358,702.89	
	AMGEN	57,900	162.10	9,385,590.00	
	BAXALTA INC	47,278	41.26	1,950,690.28	
	BIOGEN INC	17,088	271.00	4,630,848.00	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,983	86.37	1,034,971.71	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	128,046	68.91	8,823,649.86	
	CELGENE CORP	60,432	106.53	6,437,820.96	
	ENDO INTERNATIONAL PLC	15,990	28.75	459,712.50	
	GILEAD SCIENCES INC	110,216	99.44	10,959,879.04	
	ILLUMINA INC	11,035	136.88	1,510,470.80	
	INCYTE CORP	13,213	76.77	1,014,362.01	
	IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,019	42.51	383,397.69	

	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	149.52	743,263.92	
	JOHNSON & JOHNSON	211,951	112.68	23,882,638.68	
	LILLY (ELI) & CO	76,695	77.25	5,924,688.75	
	MALLINCKRODT PLC	8,200	61.86	507,252.00	
	MEDIVATION INC	11,768	52.15	613,701.20	
	MERCK & CO	214,289	56.86	12,184,472.54	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,100	362.18	760,578.00	
	MYLAN NV	32,646	47.77	1,559,499.42	
	PERRIGO CO PLC	11,238	130.62	1,467,907.56	
	PFIZER	473,152	32.89	15,561,969.28	
	QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	69.74	459,795.82	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,772	413.78	2,388,338.16	
	TARO PHARMACEUTICAL INDUS	738	147.40	108,781.20	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,148	145.59	4,389,247.32	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	114.89	370,635.14	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,666	83.21	1,553,197.86	
	WATERS CORP	6,513	136.62	889,806.06	
	ZOETIS INC	36,933	48.56	1,793,466.48	
	BANK OF AMERICA CORP	798,744	14.45	11,541,850.80	
	BB&T CORP	59,542	34.71	2,066,702.82	
	CIT GROUP INC	12,099	33.54	405,800.46	
	CITIGROUP	228,753	45.63	10,437,999.39	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	38,881	23.10	898,151.10	
	COMERICA INC	13,561	41.64	564,680.04	
	FIFTH THIRD BANCORP	62,255	18.11	1,127,438.05	
	FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,670	71.32	832,304.40	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,051	10.11	607,115.61	
	JPMORGAN CHASE & CO	282,107	63.32	17,863,015.24	
	KEY CORP	62,338	11.98	746,809.24	
	M & T BANK CORP	11,315	117.85	1,333,472.75	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	15.95	623,565.25	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	16.35	357,034.95	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,833	86.27	3,350,122.91	
	REGIONS FINL CORP	93,833	8.98	842,620.34	
	SIGNATURE BANK	3,757	146.89	551,865.73	
	SUNTRUST BANKS	37,920	39.24	1,487,980.80	

	US BANCORP	132,810	41.91	5,566,067.10	
	WELLS FARGO & CO	371,816	49.88	18,546,182.08	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,839	172.68	662,918.52	
	ALLY FINANCIAL INC	30,804	17.99	554,163.96	
	AMERICAN EXPRESS	64,220	63.57	4,082,465.40	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,641	96.84	1,320,994.44	
	BANK NEW YORK CO	84,107	38.84	3,266,715.88	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,921	145.95	13,269,919.95	
	BLACKROCK INC	9,327	364.66	3,401,183.82	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,344	72.80	3,009,843.20	
	CME GROUP INC	24,459	92.62	2,265,392.58	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	52.55	1,683,018.85	
	E*TRADE FINANCIAL CORP	23,839	24.49	583,817.11	
	EATON VANCE CORP	7,881	35.50	279,775.50	
	FRANKLIN RESOURCES INC	30,723	40.40	1,241,209.20	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,344	162.65	4,772,801.60	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,962	242.10	2,169,700.20	
	INVESCO LTD	33,107	31.79	1,052,471.53	
	LEGG MASON INC	7,716	34.53	266,433.48	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	16.98	436,487.88	
	MCGRAW-HILL FINANCIAL	20,959	103.14	2,161,711.26	
	MOODY'S CORP	13,371	99.59	1,331,617.89	
	MORGAN STANLEY	111,231	26.46	2,943,172.26	
	MSCI INC	7,670	75.93	582,383.10	
	NASDAQ INC	9,070	64.17	582,021.90	
	NAVIENT CORP	29,884	12.95	386,997.80	
	NORTHERN TRUST CORP	16,441	71.84	1,181,121.44	
	PRICE T ROWE GROUP INC	19,603	77.72	1,523,545.16	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	48.31	479,814.92	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	89,932	28.77	2,587,343.64	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	46.23	499,376.46	
	STATE STREET CORP	31,437	60.26	1,894,393.62	
	SYNCHRONY FINANCIAL	64,788	29.82	1,931,978.16	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	30.98	623,906.22	
	VOYA FINANCIAL INC	16,094	31.84	512,432.96	
	AFLAC	33,143	67.56	2,239,141.08	

	ALLEGHANY CORP	1,109	512.93	568,839.37	
	ALLSTATE CORP	29,595	67.53	1,998,550.35	
	AMERICAN INT'L GROUP	94,786	55.72	5,281,475.92	
	AON PLC	20,838	105.19	2,191,949.22	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,789	71.15	625,337.35	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,324	45.33	603,976.92	
	ASSURANT INC	4,769	81.52	388,768.88	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	55.50	405,261.00	
	CHUBB LTD	35,444	122.02	4,324,876.88	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	66.02	819,506.26	
	EVEREST RE GROUP LTD	3,353	197.89	663,525.17	
	FNF GROUP	18,683	32.80	612,802.40	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,750	46.08	1,416,960.00	
	LINCOLN NATIONAL CORP	17,658	41.78	737,751.24	
	LOEWS CORP	21,888	39.74	869,829.12	
	MARKEL CORP	1,025	914.17	937,024.25	
	MARSH & MCLENNAN COS	40,437	63.32	2,560,470.84	
	METLIFE INC	71,632	45.62	3,267,851.84	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,970	42.22	927,573.40	
	PROGRESSIVE CORP	43,470	33.75	1,467,112.50	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,355	77.50	2,662,512.50	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	117.21	380,815.29	
	TORCHMARK CORP	9,592	56.32	540,221.44	
	TRAVELERS COS INC/THE	23,150	116.27	2,691,650.50	
	UNUM GROUP	18,574	33.12	615,170.88	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,118	121.68	1,231,158.24	
	WR BERKLEY CORP	7,065	56.76	401,009.40	
	XL GROUP PLC	23,714	36.68	869,829.52	
	CBRE GROUP INC-A	24,306	30.62	744,249.72	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,900	6.45	289,605.00	
	JONES LANG LASALLE INC	3,112	120.85	376,085.20	
	REALOGY HOLDINGS CORP	11,351	36.04	409,090.04	
	WEYERHAEUSER CO	61,061	31.98	1,952,730.78	
	ACCENTURE PLC-CL A	48,157	115.10	5,542,870.70	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	37,822	35.21	1,331,712.62	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,638	96.52	3,632,819.76	

	AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	14,178	51.35	728,040.30	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,727	211.62	1,000,327.74	
	ALPHABET INC-CL A	22,345	776.25	17,345,306.25	
	ALPHABET INC-CL C	23,850	753.93	17,981,230.50	
	ANSYS INC	6,865	90.94	624,303.10	
	AUTODESK INC	17,921	59.13	1,059,668.73	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	35,470	90.74	3,218,547.80	
	CA INC	24,426	30.30	740,107.80	
	CDK GLOBAL INC	9,538	47.66	454,581.08	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,090	88.88	452,399.20	
	CITRIX SYSTEMS INC	11,275	80.14	903,578.50	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,276	59.85	2,769,618.60	
	EBAY	83,446	24.30	2,027,737.80	
	ELECTRONIC ARTS INC	24,281	66.19	1,607,159.39	
	FACEBOOK INC-A	174,120	112.29	19,551,934.80	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	20,900	65.49	1,368,741.00	
	FISERV INC	17,335	100.74	1,746,327.90	
	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,227	152.07	946,939.89	
	FORTINET INC	10,871	30.02	326,347.42	
	GARTNER INC	6,094	89.03	542,548.82	
	GLOBAL PAYMENTS INC	9,527	76.60	729,768.20	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,815	144.00	10,197,360.00	
	INTUIT INC	19,187	103.92	1,993,913.04	
	LINKEDIN CORP - A	9,109	115.42	1,051,360.78	
	MASTERCARD INC-CLASS A	76,211	97.24	7,410,757.64	
	MICROSOFT CORP	581,738	56.39	32,804,205.82	
	MOBILEYE NV	6,284	40.01	251,422.84	
	NETSUITE INC	3,217	71.57	230,240.69	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	19.21	336,636.04	
	ORACLE CORP	245,496	41.06	10,080,065.76	
	PAYCHEX INC	24,161	53.56	1,294,063.16	
	PAYPAL HOLDINGS INC	83,094	39.24	3,260,608.56	
	RED HAT INC	14,162	75.04	1,062,716.48	
	SABRE CORP	13,317	28.51	379,667.67	
	SALESFORCE.COM INC	48,755	76.19	3,714,643.45	
	SERVICENOW INC	11,485	63.67	731,249.95	

	SPLUNK INC	8,873	48.73	432,381.29	
	SYMANTEC CORP	52,499	18.13	951,806.87	
	SYNOPSYS INC	11,010	49.24	542,132.40	
	TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,378	47.00	158,766.00	
	TERADATA CORP	9,511	25.12	238,916.32	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,531	50.81	636,700.11	
	TWITTER INC	42,396	16.92	717,340.32	
	VANTIV INC - CL A	11,196	55.31	619,250.76	
	VERISIGN INC	7,494	88.79	665,392.26	
	VISA INC-CLASS A SHARES	149,422	80.75	12,065,826.50	
	VMWARE INC-CLASS A	5,459	51.46	280,920.14	
	WESTERN UNION CO	38,757	20.12	779,790.84	
	WORKDAY INC-CLASS A	7,992	75.38	602,436.96	
	XEROX CORP	73,995	11.23	830,963.85	
	YAHOO	68,304	36.33	2,481,484.32	
	ZILLOW GROUP INC-C	6,200	22.28	138,136.00	
	AMPHENOL CORPORATION	22,979	58.31	1,339,905.49	
	APPLE INC	427,536	106.91	45,707,873.76	
	ARROW ELECTRONICS INC	6,579	64.71	425,727.09	
	AVNET INC	10,936	44.21	483,480.56	
	CDW CORP/DE	10,704	42.86	458,773.44	
	CISCO SYSTEMS	389,719	28.33	11,040,739.27	
	CORNING	90,000	20.93	1,883,700.00	
	EMC CORP	149,630	25.55	3,823,046.50	
	F5 NETWORKS INC	5,350	95.76	512,316.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	12.26	473,738.66	
	FLIR SYSTEMS INC	11,686	32.97	385,287.42	
	HARRIS CORP	9,931	78.79	782,463.49	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	139,171	17.24	2,399,308.04	
	HP INC	140,099	12.78	1,790,465.22	
	JUNIPER NETWORKS INC	27,826	23.47	653,076.22	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,617	75.97	882,543.49	
	NETAPP INC	23,085	24.44	564,197.40	
	PALO ALTO NETWORKS INC	6,417	140.28	900,176.76	
	SANDISK CORP	15,286	75.81	1,158,831.66	
	SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	25.33	586,313.51	

	TE CONNECTIVITY LTD	29,455	63.69	1,875,988.95	
	TRIMBLE NAVIGATION LTD	20,622	25.27	521,117.94	
	WESTERN DIGITAL CORP	18,386	41.32	759,709.52	
	AT&T INC	471,373	38.92	18,345,837.16	
	CENTURYLINK INC	43,331	32.71	1,417,357.01	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	5.68	469,434.96	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,528	53.98	1,216,061.44	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,958	101.86	1,014,321.88	
	SPRINT CORP	53,367	3.68	196,390.56	
	T-MOBILE US INC	22,613	39.84	901,014.98	
	VERIZON COMMUNICATIONS	311,799	52.08	16,238,491.92	
	AES CORP	52,646	11.50	605,429.00	
	AGL RESOURCES INC	8,873	65.83	584,109.59	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,521	73.21	623,822.41	
	AMEREN CORPORATION	19,175	49.12	941,876.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	37,383	65.84	2,461,296.72	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,314	72.20	961,270.80	
	ATMOS ENERGY CORP	8,018	74.04	593,652.72	
	CALPINE CORP	25,284	15.73	397,717.32	
	CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	21.00	640,857.00	
	CMS ENERGY CORP	21,027	41.79	878,718.33	
	CONSOLIDATED EDISON INC	22,873	76.01	1,738,576.73	
	DOMINION RESOURCES	46,003	72.82	3,349,938.46	
	DTE ENERGY COMPANY	13,401	89.55	1,200,059.55	
	DUKE ENERGY CORP	53,072	79.79	4,234,614.88	
	EDISON INTL	25,385	71.42	1,812,996.70	
	ENTERGY CORP	13,902	76.43	1,062,529.86	
	EVERSOURCE ENERGY	24,121	57.04	1,375,861.84	
	EXELON CORP	71,086	34.80	2,473,792.80	
	FIRSTENERGY CORP	32,383	35.50	1,149,596.50	
	NEXTERA ENERGY INC	35,455	118.10	4,187,235.50	
	NRG ENERGY INC	25,186	14.31	360,411.66	
	OGE ENERGY CORP	15,686	28.69	450,031.34	
	PG&E CORP	37,062	59.58	2,208,153.96	
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	74.85	623,500.50	
	PPL CORPORATION	52,191	37.80	1,972,819.80	

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,418	47.12	1,857,376.16	
	SCANA CORP	10,178	69.88	711,238.64	
	SEMPRA ENERGY	18,123	104.21	1,888,597.83	
	SOUTHERN CO	70,202	51.00	3,580,302.00	
	TECO ENERGY INC	18,530	27.78	514,763.40	
	WEC ENERGY GROUP INC	23,970	59.14	1,417,585.80	
	XCEL ENERGY INC	37,603	41.16	1,547,739.48	
	ANALOG DEVICES	23,246	58.23	1,353,614.58	
	APPLIED MATERIALS	91,801	21.20	1,946,181.20	
	BROADCOM LTD	29,923	151.07	4,520,467.61	
	INTEL CORP	362,362	31.60	11,450,639.20	
	KLA-TENCOR CORP	11,893	73.12	869,616.16	
	LAM RESEARCH CORP	12,545	82.77	1,038,349.65	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	19,003	44.35	842,783.05	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,286	9.80	296,802.80	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,025	35.88	754,377.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,894	48.52	722,656.88	
	MICRON TECHNOLOGY	80,552	10.72	863,517.44	
	NVIDIA CORP	41,405	36.31	1,503,415.55	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	11,569	82.89	958,954.41	
	QORVO INC	10,609	45.24	479,951.16	
	QUALCOMM	115,320	51.83	5,977,035.60	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,228	72.23	1,027,688.44	
	TEXAS INSTRUMENTS	77,600	58.42	4,533,392.00	
	XILINX INC	20,299	45.90	931,724.10	
アメリカドル 小計		24,118,454		1,432,862,090.37 (156,468,540,268)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	32.42	385,344.12	
	ARC RESOURCES LTD	27,117	19.13	518,748.21	
	CAMECO CORP	28,709	16.30	467,956.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,210	38.08	3,282,876.80	
	CENOVUS ENERGY INC	59,243	17.97	1,064,596.71	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	21.08	810,610.32	
	ENBRIDGE	66,179	53.56	3,544,547.24	
	ENCANA CORP	57,917	8.97	519,515.49	
	HUSKY ENERGY INC	23,143	17.42	403,151.06	

	IMPERIAL OIL	21,387	41.03	877,508.61	
	INTER PIPELINE LTD	25,744	26.62	685,305.28	
	KEYERA CORP	14,929	40.43	603,579.47	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,431	36.49	1,110,427.19	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	31.24	394,654.92	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	17,254	25.03	431,867.62	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	13,811	21.86	301,908.46	
	SUNCOR ENERGY	121,521	37.14	4,513,289.94	
	TOURMALINE OIL CORP	15,316	28.14	430,992.24	
	TRANSCANADA CORP	55,573	51.54	2,864,232.42	
	VERESEN INC	23,263	8.51	197,968.13	
	VERMILION ENERGY INC	7,138	38.19	272,600.22	
	AGNICO EAGLE MINES	16,929	52.56	889,788.24	
	AGRIUM INC	9,859	110.27	1,087,151.93	
	BARRICK GOLD CORP	89,275	20.70	1,847,992.50	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,100	233.77	490,917.00	
	ELDORADO GOLD CORP	45,613	4.90	223,503.70	
	FRANCO-NEVADA CORP	14,192	88.03	1,249,321.76	
	GOLDCORP INC	66,632	22.00	1,465,904.00	
	KINROSS GOLD CORP	81,986	5.82	477,158.52	
	METHANEX CORP	6,468	42.73	276,377.64	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	64,591	22.72	1,467,507.52	
	SILVER WHEATON CORP	28,647	23.41	670,626.27	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	13.34	497,128.44	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.75	266,250.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	44.40	192,118.80	
	YAMANA GOLD INC	59,651	5.58	332,852.58	
	BOMBARDIER B	157,835	1.65	260,427.75	
	CAE INC	18,429	14.71	271,090.59	
	FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	21.78	256,219.92	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	47.22	572,873.04	
	PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	9,971	39.05	389,367.55	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,785	81.42	4,949,114.70	
	CP RAILWAY LIMITED	11,451	189.95	2,175,117.45	
	LINAMAR CORP	3,889	58.49	227,467.61	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	30,782	53.67	1,652,069.94	

	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	38.79	684,992.61	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,433	52.21	805,756.93	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,558	23.42	715,668.36	
	THOMSON REUTERS CORP	27,142	52.29	1,419,255.18	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	134.40	726,969.60	
	DOLLARAMA INC	10,038	90.65	909,944.70	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	32,095	57.99	1,861,189.05	
	EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	20.98	241,249.02	
	JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	20.72	114,250.08	
	LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	70.51	1,294,070.03	
	METRO INC	19,179	42.00	805,518.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,518	111.88	393,593.84	
	SAPUTO INC	19,855	39.33	780,897.15	
	BANK MONTREAL	49,397	81.65	4,033,265.05	
	BANK NOVA SCOTIA	91,953	64.33	5,915,336.49	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	31,170	99.77	3,109,830.90	
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	45.14	1,271,277.82	
	ROYAL BANK OF CANADA	114,665	78.34	8,982,856.10	
	TORONTO-DOMINION BANK	143,203	55.91	8,006,479.73	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	27.69	516,999.99	
	ELEMENT FINANCIAL CORP	28,986	14.89	431,601.54	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	39.25	301,636.25	
	ONEX CORP	5,970	77.14	460,525.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,733	696.73	1,207,433.09	
	GREAT-WEST LIFECO INC	22,628	35.88	811,892.64	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	40.15	277,878.15	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,906	92.49	916,205.94	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	151,479	18.61	2,819,024.19	
	POWER CORP OF CANADA	28,343	30.34	859,926.62	
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	32.36	671,146.40	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	46,869	42.89	2,010,211.41	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	66,612	43.11	2,871,643.32	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,916	20.17	139,495.72	
	CGI GROUP INC - CL A	17,086	61.63	1,053,010.18	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	533.00	771,784.00	
	OPEN TEXT CORP	9,997	70.19	701,689.43	

	BCE INC	10,313	59.65	615,170.45	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	29,051	49.27	1,431,342.77	
	TELUS CORP	16,454	40.25	662,273.50	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.74	208,277.34	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.75	369,083.00	
	FORTIS INC	21,187	40.17	851,081.79	
カナダドル 小計		2,892,795		108,901,762.76 (9,365,551,597)	
ユーロ	ENI	193,858	13.67	2,650,038.86	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	11.89	474,018.63	
	NESTE OIL OYJ	9,335	29.90	279,116.50	
	OMV AG	9,889	25.50	252,169.50	
	REPSOL SA	85,163	10.91	929,554.14	
	SAIPEM	590,236	0.37	219,921.93	
	TECHNIP S.A.	7,230	52.60	380,298.00	
	TENARIS SA	34,866	11.93	415,951.38	
	TOTAL SA	169,092	42.88	7,251,510.42	
	VOPAK	4,507	44.71	201,530.50	
	AIR LIQUIDE	26,160	105.00	2,746,800.00	
	AKZO NOBEL	18,901	63.75	1,204,938.75	
	ARCELORMITTAL	75,111	5.19	390,051.42	
	ARKEMA	5,986	71.01	425,065.86	
	BASF SE	71,056	69.99	4,973,209.44	
	CRH	64,384	25.66	1,652,415.36	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,337	27.96	289,074.20	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	39.99	230,451.19	
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,108	79.26	801,160.08	
	IMERYS SA	3,000	64.11	192,330.00	
	K+S AG	14,355	20.75	297,866.25	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,482	52.72	710,771.04	
	LANXESS	7,293	45.77	333,837.07	
	LINDE AG	14,223	135.40	1,925,794.20	
	OCI NV	5,400	17.93	96,849.00	
	SOLVAY SA	5,674	90.64	514,291.36	
	STORA ENSO OYJ R	48,306	7.65	369,782.43	
	SYMRISE AG	9,404	61.33	576,747.32	

	THYSSEN KRUPP	26,520	21.42	568,058.40	
	UMICORE	6,892	45.93	316,584.02	
	UPM KYMMENE CORP	38,348	15.45	592,476.60	
	VOESTALPINE AG	7,829	31.25	244,656.25	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	28.19	402,088.89	
	AIRBUS GROUP SE	44,928	57.38	2,577,968.64	
	ALSTOM	11,216	23.21	260,323.36	
	ANDRITZ AG	5,242	49.55	259,741.10	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	36.36	212,815.08	
	BOUYGUES ORD	16,815	30.98	520,928.70	
	BRENNTAG AG	11,535	51.50	594,052.50	
	CNH INDUSTRIAL NV	65,726	6.36	418,345.99	
	FERROVIAL SA	35,789	19.04	681,601.50	
	FINMECCANICA SPA	28,941	11.06	320,087.46	
	GEA GROUP AG	13,801	42.67	588,888.67	
	KONE OYJ-B	26,144	43.13	1,127,590.72	
	KONINKLIJKE PHILIPS	74,872	25.14	1,882,282.08	
	LEGRAND SA	20,583	50.05	1,030,179.15	
	MAN SE	2,329	95.64	222,745.56	
	METSO OYJ	9,561	22.79	217,895.19	
	OSRAM LICHT AG	7,897	45.68	360,734.96	
	PRYSMIAN SPA	14,715	20.46	301,068.90	
	REXEL SA	24,339	12.25	298,152.75	
	SAFRAN SA	23,618	61.33	1,448,491.94	
	SAINT-GOBAIN	35,987	40.37	1,452,795.19	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,519	55.80	2,372,560.20	
	SIEMENS	61,214	95.39	5,839,203.46	
	THALES SA	7,875	76.87	605,351.25	
	VINCI S.A.	36,493	66.18	2,415,106.74	
	WARTSILA OYJ	11,462	41.14	471,546.68	
	ZARDOYA OTIS SA	13,496	9.69	130,776.24	
	ZODIAC AEROSPACE	17,832	17.50	312,060.00	
	BUREAU VERITAS SA	19,558	20.95	409,740.10	
	EDENRED	18,941	18.87	357,511.37	
	RANDSTAD HOLDING NV	9,588	49.41	473,743.08	
	SOCIETE BIC SA	1,899	136.80	259,783.20	

	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	39,689	14.26	565,965.14	
	ADP	2,382	109.70	261,305.40	
	AENA SA	5,610	121.05	679,090.50	
	ATLANTIA SPA	33,587	24.45	821,202.15	
	BOLLORE	61,805	3.50	216,626.52	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	14.07	297,974.46	
	DEUTSCHE POST AG-REG	76,258	25.88	1,973,557.04	
	FRAPORT AG	3,561	53.86	191,795.46	
	GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	10.05	366,786.29	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	6.73	405,870.56	
	TNT EXPRESS	38,784	7.93	307,557.12	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,274	83.07	2,099,511.18	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	71.38	255,611.78	
	CONTINENTAL AG	8,665	199.65	1,729,967.25	
	DAIMLER AG	74,419	65.64	4,884,863.16	
	FERRARI NV	10,924	39.30	429,313.20	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	7.10	474,734.40	
	MICHELIN	14,817	94.34	1,397,835.78	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	32.16	247,535.52	
	PEUGEOT SA	31,342	14.30	448,190.60	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,908	45.37	494,950.50	
	RENAULT SA	14,321	90.00	1,288,890.00	
	VALEO SA	6,450	134.90	870,105.00	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	13,976	113.40	1,584,878.40	
	VOLKSWAGEN STAMM	2,594	129.05	334,755.70	
	ADIDAS AG	15,861	108.60	1,722,504.60	
	CHRISTIAN DIOR	4,038	159.55	644,262.90	
	HERMES INTERNATIONAL	1,961	315.15	618,009.15	
	HUGO BOSS AG	4,852	61.04	296,166.08	
	KERING	5,932	161.90	960,390.80	
	LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	48.36	644,106.84	
	LVMH	21,132	153.45	3,242,705.40	
	ACCOR	14,931	38.92	581,114.52	
	PADDY POWER PLC	6,543	118.35	774,364.05	
	SODEXO	7,055	93.18	657,384.90	
	ALTICE NV -A	28,394	14.25	404,756.47	

	ALTICE NV -B	10,461	14.34	150,010.74	
	AXEL SPRINGER SE	3,827	50.68	193,952.36	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	27.54	329,819.04	
	JC DECAUX SA	4,674	39.37	184,038.75	
	LAGADERE S.C.A	9,057	24.25	219,632.25	
	NUMERICABLE-SFR	7,526	29.20	219,759.20	
	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,172	45.82	741,081.90	
	PUBLICIS GROUPE	14,973	66.38	993,907.74	
	RELX NV	79,145	15.83	1,253,261.07	
	RTL GROUP	2,486	74.70	185,704.20	
	SES	26,910	25.92	697,641.75	
	TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	45.42	227,034.15	
	VIVENDI	89,177	18.51	1,651,112.15	
	WOLTERS KLUWER	22,399	36.02	806,923.97	
	INDITEX	83,011	29.52	2,450,899.77	
	ZALANDO SE	6,805	29.31	199,454.55	
	CARREFOUR	42,603	26.25	1,118,541.76	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	53.05	195,595.35	
	COLRUYT SA	6,317	52.11	329,178.87	
	DELHAIZE GROUP	7,450	93.79	698,735.50	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.02	231,994.28	
	JERONIMO MARTINS	20,234	14.94	302,295.96	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	66,089	20.10	1,328,388.90	
	METRO STAMM	13,712	29.72	407,589.20	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV	61,964	115.45	7,153,743.80	
	DANONE (GROUPE)	45,092	64.52	2,909,335.84	
	HEINEKEN HOLDING NV	7,613	72.83	554,454.79	
	HEINEKEN NV	17,525	83.16	1,457,379.00	
	KERRY GROUP PLC-A	12,782	84.05	1,074,327.10	
	PERNOD-RICARD	16,708	102.30	1,709,228.40	
	REMY COINTREAU	1,575	75.11	118,298.25	
	BEIERSDORF AG	7,534	82.24	619,596.16	
	HENKEL AG & CO KGAA	7,463	90.79	677,565.77	
	HENKEL AG & CO KGAA -PFD	13,557	104.05	1,410,605.85	
	LOREAL	19,077	168.50	3,214,474.50	
	UNILEVER NV-CVA	125,823	41.50	5,221,654.50	

	ESSILOR INTERNATIONAL	16,136	111.15	1,793,516.40	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,643	80.00	1,331,440.00	
	FRESENIUS SE&CO KGAA	29,931	66.42	1,988,017.02	
	BAYER	63,752	109.65	6,990,406.80	
	GRIFOLS SA	22,728	19.57	444,900.60	
	MERCK KGAA	10,480	79.29	830,959.20	
	ORION OYJ-CLASS B	7,975	30.34	241,961.50	
	QIAGEN N.V.	14,956	20.76	310,486.56	
	SANOFI	90,556	77.71	7,037,106.76	
	UCB (GROUPE)	9,374	70.21	658,148.54	
	BANCO BILBAO VIZCAYA	488,612	6.01	2,939,978.40	
	BANCO DE SABADELL SA	356,994	1.61	576,902.30	
	BANCO SANTANDER SA	1,131,848	4.16	4,718,674.31	
	BANKINTER SA	46,530	6.43	299,327.49	
	BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.03	82,961.05	
	BNP PARIBAS	82,217	45.63	3,751,561.71	
	CAIXABANK	184,750	2.61	482,567.00	
	COMMERZBANK AG	77,118	8.45	652,109.80	
	CREDIT AGRICOLE SA	83,725	9.74	816,235.02	
	ERSTE GROUP BANK AG	20,524	25.59	525,209.16	
	ING GROEP NV-CVA	296,356	11.17	3,311,778.30	
	INTESA SANPAOLO	978,238	2.42	2,367,335.96	
	INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.27	148,070.00	
	KBC GROEP NV	19,728	47.39	934,909.92	
	NATIXIS	69,996	4.72	330,661.10	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	13.88	127,654.36	
	SOCIETE GENERALE	56,363	34.23	1,929,305.49	
	UNICREDIT SPA	372,056	3.30	1,227,784.80	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	3.60	236,184.53	
	DEUTSCHE BANK NAMEN	106,948	15.64	1,672,666.72	
	DEUTSCHE BOERSE	15,014	73.51	1,103,679.14	
	EURAZEO	2,763	63.01	174,096.63	
	EXOR SPA	7,381	32.12	237,077.72	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	78.14	488,140.58	
	MEDIOBANCA	41,923	6.58	275,853.34	
	WENDEL	1,898	100.45	190,654.10	

	AEGON	131,858	5.14	678,409.41	
	AGEAS	16,065	35.38	568,460.02	
	ALLIANZ SE-REG	35,632	151.35	5,392,903.20	
	ASSICURAZIONI GENERALI	90,605	13.27	1,202,328.35	
	AXA	155,067	22.40	3,473,500.80	
	CNP ASSURANCES	11,830	14.93	176,621.90	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	105.60	496,953.60	
	MAPFRE SA	90,939	2.20	200,793.31	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,918	183.30	2,367,869.40	
	NN GROUP NV	18,368	30.30	556,550.40	
	SAMPO OYJ-A SHS	35,389	43.13	1,526,327.57	
	SCOR SE	13,354	32.81	438,211.51	
	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	2.03	193,773.04	
	DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,500	27.43	699,465.00	
	VONOVIA SE	36,559	30.97	1,132,415.02	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,922	39.70	1,307,168.01	
	ATOS SE	6,536	75.97	496,539.92	
	CAP GEMINI SA	12,178	81.55	993,115.90	
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,516	71.95	684,676.20	
	GEMALTO	6,158	59.00	363,322.00	
	SAP SE	75,860	71.03	5,388,335.80	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	44.75	425,754.31	
	INGENICO GROUP	3,848	100.95	388,455.60	
	NOKIA OYJ	417,876	5.54	2,315,033.04	
	DEUTSCHE TELEKOM	243,742	16.12	3,930,339.75	
	ELISA A	10,064	34.80	350,227.20	
	ILIAD SA	2,053	190.60	391,301.80	
	KPN (KON.)	258,436	3.56	920,807.46	
	ORANGE	151,706	15.23	2,310,482.38	
	PROXIMUS	13,141	30.96	406,911.06	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.90	768,149.35	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.72	338,740.91	
	TELEFONICA	342,318	9.75	3,340,339.04	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.71	315,816.37	
	E.ON SE	148,316	9.13	1,354,718.34	
	ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	11.61	183,043.26	

	ENAGAS	18,299	27.28	499,288.21	
	ENDESA	24,774	17.59	435,898.53	
	ENEL	599,730	3.92	2,354,539.98	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.00	580,112.48	
	ENGIE	115,121	14.25	1,640,474.25	
	FORTUM OYJ	33,469	12.53	419,366.57	
	GAS NATURAL SDG SA	26,546	18.00	477,828.00	
	IBERDROLA SA	428,185	5.99	2,568,253.63	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,102	78.25	633,981.50	
	RWE STAMM	36,844	12.53	461,655.32	
	SNAM SPA	169,892	5.43	923,363.02	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	16.59	344,574.30	
	TERNA SPA	113,720	5.01	569,737.20	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	21.49	716,863.42	
	ASML HOLDING NV	26,436	88.25	2,332,977.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	87,730	12.81	1,124,259.95	
	STMICROELECTRONICS	42,509	5.22	222,024.50	
ユーロ 小計		17,311,380		249,356,717.34 (30,935,194,353)	
イギリスポンド	BP PLC	1,408,950	3.62	5,113,784.02	
	PETROFAC LTD	16,711	9.20	153,741.20	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	303,213	18.00	5,459,350.06	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	298,353	18.08	5,395,714.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	98,685	7.52	742,604.62	
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	4.92	125,259.90	
	BHP BILLTON PLC	163,311	9.64	1,575,134.59	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,609	30.76	326,332.84	
	FRESNILLO PLC	17,743	10.63	188,608.09	
	GLENCORE PLC	903,415	1.69	1,534,902.08	
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,364	29.06	417,417.84	
	MONDI PLC	27,264	13.56	369,699.84	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	67.15	489,792.10	
	REXAM PLC	54,799	6.33	346,877.67	
	RIO TINTO PLC REG	95,821	23.33	2,235,503.93	
	ASHTEAD GROUP PLC	38,400	8.46	325,056.00	
	BAE SYSTEMS PLC	247,437	5.17	1,280,486.47	

	BUNZL PLC	24,824	20.94	519,814.56	
	COBHAM PLC	90,015	2.10	189,841.63	
	IMI PLC	17,506	9.75	170,771.03	
	MEGGITT PLC	66,268	4.13	273,819.37	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	141,186	6.96	983,360.49	
	SMITHS GROUP PLC	29,684	11.17	331,570.28	
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	18.24	338,443.20	
	WEIR GROUP PLC/THE	13,390	11.96	160,144.40	
	WOLSELEY LTD	20,207	38.86	785,244.02	
	AGGREKO PLC	19,830	11.07	219,518.10	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	9.89	194,763.77	
	CAPITA GROUP PLC	53,334	10.44	556,806.96	
	EXPERIAN PLC	75,104	12.90	968,841.60	
	G4S PLC	132,555	1.97	261,796.12	
	INTERTEK GROUP PLC	12,430	32.30	401,489.00	
	EASYJET PLC	11,633	14.67	170,656.11	
	ROYAL MAIL PLC	75,133	4.90	368,527.36	
	NEW GKN	123,433	2.95	364,991.38	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	4.99	365,777.14	
	BURBERRY GROUP PLC	32,866	12.92	424,628.72	
	PERSIMMON PLC	22,640	18.59	420,877.60	
	TAYLOR WIMPAY PLC	233,248	1.71	399,787.07	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	28.82	305,463.18	
	CARNIVAL PLC	13,621	36.69	499,754.49	
	COMPASS GROUP PLC	127,937	12.74	1,629,917.38	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	17,502	28.98	507,207.96	
	MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.60	223,785.38	
	TUI AG-DI	35,476	10.46	371,078.96	
	WHITBREAD PLC	14,664	37.95	556,498.80	
	WILLIAM HILL	70,325	3.36	236,502.97	
	ITV PLC	295,435	2.38	704,317.04	
	PEARSON	66,305	8.46	561,271.82	
	RELX PLC	85,261	13.19	1,124,592.59	
	SKY PLC	79,121	10.20	807,034.20	
	WPP PLC	100,815	16.78	1,691,675.70	
	DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.14	276,295.32	

	KINGFISHER PLC	165,161	3.63	600,195.07	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,812	4.34	507,898.57	
	NEXT PLC	11,202	54.40	609,388.80	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	3.98	72,086.49	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.93	325,826.25	
	SAINSBURY (J) PLC	114,102	2.92	333,748.35	
	TESCO	602,014	1.81	1,094,461.45	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,296	34.13	931,612.48	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	143,298	42.81	6,134,587.38	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	14.50	202,985.50	
	DIAGEO	193,874	19.46	3,773,757.41	
	IMPERIAL BRANDS PLC	74,069	37.70	2,792,401.30	
	SABMILLER PLC	74,974	42.75	3,205,138.50	
	TATE & LYLE	40,576	6.06	245,890.56	
	RECKITT BENCKISER PLC	49,168	69.74	3,428,976.32	
	UNILEVER PLC	99,080	33.31	3,300,354.80	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	9.00	270,393.13	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,928	11.93	822,311.04	
	ASTRAZENECA	97,330	41.60	4,048,928.00	
	GLAXOSMITHKLINE	374,253	15.01	5,617,537.53	
	SHIRE PLC	44,905	42.75	1,919,688.75	
	BARCLAYS	1,283,239	1.67	2,153,275.04	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,523,277	4.54	6,916,439.21	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,467,576	0.67	3,031,250.31	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	261,518	2.43	635,488.74	
	STANDARD CHARTERED PLC	260,607	5.41	1,412,229.33	
	3I GROUP PLC	74,066	4.82	357,146.25	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	3.15	234,391.46	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	13.75	281,448.75	
	ICAP PLC	43,892	4.71	206,819.10	
	INVESTEC PLC	36,474	5.29	193,129.83	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	23,357	27.60	644,653.20	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	30.19	335,531.66	
	SCHRODERS PLC	9,867	26.24	258,910.08	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.50	316,972.50	
	AVIVA PIC	314,304	4.40	1,384,823.42	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.59	408,691.71	
	LEGAL & GENERAL GROUP	445,827	2.43	1,086,480.39	
	OLD MUTUAL PLC	397,509	1.96	779,912.65	
	PRUDENTIAL	196,391	14.25	2,799,553.70	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	4.70	330,108.61	
	ST JAMES'S PLACE PLC	37,294	9.19	342,731.86	
	STANDARD LIFE PLC	141,626	3.39	480,961.89	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.83	306,838.35	
	SAGE GROUP PLC	80,156	6.36	510,192.94	
	WORLDPAY GROUP PLC	91,671	2.71	248,428.41	
	BT GROUP PLC	653,303	4.51	2,947,049.83	
	INMARSAT PLC	33,632	10.05	338,001.60	
	VODAFONE GROUP PLC	2,043,830	2.32	4,748,839.00	
	CENTRICA PLC	375,613	2.37	891,329.64	
	NATIONAL GRID PLC	289,241	10.07	2,912,656.87	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	22.36	404,984.32	
	SSE PLC	78,889	15.31	1,207,790.59	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	9.55	482,059.30	
	ARM HOLDINGS PLC	106,786	9.64	1,029,417.04	
イギリスポンド 小計		22,322,697		125,303,836.21 (19,690,244,822)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	489.25	328,776.00	
	GIVAUDAN-REG	727	1,941.00	1,411,107.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	35,859	49.72	1,782,909.48	
	SIKA AG-BR	164	3,841.00	629,924.00	
	SYNGENTA AG	7,079	405.00	2,866,995.00	
	ABB LTD	166,939	19.53	3,260,318.67	
	GEBERIT AG-REG	3,003	360.10	1,081,380.30	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	180.40	243,900.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,393	182.20	618,204.60	
	SULZER AG-REG	1,607	81.95	131,693.65	
	ADECCO	12,082	65.70	793,787.40	
	SGS SA	406	2,145.00	870,870.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	136.60	556,235.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	39,756	65.30	2,596,066.80	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	341.00	846,703.00	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	67.80	266,996.40	
	DUFRY AG-REG	2,999	128.10	384,171.90	
	ARYZTA AG	7,596	38.31	291,002.76	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,166.00	153,912.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,130.00	459,750.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	74,000.00	592,000.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	244,547	73.95	18,084,250.65	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	130.40	539,856.00	
	ACTELION LTD-REG	8,148	155.00	1,262,940.00	
	GALENICA AG-REG	291	1,493.00	434,463.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	166.30	663,204.40	
	NOVARTIS	174,656	74.15	12,950,742.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	53,915	254.40	13,715,976.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	139,903	14.75	2,063,569.25	
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,269	40.36	656,616.84	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	67.10	127,221.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,221	400.75	489,315.75	
	UBS GROUP AG	286,104	15.87	4,540,470.48	
	BALOISE HOLDING AG	3,877	122.20	473,769.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	259.10	636,867.80	
	SWISS RE LTD	27,320	93.90	2,565,348.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,626	216.20	2,513,541.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,038	84.85	427,474.30	
	SWISSCOM	2,064	504.50	1,041,288.00	
スイスフラン 小計		1,281,803		83,353,620.03 (9,464,803,554)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	140.00	1,986,740.00	
	BOLIDEN AB	18,196	138.10	2,512,867.60	
	ALFA LAVAL AB	25,732	136.40	3,509,844.80	
	ASSA ABLOY AB-B	75,899	167.40	12,705,492.60	
	ATLAS COPCO A	51,594	218.20	11,257,810.80	
	ATLAS COPCO B	29,087	204.20	5,939,565.40	
	SANDVIK AB	79,113	87.15	6,894,697.95	
	SKANSKA B	28,530	177.10	5,052,663.00	
	SKF AB-B	33,479	143.50	4,804,236.50	
	VOLVO B	118,891	93.25	11,086,585.75	

	SECURITAS B	22,844	135.70	3,099,930.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	220.10	3,999,217.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	63.85	1,772,348.30	
	HENNES & MAURITZ B	72,215	303.00	21,881,145.00	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	280.50	1,607,265.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	284.10	4,303,830.90	
	SCA SV CELLULOSA B	45,085	258.80	11,667,998.00	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	197.20	3,124,634.00	
	NORDEA BANK AB	233,076	79.20	18,459,619.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	118,857	81.15	9,645,245.55	
	SVENSKA HANDELSBK A	117,460	104.20	12,239,332.00	
	SWEDBANK AB-A	69,862	171.50	11,981,333.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	146.90	1,879,144.80	
	INVESTOR AB-B SHS	35,537	309.40	10,995,147.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,104	250.50	4,535,052.00	
	ERICSSON (LM) B	232,524	79.00	18,369,396.00	
	HEXAGON AB-B SHS	18,602	334.80	6,227,949.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	478.50	2,071,426.50	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	75.95	1,618,494.50	
	TELIA CO AB	202,889	39.65	8,044,548.85	
スウェーデンクローナ 小計		1,782,850		223,273,563.20 (3,014,193,103)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	86,962	133.70	11,626,819.40	
	NORSK HYDRO	106,150	33.84	3,592,116.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	321.60	4,331,952.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	231.00	1,610,301.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	236.60	1,418,417.00	
	ORKLA	60,218	70.75	4,260,423.50	
	DNB ASA	80,217	104.20	8,358,611.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	135.60	1,828,023.60	
	TELENOR ASA	60,821	140.40	8,539,268.40	
ノルウェークローネ 小計		434,285		45,565,932.30 (611,950,470)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	420.80	3,114,340.80	
	NOVOZYMES A/S	17,281	303.70	5,248,239.70	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,462	450.90	7,873,615.80	

	ISS A/S	11,663	257.50	3,003,222.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,960.00	2,679,040.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,230.00	4,688,840.00	
	DSV A/S	14,580	273.70	3,990,546.00	
	PANDORA A/S	8,093	866.00	7,008,538.00	
	CARLSBERG AS-B	8,005	646.00	5,171,230.00	
	COLOPLAST-B	8,335	501.00	4,175,835.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	698.50	1,036,574.00	
	GENMAB A/S	4,512	967.00	4,363,104.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,927	377.80	57,020,220.60	
	DANSKE BANK A/S	54,625	179.60	9,810,650.00	
	TRYG A/S	9,828	129.90	1,276,657.20	
	TDC A/S	52,498	33.49	1,758,158.02	
デンマーククローネ 小計		367,501		122,218,811.62 (2,037,387,589)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	32.48	670,029.92	
	OIL SEARCH LTD	101,778	6.53	664,610.34	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	131,447	4.98	654,606.06	
	SANTOS	128,132	4.08	522,778.56	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	59,282	26.82	1,589,943.24	
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.42	242,050.36	
	AMCOR	88,019	15.40	1,355,492.60	
	BHP BILLITON LTD	243,985	19.67	4,799,184.95	
	BORAL LIMITED	68,971	6.54	451,070.34	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	136,041	3.32	451,656.12	
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	6.05	172,757.75	
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.05	336,073.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	19.53	729,699.39	
	NEWCREST MINING LIMITED	58,258	18.01	1,049,226.58	
	ORICA LTD	29,211	15.30	446,928.30	
	RIO TINTO LTD	31,029	49.29	1,529,419.41	
	SOUTH32 LTD	354,855	1.55	550,025.25	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	35.90	330,998.00	
	BRAMBLES LTD	116,593	12.41	1,446,919.13	
	SEEK LTD	21,328	15.83	337,622.24	
	ASCIANO GROUP	47,074	8.81	414,721.94	

	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.20	669,845.40	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	3.47	118,517.85	
	TRANSURBAN GROUP	154,945	11.30	1,750,878.50	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	10.29	449,930.25	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	11.82	358,476.96	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	40.41	131,857.83	
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.59	287,935.29	
	TATTS GROUP LTD	124,218	3.85	478,239.30	
	REA GROUP LTD	3,593	50.81	182,560.33	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	57,915	4.35	251,930.25	
	WESFARMERS LTD	87,805	40.82	3,584,200.10	
	WOOLWORTHS LTD	96,892	22.14	2,145,188.88	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	8.82	335,195.28	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	9.40	548,725.00	
	COCHLEAR LIMITED	3,856	104.70	403,723.20	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.71	380,156.09	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	62.78	676,328.94	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	19.33	614,249.41	
	CSL LIMITED	35,189	103.50	3,642,061.50	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,554	24.06	5,426,829.24	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	11.54	281,310.58	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	9.04	282,093.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	131,629	74.70	9,832,686.30	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	199,060	27.20	5,414,432.00	
	WESTPAC BANKING	256,694	30.55	7,842,001.70	
	ASX LTD	15,814	43.31	684,904.34	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	8.67	382,069.56	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,495	65.90	1,614,220.50	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	6.05	122,373.35	
	AMP LTD	217,702	5.81	1,264,848.62	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	175,295	5.62	985,157.90	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.03	649,971.36	
	QBE INSURANCE GROUP	100,546	11.25	1,131,142.50	
	SUNCORP GROUP LIMITED	95,154	12.41	1,180,861.14	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	9.67	298,000.39	
	TELSTRA CORP	340,642	5.39	1,836,060.38	

	TPG TELECOM LTD	20,000	10.96	219,200.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	28,000	8.94	250,320.00	
	AGL ENERGY LTD	50,606	18.44	933,174.64	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.53	184,553.05	
オーストラリアドル 小計		5,536,353		76,572,024.99 (6,517,810,767)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	8.18	380,779.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.50	552,175.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	8.70	191,539.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.74	544,706.50	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.98	293,635.74	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.69	297,363.36	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.96	182,753.36	
ニュージーランドドル 小計		530,213		2,442,952.16 (187,081,276)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	205,996	97.40	20,064,010.40	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	12.00	1,188,000.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	13.34	1,147,240.00	
	MTR CORP	114,000	38.75	4,417,500.00	
	LI & FUNG	378,800	4.85	1,837,180.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	30.35	2,837,725.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	27.35	1,271,775.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	29.45	5,183,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.26	823,872.00	
	SANDS CHINA LTD	174,000	30.75	5,350,500.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	9.58	938,840.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.50	726,000.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	12.34	1,268,552.00	
	WH GROUP LTD	476,500	5.96	2,839,940.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	29.25	2,479,230.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	24.30	7,338,600.00	
	HANG SENG BANK	59,700	140.30	8,375,910.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.06	647,680.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,800	196.00	17,600,800.00	
	AIA GROUP LTD	931,800	45.10	42,024,180.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	207,496	51.65	10,717,168.40	

	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.96	2,761,080.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	86,360	49.90	4,309,364.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	33.40	1,336,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	21.85	841,225.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	399,500	7.85	3,136,075.00	
	SINO LAND CO	235,400	12.50	2,942,500.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	137,000	98.00	13,426,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	83.60	3,385,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.85	2,005,770.00	
	WHARF HOLDINGS	99,000	42.95	4,252,050.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	36.15	2,349,750.00	
	PCCW LTD	357,000	5.32	1,899,240.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	74.45	3,722,500.00	
	CLP HOLDINGS	145,500	72.95	10,614,225.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	541,679	15.06	8,157,685.74	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	81.00	8,991,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	61.75	852,150.00	
香港ドル 小計		6,683,291		214,060,317.54 (3,013,969,270)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.07	681,661.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.45	135,391.16	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.10	176,700.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	1.81	110,533.50	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.41	371,690.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.01	134,330.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.93	424,850.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	11.50	498,329.50	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.86	365,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	4.10	521,110.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	43.78	433,422.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.41	173,885.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	155,000	3.52	545,600.00	
	DBS GROUP	139,800	15.87	2,218,626.00	
	OCBC BANK	245,000	9.39	2,300,550.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	99,600	19.86	1,978,056.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	8.02	441,100.00	

	CAPITALAND LTD	185,500	3.22	597,310.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	8.85	212,400.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	1.97	490,530.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	6.25	203,125.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	628,943	3.96	2,490,614.28	
	STARHUB LTD	38,000	3.36	127,680.00	
シンガポールドル 小計		3,791,439		15,632,993.44 (1,275,183,274)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	661.70	287,839.50	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	17.60	576,505.60	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	68,638	212.60	14,592,438.80	
	BANK HAPOALIM BM	80,056	19.90	1,593,114.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	14.43	1,370,691.27	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	44.24	362,768.00	
	AZRIELI GROUP	1,780	148.00	263,440.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,894	245.20	1,200,008.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	8.45	1,307,657.54	
イスラエルシェケル 小計		446,354		21,554,463.91 (625,941,631)	
合　計		87,499,415		243,207,851,974 (243,207,851,974)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472,900	219,898.50	
	アメリカドル 小計		472,900	219,898.50 (24,012,916)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	785,537.67	
		DUET GROUP	177,921	402,101.46	
		LENDLEASE GROUP	44,009	570,356.64	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	591,278.80	
	オーストラリアドル 小計		401,361	2,349,274.57 (199,970,251)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,534,680.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	2,015,860.00	
	香港ドル 小計		407,500	3,550,540.00	

				(49,991,603)	
投資信託受益証券合計			1,281,761	273,974,770 (273,974,770)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	27,108	513,154.44	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	32,023	3,378,426.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,023	731,740.35	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,614	1,948,942.68	
		BOSTON PROPERTIES	11,357	1,489,356.98	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	329,602.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	583,033.32	
		CROWN CASTLE INTL CORP	25,491	2,245,502.19	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,488	1,019,100.48	
		DUKE REALTY CORP	26,052	583,304.28	
		EQUINIX INC	5,161	1,676,602.46	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,780	1,993,215.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,199	1,191,974.73	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,793	774,223.65	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,512	856,509.68	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	43,970	1,292,718.00	
		HCP INC	34,359	1,210,811.16	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	941,893.68	
		IRON MOUNTAIN INC	14,074	492,730.74	
		KIMCO REALTY CORP	32,727	937,955.82	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	410,932.72	
		MACERICH CO/THE	10,128	796,364.64	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,929	587,267.45	
		PROLOGIS INC	40,917	1,873,180.26	
		PUBLIC STORAGE	11,158	2,939,909.84	
		REALTY INCOME CORP	19,594	1,240,104.26	
		REGENCY CENTERS CORP	7,269	545,756.52	
		SIMON PROPERTY GROUP	23,823	4,961,377.98	
		SL GREEN REALTY CORP	7,346	751,936.56	
		UDR INC	20,960	771,118.40	
		VENTAS INC	26,066	1,666,399.38	
		VEREIT INC	67,784	622,934.96	

		VORNADO REALTY TRUST	12,616	1,211,892.96	
		WELLTOWER INC	26,980	1,924,483.40	
	アメリカドル 小計		763,438	44,494,458.27 (4,858,794,843)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	206,780.85	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	289,330.80	
		SMART REAL ESTATE INVWSTMENT	5,631	192,354.96	
	カナダドル 小計		25,569	688,466.61 (59,208,128)	
	ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	195,518.40	
		GECINA SA	2,522	316,384.90	
		ICADE	2,845	190,814.15	
		KLEPIERRE	16,799	721,685.04	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	7,841	1,896,345.85	
	ユーロ 小計		32,317	3,320,748.34 (411,972,039)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,136	523,029.48	
		HAMMERSON PLC	61,184	356,702.72	
		INTU PROPERTIES PLC	73,489	219,217.68	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	62,454	689,492.16	
		SEGRO PLC	64,553	272,090.89	
	イギリスポンド 小計		335,816	2,060,532.93 (323,792,144)	
	オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	596,424.50	
		GOODMAN GROUP	140,271	953,842.80	
		GPT GROUP	136,015	674,634.40	
		MIRVAC GROUP	306,089	598,403.99	
		SCENTRE GROUP	422,912	1,945,395.20	
		STOCKLAND	182,732	798,538.84	
		VICINITY CENTERS	254,887	838,578.23	
		WESTFIELD CORP	144,920	1,476,734.80	
	オーストラリアドル 小計		1,661,916	7,882,552.76 (670,962,890)	
	香港ドル	LINK REIT	177,000	8,460,600.00	
	香港ドル 小計		177,000	8,460,600.00	

				(119,125,248)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	348,516.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	205,205.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	426,639.00	
		SUNTEC REIT	173,000	294,965.00	
	シンガポールドル 小計		654,600	1,275,325.00 (104,028,260)	
投資証券合計			3,650,656	6,547,883,552 (6,547,883,552)	
合計				6,821,858,322 (6,821,858,322)	

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 603銘柄	97.0%	—	—	62.6%
	投資信託受益証券 1銘柄	—	0.0%	—	0.0%
	投資証券 34銘柄	—	—	3.0%	1.9%
カナダドル	株式 87銘柄	99.4%	—	—	3.7%
	投資証券 3銘柄	—	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式 225銘柄	98.7%	—	—	12.4%
	投資証券 5銘柄	—	—	1.3%	0.2%
イギリスポンド	株式 108銘柄	98.4%	—	—	7.9%
	投資証券 5銘柄	—	—	1.6%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	—	—	3.8%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%	—	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	88.2%	—	—	2.6%
	投資信託受益証券 4銘柄	—	2.7%	—	0.1%
	投資証券 8銘柄	—	—	9.1%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%	—	—	0.1%

香港ドル	株式　38銘柄	94.7%	—	—	1.2%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式　23銘柄	92.5%	—	—	0.5%
	投資証券　4銘柄	—	—	7.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.3%

(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

注記事項(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

	平成28年 4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	58,182,865
金銭信託	1,270,202,017
コール・ローン	946,280,014
国債証券	206,645,595,936
派生商品評価勘定	11,560,838
未収利息	1,916,295,195
前払金	1,239,158
前払費用	108,656,265
差入委託証拠金	94,630,172
流動資産合計	211,052,642,460
資産合計	211,052,642,460
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,233,621
未払金	875,185
未払解約金	121,026,517
未払利息	2,752
その他未払費用	11,179
流動負債合計	124,149,254
負債合計	124,149,254
純資産の部	
元本等	

元本	79,595,067,879
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	131,333,425,327
元本等合計	210,928,493,206
純資産合計	210,928,493,206
負債純資産合計	211,052,642,460

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
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）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	79,595,067,879 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　2.6500 円 (1 万口当たり純資産額)　(26,500 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成28年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年10月21日
期首元本額	79,617,513,768円
期中追加設定元本額	6,650,839,478円
期中一部解約元本額	6,673,285,367円
期末元本額	79,595,067,879円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,865,292,877円
外国債券オープン（３ケ月決算型）	152,625,278円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,077,605,809円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	740,546,081円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,585,178,802円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,070,872円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	5,174,182,260円
世界経済インデックスファンド	1,888,425,578円
マイセレクション２５	5,854,754円
マイセレクション５０	4,338,082円
マイセレクション７５	2,980,989円
ＤＣマイセレクション２５	1,161,340,357円
ＤＣマイセレクション５０	973,363,811円
ＤＣマイセレクション７５	645,067,953円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	1,450,117,809円
ＤＣマイセレクションＳ２５	469,724,633円
ＤＣマイセレクションＳ５０	372,923,145円
ＤＣマイセレクションＳ７５	169,300,031円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	51,236,512円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	39,422,473円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	15,430,392円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,392,797,968円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	460,778,029円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	165,165,867円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,536,439円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,455,152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）	105,253,637円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	299,053,568円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	444,139,525円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	384,481,335円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	770,949,174円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,708,141,046円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	890,616,324円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,962,835,277円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,255,362,664円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,520,225,558円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	917,413,269円

グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	2,104,353,594円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	324,017,085円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	451,847,714円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,677,068,080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）	1,019,285,599円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	545,203,431円
外国債券ファンド・シリーズ１	481,824,388円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,869,051,042円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,186,602,435円
分散投資コア戦略ファンドＡ	769,197,711円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,260,102,638円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	45,384,288円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	617,645,215円
コア投資戦略ファンド（切替型）	577,212,860円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	149,905,511円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	88,780,570円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	328,380,497円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	187,951,150円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	22,335,708,640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）	916,859,196円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	510,452,905円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,785,730,592
合計	2,785,730,592

(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

（平成28年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,625,602,978	－	1,624,363,820	△1,239,158
合計		1,625,602,978	－	1,624,363,820	△1,239,158

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,226,771,925	－	2,237,338,300	10,566,375
	アメリカドル	1,007,895,910	－	1,011,635,100	3,739,190
	カナダドル	90,158,385	－	91,085,800	927,415
	ユーロ	950,416,870	－	954,021,400	3,604,530
	イギリスポンド	178,300,760	－	180,596,000	2,295,240
合計		2,226,771,925	－	2,237,338,300	10,566,375

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 03/31/17	1,000,000.00	999,707.03	
		T 0.5% 07/31/17	2,000,000.00	1,996,289.06	
		T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,967,968.80	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,995,078.16	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	998,906.25	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,991,503.90	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,399,312.50	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,998,300.77	
		T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	6,009,375.00	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,900,000.00	
		T 0.875% 01/15/18	5,200,000.00	5,210,968.77	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,511,279.29	

		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,016,210.95	
		T 0.875% 04/30/17	11,600,000.00	11,636,250.00	
		T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,011,562.52	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,482,382.84	
		T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,824,406.27	
		T 0.875% 10/15/17	6,200,000.00	6,215,742.17	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	4,001,875.00	
		T 0.875% 11/15/17	1,500,000.00	1,503,632.82	
		T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,999,687.50	
		T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	3,020,800.77	
		T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,055,957.04	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	909,017.57	
		T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,569,755.43	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,418,527.34	
		T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,563,349.58	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,543,183.58	
		T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,614,476.56	
		T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	5,052,050.80	
		T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,828,218.76	
		T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,127,849.61	
		T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,927,370.30	
		T 1.375% 04/30/20	10,000,000.00	10,091,406.30	
		T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,563,986.33	
		T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,227,542.96	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,950,273.45	
		T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	4,027,968.75	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	6,040,195.32	
		T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,039,492.18	
		T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,033,671.88	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,520,126.97	
		T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,033,750.00	
		T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,390,812.51	
		T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,475,195.29	
		T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,135,468.72	
		T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,891,078.15	
		T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,606,924.81	

		T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,078,613.30	
		T 1.5% 12/31/18	11,500,000.00	11,691,142.53	
		T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,061,464.84	
		T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,103,027.35	
		T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	3,055,605.48	
		T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	5,091,796.90	
		T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,538,759.76	
		T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,655,126.92	
		T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,198,039.06	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,645,259.78	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,544,140.62	
		T 1.75% 03/31/22	7,000,000.00	7,119,765.66	
		T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,846,020.51	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,862,937.50	
		T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	7,086,542.96	
		T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	2,028,828.12	
		T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,092,734.36	
		T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,351,835.94	
		T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,027,140.62	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,089,296.88	
		T 1.875% 09/30/17	850,000.00	864,327.14	
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,543,994.15	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,542,593.75	
		T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,812,523.44	
		T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,573,197.27	
		T 1% 05/31/18	5,000,000.00	5,020,117.20	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	9,012,656.25	
		T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,219,195.33	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,998,828.12	
		T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,289,787.13	
		T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,121,230.48	
		T 2.125% 05/15/25	12,450,000.00	12,840,278.36	
		T 2.125% 06/30/21	1,000,000.00	1,040,312.50	
		T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,632,958.98	
		T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,345,310.52	
		T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,754,033.19	

		T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,079,570.32	
		T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,677,011.73	
		T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,191,777.35	
		T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,663,310.56	
		T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,470,593.75	
		T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,494,624.05	
		T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	3,019,115.23	
		T 2.25% 11/30/17	5,000,000.00	5,122,460.95	
		T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,132,265.64	
		T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,947,910.13	
		T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,418,414.07	
		T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	6,170,923.83	
		T 2.5% 02/15/46	5,000,000.00	4,899,804.70	
		T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,931,234.39	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,842,550.80	
		T 2.625% 01/31/18	8,000,000.00	8,262,968.72	
		T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,187,792.95	
		T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,831,074.20	
		T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,122,890.62	
		T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,840,781.25	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,246,328.14	
		T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,939,531.25	
		T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,189,687.52	
		T 2.75% 08/15/42	2,000,000.00	2,075,859.38	
		T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,465,746.11	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,351,593.75	
		T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,404,814.41	
		T 2.875% 03/31/18	5,250,000.00	5,463,793.96	
		T 2.875% 05/15/43	10,300,000.00	10,906,130.89	
		T 2.875% 08/15/45	7,650,000.00	8,090,323.19	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,583,886.72	
		T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,676,324.22	
		T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,579,156.29	
		T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,137,265.64	
		T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,930,921.89	
		T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,376,109.38	

		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,090,175.77	
		T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,540,714.80	
		T 2% 08/31/21	6,800,000.00	7,028,437.50	
		T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,171,972.65	
		T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,403,558.58	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,479,500.00	
		T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,687,451.16	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,058,593.76	
		T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,112,226.56	
		T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,668,974.58	
		T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,334,179.70	
		T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,776,689.47	
		T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	7,224,648.47	
		T 3.125% 11/15/41	4,800,000.00	5,358,281.23	
		T 3.375% 05/15/44	4,000,000.00	4,657,812.52	
		T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	5,980,880.83	
		T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,388,867.18	
		T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,641,060.53	
		T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,106,503.92	
		T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	6,090,917.95	
		T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,932,769.53	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,438,437.50	
		T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	3,955,687.48	
		T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,371,386.70	
		T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,867,722.66	
		T 3.875% 08/15/40	2,700,000.00	3,396,884.76	
		T 3% 05/15/42	3,950,000.00	4,304,265.62	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,793,466.81	
		T 3% 11/15/44	6,300,000.00	6,831,931.61	
		T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,549,369.15	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,194,996.09	
		T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,690,200.19	
		T 4.25% 11/15/40	1,450,000.00	1,926,772.45	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,355,507.81	
		T 4.375% 05/15/40	3,000,000.00	4,052,871.09	
		T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,646,687.50	

		T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,530,898.43	
		T 4.5% 05/15/17	4,800,000.00	4,999,687.48	
		T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,377,890.63	
		T 4.5% 08/15/39	250,000.00	343,398.43	
		T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	5,451,240.24	
		T 4.75% 08/15/17	3,500,000.00	3,687,646.48	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,613,691.40	
		T 5.25% 02/15/29	400,000.00	549,289.06	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,778,587.88	
		T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,293,843.74	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,669,078.12	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,351,611.32	
		T 6.125% 11/15/27	950,000.00	1,368,964.84	
		T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,677,908.19	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,186,250.00	
		T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,307,119.14	
		T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,589,070.32	
	アメリカドル 小計		768,140,000.00	803,719,441.25 (87,766,162,984)	
	カナダドル	CAN 0.25% 05/01/18	900,000.00	893,407.50	
		CAN 0.75% 03/01/21	1,250,000.00	1,247,731.25	
		CAN 0.75% 09/01/20	1,700,000.00	1,701,249.50	
		CAN 1.25% 02/01/18	1,350,000.00	1,365,241.50	
		CAN 1.25% 03/01/18	3,640,000.00	3,683,425.20	
		CAN 1.25% 08/01/17	2,250,000.00	2,268,450.00	
		CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	507,570.00	
		CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,493,724.75	
		CAN 1.5% 06/01/23	1,450,000.00	1,488,062.50	
		CAN 1.5% 06/01/26	680,000.00	684,804.20	
		CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,669,948.50	
		CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,444,765.00	
		CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	880,714.75	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,672,605.00	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,864,755.50	
		CAN 2.75% 06/01/22	1,550,000.00	1,713,625.75	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,000,000.00	1,171,685.00	

		CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	519,147.30	
		CAN 3.25% 06/01/21	1,690,000.00	1,894,937.85	
		CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	2,002,113.00	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,740,000.00	2,315,209.20	
		CAN 3.75% 06/01/19	2,300,000.00	2,518,431.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,970,000.00	2,729,829.00	
		CAN 4.25% 06/01/18	2,100,000.00	2,259,757.50	
		CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,452,717.00	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,284,855.00	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,560,000.00	2,436,447.00	
		CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,421,856.00	
		CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	598,269.60	
	カナダドル 小計		43,360,000.00	49,185,335.35 (4,229,938,840)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,875,600.00	
		MBONO 10% 12/05/24	19,100,000.00	24,675,576.50	
		MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	21,286,946.25	
		MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,031,843.00	
		MBONO 5% 12/11/19	12,300,000.00	12,326,568.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	12,456,198.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	24,000,000.00	25,322,040.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	16,528,974.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	24,550,000.00	28,147,066.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	9,800,000.00	11,331,005.00	
		MBONO 7.75% 12/14/17	25,700,000.00	27,204,349.50	
		MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	18,940,896.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	20,476,500.00	
		MBONO 8.5% 12/13/18	16,300,000.00	17,878,818.00	
		MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	16,088,837.50	
		MBONO 8% 12/07/23	28,600,000.00	32,755,866.00	
	メキシコペソ 小計		288,400,000.00	324,327,083.75 (2,043,260,627)	
	ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,570,000.00	1,626,221.70	
		BGB 1.25% 06/22/18	980,000.00	1,016,642.20	
		BGB 1.6% 06/22/47	460,000.00	460,004.60	
		BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	562,167.90	

		BGB 1% 06/22/26	1,150,000.00	1,200,996.75	
		BGB 1% 06/22/31	580,000.00	577,123.20	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,738,440.00	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,553,843.90	
		BGB 3.5% 06/28/17	670,000.00	701,764.70	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,010,000.00	1,551,556.95	
		BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,952,525.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,000,000.00	1,300,965.00	
		BGB 3% 09/28/19	1,230,000.00	1,373,953.05	
		BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,922,870.00	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	3,043,211.85	
		BGB 4.25% 09/28/21	2,100,000.00	2,610,184.50	
		BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,877,108.75	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,163,048.25	
		BGB 4% 03/28/18	1,660,000.00	1,804,818.40	
		BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,384,086.75	
		BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,480,594.10	
		BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,867,555.50	
		BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,064,274.00	
		BGB 5% 03/28/35	2,020,000.00	3,336,838.00	
		BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,666,960.00	
		BTPS 0.25% 05/15/18	2,500,000.00	2,512,362.50	
		BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,006,440.00	
		BTPS 0.65% 11/01/20	1,500,000.00	1,518,757.50	
		BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,634,450.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,506,540.00	
		BTPS 1.05% 12/01/19	1,200,000.00	1,237,656.00	
		BTPS 1.15% 05/15/17	800,000.00	810,352.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	3,250,000.00	3,374,198.75	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,000,000.00	1,041,885.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,625,296.00	
		BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,506,992.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	900,000.00	911,322.00	
		BTPS 1.65% 03/01/32	800,000.00	773,820.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,714,650.00	
		BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,680,862.50	

		BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,696,886.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	1,050,000.00	1,076,145.00	
		BTPS 2% 12/01/25	600,000.00	632,484.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,779,911.50	
		BTPS 3.5% 03/01/30	2,460,000.00	2,963,352.90	
		BTPS 3.5% 06/01/18	1,600,000.00	1,717,488.00	
		BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,107,390.00	
		BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,488,848.00	
		BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,448,992.00	
		BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,801,193.00	
		BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,673,460.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,957,690.00	
		BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,241,978.00	
		BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	5,198,287.50	
		BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,013,421.00	
		BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,592,120.00	
		BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,916,722.50	
		BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,985,238.25	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,450,000.00	3,069,139.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,591,854.00	
		BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,550,845.75	
		BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	1,983,726.00	
		BTPS 4.75% 05/01/17	3,770,000.00	3,956,652.70	
		BTPS 4.75% 06/01/17	1,700,000.00	1,790,754.50	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,623,363.75	
		BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,934,432.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,671,140.00	
		BTPS 4.75% 09/01/44	1,800,000.00	2,609,253.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	3,908,803.75	
		BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,115,248.75	
		BTPS 5.0% 08/01/39	2,200,000.00	3,225,871.00	
		BTPS 5.25% 08/01/17	900,000.00	960,948.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,657,537.50	
		BTPS 5.5% 09/01/22	2,050,000.00	2,650,352.75	
		BTPS 5.5% 11/01/22	1,950,000.00	2,527,911.75	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	3,126,824.00	

		BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,809,181.25	
		BTPS 5% 03/01/25	4,500,000.00	5,889,487.50	
		BTPS 5% 08/01/34	2,650,000.00	3,801,756.25	
		BTPS 5% 09/01/40	2,650,000.00	3,879,785.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	2,000,000.00	3,008,490.00	
		BTPS 6% 05/01/31	4,350,000.00	6,648,170.25	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,179,394.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,259,336.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	2,400,000.00	2,499,336.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	1,450,000.00	1,497,639.75	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	3,075,558.75	
		DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,186,359.50	
		DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,824,123.40	
		DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,615,626.25	
		DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,404,095.20	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,045,195.00	
		DBR 1% 08/15/24	1,150,000.00	1,250,142.00	
		DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,251,685.00	
		DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,798,000.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,284,230.00	
		DBR 2.5% 01/04/21	2,300,000.00	2,618,101.50	
		DBR 2.5% 07/04/44	2,000,000.00	2,836,700.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,550,000.00	2,224,420.50	
		DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,573,218.25	
		DBR 2% 08/15/23	1,100,000.00	1,276,137.50	
		DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,356,707.50	
		DBR 3.25% 07/04/21	2,250,000.00	2,678,658.75	
		DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,995,055.50	
		DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,951,815.00	
		DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,631,960.25	
		DBR 3% 07/04/20	2,300,000.00	2,636,455.50	
		DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,855,613.50	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,700,000.00	4,413,366.00	
		DBR 4.25% 07/04/17	6,200,000.00	6,556,283.00	
		DBR 4.25% 07/04/18	4,550,000.00	5,030,957.75	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,873,310.00	

		DBR 4.75% 07/04/28	1,200,000.00	1,845,828.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,450,000.00	4,201,370.25	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	3,754,170.00	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,772,736.00	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,515,712.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,393,904.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,879,704.75	
		DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,635,310.00	
		FRTR 0.25% 11/25/20	2,600,000.00	2,658,279.00	
		FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,256,238.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	1,300,000.00	1,299,538.50	
		FRTR 0.5% 11/25/19	4,300,000.00	4,431,902.50	
		FRTR 1.5% 05/25/31	1,400,000.00	1,503,684.00	
		FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,215,072.80	
		FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,604,736.00	
		FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,894,376.25	
		FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,389,798.75	
		FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,592,750.00	
		FRTR 1% 11/25/25	3,000,000.00	3,161,745.00	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	5,136,384.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,708,891.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,249,665.00	
		FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	6,131,849.50	
		FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	5,055,054.00	
		FRTR 3.25% 05/25/45	2,050,000.00	2,914,597.75	
		FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,178,328.00	
		FRTR 3.5% 04/25/20	5,050,000.00	5,826,892.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	3,850,000.00	4,998,974.75	
		FRTR 3.75% 04/25/17	3,800,000.00	3,963,210.00	
		FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000.00	5,636,592.50	
		FRTR 3.75% 10/25/19	3,750,000.00	4,294,706.25	
		FRTR 3% 04/25/22	3,800,000.00	4,509,346.00	
		FRTR 4.25% 04/25/19	4,100,000.00	4,676,911.00	
		FRTR 4.25% 10/25/17	3,450,000.00	3,697,675.50	
		FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,361,409.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,763,443.50	

		FRTR 4.5% 04/25/41	3,320,000.00	5,541,677.60	
		FRTR 4.75% 04/25/35	2,950,000.00	4,760,813.25	
		FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,883,401.60	
		FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,947,603.75	
		FRTR 4% 04/25/60	1,430,000.00	2,449,211.05	
		FRTR 4% 10/25/38	3,180,000.00	4,850,008.80	
		FRTR 5.5% 04/25/29	3,750,000.00	5,951,381.25	
		FRTR 5.75% 10/25/32	3,420,000.00	5,900,662.80	
		FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,676,140.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,596,595.00	
		FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,471,327.20	
		IRISH 0.8% 03/15/22	1,000,000.00	1,034,375.00	
		IRISH 1% 05/15/26	550,000.00	557,656.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	800,000.00	914,868.00	
		IRISH 2% 02/18/45	670,000.00	696,076.40	
		IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,092,591.00	
		IRISH 3.9% 03/20/23	750,000.00	928,590.00	
		IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,259,912.50	
		IRISH 4.5% 04/18/20	1,950,000.00	2,305,455.75	
		IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	997,258.35	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,953,518.00	
		IRISH 5.5% 10/18/17	920,000.00	1,000,408.00	
		IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	907,833.75	
		NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,948,545.00	
		NETHER 0.25% 07/15/25	1,750,000.00	1,750,708.75	
		NETHER 0.5% 07/15/26	750,000.00	759,337.50	
		NETHER 1.25% 01/15/18	2,350,000.00	2,422,004.00	
		NETHER 1.25% 01/15/19	2,700,000.00	2,828,209.50	
		NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,256,490.00	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,900,000.00	2,187,850.00	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,300,000.00	1,660,808.50	
		NETHER 2.75% 01/15/47	1,140,000.00	1,662,268.20	
		NETHER 2% 07/15/24	1,700,000.00	1,964,299.00	
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,050,000.00	2,432,950.25	
		NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,274,255.75	
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,320,000.00	1,665,133.80	

		NETHER 3.75% 01/15/42	1,920,000.00	3,171,638.40	
		NETHER 4.0% 07/15/18	2,350,000.00	2,586,609.75	
		NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,602,120.50	
		NETHER 4% 01/15/37	1,630,000.00	2,617,894.10	
		NETHER 4% 07/15/19	1,800,000.00	2,061,477.00	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,510,721.30	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	303,052.00	
		OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,132,193.00	
		OBL 0.25% 10/11/19	1,450,000.00	1,487,729.00	
		OBL 0.25% 10/16/20	2,400,000.00	2,472,672.00	
		OBL 0.5% 02/23/18	2,900,000.00	2,954,230.00	
		OBL 0.5% 04/12/19	1,090,000.00	1,122,977.95	
		OBL 0.5% 10/13/17	2,750,000.00	2,791,318.75	
		OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,231,474.25	
		RAGB 0.25% 10/18/19	950,000.00	970,904.75	
		RAGB 0.75% 10/20/26	400,000.00	408,494.00	
		RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	754,558.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	1,080,000.00	1,212,683.40	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	1,975,041.25	
		RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	859,520.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	600,000.00	741,021.00	
		RAGB 3.15% 06/20/44	820,000.00	1,193,075.40	
		RAGB 3.4% 11/22/22	1,100,000.00	1,352,026.50	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,127,380.70	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,350,717.50	
		RAGB 3.8% 01/26/62	450,000.00	823,041.00	
		RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,712,189.00	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,281,944.75	
		RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,494,290.00	
		RAGB 4.35% 03/15/19	1,950,000.00	2,220,864.75	
		RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,470,669.75	
		RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,361,758.50	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,060,000.00	1,727,651.60	
		RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	565,994.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	471,647.35	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	494,782.50	

		RFGB 0.875% 09/15/25	500,000.00	522,797.50	
		RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	571,227.25	
		RFGB 1.5% 04/15/23	560,000.00	617,638.00	
		RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	653,820.30	
		RFGB 2.625% 07/04/42	480,000.00	654,441.60	
		RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	800,198.40	
		RFGB 2% 04/15/24	570,000.00	652,476.15	
		RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	689,160.00	
		RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	830,837.00	
		RFGB 3.875% 09/15/17	1,170,000.00	1,242,171.45	
		RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,212,566.25	
		RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	1,002,705.00	
		SPGB 0.25% 04/30/18	3,200,000.00	3,218,432.00	
		SPGB 0.5% 10/31/17	2,230,000.00	2,249,044.20	
		SPGB 0.75% 07/30/21	800,000.00	806,808.00	
		SPGB 1.15% 07/30/20	1,350,000.00	1,393,004.25	
		SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,916,956.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	2,300,000.00	2,343,171.00	
		SPGB 1.95% 04/30/26	550,000.00	571,054.00	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,344,910.50	
		SPGB 2.1% 04/30/17	1,000,000.00	1,022,865.00	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,450,000.00	2,598,996.75	
		SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,427,075.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	2,750,000.00	3,061,286.25	
		SPGB 2.9% 10/31/46	720,000.00	737,287.20	
		SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,531,922.00	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,342,948.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	2,730,000.00	2,984,081.10	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,693,313.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,372,469.50	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,150,000.00	1,425,258.25	
		SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	3,058,918.70	
		SPGB 4.6% 07/30/19	2,200,000.00	2,516,811.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,450,000.00	3,132,582.25	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,550,000.00	2,143,611.25	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,878,868.00	

		SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,574,936.75	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,600,000.00	2,261,968.00	
		SPGB 4% 04/30/20	3,700,000.00	4,239,349.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,400,000.00	4,644,791.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,400,000.00	2,079,672.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,350,000.00	3,047,245.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,742,185.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,428,768.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,270,000.00	3,411,049.55	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,628,226.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,366,649.60	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,204,782.50	
	ユーロ 小計		566,400,000.00	684,724,667.30 (84,946,942,225)	
	イギリスポンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,847,302.90	
		UKT 1.5% 01/22/21	1,170,000.00	1,203,707.70	
		UKT 1.5% 07/22/26	350,000.00	345,716.00	
		UKT 1.75% 07/22/19	3,550,000.00	3,678,403.50	
		UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,967,420.00	
		UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,023,985.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,800,000.00	2,995,440.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	700,000.00	761,635.00	
		UKT 2.75% 09/07/24	2,900,000.00	3,209,096.50	
		UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,467,838.00	
		UKT 2% 09/07/25	2,420,000.00	2,526,213.80	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,950,000.00	3,490,912.00	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,700,000.00	3,347,703.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	2,090,000.00	2,926,104.50	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	2,539,476.50	
		UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	609,160.75	
		UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,997,746.25	
		UKT 3.75% 09/07/21	2,350,000.00	2,701,336.75	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,550,000.00	3,378,597.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,250,000.00	2,931,896.25	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,670,000.00	2,257,756.50	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,830,880.80	

		UKT 4.25% 12/07/40	2,080,000.00	2,840,167.20	
		UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	2,987,019.00	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,600,000.00	2,344,920.00	
		UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	2,956,483.20	
		UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,567,133.50	
		UKT 4.5% 09/07/34	2,770,000.00	3,752,976.05	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,300,000.00	3,296,394.50	
		UKT 4.75% 03/07/20	4,150,000.00	4,803,438.25	
		UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	3,124,170.50	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,730,357.00	
		UKT 4% 01/22/60	1,750,000.00	2,635,771.25	
		UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,409,436.75	
		UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	1,958,238.00	
		UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,472,945.00	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,862,062.50	
		UKT 8.75% 08/25/17	1,150,000.00	1,281,192.00	
		UKT 8% 06/07/21	1,250,000.00	1,697,981.25	
	イギリスポンド 小計		84,440,000.00	102,759,014.65 (16,147,551,562)	
	スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	453,620.00	
		SWISS 2% 04/28/21	540,000.00	617,533.20	
		SWISS 3% 01/08/18	1,970,000.00	2,104,757.85	
		SWISS 4% 02/11/23	1,060,000.00	1,401,950.70	
		SWISS 4% 04/08/28	490,000.00	742,619.50	
	スイスフラン 小計		4,460,000.00	5,320,481.25 (604,140,645)	
	スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,600,000.00	10,403,952.00	
		SGB 1% 11/12/26	4,050,000.00	4,140,477.00	
		SGB 2.5% 05/12/25	7,600,000.00	8,924,224.00	
		SGB 3.5% 03/30/39	5,470,000.00	7,371,372.00	
		SGB 3.5% 06/01/22	10,250,000.00	12,317,681.25	
		SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,148,153.50	
		SGB 4.25% 03/12/19	10,150,000.00	11,530,704.50	
		SGB 5% 12/01/20	10,700,000.00	13,230,871.00	
	スウェーデンクローナ 小計		66,470,000.00	77,067,435.25 (1,040,410,375)	

	ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	2,700,000.00	2,752,987.50	
		NGB 1.75% 03/13/25	3,150,000.00	3,299,136.75	
		NGB 2% 05/24/23	7,040,000.00	7,529,737.60	
		NGB 3.75% 05/25/21	9,350,000.00	10,740,064.50	
		NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,358,385.25	
		NGB 4.25% 05/19/17	7,650,000.00	7,960,398.75	
		NGB 4.5% 05/22/19	8,000,000.00	8,973,560.00	
	ノルウェークローネ 小計		43,440,000.00	47,614,270.35 (639,459,650)	
	デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/18	3,500,000.00	3,561,530.00	
		DGB 1.5% 11/15/23	5,800,000.00	6,413,060.00	
		DGB 1.75% 11/15/25	7,250,000.00	8,169,662.50	
		DGB 3% 11/15/21	11,450,000.00	13,457,070.50	
		DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	26,238,518.60	
		DGB 4% 11/15/17	5,900,000.00	6,321,407.50	
		DGB 4% 11/15/19	11,050,000.00	12,777,501.75	
		DGB 7% 11/10/24	5,000,000.00	7,929,325.00	
	デンマーククローネ 小計		64,930,000.00	84,868,075.85 (1,414,750,824)	
	ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,600,000.00	2,551,302.00	
		POLGB 2.5% 07/25/18	3,700,000.00	3,779,476.00	
		POLGB 2.5% 07/25/26	1,550,000.00	1,489,914.25	
		POLGB 2% 04/25/21	2,250,000.00	2,223,180.00	
		POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,935,660.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	3,260,000.00	3,374,360.80	
		POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,880,595.00	
		POLGB 4.75% 04/25/17	2,720,000.00	2,812,330.40	
		POLGB 4% 10/25/23	3,150,000.00	3,442,524.75	
		POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,334,397.00	
		POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,879,873.70	
		POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,927,184.00	
		POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,772,631.00	
		POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,454,922.75	
		POLGB 5.75% 10/25/21	3,200,000.00	3,765,792.00	
	ポーランドズロチ 小計		40,550,000.00	43,624,143.65 (1,258,556,544)	

	オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,300,000.00	1,279,486.00	
		ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	3,001,813.50	
		ACGB 2.75% 06/21/35	650,000.00	614,591.25	
		ACGB 2.75% 10/21/19	1,890,000.00	1,936,985.40	
		ACGB 2.75% 11/21/27	900,000.00	905,980.50	
		ACGB 3.25% 04/21/25	2,750,000.00	2,911,521.25	
		ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,765,352.40	
		ACGB 3.25% 06/21/39	610,000.00	607,340.40	
		ACGB 3.25% 10/21/18	2,050,000.00	2,112,402.00	
		ACGB 3.75% 04/21/37	900,000.00	979,263.00	
		ACGB 4.25% 04/21/26	3,040,000.00	3,490,041.60	
		ACGB 4.25% 07/21/17	1,500,000.00	1,540,777.50	
		ACGB 4.5% 04/15/20	2,600,000.00	2,844,426.00	
		ACGB 4.5% 04/21/33	1,300,000.00	1,564,777.50	
		ACGB 4.75% 04/21/27	2,210,000.00	2,658,254.30	
		ACGB 5.25% 03/15/19	3,890,000.00	4,246,401.80	
		ACGB 5.5% 01/21/18	2,770,000.00	2,935,299.75	
		ACGB 5.5% 04/21/23	2,850,000.00	3,422,622.00	
		ACGB 5.75% 05/15/21	2,850,000.00	3,337,464.00	
		ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,877,900.00	
	オーストラリアドル 小計		41,080,000.00	45,032,700.15 (3,833,183,436)	
	シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	595,167.00	
		SIGB 1.375% 10/01/17	340,000.00	342,946.10	
		SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	111,669.80	
		SIGB 2.25% 06/01/21	470,000.00	486,309.00	
		SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	660,058.75	
		SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	280,735.20	
		SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	938,128.50	
		SIGB 2.75% 03/01/46	210,000.00	219,738.75	
		SIGB 2.75% 04/01/42	590,000.00	623,491.35	
		SIGB 2.75% 07/01/23	320,000.00	339,320.00	
		SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	215,477.00	
		SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	322,420.50	
		SIGB 2% 07/01/20	150,000.00	154,231.50	
		SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	780,991.20	

		SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	1,004,404.65	
		SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	458,874.00	
		SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	810,560.85	
		SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	834,760.85	
		SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	674,830.80	
	シンガポールドル 小計		9,270,000.00	9,854,115.80 (803,800,225)	
	マレーシアリンギット	MGS 3.26% 03/01/18	2,700,000.00	2,710,908.00	
		MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	1,006,350.00	
		MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,166,670.00	
		MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	2,014,678.50	
		MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,003,020.00	
		MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	755,868.00	
		MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,169,102.75	
		MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,614,560.00	
		MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,247,909.00	
		MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,522,762.50	
		MGS 3.892% 03/15/27	750,000.00	739,143.75	
		MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	547,041.60	
		MGS 4.012% 09/15/17	1,000,000.00	1,015,065.00	
		MGS 4.048% 09/30/21	1,700,000.00	1,734,612.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	1,300,000.00	1,278,537.00	
		MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,695,276.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	2,100,000.00	2,149,329.00	
		MGS 4.24% 02/07/18	1,150,000.00	1,173,960.25	
		MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,686,502.00	
		MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,136,256.00	
		MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	518,595.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	650,000.00	680,576.00	
		MGS 5.248% 09/15/28	1,350,000.00	1,488,159.00	
	マレーシアリンギット 小計		33,690,000.00	34,054,881.35 (964,434,239)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	28,179,141.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	6,895,327.40	
		SAGB 6.5% 02/28/41	8,850,000.00	6,299,076.00	
		SAGB 6.75% 03/31/21	8,020,000.00	7,460,685.20	

		SAGB 7.25% 01/15/20	6,800,000.00	6,557,920.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	6,850,000.00	6,509,212.50	
		SAGB 7% 02/28/31	16,300,000.00	13,326,065.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	5,800,000.00	5,257,526.00	
		SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,234,782.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	10,450,000.00	9,466,864.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	6,350,000.00	5,806,852.75	
		SAGB 8.75% 02/28/48	14,950,000.00	13,647,032.75	
		SAGB 8% 01/31/30	3,200,000.00	2,889,904.00	
		SAGB 8% 12/21/18	6,400,000.00	6,371,808.00	
	南アフリカランド 小計		135,190,000.00	124,902,196.60 (953,003,760)	
合計				206,645,595,936 (206,645,595,936)	

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　173銘柄	100.0%	42.5%
カナダドル	国債証券　29銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　16銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券　268銘柄	100.0%	41.1%
イギリスポンド	国債証券　39銘柄	100.0%	7.8%
スイスフラン	国債証券　5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.7%
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　20銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　23銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　14銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	495,581,595
金銭信託	4,530,524
コール・ローン	3,375,168
株式	25,730,360,050
投資信託受益証券	51,788,357
投資証券	144,049,045
派生商品評価勘定	25,869,557
未収入金	380,877
未収配当金	31,065,004
差入委託証拠金	190,445,047
流動資産合計	26,677,445,224
資産合計	26,677,445,224
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,490
前受金	25,867,296
未払金	11,243
未払株式払込金	909,261
未払解約金	6,341,435
未払利息	9
その他未払費用	113
流動負債合計	33,133,847
負債合計	33,133,847
純資産の部	
元本等	
元本	12,581,032,137
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,063,279,240
元本等合計	26,644,311,377
純資産合計	26,644,311,377
負債純資産合計	26,677,445,224

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数	12,581,032,137 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 2.1178 円 (1 万口当たり純資産額) (21,178 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ

	る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成28年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年10月21日
期首元本額	10,753,669,453円
期中追加設定元本額	1,951,359,776円
期中一部解約元本額	123,997,092円
期末元本額	12,581,032,137円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	5,754,940,012円
世界経済インデックスファンド	1,500,850,592円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	2,566,229,588円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	1,909,105,967円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	16,220,887円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	112,235,972円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	158,480,230円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	373,812,095円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,504,729円
新興国株式インデックス・オープン	15,979,844円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	151,672,221円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	236,299,896
投資信託受益証券	△1,515,956
投資証券	8,925,303
合計	243,709,243

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	677,817,504	－	703,684,800	25,867,296
合計		677,817,504	－	703,684,800	25,867,296

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	183,044	－	185,305	2,261
	アメリカドル	183,044	－	185,305	2,261
	売建	183,044	－	187,534	△4,490
	ブラジルレアル	183,044	－	187,534	△4,490
合計		366,088	－	372,839	△2,229

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	399,588	4.67	1,869,872.04	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	33,685	43.00	1,448,455.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	6,233	92.00	573,436.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	81,895	4.76	390,065.88	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	81,414	5.37	437,193.18	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	16,303	31.11	507,186.33	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.21	138,995.30	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	40,146	14.09	565,657.14	
	SEVERSTAL - GDR REG S	15,540	11.85	184,149.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,196	29.10	267,603.60	
	DP WORLD LTD	10,914	19.00	207,366.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	5,615	39.54	222,017.10	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,460	58.49	85,395.40	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	7,952	47.77	379,867.04	
	JD.COM INC-ADR	11,710	28.85	337,833.50	
	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	1,562	42.76	66,791.12	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,631	13.98	148,621.38	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	17,170	40.00	686,800.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	79,426	3.72	295,861.85	
	CREDICORP LTD	4,266	143.11	610,507.26	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	178,167	7.89	1,405,915.79	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	200,292	2.18	438,038.60	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	25,200	3.33	84,067.20	
	58.COM INC-ADR	2,035	54.94	111,802.90	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	31,674	79.46	2,516,816.04	
	BAIDU INC - SPON ADR	8,646	194.52	1,681,819.92	
	NETEASE INC-ADR	2,549	137.78	351,201.22	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	3,550	75.50	268,025.00	
	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	8,433	5.98	50,429.34	
	YY INC-ADR	1,029	63.25	65,084.25	
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	38,757	1.65	63,949.05	

	MEGAFON-PJSC	10,762	10.80	116,229.60	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	40,335	9.06	365,435.10	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	12,444	8.67	107,889.48	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	85,721	0.99	84,949.51	
アメリカドル 小計		1,501,230		17,135,327.12 (1,871,177,721)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	886,984	13.00	11,530,792.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	258,992	43.05	11,149,605.60	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,925	246.22	2,443,733.50	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	94,490	44.56	4,210,474.40	
	ALFA S.A.B.-A	175,000	32.98	5,771,500.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	81.76	3,066,000.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	9,900	257.75	2,551,725.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	159.16	2,782,116.80	
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	27.45	1,032,120.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	220.93	3,751,391.40	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	168,890	90.91	15,353,789.90	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	188.05	2,049,745.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	49.01	960,596.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	301,980	41.18	12,435,536.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	23,075	117.43	2,709,697.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	29,500	148.99	4,395,205.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	112,040	163.16	18,280,446.40	
	GRUMA S.A.B.-B	14,210	252.41	3,586,746.10	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	130,400	50.18	6,543,472.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	46.26	1,656,108.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	92,600	44.72	4,141,072.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	151,800	31.53	4,786,254.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,600	95.02	15,925,352.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	150,500	35.55	5,350,275.00	
	GENTERA SAB DE CV	77,100	34.54	2,663,034.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,953,040	13.61	26,580,874.40	
メキシコペソ 小計		4,983,886		175,707,662.15 (1,106,958,271)	
ブラジルレアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	13,400	32.65	437,510.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	194,800	12.36	2,407,728.00	

	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	244,140	9.62	2,348,626.80	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	23,700	73.42	1,740,054.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	25.49	226,861.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	60,400	13.30	803,320.00	
	DURATEX SA	21,672	8.00	173,376.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	13,900	32.01	444,939.00	
	GERDAU SA-PREF	43,200	8.08	349,056.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	13.15	243,275.00	
	VALE SA	86,700	20.46	1,773,882.00	
	VALE SA-PREF A	112,215	15.84	1,777,485.60	
	EMBRAER SA	41,400	21.65	896,310.00	
	WEG SA	31,440	14.05	441,732.00	
	CCR SA	61,900	15.00	928,500.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	10,890	33.35	363,181.50	
	ESTACIO PARTICIPACOES SA	13,800	12.25	169,050.00	
	KROTON EDUCATIONAL SA	101,484	12.45	1,263,475.80	
	B2W CIA DIGITAL	6,700	13.55	90,785.00	
	LOJAS AMERICANAS SA	10,800	10.56	114,048.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	38,216	15.06	575,532.96	
	LOJAS RENNER S.A.	42,700	21.36	912,072.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10,800	51.28	553,824.00	
	RAIA DROGASIL SA	12,900	55.21	712,209.00	
	AMBEV SA	291,100	19.16	5,577,476.00	
	BRF SA	39,600	48.91	1,936,836.00	
	JBS SA	44,400	9.67	429,348.00	
	M DIAS BRANCO SA	2,100	78.00	163,800.00	
	HYPERMARCAS SA	21,600	28.69	619,704.00	
	NATURA COSMETICOS SA	10,700	28.75	307,625.00	
	ODONTOPREV S.A.	12,400	12.10	150,040.00	
	QUALICORP SA	8,300	15.36	127,488.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	53,108	28.57	1,517,295.56	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	178,728	26.12	4,668,375.36	
	BANCO DO BRASIL S.A.	63,500	21.98	1,395,730.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	189,529	32.88	6,231,713.52	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	217,872	8.54	1,860,626.88	
	BM&FBOVESPA SA	105,200	16.79	1,766,308.00	

	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,405	42.24	481,747.20	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,000	33.55	1,509,750.00	
	PORTO SEGURO SA	7,300	29.85	217,905.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	22,400	16.82	376,768.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	57.90	318,450.00	
	CIELO SA	62,308	33.00	2,056,164.00	
	TOTVS SA	7,300	28.00	204,400.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	26,700	43.45	1,160,115.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,200	7.40	304,880.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	11.36	201,072.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	10,300	15.40	158,620.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	35,892	7.52	269,907.84	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	28.38	93,654.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,100	25.78	672,858.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,652	19.40	303,648.80	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	26,600	12.12	322,392.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	7,500	41.75	313,125.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	5,700	38.42	218,994.00	
ブラジルレアル 小計		2,840,551		55,683,650.82 (1,721,181,646)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	32,412	6,408.20	207,702,578.40	
	EMPRESAS CMPC SA	84,280	1,500.70	126,478,996.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,260	15,211.00	110,431,860.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	22,107	4,879.80	107,877,738.60	
	S.A.C.I. FALABELLA	51,520	5,051.40	260,248,128.00	
	CENCOSUD SA	67,389	1,894.00	127,634,766.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,323	7,542.90	70,322,456.70	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,177.60	33,125,651.20	
	BANCO DE CHILE	1,114,705	70.93	79,066,025.65	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,436	28,026.00	68,271,336.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,238,261	33.82	143,337,987.02	
	ITAU CORPBANCA	15,284,724	5.99	91,616,635.65	
	SONDA SA	34,296	1,312.80	45,023,788.80	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	5,838.40	35,579,209.60	
	AES GENER SA	141,749	332.26	47,097,522.74	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	381.67	62,306,864.16	

	COLBUN SA	475,888	176.51	83,998,990.88	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	216,099	895.61	193,540,425.39	
	ENERSIS AMERICAS SA	1,030,498	186.49	192,177,572.02	
チリペソ 小計		22,997,501		2,085,838,532.81 (344,580,525)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	357,327	1,380.00	493,111,260.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	32,011	11,420.00	365,565,620.00	
	GRUPO ARGOS SA	17,723	19,600.00	347,370,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	33,879	27,920.00	945,901,680.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PF	303,708	1,185.00	359,893,980.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	4,335	39,680.00	172,012,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	14,552	39,180.00	570,147,360.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	4,705	38,500.00	181,142,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	48,669	8,750.00	425,853,750.00	
コロンビアペソ 小計		816,909		3,860,999,750.00 (145,559,690)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	7,408	74.10	548,932.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	4.77	556,921.35	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	48,013	4.01	192,532.13	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	31,657	4.92	155,752.44	
	KOC HOLDING AS	38,796	14.89	577,672.44	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	36,454	3.74	136,337.96	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	17.09	168,097.24	
	TURK HAVA YOLLARI AO	62,191	7.50	466,432.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	38.18	124,390.44	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	22.94	154,845.00	
	ARCELIK AS	15,358	19.35	297,177.30	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,345	62.20	643,459.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	22.06	247,733.80	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	39.92	176,326.64	
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	20.76	199,835.76	
	AKBANK T.A.S.	161,430	8.69	1,402,826.70	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	165,655	8.81	1,459,420.55	
	TURKIYE HALK BANKASI	52,431	10.83	567,827.73	
	TURKIYE IS BANKASI-C	111,169	4.97	552,509.93	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	5.14	266,987.02	

	YAPI VE KREDI BANKASI	105,585	4.34	458,238.90	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	61,446	9.93	610,158.78	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	7.00	124,572.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	56,101	11.85	664,796.85	
トルコリラ 小計		1,195,650		10,753,785.26 (414,558,421)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,455	5,095.00	7,413,225.00	
	02 CZECH REPUBLIC AS	4,500	239.60	1,078,200.00	
	CEZ AS	13,737	426.00	5,851,962.00	
チェココルナ 小計		19,692		14,343,387.00 (65,836,146)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	16,725.00	38,333,700.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	5,560.00	47,032,040.00	
	OTP BANK NYRT	16,953	7,380.00	125,113,140.00	
ハンガリーフォリント 小計		27,704		210,478,880.00 (84,233,647)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	5,516	28.25	155,827.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	21,535	73.19	1,576,146.65	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	146,497	5.04	738,344.88	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	87.69	244,304.34	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,246	74.65	914,163.90	
	SYNTHOS SA	33,750	4.08	137,700.00	
	CCC SA	1,281	170.00	217,770.00	
	LPP SA	67	6,210.00	416,070.00	
	CYFROWY POLSAT SA	24,376	24.51	597,455.76	
	EUROCASH SA	5,057	55.80	282,180.60	
	ALIOR BANK SA	2,949	69.80	205,840.20	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	82.08	164,980.80	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	5.49	181,263.33	
	BANK PEKAO SA	7,896	160.55	1,267,702.80	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,398	288.00	690,624.00	
	M BANK SA	1,802	331.70	597,723.40	
	PKO BANK POLSKI SA	49,889	26.28	1,311,082.92	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	40,673	35.13	1,428,842.49	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.43	357,880.94	
	ENEA SA	12,967	11.52	149,379.84	

	ENERGA SA	12,891	12.72	163,973.52	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	13.34	847,036.64	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	2.84	161,973.72	
ポーランドズロチ 小計		595,790		12,808,267.73 (369,518,524)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	229,000	3.75	858,750.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	6.46	671,840.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,599,400	5.33	8,524,802.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	210,500	13.76	2,896,480.00	
	CNOOC LTD-R	1,155,000	9.79	11,307,450.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	162,000	6.89	1,116,180.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,382,000	5.43	7,504,260.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	4.69	525,280.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.69	914,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	76,500	22.15	1,694,475.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	134,000	4.39	588,260.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	9.86	818,380.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	5.92	597,920.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	3.86	768,140.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	379,000	2.48	939,920.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	5.98	741,520.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	39,000	42.90	1,673,100.00	
	CHINA COMMUICATIONS CONST-H	312,000	10.04	3,132,480.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85,500	16.30	1,393,650.00	
	CHINA INTL MARINE CO-H	35,600	12.20	434,320.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	109,500	10.40	1,138,800.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	300,000	6.59	1,977,000.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	100,000	12.38	1,238,000.00	
	CITIC LTD	288,000	12.20	3,513,600.00	
	CRRC CORP LTD-H	315,050	8.15	2,567,657.50	
	FOSUN INTERNATIONAL	126,000	11.38	1,433,880.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	13.60	476,000.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.61	606,480.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	38,000	18.10	687,800.00	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	6.89	468,520.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	54,400	10.72	583,168.00	

	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	39,500	47.55	1,878,225.00	
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	147,000	8.99	1,321,530.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	118,000	6.13	723,340.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	8.63	932,040.00	
	CAR INC	40,000	9.06	362,400.00	
	CHINA COSCO HOLDONGS-H	160,500	3.19	511,995.00	
	CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	55,513	23.30	1,293,452.90	
	CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	1.91	420,200.00	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	86,000	5.15	442,900.00	
	COSCO PACIFIC LIMITED-R	102,000	9.09	927,180.00	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.18	692,240.00	
	SINOTRANS LIMITED-H	91,000	3.66	333,060.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	8.10	712,800.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	236,000	8.43	1,989,480.00	
	BYD CO LTD-H	37,000	44.80	1,657,600.00	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBI-B	47,600	13.22	629,272.00	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	166,000	8.98	1,490,680.00	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	295,000	4.11	1,212,450.00	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	203,750	6.26	1,275,475.00	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	122,246	9.03	1,103,881.38	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,000	20.35	1,444,850.00	
	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	308,000	4.90	1,509,200.00	
	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	70,000	14.36	1,005,200.00	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	39.40	1,260,800.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	530,000	1.83	969,900.00	
	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	593,958	1.08	641,474.64	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	66,000	15.12	997,920.00	
	SUN ART RETAIL GROUP LTD	87,500	5.61	490,875.00	
	CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	435,000	2.94	1,278,900.00	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	154,000	13.76	2,119,040.00	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	122,000	9.32	1,137,040.00	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	29.90	598,000.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	6.60	2,171,400.00	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	40,000	74.35	2,974,000.00	
	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	4.89	528,120.00	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	16.54	711,220.00	

	SINOPHARM GROUP CO-H	72,000	35.85	2,581,200.00	
	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	51,000	10.62	541,620.00	
	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	298,000	6.94	2,068,120.00	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	65,500	5.65	370,075.00	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	21.80	566,800.00	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	246,000	5.68	1,397,280.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,383,000	2.86	3,955,380.00	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,978,200	3.26	16,228,932.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	609,475	5.08	3,096,133.00	
	CHINA CITIC BANK-H	503,200	5.01	2,521,032.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,314,620	5.08	26,998,269.60	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	223,000	3.64	811,720.00	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	296,423	17.16	5,086,618.68	
	CHINA MINSHENG BANKING-H	421,000	7.47	3,144,870.00	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	4.14	575,460.00	
	IND&COMM BK OF CHINA-H	4,654,515	4.38	20,386,775.70	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	525,000	2.67	1,401,750.00	
	CHINA EVERBRIGHT LTD-R	62,000	16.30	1,010,600.00	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	259,000	7.88	2,040,920.00	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	141,500	18.80	2,660,200.00	
	FAR EAST HORIZON LTD	141,000	6.60	930,600.00	
	GF SECURITIES CO LTD-H	105,600	18.88	1,993,728.00	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	203,600	13.46	2,740,456.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	105,400	18.54	1,954,116.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	496,000	19.60	9,721,600.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	176,800	29.30	5,180,240.00	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	101,824	17.32	1,763,591.68	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	48,800	27.30	1,332,240.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	566,000	3.36	1,901,760.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	272,859	14.50	3,956,455.50	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	330,000	37.90	12,507,000.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	220,000	2.27	499,400.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	255,040	24.95	6,363,248.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	173,111	19.68	3,406,824.48	
	CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	19.92	1,494,000.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	267,285	3.15	841,947.75	

	DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	30,700	47.45	1,456,715.00	
	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	295,000	5.94	1,752,300.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	11.14	766,432.00	
	LONGFOR PROPERTIES	73,000	11.34	827,820.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	11.14	729,670.00	
	SHUI ON LAND LTD	209,278	2.10	439,483.80	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	187,591	3.70	694,086.70	
	SOHO CHINA LTD	113,000	3.89	439,570.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	190,000	5.26	999,400.00	
	YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	344,000	1.15	395,600.00	
	KINGSOFT CORP LTD	66,000	19.28	1,272,480.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	331,200	165.70	54,879,840.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	96,000	14.50	1,392,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	51,000	56.40	2,876,400.00	
	LENOVO GROUP LTD	440,000	6.52	2,868,800.00	
	ZTE CORP-H	48,508	12.14	588,887.12	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	140,000	4.78	669,200.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	3.76	488,800.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	389,500	89.55	34,879,725.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	840,000	4.17	3,502,800.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	374,000	9.74	3,642,760.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	358,000	5.27	1,886,660.00	
	CGN POWER CO LTD-H	490,000	2.73	1,337,700.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,000	12.60	1,713,600.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	253,000	5.90	1,492,700.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	208,000	3.84	798,720.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	52,000	23.65	1,229,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	113,400	14.48	1,642,032.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	158,000	2.33	368,140.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	56,000	47.15	2,640,400.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	150,000	10.74	1,611,000.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	84,000	4.48	376,320.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	258,000	6.50	1,677,000.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	306,000	2.45	749,700.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,035,000	1.23	1,273,050.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	1.95	1,270,750.00	

	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,214,000	0.70	849,800.00	
香港ドル 小計		47,716,246		392,051,958.43 (5,520,091,574)	
マレーシアリンギット	BUMI ARMADA BERHAD	307,400	0.72	221,328.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	15,300	23.76	363,528.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	282,600	1.79	505,854.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	9.11	237,771.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	174,900	6.69	1,170,081.00	
	DIALOG GROUP BHD	222,968	1.59	354,519.12	
	GAMUDA BHD	139,200	4.86	676,512.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.65	292,230.00	
	IJM CORP BHD	198,100	3.53	699,293.00	
	SIME DARBY BERHAD	165,542	7.94	1,314,403.48	
	AIRASIA BHD	64,800	2.12	137,376.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53,594	6.56	351,576.64	
	MISC BHD	56,540	8.85	500,379.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	124,900	4.20	524,580.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	6.89	234,260.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	31,541	3.15	99,354.15	
	GENTING BHD	148,900	8.99	1,338,611.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	224,100	4.50	1,008,450.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	118,500	2.95	349,575.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,900	55.54	605,386.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	1.48	118,844.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.64	148,960.00	
	IOI CORPORATION BHD	179,640	4.47	802,990.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	28,600	23.92	684,112.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,500	16.38	335,790.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	36,000	4.64	167,040.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	164,400	6.67	1,096,548.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	4.08	288,048.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	130,200	4.59	597,618.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	319,351	4.85	1,548,852.35	
	HONG LEONG BANK BERHAD	26,192	13.42	351,496.64	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	14,933	15.18	226,682.94	
	MALAYAN BANKING BHD	301,995	9.08	2,742,114.60	

	PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	148,320	19.00	2,818,080.00	
	RHB CAPITAL BHD	40,729	6.19	252,112.51	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	123,060	2.39	294,113.40	
	AXIATA GROUP BERHAD	148,687	5.85	869,818.95	
	DIGI.COM BERHAD	203,600	4.67	950,812.00	
	MAXIS BHD	135,500	5.97	808,935.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	6.70	472,698.40	
	PETRONAS GAS BHD	44,600	21.88	975,848.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	219,775	14.40	3,164,760.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	247,417	1.63	403,289.71	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.50	183,487.50	
マレーシアリンギット 小計		5,329,361		31,288,120.19 (886,079,563)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	79,000	17.80	1,406,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	22.00	1,511,400.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	5.25	3,007,200.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	76,200	71.50	5,448,300.00	
	PTT PCL-NVDR	66,400	298.00	19,787,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	68.50	3,288,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	212,400	25.25	5,363,100.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,734	61.00	9,072,774.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	11,300	488.00	5,514,400.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,700	490.00	9,163,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	23,100	404.00	9,332,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	9.30	3,417,750.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	107,910	39.50	4,262,445.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	27.25	1,528,725.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	231,635	8.50	1,968,897.50	
	CP ALL PCL-NVDR	299,900	46.00	13,795,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	266,800	26.50	7,070,200.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	111,200	22.70	2,524,240.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	327,800	24.20	7,932,760.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	25,600	210.00	5,376,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	170.00	2,754,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	68,600	162.00	11,113,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	51,600	162.00	8,359,200.00	

	KRUNG THAI BANK - NVDR	247,250	17.70	4,376,325.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	99,000	133.50	13,216,500.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,336,500	2.40	3,207,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	74,800	54.25	4,057,900.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	86.50	2,793,950.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	70,900	155.50	11,024,950.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	607,709	7.35	4,466,661.15	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	93.50	2,767,600.00	
タイバーツ 小計		5,754,238		188,908,277.65 (591,282,909)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	114,690	63.70	7,305,753.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	16.36	2,275,676.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	12.42	4,290,489.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	132,060	81.35	10,743,081.00	
	SM INVESTMENTS CORP	8,677	959.50	8,325,581.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	8,510	66.50	565,915.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	221.80	5,644,810.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,380	206.00	13,056,280.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	88.85	4,657,517.00	
	BDO UNIBANK INC	114,901	102.90	11,823,312.90	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	41,152	83.00	3,415,616.00	
	AYALA CORPORATION	15,430	779.50	12,027,685.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,135	1,363.00	8,362,005.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.90	4,340,630.00	
	AYALA LAND INC	468,600	34.45	16,143,270.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	4.01	2,558,380.00	
	ROBINSONS LAND CO	93,000	28.95	2,692,350.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	467,450	22.00	10,283,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	2,198.00	3,934,420.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	6,225	1,850.00	11,516,250.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	44.00	3,938,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	5.90	3,577,170.00	
フィリピンペソ 小計		4,173,920		151,478,091.40 (359,003,076)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	700.00	560,350,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	105,300	20,050.00	2,111,265,000.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	234,600	10,325.00	2,422,245,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	140,200	6,750.00	946,350,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	128,900	16,600.00	2,139,740,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,300.00	654,550,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,276,200	7,600.00	9,699,120,000.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	473,000	1,110.00	525,030,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	175,700	2,080.00	365,456,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	292,400	3,105.00	907,902,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	185,500	18,000.00	3,339,000,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	16,300.00	326,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	432,100	3,695.00	1,596,609,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	30,800	66,925.00	2,061,290,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	18,300	99,400.00	1,819,020,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	80,500	14,700.00	1,183,350,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	248,900	7,175.00	1,785,857,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	45,475.00	4,051,822,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,253,400	1,415.00	1,773,561,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	752,900	13,025.00	9,806,522,500.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	3,615.00	710,347,500.00	
	BANK MANDIRI	565,298	9,625.00	5,440,993,250.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	471,600	4,915.00	2,317,914,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	732,500	10,150.00	7,434,875,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	683,400	1,930.00	1,318,962,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	1,065.00	1,291,845,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	453,200	1,635.00	740,982,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	3,135,800	3,650.00	11,445,670,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	5,775.00	770,385,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	3,995.00	689,137,500.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	791,500	2,590.00	2,049,985,000.00	
インドネシアルピア 小計		15,410,498		82,286,137,250.00 (682,974,939)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	4,192	57,600.00	241,459,200.00	
	S-OIL CORPORATION	3,401	91,000.00	309,491,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	4,435	163,500.00	725,122,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,389	25,850.00	165,155,650.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	135,500.00	190,919,500.00	

	HYUNDAI STEEL CO	6,267	59,900.00	375,393,300.00	
	KOREA ZINC CO LTD	484	503,000.00	243,452,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	70,100.00	73,675,100.00	
	LG CHEM LTD	2,918	326,500.00	952,727,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	222,500.00	106,577,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,110	316,500.00	351,315,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	98,900.00	111,460,300.00	
	POSCO	4,445	240,000.00	1,066,800,000.00	
	CJ CORP	822	210,000.00	172,620,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	92,500.00	145,317,500.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	6,490.00	53,672,300.00	
	DOOSAN CORP	423	105,000.00	44,415,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	25,700.00	85,889,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	28,600.00	97,182,800.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	38,950.00	110,033,750.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,777	47,350.00	178,840,950.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,354	40,400.00	256,701,600.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,694	115,000.00	309,810,000.00	
	KCC CORP	326	421,000.00	137,246,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,722	68,700.00	255,701,400.00	
	LG CORP	5,640	70,000.00	394,800,000.00	
	POSCO DAEWOO CORP	1,548	23,500.00	36,378,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	4,559	140,500.00	640,539,500.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	7,429	11,600.00	86,176,400.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,110	226,500.00	477,915,000.00	
	SK NETWORKS CO LTD	2,484	6,470.00	16,071,480.00	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	77,300.00	72,739,300.00	
	S-1 CORPORATION	960	90,800.00	87,168,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	952	188,000.00	178,976,000.00	
	KOREA EXPRESS CO LTD	324	192,500.00	62,370,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	1,921	32,100.00	61,664,100.00	
	HANKOOK TIRE CO LTD	4,770	53,200.00	253,764,000.00	
	HANON SYSTEMS	10,825	9,510.00	102,945,750.00	
	HYUNDAI MOBIS	4,319	246,500.00	1,064,633,500.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	10,030	153,000.00	1,534,590,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,900	107,500.00	311,750,000.00	

	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,250	105,000.00	131,250,000.00	
	HYUNDAI WIA CORP	685	107,500.00	73,637,500.00	
	KIA MOTORS CORPORATION	17,258	48,950.00	844,779,100.00	
	COWAY CO.,LTD.	3,051	98,000.00	298,998,000.00	
	HANSSEM CO LTD	615	208,000.00	127,920,000.00	
	LG ELECTRONICS INC	6,703	62,500.00	418,937,500.00	
	KANGWON LAND INC	8,683	42,900.00	372,500,700.00	
	PARADISE CO LTD	1,876	16,500.00	30,954,000.00	
	CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	17,000.00	86,190,000.00	
	CJ E&M CORP	1,055	68,100.00	71,845,500.00	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,152	71,900.00	154,728,800.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	1,222	141,000.00	172,302,000.00	
	LOTTE SHOPPING CO	710	270,000.00	191,700,000.00	
	SHINSEGAE CO LTD	417	203,000.00	84,651,000.00	
	BGF RETAIL CO LTD	371	189,000.00	70,119,000.00	
	DONGSUH COMPANIES INC	1,521	33,100.00	50,345,100.00	
	EMART	1,193	175,500.00	209,371,500.00	
	GS RETAIL CO LTD	1,311	50,000.00	65,550,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	503	365,000.00	183,595,000.00	
	KT&G CORP	6,762	114,000.00	770,868,000.00	
	LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	31	1,930,000.00	59,830,000.00	
	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	2,411,000.00	108,495,000.00	
	ORION CORP	206	969,000.00	199,614,000.00	
	OTTOGI CORPORATION	68	878,000.00	59,704,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	2,062	406,500.00	838,203,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	710	222,500.00	157,975,000.00	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	610	993,000.00	605,730,000.00	
	PACIFIC CORP	1,561	157,000.00	245,077,000.00	
	CELLTRION INC	4,351	106,000.00	461,206,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	342	654,000.00	223,668,000.00	
	HANMI SCIENCE CO LTD	565	138,000.00	77,970,000.00	
	YUHAN CORPORATION	545	303,500.00	165,407,500.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,626	9,690.00	228,935,940.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	12,276	9,320.00	114,412,320.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	19,070	25,000.00	476,750,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,046	12,550.00	226,477,300.00	

	KB FINANCIAL GROUP INC	24,912	34,500.00	859,464,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	27,104	42,600.00	1,154,630,400.00	
	WOORI BANK	20,802	10,050.00	209,060,100.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	11,786	8,050.00	94,877,300.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,255	45,050.00	101,587,750.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	3,856	24,300.00	93,700,800.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,298	10,000.00	112,980,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,899	39,200.00	74,440,800.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,091	39,450.00	200,839,950.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	2,739	71,900.00	196,934,100.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	6,850.00	83,707,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	4,318	32,700.00	141,198,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,395	294,500.00	705,327,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	5,428	112,500.00	610,650,000.00	
	KAKAO CORP	1,728	102,500.00	177,120,000.00	
	NAVER CORP	1,807	669,000.00	1,208,883,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,174	236,500.00	277,651,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,320	164,500.00	381,640,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	15,287	25,050.00	382,939,350.00	
	LG INNOTEK CO LTD	857	79,900.00	68,474,300.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,895	55,800.00	161,541,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,027	1,288,000.00	9,050,776,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,323	1,061,000.00	1,403,703,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	3,866	106,500.00	411,729,000.00	
	KT CORP	3,800	30,450.00	115,710,000.00	
	LG UPLUS CORP	12,570	11,000.00	138,270,000.00	
	SK TELECOM	1,220	206,500.00	251,930,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,870	59,500.00	1,003,765,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,432	40,100.00	57,423,200.00	
	SK HYNIX INC	37,370	27,450.00	1,025,806,500.00	
韓国ウォン 小計		531,114		41,559,917,190.00 (4,022,999,983)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	68,240	93.00	6,346,320.00	
	ASIA CEMENT CORP	132,176	29.15	3,852,930.40	
	CHINA STEEL	765,261	22.70	17,371,424.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	200,061	86.00	17,205,246.00	

	FORMOSA PLASTICS CORP	278,824	81.60	22,752,038.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	309,752	66.00	20,443,632.00	
	TAIWAN CEMENT	195,929	33.50	6,563,621.50	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	45.05	1,531,700.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	189,028	25.20	4,763,505.60	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,514	149.50	1,870,843.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	26.10	2,897,100.00	
	CHINA AIRLINES LTD	140,203	10.80	1,514,192.40	
	EVA AIRWAYS CORP	133,085	16.60	2,209,211.00	
	EVERGREEN MARINE	107,563	11.90	1,279,999.70	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	85,061	68.50	5,826,678.50	
	YULON MOTOR COMPANY	51,000	30.00	1,530,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,703	378.00	4,423,734.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	13,390	158.50	2,122,315.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	30.10	1,204,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	25,464	190.00	4,838,160.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	131.00	1,513,050.00	
	POU CHEN	153,780	40.90	6,289,602.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	46.05	1,696,804.35	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	14,000	337.50	4,725,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	33,544	239.00	8,017,016.00	
	STANDARD FOODS CORP	30,974	79.10	2,450,043.40	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	315,395	58.30	18,387,528.50	
	OBI PHARMA INC	6,000	407.00	2,442,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	356,129	16.65	5,929,547.85	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,172,780	8.40	9,851,352.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	970,405	16.45	15,963,162.25	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	537,720	18.00	9,678,960.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	520,504	15.75	8,197,938.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	427,085	15.85	6,769,297.25	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	750,339	23.00	17,257,797.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	885,573	9.87	8,740,605.51	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	720,566	11.95	8,610,763.70	
	TAIWAN BUSINESS BANK	501,305	8.53	4,276,131.65	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	585,340	14.35	8,399,629.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	114,429	56.50	6,465,238.50	

	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	411,082	40.05	16,463,834.10	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	775,153	10.75	8,332,894.75	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	541,951	36.05	19,537,333.55	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	299,968	24.35	7,304,220.80	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	615,771	6.37	3,922,461.27	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,120	50.30	2,118,636.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,445	37.85	1,757,943.25	
	ACER INC	93,803	12.15	1,139,706.45	
	ADVANTECH CO LTD	18,548	225.50	4,182,574.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	38,092	286.00	10,894,312.00	
	AU OPTRONICS CORP	590,090	9.82	5,794,683.80	
	CASETEK HOLDINGS LTD	9,000	159.00	1,431,000.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	41,700	237.00	9,882,900.00	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,366	82.00	2,326,012.00	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	552,000	11.00	6,072,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	241,760	20.10	4,859,376.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	126,903	147.00	18,654,741.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	49,357	70.60	3,484,604.20	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	895,829	81.50	73,010,063.50	
	HTC CORPORATION	37,430	81.70	3,058,031.00	
	INVENTEC CO LTD	136,511	21.25	2,900,858.75	
	LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	2,380.00	14,375,200.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	100,705	40.40	4,068,482.00	
	PEGATRON CORP	122,474	70.50	8,634,417.00	
	QUANTA COMPUTER INC	156,270	56.00	8,751,120.00	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	17,354	112.50	1,952,325.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	74,381	33.40	2,484,325.40	
	WISTRON CORP	118,448	19.40	2,297,891.20	
	WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	34.40	2,792,832.80	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	67.30	1,475,350.60	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	198,000	10.70	2,118,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	227,315	109.50	24,890,992.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	95,000	72.70	6,906,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	110,200	106.50	11,736,300.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	412,739	35.25	14,549,049.75	
	HERMES MICROVISION INC	2,000	822.00	1,644,000.00	

	INOTERA MEMORIES INC	192,000	29.15	5,596,800.00	
	MEDIATEK INC	95,804	232.50	22,274,430.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,045	109.00	4,364,905.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	280.00	3,247,720.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,770	70.80	3,382,116.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,157	56.80	1,485,717.60	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	88.10	2,461,866.40	
	SILICONWARE PRECISION INDS	157,000	49.85	7,826,450.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,563,389	157.50	246,233,767.50	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	95.70	903,886.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	727,000	12.65	9,196,550.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	51.60	2,786,400.00	
新台湾ドル 小計		21,336,586		911,774,300.83 (3,090,914,879)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	11,099	969.90	10,764,920.10	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	149.30	3,306,995.00	
	COAL INDIA LTD	41,924	275.80	11,562,639.20	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	45,947	207.55	9,536,299.85	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	79,350	1,064.75	84,487,912.50	
	ACC LTD	1,768	1,464.15	2,588,617.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	228.60	8,500,491.00	
	ASIAN PAINTS LTD	18,180	885.20	16,092,936.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	79,021	97.05	7,668,988.05	
	JSW STEEL LTD	7,923	1,334.25	10,571,262.75	
	SHREE CEMENT LTD	786	12,956.60	10,183,887.60	
	TATA STEEL LTD	25,839	335.55	8,670,276.45	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,375	3,405.65	8,088,418.75	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	17,944	507.25	9,102,094.00	
	VEDANTA LTD	72,716	97.50	7,089,810.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	63,171	109.30	6,904,590.30	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,997	132.20	4,494,403.40	
	EICHER MOTORS LTD	939	20,268.35	19,031,980.65	
	LARSEN & TOUBRO LTD	20,632	1,253.00	25,851,896.00	
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	1,178.45	6,314,135.10	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	62,526	231.30	14,462,263.80	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,670	1,332.30	3,557,241.00	

	BAJAJ AUTO LTD	5,458	2,544.45	13,887,608.10	
	BHARAT FORGE LTD	6,696	832.50	5,574,420.00	
	BOSCH LTD	431	20,060.65	8,646,140.15	
	HERO MOTOCORP LTD	3,249	3,054.50	9,924,070.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	25,703	1,340.65	34,458,726.95	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,810	3,718.95	21,607,099.50	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	16,492	261.65	4,315,131.80	
	TATA MOTORS LTD	50,825	407.35	20,703,563.75	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	35,592	300.85	10,707,853.20	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	34,593	407.75	14,105,295.75	
	GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	529	6,067.00	3,209,443.00	
	ITC LTD	128,745	335.40	43,181,073.00	
	NESTLE INDIA LIMITED	1,289	6,134.60	7,907,499.40	
	UNITED BREWERIES LTD	4,195	784.75	3,292,026.25	
	UNITED SPIRITS LTD	3,561	2,397.95	8,539,099.95	
	DABUR INDIA LTD	30,963	273.65	8,473,024.95	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,799	1,377.35	7,987,252.65	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	48,288	899.15	43,418,155.20	
	MARICO LTD	20,706	257.85	5,339,042.10	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	1,361.35	5,641,434.40	
	AUROBINDO PHARMA LTD	20,336	782.80	15,919,020.80	
	CADILA HEALTHCARE LTD	10,506	330.10	3,468,030.60	
	CIPLA LTD	19,928	524.10	10,444,264.80	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	5,388	1,039.05	5,598,401.40	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	7,801	3,091.05	24,113,281.05	
	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,671	791.90	10,034,164.90	
	LUPIN LTD	12,671	1,575.00	19,956,825.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	1,084.35	3,833,177.25	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	59,641	837.80	49,967,229.80	
	AXIS BANK LTD	35,446	445.25	15,782,331.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	95,319	1,132.40	107,939,235.60	
	ICICI BANK LTD	76,629	237.15	18,172,567.35	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	20,091	641.60	12,890,385.60	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	25,565	485.45	12,410,529.25	
	STATE BANK OF INDIA	104,739	186.75	19,560,008.25	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	278.60	4,518,334.80	

	POWER FINANCE CORPORATION	19,274	168.30	3,243,814.20	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	34,922	159.95	5,585,773.90	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,137	1,000.05	12,137,606.85	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	35,709	853.30	30,470,489.70	
	INFOSYS LTD	117,097	1,238.70	145,048,053.90	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	30,202	2,519.75	76,101,489.50	
	TECH MAHINDRA LTD	16,432	476.70	7,833,134.40	
	WIPRO LTD	45,076	588.60	26,531,733.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	82,655	359.40	29,706,207.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	36,202	396.80	14,364,953.60	
	IDEA CELLULAR LTD	59,982	120.70	7,239,827.40	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	53,477	54.20	2,898,453.40	
	GAIL INDIA LTD	28,235	359.45	10,149,070.75	
	NTPC LTD	97,417	139.50	13,589,671.50	
	TATA POWER CO LTD	93,250	69.60	6,490,200.00	
インドルピー 小計		2,375,119		1,295,748,286.95 (2,150,942,156)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,740	23.40	532,116.00	
	INDUSTRIES QATAR	9,924	105.30	1,044,997.20	
	COMMERCIAL BANK QSC	6,420	38.20	245,244.00	
	DOHA BANK QSC	2,020	36.60	73,932.00	
	MASRAF AL RAYAN	26,948	34.75	936,443.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	100.00	588,700.00	
	QATAR NATIONAL BANK	11,666	140.60	1,640,239.60	
	QATAR INSURANCE CO	3,555	83.80	297,909.00	
	QATAR INSURANCE CO - RTS	711	31.00	22,041.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	34.30	131,231.80	
	EZDAN HOLDING GROUP	48,549	19.21	932,626.29	
	OOREDOO QSC	7,280	91.00	662,480.00	
	VODAFONE QATAR	19,530	12.58	245,687.40	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	208.50	331,723.50	
カタールリアル 小計		170,647		7,685,370.79 (230,945,392)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,692	77.00	361,284.00	
	SASOL LTD	36,846	447.75	16,497,796.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	397.19	1,267,830.48	

	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,367	215.25	6,105,996.75	
	GOLD FIELDS LTD	64,581	59.56	3,846,444.36	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	60,550	48.40	2,930,620.00	
	MONDI LTD	10,177	275.00	2,798,675.00	
	SAPPI LIMITED	32,518	62.84	2,043,431.12	
	SIBANYE GOLD LTD	42,670	54.51	2,325,941.70	
	BARLOWORLD LTD	12,333	79.58	981,460.14	
	BIDVEST GROUP LTD	19,573	372.50	7,290,942.50	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	176,834	89.39	15,807,191.26	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	25,358	25.60	649,164.80	
	NASPERS LTD-N SHS	25,391	2,088.23	53,022,247.93	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,440	150.00	1,866,000.00	
	MR PRICE GROUP LTD	13,092	194.55	2,547,048.60	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	11,184	148.00	1,655,232.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	23,945	110.00	2,633,950.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	59,347	89.33	5,301,467.51	
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	130.12	1,091,576.68	
	PICK N PAY STORES LTD	18,180	70.30	1,278,054.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,002	169.20	4,230,338.40	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	7,827	211.95	1,658,932.65	
	PIONEER FOODS LTD	8,805	162.99	1,435,126.95	
	TIGER BRANDS LTD	8,940	345.65	3,090,111.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	74,711	38.30	2,861,431.30	
	NETCARE LTD	60,221	36.36	2,189,635.56	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	20,636	330.00	6,809,880.00	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	25,675	143.00	3,671,525.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,222	621.63	2,002,891.86	
	NEDBANK GROUP LTD	14,966	183.96	2,753,145.36	
	STANDARD BANK GROUP LTD	79,862	129.09	10,309,385.58	
	BRAIT SE	20,371	164.70	3,355,103.70	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	75.65	764,367.60	
	FIRSTRAND LTD	211,218	47.34	9,999,060.12	
	INVESTEC LTD	25,827	108.46	2,801,196.42	
	PSG GROUP LTD	8,086	214.00	1,730,404.00	
	REMGRO LTD	27,640	262.39	7,252,459.60	
	RMB HOLDINGS LTD	43,247	59.14	2,557,627.58	

	DISCOVERY LIMITED	21,716	128.49	2,790,288.84	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	142.23	885,523.98	
	MMI HOLDINGS LTD	68,078	24.80	1,688,334.40	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	40,408	42.50	1,717,340.00	
	SANLAM LTD	123,162	68.00	8,375,016.00	
	FORTRESS INCOME FUND LTD	36,400	36.50	1,328,600.00	
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	49,578	16.00	793,248.00	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	10,857	183.00	1,986,831.00	
	MTN GROUP LTD	109,960	144.00	15,834,240.00	
	TELKOM SA LTD	11,353	56.50	641,444.50	
	VODACOM GROUP	21,700	166.00	3,602,200.00	
南アフリカランド 小計		1,865,457		241,418,044.73 (1,842,019,681)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ARABTEC HOLDING CO	248,934	1.73	430,655.82	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	113,289	6.99	791,890.11	
	DUBAI ISLAMIC BANK	31,286	6.11	191,157.46	
	FIRST GULF BANK	49,802	12.95	644,935.90	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	45,082	9.00	405,738.00	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	127,997	1.55	198,395.35	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.75	746,575.50	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	179,643	2.93	526,353.99	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	245,114	6.65	1,630,008.10	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	112,837	18.95	2,138,261.15	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		1,425,466		7,703,971.38 (229,501,307)	
合　計		141,067,565		25,730,360,050 (25,730,360,050)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	793,065.00	
		KLABIN SA-UNIT	28,700	488,474.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	14,318	240,542.40	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	153,375.00	
	ブラジルレアル 小計		96,018	1,675,456.40 (51,788,357)	

投資信託受益証券合計			96,018	51,788,357 (51,788,357)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	141,600	5,676,744.00	
	メキシコペソ 小計		141,600	5,676,744.00 (35,763,487)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	405,533.70	
	トルコリラ 小計		135,630	405,533.70 (15,633,324)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	144,115	3,601,433.85	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,795,230.62	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	324,053	3,946,965.54	
		RESILIENT REIT LTD	13,040	1,799,520.00	
	南アフリカランド 小計		504,131	12,143,150.01 (92,652,234)	
投資証券合計			781,361	144,049,045 (144,049,045)	
合計				195,837,402 (195,837,402)	

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 35銘柄	100.0%	—	—	7.2%
メキシコペソ	株式 26銘柄	96.9%	—	—	4.3%
	投資証券1銘柄	—	—	3.1%	0.1%
ブラジルレアル	株式 56銘柄	97.1%	—	—	6.6%
	投資信託4銘柄 受益証券	—	2.9%	—	0.2%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%	—	—	1.3%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%	—	—	0.6%
トルコリラ	株式 24銘柄	96.4%	—	—	1.6%
	投資証券1銘柄	—	—	3.6%	0.1%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%	—	—	0.3%

ポーランドズロチ	株式　23銘柄	100.0%	―	―	1.4%
香港ドル	株式　140銘柄	100.0%	―	―	21.3%
マレーシアリンギット	株式　44銘柄	100.0%	―	―	3.4%
タイバーツ	株式　31銘柄	100.0%	―	―	2.3%
フィリピンペソ	株式　22銘柄	100.0%	―	―	1.4%
インドネシアルピア	株式　31銘柄	100.0%	―	―	2.6%
韓国ウォン	株式　107銘柄	100.0%	―	―	15.5%
新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	―	―	11.9%
インドルピー	株式　73銘柄	100.0%	―	―	8.3%
カタールリアル	株式　14銘柄	100.0%	―	―	0.9%
南アフリカランド	株式　50銘柄	95.2%	―	―	7.1%
	投資証券4銘柄	―	―	4.8%	0.4%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　10銘柄	100.0%	―	―	0.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	98,042,406
金銭信託	140,894,529
コール・ローン	104,964,152
国債証券	19,252,011,651
未収利息	270,109,119
前払費用	52,609,228
流動資産合計	19,918,631,085
資産合計	19,918,631,085
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,340,313
未払利息	305
その他未払費用	1,208
流動負債合計	16,341,826
負債合計	16,341,826
純資産の部	
元本等	
元本	12,980,032,056
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,922,257,203
元本等合計	19,902,289,259
純資産合計	19,902,289,259
負債純資産合計	19,918,631,085

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	12,980,032,056 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　1.5333 円 (1 万口当たり純資産額)　(15,333 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	10,005,642,596 円
期中追加設定元本額	3,202,499,573 円
期中一部解約元本額	228,110,113 円
期末元本額	12,980,032,056 円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン	3,157,651,668 円
世界経済インデックスファンド	2,022,483,909 円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	2,759,481,616 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,659,155,011 円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,134,030,551 円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	20,785,555 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	50,072,266 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	696,707,848 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	161,544,535 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	99,159,449 円
新興国債券インデックス・オープン	8,724,942 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	210,234,706 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月 20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	537,679,685
合計	537,679,685

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	9,500,000.00	13,359,850.00	
		MBONO 10% 12/05/24	26,450,000.00	34,171,151.75	
		MBONO 4.75% 06/14/18	23,200,000.00	23,350,220.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	3,900,000.00	3,880,597.50	
		MBONO 5% 06/15/17	11,200,000.00	11,319,112.00	
		MBONO 5% 12/11/19	15,800,000.00	15,834,128.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	18,000,000.00	19,000,980.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	19,500,000.00	20,574,157.50	
		MBONO 7.5% 06/03/27	10,650,000.00	11,975,073.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	12,450,000.00	14,274,174.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	14,900,000.00	17,227,752.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	10,850,000.00	12,466,216.00	
		MBONO 7.75% 12/14/17	18,900,000.00	20,006,311.50	
		MBONO 8.5% 05/31/29	10,100,000.00	12,263,016.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	11,900,000.00	14,767,900.00	
		MBONO 8.5% 12/13/18	30,600,000.00	33,563,916.00	
		MBONO 8% 06/11/20	13,100,000.00	14,535,432.50	
		MBONO 8% 12/07/23	13,700,000.00	15,690,747.00	
	メキシコペソ 小計		274,700,000.00	308,260,735.25	

				(1,942,042,632)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/18	5,350,000.00	4,366,322.25	
		BLTN 0% 01/01/19	8,800,000.00	6,374,007.20	
		BLTN 0% 07/01/17	9,300,000.00	8,038,278.30	
		BLTN 0% 07/01/18	9,100,000.00	7,002,795.80	
		BLTN 0% 07/01/19	9,350,000.00	6,372,155.90	
		BLTN 0% 10/01/17	1,850,000.00	1,552,692.05	
		BNTNF 10% 01/01/18	1,500,000.00	1,444,858.70	
		BNTNF 10% 01/01/19	5,950,000.00	5,622,697.27	
		BNTNF 10% 01/01/21	10,650,000.00	9,691,118.07	
		BNTNF 10% 01/01/23	7,200,000.00	6,331,601.79	
		BNTNF 10% 01/01/25	7,750,000.00	6,649,074.81	
		BNTNF 10% 01/01/27	1,100,000.00	923,148.74	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	700,000.00	611,187.50	
		BRAZIL 12.5% 01/05/22	450,000.00	463,781.25	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	300,000.00	252,937.50	
	ブラジルレアル 小計		79,350,000.00	65,696,657.13 (2,030,683,671)	
	チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	100,000,000.00	105,026,000.00	
	チリペソ 小計		100,000,000.00	105,026,000.00 (17,350,295)	
	コロンビアペソ	COLOM 4.375% 03/21/23	10,950,000,000.00	9,152,064,750.00	
		COLOM 7.75% 04/14/21	16,500,000,000.00	16,774,395,000.00	
		COLOM 9.85% 06/28/27	6,830,000,000.00	7,840,361,900.00	
	コロンビアペソ 小計		34,280,000,000.00	33,766,821,650.00 (1,273,009,176)	
	ペルーヌエボソル	PERUGB 5.2% 09/12/23	1,500,000.00	1,437,630.00	
		PERUGB 5.7% 08/12/24	1,650,000.00	1,632,741.00	
		PERUGB 6.9% 08/12/37	1,500,000.00	1,492,852.50	
		PERUGB 6.95% 08/12/31	1,800,000.00	1,854,774.00	
		PERUGB 7.84% 08/12/20	1,600,000.00	1,753,248.00	
		PERUGB 8.2% 08/12/26	2,350,000.00	2,703,534.00	
	ペルーヌエボソル 小計		10,400,000.00	10,874,779.50 (365,392,591)	
	トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	2,800,000.00	3,001,306.00	
		TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	2,795,715.00	

		TURKGB 10.5% 01/15/20	1,900,000.00	1,996,035.50	
		TURKGB 6.3% 02/14/18	3,100,000.00	2,961,585.00	
		TURKGB 7.1% 03/08/23	3,850,000.00	3,461,939.25	
		TURKGB 7.4% 02/05/20	3,850,000.00	3,653,919.50	
		TURKGB 8.3% 06/20/18	3,250,000.00	3,205,702.50	
		TURKGB 8.5% 07/10/19	4,200,000.00	4,144,119.00	
		TURKGB 8.5% 09/14/22	3,350,000.00	3,260,605.25	
		TURKGB 8.8% 09/27/23	2,950,000.00	2,901,738.00	
		TURKGB 8.8% 11/14/18	3,100,000.00	3,088,344.00	
		TURKGB 8% 03/12/25	4,400,000.00	4,109,358.00	
		TURKGB 9.4% 07/08/20	4,900,000.00	4,971,417.50	
		TURKGB 9.5% 01/12/22	3,000,000.00	3,057,900.00	
		TURKGB 9% 07/24/24	2,700,000.00	2,683,597.50	
	トルコリラ 小計		50,050,000.00	49,293,282.00 (1,900,256,021)	
	ハンガリーフォリント	HGB 2.5% 06/22/18	142,000,000.00	145,834,710.00	
		HGB 3.5% 06/24/20	244,000,000.00	261,250,800.00	
		HGB 3% 06/26/24	128,000,000.00	131,066,240.00	
		HGB 4% 04/25/18	220,000,000.00	232,420,100.00	
		HGB 5.5% 06/24/25	248,000,000.00	303,269,280.00	
		HGB 5.5% 12/20/18	170,000,000.00	188,478,150.00	
		HGB 6.0% 11/24/23	260,600,000.00	323,636,534.00	
		HGB 6.5% 06/24/19	362,000,000.00	418,464,760.00	
		HGB 6.75% 11/24/17	95,000,000.00	103,816,475.00	
		HGB 7.5% 11/12/20	224,000,000.00	278,980,800.00	
		HGB 7% 06/24/22	228,700,000.00	291,219,719.00	
	ハンガリーフォリント 小計		2,322,300,000.00	2,678,437,568.00 (1,071,910,714)	
	ポーランドズロチ	POLGB 0% 07/25/17	1,250,000.00	1,228,812.50	
		POLGB 0% 10/25/18	1,300,000.00	1,250,021.50	
		POLGB 1.5% 04/25/20	4,100,000.00	4,023,207.00	
		POLGB 2.5% 07/25/18	5,400,000.00	5,515,992.00	
		POLGB 2.5% 07/25/26	3,550,000.00	3,412,384.25	
		POLGB 2% 04/25/21	5,400,000.00	5,335,632.00	
		POLGB 3.25% 07/25/19	4,850,000.00	5,084,982.50	
		POLGB 3.25% 07/25/25	5,200,000.00	5,382,416.00	

		POLGB 3.75% 04/25/18	4,750,000.00	4,962,681.25	
		POLGB 4% 10/25/23	5,700,000.00	6,229,330.50	
		POLGB 5.25% 10/25/17	5,250,000.00	5,550,142.50	
		POLGB 5.25% 10/25/20	4,650,000.00	5,293,048.50	
		POLGB 5.5% 10/25/19	3,700,000.00	4,165,608.00	
		POLGB 5.75% 09/23/22	4,250,000.00	5,080,768.75	
		POLGB 5.75% 10/25/21	3,050,000.00	3,589,270.50	
	ポーランドズロチ 小計		62,400,000.00	66,104,297.75 (1,907,108,990)	
	ロシアルーブル	RFLB 6.2% 01/31/18	32,000,000.00	30,538,560.00	
		RFLB 6.4% 05/27/20	56,000,000.00	51,147,880.00	
		RFLB 6.7% 05/15/19	50,500,000.00	47,283,402.50	
		RFLB 6.8% 12/11/19	46,200,000.00	43,027,677.00	
		RFLB 7.05% 01/19/28	62,300,000.00	53,866,760.50	
		RFLB 7.4% 06/14/17	21,000,000.00	20,607,720.00	
		RFLB 7.5% 02/27/19	32,500,000.00	31,197,887.50	
		RFLB 7.5% 03/15/18	14,300,000.00	13,927,342.00	
		RFLB 7.6% 04/14/21	35,000,000.00	33,122,600.00	
		RFLB 7.6% 07/20/22	40,000,000.00	37,242,800.00	
		RFLB 7% 01/25/23	42,700,000.00	38,440,034.50	
		RFLB 7% 08/16/23	69,500,000.00	62,260,185.00	
		RFLB 8.15% 02/03/27	59,000,000.00	55,828,160.00	
		RUSSIA 7.85% 03/10/18	85,000,000.00	82,952,775.00	
	ロシアルーブル 小計		646,000,000.00	601,443,784.00 (992,382,243)	
	マレーシアリンギット	MGS 3.26% 03/01/18	2,400,000.00	2,409,696.00	
		MGS 3.314% 10/31/17	3,170,000.00	3,190,129.50	
		MGS 3.418% 08/15/22	3,100,000.00	3,053,035.00	
		MGS 3.48% 03/15/23	3,150,000.00	3,095,725.50	
		MGS 3.492% 03/31/20	2,850,000.00	2,854,303.50	
		MGS 3.58% 09/28/18	4,950,000.00	4,993,980.75	
		MGS 3.654% 10/31/19	2,800,000.00	2,825,480.00	
		MGS 3.659% 10/15/20	3,400,000.00	3,434,221.00	
		MGS 3.733% 06/15/28	1,050,000.00	1,007,926.50	
		MGS 3.759% 03/15/19	650,000.00	659,272.25	
		MGS 3.795% 09/30/22	2,200,000.00	2,208,690.00	

		MGS 3.844% 04/15/33	900,000.00	852,502.50	
		MGS 3.889% 07/31/20	1,600,000.00	1,624,280.00	
		MGS 3.892% 03/15/27	2,000,000.00	1,971,050.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	2,000,000.00	2,026,080.00	
		MGS 4.012% 09/15/17	3,150,000.00	3,197,454.75	
		MGS 4.048% 09/30/21	3,050,000.00	3,112,098.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	1,650,000.00	1,622,758.50	
		MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,801,528.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	3,700,000.00	3,786,913.00	
		MGS 4.24% 02/07/18	3,450,000.00	3,521,880.75	
		MGS 4.378% 11/29/19	4,650,000.00	4,804,705.50	
		MGS 4.392% 04/15/26	4,000,000.00	4,131,840.00	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,930,000.00	3,038,966.70	
		MGS 5.734% 07/30/19	2,150,000.00	2,308,143.25	
	マレーシアリンギット 小計		68,650,000.00	69,532,660.95 (1,969,164,958)	
	タイバーツ	THAIGB 2.55% 06/26/20	31,000,000.00	32,430,030.00	
		THAIGB 2.8% 10/10/17	20,000,000.00	20,434,800.00	
		THAIGB 3.25% 06/16/17	51,200,000.00	52,391,168.00	
		THAIGB 3.45% 03/08/19	13,000,000.00	13,773,565.00	
		THAIGB 3.58% 12/17/27	18,500,000.00	21,983,735.00	
		THAIGB 3.625% 06/16/23	59,000,000.00	67,322,540.00	
		THAIGB 3.65% 12/17/21	82,800,000.00	92,584,890.00	
		THAIGB 3.85% 12/12/25	41,900,000.00	49,965,959.50	
		THAIGB 3.875% 06/13/19	93,700,000.00	100,991,265.50	
		THAIGB 4.875% 06/22/29	57,550,000.00	77,784,867.75	
		THAIGB 5.125% 03/13/18	37,000,000.00	39,613,495.00	
	タイバーツ 小計		505,650,000.00	569,276,315.75 (1,781,834,868)	
	フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	10,000,000.00	9,911,150.00	
		PHILIP 4.95% 01/15/21	5,000,000.00	5,235,000.00	
		PHILIP 6.25% 01/14/36	10,000,000.00	11,271,550.00	
	フィリピンペソ 小計		25,000,000.00	26,417,700.00 (62,609,949)	
	インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	6,300,000,000.00	7,829,703,000.00	
		INDOGB 10% 07/15/17	2,500,000,000.00	2,596,700,000.00	

		INDOGB 11% 09/15/25	5,200,000,000.00	6,401,590,000.00	
		INDOGB 11% 11/15/20	4,100,000,000.00	4,690,830,500.00	
		INDOGB 12.8% 06/15/21	5,700,000,000.00	7,032,261,000.00	
		INDOGB 5.25% 05/15/18	5,900,000,000.00	5,702,674,500.00	
		INDOGB 5.625% 05/15/23	5,500,000,000.00	4,962,237,500.00	
		INDOGB 6.125% 05/15/28	11,000,000,000.00	9,714,925,000.00	
		INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	21,583,080,000.00	
		INDOGB 7.875% 04/15/19	14,800,000,000.00	15,054,782,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/22	8,000,000,000.00	7,851,600,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	6,000,000,000.00	5,768,880,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	7,200,000,000.00	7,614,108,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	12,300,000,000.00	12,930,867,000.00	
		INDOGB 8.25% 07/15/21	17,000,000,000.00	17,749,955,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	37,500,000,000.00	39,642,937,500.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	13,600,000,000.00	14,510,180,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	16,100,000,000.00	17,247,769,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	8,400,000,000.00	9,757,188,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	24,000,000,000.00	26,662,440,000.00	
	インドネシアルピア 小計		235,100,000,000.00	245,304,708,000.00 (2,036,029,076)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	35,800,000.00	39,717,057.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	20,900,000.00	14,980,493.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	18,200,000.00	12,954,032.00	
		SAGB 6.75% 03/31/21	15,700,000.00	14,605,082.00	
		SAGB 7.25% 01/15/20	18,600,000.00	17,937,840.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	15,200,000.00	14,443,800.00	
		SAGB 7% 02/28/31	22,500,000.00	18,394,875.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	15,000,000.00	13,597,050.00	
		SAGB 8.25% 09/15/17	13,600,000.00	13,676,296.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	20,900,000.00	18,933,728.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	15,750,000.00	14,402,823.75	
		SAGB 8.75% 02/28/48	21,400,000.00	19,534,883.00	
		SAGB 8% 01/31/30	22,150,000.00	20,003,554.25	
		SAGB 8% 12/21/18	16,200,000.00	16,128,639.00	
	南アフリカランド 小計		271,900,000.00	249,310,153.00 (1,902,236,467)	

合計		19,252,011,651 (19,252,011,651)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　18銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券　15銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	6.6%
ペルーヌエボソル	国債証券　6銘柄	100.0%	1.9%
トルコリラ	国債証券　15銘柄	100.0%	9.9%
ハンガリーフォリント	国債証券　11銘柄	100.0%	5.6%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	9.9%
ロシアルーブル	国債証券　14銘柄	100.0%	5.2%
マレーシアリンギット	国債証券　25銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券　11銘柄	100.0%	9.3%
フィリピンペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券　20銘柄	100.0%	10.6%
南アフリカランド	国債証券　14銘柄	100.0%	9.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	241,331,069
コール・ローン	179,787,754
投資証券	65,377,993,900
派生商品評価勘定	4,724,000
未収入金	30,716,949
未収配当金	414,311,387
差入委託証拠金	36,259,600
流動資産合計	66,285,124,659
資産合計	66,285,124,659
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	135,000
前受金	4,589,000
未払金	3,894,330
未払解約金	75,777,171
未払利息	523
その他未払費用	1,980
流動負債合計	84,398,004
負債合計	84,398,004
純資産の部	
元本等	
元本	40,954,741,543
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	25,245,985,112
元本等合計	66,200,726,655
純資産合計	66,200,726,655
負債純資産合計	66,285,124,659

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	40,954,741,543 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　1.6164 円 (1 万口当たり純資産額)　(16,164 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
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コンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	42,967,582,102 円
期中追加設定元本額	2,722,471,212 円
期中一部解約元本額	4,735,311,771 円
期末元本額	40,954,741,543 円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,586,081,594 円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,282,539 円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	8,263,600,502 円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	19,708,419,209 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,850,601,502 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,605,269,737 円
分散投資コア戦略ファンドＡ	499,586,137 円
分散投資コア戦略ファンドＳ	985,115,486 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	473,094,200 円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	310,584,635 円

ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	32,907,605円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	911,623,378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）	714,575,019円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	5,855,959,123
合計	5,855,959,123

(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

（平成28年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	700,223,500	－	704,812,500	4,589,000
合計		700,223,500	－	704,812,500	4,589,000

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,701	1,270,820,500	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	1,483	524,982,000	
	森ヒルズリート投資法人	9,760	1,531,344,000	
	産業ファンド投資法人	1,965	994,290,000	
	大和ハウスリート投資法人	1,955	1,083,070,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,247	2,019,738,900	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1,946	578,740,400	

	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,343	1,892,138,000	
	ＧＬＰ投資法人	14,461	1,858,238,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,863	684,543,300	
	日本プロロジスリート投資法人	10,239	2,634,494,700	
	星野リゾート・リート投資法人	435	587,685,000	
	ＳＩＡ不動産投資法人	419	174,932,500	
	イオンリート投資法人	7,300	982,580,000	
	ヒューリックリート投資法人	5,289	973,176,000	
	日本リート投資法人	2,184	620,692,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	3,023	304,416,100	
	日本ヘルスケア投資法人	416	80,745,600	
	積水ハウス・リート投資法人	4,427	571,083,000	
	トーセイ・リート投資法人	898	107,311,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,981	550,321,800	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	672	72,576,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	911	86,909,400	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	472	77,927,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	20,751	3,374,112,600	
	いちごホテルリート投資法人	772	125,758,800	
	ラサールロジポート投資法人	6,132	635,275,200	
	日本ビルファンド投資法人	7,872	5,282,112,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	7,300	4,774,200,000	
	日本リテールファンド投資法人	14,229	3,736,535,400	
	オリックス不動産投資法人	13,471	2,388,408,300	
	日本プライムリアルティ投資法人	4,867	2,292,357,000	
	プレミア投資法人	7,342	1,031,551,000	
	東急リアル・エステート投資法人	5,450	844,750,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,080	471,960,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	15,339	2,771,757,300	
	森トラスト総合リート投資法人	7,358	1,496,617,200	
	インヴィンシブル投資法人	20,365	1,633,273,000	
	フロンティア不動産投資法人	2,765	1,473,745,000	
	平和不動産リート投資法人	5,658	499,601,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,906	1,163,212,600	
	福岡リート投資法人	4,164	796,989,600	

	ケネディクス・オフィス投資法人	2,257	1,446,737,000	
	積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人	5,676	661,254,000	
	いちごオフィスリート投資法人	7,895	691,602,000	
	大和証券オフィス投資法人	2,698	1,826,546,000	
	阪急リート投資法人	3,331	454,348,400	
	スターツプロシード投資法人	969	168,799,800	
	トップリート投資法人	981	413,001,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,169	1,067,680,900	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	18,520	1,768,660,000	
	日本賃貸住宅投資法人	9,143	760,697,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	7,049	1,063,694,100	
合計		298,899	65,377,993,900	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	253,573,962
金銭信託	27,794,962
コール・ローン	20,706,798
投資証券	57,895,438,933
未収入金	2,405,236
未収配当金	51,991,940
流動資産合計	58,251,911,831
資産合計	58,251,911,831
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	78,840
未払解約金	94,254,546
未払利息	60
その他未払費用	323

流動負債合計	94,333,769
負債合計	94,333,769
純資産の部	
元本等	
元本	36,056,842,267
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,100,735,795
元本等合計	58,157,578,062
純資産合計	58,157,578,062
負債純資産合計	58,251,911,831

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成 28 年 4 月 20 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	36,056,842,267 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　1.6129 円 (1 万口当たり純資産額)　(16,129 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成28年 4月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年10月21日
期首元本額	35,702,044,256円
期中追加設定元本額	1,946,677,396円
期中一部解約元本額	1,591,879,385円
期末元本額	36,056,842,267円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	241,166,679円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,501,032,861円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	11,564,849円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	7,996,954,119円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	17,821,221,368円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,251,950,310円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,789,123,254円
分散投資コア戦略ファンドＡ	333,599,182円
分散投資コア戦略ファンドＳ	667,033,112円
コア投資戦略ファンド（切替型）	298,466,924円
グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	39,612,834円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	161,902,055円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,155,939,861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）	319,187,511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）	468,087,348円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	3,875,693,303
合計	3,875,693,303

(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

（平成28年 4月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	70,368,760	－	70,447,600	△78,840
	アメリカドル	53,479,100	－	53,503,100	△24,000
	ユーロ	6,170,200	－	6,203,000	△32,800
	オーストラリアドル	5,936,000	－	5,957,700	△21,700

	香港ドル	4,783,460	－	4,783,800	△340
合計		70,368,760	－	70,447,600	△78,840

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	36,860	1,249,554.00	
		AGREE REALTY CORP	8,660	346,833.00	
		ALEXANDER'S INC	1,860	727,762.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37,210	3,490,670.10	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,930	806,851.50	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	66,340	3,022,450.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	95,850	1,533,600.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	77,680	3,177,112.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,000	1,466,800.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	15,370	175,679.10	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	9,433	103,291.35	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	278,481.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	68,760	12,625,711.20	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	102,330.00	
		BOSTON PROPERTIES	76,230	9,996,802.20	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	85,540	1,226,643.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	85,000	2,182,800.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	42,910	3,527,631.10	
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	42,195	1,113,948.00	
		CARETRUST REIT INC	29,800	385,016.00	

		CBL & ASSOCIATES PRTYS	74,960	920,508.80	
		CEDAR REALTY TRUST INC	31,950	223,650.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	18,110	395,341.30	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	28,200	712,896.00	
		CITY OFFICE REIT INC	8,000	89,520.00	
		COLONY STARWOOD HOMES	16,610	416,911.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	63,210	1,377,978.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	3,600	65,484.00	
		CORESITE REALTY CORP	15,890	1,150,753.80	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	47,640	1,263,889.20	
		CORRECTIONS CORP OF AMERICA	59,430	1,889,874.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	96,810	1,012,632.60	
		CUBESMART	84,350	2,633,407.00	
		CYRUSONE INC	35,750	1,577,290.00	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	45,147	1,823,938.80	
		DDR CORPORATION	155,260	2,768,285.80	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	95,700	896,709.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	72,560	6,436,797.60	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	71,870	2,293,371.70	
		DUKE REALTY CORP	172,200	3,855,558.00	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	37,220	1,554,307.20	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,000	93,100.00	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	16,180	991,510.40	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	31,686	1,281,381.84	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	60,390	1,106,948.70	
		EPR PROPERTIES	32,500	2,178,150.00	
		EQUITY COMMONWEALTH	63,470	1,787,949.90	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,830	2,896,835.90	
		EQUITY ONE INC	46,790	1,328,836.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	183,240	13,147,470.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	32,810	7,522,348.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	62,490	5,502,244.50	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,960	5,432,434.40	
		FELCOR LODGING TRUST INC	64,920	515,464.80	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	53,470	1,229,275.30	
		FIRST POTOMAC REALTY TRUST	26,460	228,085.20	

		FOREST CITY REALTY TRUST-A	108,000	2,268,000.00	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	25,966	474,658.48	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	44,030	489,173.30	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	48,520	1,628,331.20	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	291,980	8,584,212.00	
		GEO GROUP INC/THE	38,400	1,300,608.00	
		GETTY REALTY CORP	13,132	267,761.48	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,150	171,129.00	
		GLOBAL NET LEASE INC	81,000	704,700.00	
		GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	33,380	633,552.40	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	216,780	1,866,475.80	
		HCP INC	233,050	8,212,682.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	51,720	1,602,802.80	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	64,290	1,884,982.80	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	23,920	495,383.20	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	47,360	2,268,070.40	
		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	74,100	2,031,081.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	379,400	6,017,284.00	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	34,600	1,013,780.00	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	10,525	77,148.25	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	63,890	461,285.80	
		IRON MOUNTAIN INC	95,550	3,345,205.50	
		KILROY REALTY CORPORATION	46,410	2,964,670.80	
		KIMCO REALTY CORP	207,940	5,959,560.40	
		KITE REALTY GROUP TRUST	43,870	1,234,940.50	
		LASALLE HOTEL PROPERTIES	55,810	1,386,320.40	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	100,610	904,483.90	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	73,920	2,569,459.20	
		LTC PROPERTIES INC	19,390	911,911.70	
		MACERICH CO/THE	63,640	5,004,013.20	
		MACK-CALI REALTY CORP	44,340	1,086,330.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	114,010	1,527,734.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,840	3,748,052.00	
		MONMOUTH REIT -CL A	26,640	312,220.80	
		MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	83,560	858,996.80	

		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	70,880	3,277,491.20	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,000	209,100.00	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	16,120	1,109,539.60	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	436,000.00	
		NEW YORK REIT INC	77,160	767,742.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	10,000	143,100.00	
		NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	29,946	358,453.62	
		NORTHSTAR REALTY FINANCE	89,840	1,181,396.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	83,136	2,973,774.72	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,700	106,596.00	
		PARKWAY PROPERTIES INC	43,110	663,462.90	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,020	952,219.80	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	34,470	781,434.90	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	54,870	1,029,909.90	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	73,440	1,479,816.00	
		POST PROPERTIES	27,480	1,608,404.40	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,500	96,375.00	
		PROLOGIS INC	262,460	12,015,418.80	
		PS BUSINESS PARKS INC	9,310	917,966.00	
		PUBLIC STORAGE	73,470	19,357,875.60	
		QTS REALTY TRUST INC	20,370	1,017,277.80	
		RAMCO-GERSHENSON PRTYS	39,850	720,886.50	
		REALTY INCOME CORP	126,060	7,978,337.40	
		REGENCY CENTERS CORP	49,420	3,710,453.60	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51,200	1,004,032.00	
		RETAIL PROPERTISE OF AME-A	119,800	1,982,690.00	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	26,000	488,280.00	
		RLJ LODGING TRUST	64,470	1,443,483.30	
		ROUSE PROPERTIES INC	16,050	294,196.50	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25,470	1,325,204.10	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,810	621,745.80	
		SAUL CENTERS INC	5,300	278,833.00	
		SELECT INCOME REIT	29,920	707,308.80	
		SENIOR HOUSING PROP TRUST	117,760	2,183,270.40	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,000	375,200.00	

		SILVER BAY REALTY TRUST CORP	17,380	250,619.60	
		SIMON PROPERTY GROUP	154,900	32,259,474.00	
		SL GREEN REALTY CORP	49,900	5,107,764.00	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	19,700	2,211,325.00	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	214,720	2,480,016.00	
		STAG INDUSTRIAL INC	31,380	649,566.00	
		STORE CAPITAL CORP	52,200	1,406,790.00	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	40,380	464,370.00	
		SUN COMMUNITIES INC	32,680	2,281,064.00	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	108,180	1,455,021.00	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	46,710	1,738,546.20	
		TAUBMAN CENTERS INC	29,420	2,077,640.40	
		TERRENO REALTY CORP	22,010	503,588.80	
		UDR INC	134,990	4,966,282.10	
		UMH PROPERTIES INC	7,500	74,550.00	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,790	321,287.10	
		URBAN EDGE PROPERTIES	45,685	1,162,683.25	
		URSTADT BIDDLE - CL A	12,770	267,276.10	
		VENTAS INC	168,170	10,751,108.10	
		VEREIT INC	450,960	4,144,322.40	
		VORNADO REALTY TRUST	88,870	8,536,852.20	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	35,280	1,040,054.40	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	55,350	2,085,034.50	
		WELLTOWER INC	177,530	12,663,214.90	
		WHITESTONE REIT	13,600	178,024.00	
		WINTHROP REALTY TRUST	18,000	227,340.00	
		WP CAREY INC	48,280	3,009,292.40	
		WP GLIMCHER INC	88,540	894,254.00	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,380	848,975.40	
	アメリカドル 小計		9,835,691	378,061,719.29 (41,284,339,746)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	18,690	644,057.40	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	34,460	463,142.40	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,110	622,937.70	
		BROOKFIELD CANADA OFFICE	7,307	205,984.33	

		PROPERTIES			
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	31,990	958,100.50	
		CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	18,630	838,350.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	25,030	316,128.90	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	40,590	710,325.00	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,050	256,129.50	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	209,218.00	
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	24,400	217,404.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	13,650	110,292.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	25,290	532,860.30	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,010	400,653.90	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	68,620	1,500,719.40	
		INNVEST REAL ESTATE INVESTME	24,590	127,376.20	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	82,610.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,000	215,460.00	
		MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	17,470	294,194.80	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	93,575.40	
		MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	13,580	196,231.00	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	11,403	219,279.69	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	13,390	125,196.50	
		ONEREIT	25,000	84,250.00	
		PLAZA RETAIL REIT	15,650	74,337.50	
		PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	44,240	221,200.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	80,320	2,216,832.00	
		SLATE RETAIL REIT	7,000	94,150.00	
		SMART REAL ESTATE INVWSTMENT	33,110	1,131,037.60	
	カナダドル 小計		686,070	13,162,034.02 (1,131,934,925)	
	ユーロ	AEDIFICA	7,350	449,746.50	
		AFFINE	3,000	50,790.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT -AG	51,000	632,655.00	
		ALTAREA	1,000	188,200.00	

		ANF IMMOBILIER	3,270	79,134.00	
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	29,010	380,031.00	
		BEFIMMO S.C.A.	10,220	585,912.60	
		BENI STABILI SPA	547,000	358,285.00	
		COFINIMMO	10,210	1,105,743.00	
		EUROCOMMERCIAL	24,400	1,014,308.00	
		FONCIERE DES MURS	4,000	114,400.00	
		FONCIERE DES REGIONS	22,170	1,876,468.80	
		GECINA SA	18,270	2,291,971.50	
		GREEN REIT PLC	337,170	476,421.21	
		HAMBORNER REIT AG	32,440	318,041.76	
		HIBERNIA REIT PLC	358,290	463,268.97	
		ICADE	17,970	1,205,247.90	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	157,540	124,062.75	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	3,900	97,851.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	160,000	178,400.00	
		KLEPIERRE	93,350	4,010,316.00	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	27,510	240,987.60	
		MERCIALYS	9,620	192,496.20	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	153,000	1,512,864.00	
		NSI NV	65,000	272,090.00	
		RETAIL ESTATES	2,600	204,100.00	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	48,980	11,845,813.00	
		VASTNED RETAIL	9,340	373,039.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,020	575,569.80	
		WERELDHAVE BELGIUM	1,000	113,000.00	
		WERELDHAVE NV	20,400	992,052.00	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	1,800	56,700.00	
	ユーロ 小計		2,237,830	32,379,967.19 (4,017,058,729)	
	イギリスポンド	ASSURA PLC	814,900	464,085.55	
		BIG YELLOW GROUP PLC	72,640	557,512.00	
		BRITISH LAND CO PLC	511,750	3,610,396.25	
		DERWENT LONDON PLC	55,300	1,789,508.00	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	175,000	197,750.00	

		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	171,520	1,272,678.40	
		HAMMERSON PLC	397,840	2,319,407.20	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	353,580	377,977.02	
		INTU PROPERTIES PLC	416,110	1,241,256.13	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	398,770	4,402,420.80	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	326,380	528,409.22	
		MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	92,723.44	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	206,040	213,251.40	
		REDEFINE INTERNATIONAL PLC	692,000	323,025.60	
		REGIONAL REIT LTD	92,000	97,520.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	101,990	345,746.10	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	250,000	148,750.00	
		SEGRO PLC	374,440	1,578,264.60	
		SHAFTESBURY PLC	137,850	1,232,379.00	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	418,110	557,340.63	
		WORKSPACE GROUP PLC	59,490	476,514.90	
	イギリスポンド 小計		6,065,677	21,826,916.24 (3,429,881,617)	
	オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	105,050.00	
		360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000	45,980.00	
		ABACUS PROPERTY GROUP	122,010	380,671.20	
		ALE PROPERTY GROUP	77,000	321,860.00	
		ARENA REIT	114,000	221,730.00	
		ASPEN GROUP	70,000	78,050.00	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	136,593.20	
		BWP TRUST	232,960	801,382.40	
		CHARTER HALL GROUP	164,920	771,825.60	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	179,170	843,890.70	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	591,940	586,020.60	
		DEXUS PROPERTY GROUP	487,000	3,920,350.00	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	103,800	252,234.00	
		GALILEO JAPAN TRUST	40,590	97,416.00	
		GDI PROPERTY GROUP	216,488	182,932.36	
		GOODMAN GROUP	797,520	5,423,136.00	
		GPT GROUP	906,710	4,497,281.60	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	85,200	270,084.00	

		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	217,620.00	
		INDUSTRIA REIT	36,000	74,160.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	66,666	183,331.50	
		INVESTA OFFICE FUND	297,190	1,206,591.40	
		MIRVAC GROUP	1,832,190	3,581,931.45	
		NATIONAL STORAGE REIT	163,217	266,859.79	
		SCENTRE GROUP	2,675,790	12,308,634.00	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	385,170	882,039.30	
		STOCKLAND	1,195,140	5,222,761.80	
		VICINITY CENTERS	1,621,280	5,334,011.20	
		WESTFIELD CORP	958,430	9,766,401.70	
	オーストラリアドル 小計		13,652,201	57,980,829.80 (4,935,328,232)	
	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	415,000	498,000.00	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	535,000	716,900.00	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	662,000	973,140.00	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	460,000	602,600.00	
		PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	220,000	372,900.00	
		STRIDE PROPERTY LTD	174,000	394,110.00	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	127,460	272,127.10	
	ニュージーランドドル 小計		2,593,460	3,829,777.10 (293,284,330)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	1,101,000	4,558,140.00	
		FORTUNE REIT	697,000	5,952,380.00	
		LINK REIT	1,116,500	53,368,700.00	
		NEW CENTURY REIT	215,000	580,500.00	
		PROSPERITY REIT	592,000	1,764,160.00	
		REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	447,000	898,470.00	
		SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	393,000	1,285,110.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	562,000	2,304,200.00	
		YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	459,000	1,950,750.00	
	香港ドル 小計		5,582,500	72,662,410.00 (1,023,086,732)	
	シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	280,000	379,400.00	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	450,000	306,000.00	

		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,156,266	2,913,790.32	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	421,000	471,520.00	
		CACHE LOGISTICS TRUST	402,000	353,760.00	
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	521,000	283,945.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	989,400	1,419,789.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,356,200	2,888,706.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	356,560	518,794.80	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	339,000	477,990.00	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	389,000	256,740.00	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	288,000	362,880.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	264,000	535,920.00	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	305,600	398,808.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	280,000	226,800.00	
		KEPPEL DC REIT	450,000	488,250.00	
		KEPPEL REIT	827,000	831,135.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	884,000	291,720.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	629,000	937,210.00	
		MAPLETREE GREATER CHINA COM	911,000	892,780.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	574,160	941,622.40	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	803,920	832,057.20	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	240,000	156,000.00	
		OUE HOSPITALITY TRUST	532,000	367,080.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	198,000	491,040.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REI	337,000	215,680.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	292,000	216,080.00	
		SPH REIT	375,000	356,250.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	700,000	553,000.00	
		SUNTEC REIT	1,278,000	2,178,990.00	
	シンガポールドル 小計		16,829,106	21,543,737.72 (1,757,322,685)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	72,370	798,964.80	
	イスラエルシェケル 小計		72,370	798,964.80 (23,201,937)	

合計	57,554,905	57,895,438,933 (57,895,438,933)	

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%	71.3%
カナダドル	投資証券　29銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券　32銘柄	100.0%	6.9%
イギリスポンド	投資証券　21銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券　29銘柄	100.0%	8.5%
ニュージーランドドル	投資証券　7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券　9銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券　30銘柄	100.0%	3.0%
イスラエルシェケル	投資証券　1銘柄	100.0%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	平成28年4月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	18,596,780
金銭信託	729,292
コール・ローン	543,311
投資証券	370,862,975
流動資産合計	390,732,358
資産合計	390,732,358
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	540
未払解約金	534,431
未払利息	1
その他未払費用	7
流動負債合計	534,979
負債合計	534,979
純資産の部	
元本等	
元本	468,034,903
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△77,837,524
元本等合計	390,197,379
純資産合計	390,197,379
負債純資産合計	390,732,358

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成 28 年 4 月 20 日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		468,034,903 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	77,837,524 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	0.8337 円
	(1 万口当たり純資産額)	(8,337 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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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

	平成 28 年 4 月 20 日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なること

	もあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	平成 28 年 4 月 20 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成 27 年 10 月 21 日
期首元本額	340,654,395 円
期中追加設定元本額	138,791,168 円
期中一部解約元本額	11,410,660 円
期末元本額	468,034,903 円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,209,061 円
ＳＭＴ　新興国ＲＥＩＴインデックス・オープン	271,825,842 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成 28 年 4 月 20 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	24,841,107
合計	24,841,107

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国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

（平成 28 年 4 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち 1 年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	566,640	－	566,100	△540
	メキシコペソ	566,640	－	566,100	△540
合計		566,640	－	566,100	△540

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	ASESOR DE ACTIVOS PRISMA SAP	31,700	440,630.00	
		CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	73,400	2,767,914.00	
		CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA	47,700	786,573.00	
		FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOB	35,000	598,500.00	
		FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	253,300	10,154,797.00	
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	75,200	1,816,832.00	
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	58,800	1,819,272.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	26,300	724,302.00	
	メキシコペソ 小計		601,400	19,108,820.00 (120,385,566)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	185,590	554,914.10	
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	40,550	77,045.00	
		SAF GAYRIMENKUL YATIRIM ORTA	19,530	15,624.00	
		TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	7,600	34,808.00	

	トルコリラ 小計		253,270	682,391.10 (26,306,176)	
	マレーシアリンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	60,900	98,049.00	
		CAPITALAND MALAYSIA MALL TRU	78,900	114,405.00	
		IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	127,800	192,978.00	
		KLCCP STAPLED GROUP	32,100	231,120.00	
		PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	77,600	131,144.00	
		SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	105,200	170,424.00	
	マレーシアリンギット 小計		482,500	938,120.00 (26,567,558)	
	タイバーツ	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	156,000	3,244,800.00	
		IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	64,300	958,070.00	
		SAMUI AIRPORT PROPERTY FUND	69,800	1,779,900.00	
		TESCO LOTUS RETAIL GROWTH FR	163,800	2,686,320.00	
	タイバーツ 小計		453,900	8,669,090.00 (27,134,251)	
	新台湾ドル	CATHAY NO 1 REIT	111,000	1,910,310.00	
		CATHAY NO 2 REIT	51,000	826,710.00	
	新台湾ドル 小計		162,000	2,737,020.00 (9,278,497)	
	南アフリカランド	DELTA PROPERTY FUND LTD	45,437	290,796.80	
		EMIRA PROPERTY FUND LTD	42,240	672,883.20	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	209,650	5,239,153.50	
		HOSPITALITY PROPERTY FUND-A	11,776	129,536.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	20,040	2,443,677.60	
		OCTODEC INVESTMENTS LTD	17,222	409,883.60	
		REBOSIS PROPERTY FUND LTD	28,384	322,158.40	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	435,360	5,302,684.80	
		RESILIENT REIT LTD	33,510	4,624,380.00	
		SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	164,470	830,573.50	
		VUKILE PROPERTY FUND LTD	50,810	860,213.30	
	南アフリカランド 小計		1,058,899	21,125,940.70 (161,190,927)	
合計			3,011,969	370,862,975 (370,862,975)	

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
メキシコペソ	投資証券　8銘柄	100.0%	32.5%
トルコリラ	投資証券　4銘柄	100.0%	7.1%
マレーシアリンギット	投資証券　6銘柄	100.0%	7.2%
タイバーツ	投資証券　4銘柄	100.0%	7.3%
新台湾ドル	投資証券　2銘柄	100.0%	2.5%
南アフリカランド	投資証券　11銘柄	100.0%	43.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

(平成28年 5月31日現在)

Ⅰ　資産総額	2,413,938,198円
Ⅱ　負債総額	3,076,904円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,410,861,294円
Ⅳ　発行済口数	2,699,173,272口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8932円
（1万口当たり純資産額）	(8,932円)

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	153,107,565,914円
Ⅱ　負債総額	630,954,630円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	152,476,611,284円
Ⅳ　発行済口数	128,424,405,749口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1873円
（1万口当たり純資産額）	（11,873円）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	328,003,406,065円
Ⅱ　負債総額	7,768,876,170円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	320,234,529,895円
Ⅳ　発行済口数	226,811,550,269口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4119円
（1万口当たり純資産額）	（14,119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

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	268,389,671,099円
Ⅱ　負債総額	1,035,342,920円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	267,354,328,179円
Ⅳ　発行済口数	140,881,003,246口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8977円
（1万口当たり純資産額）	（18,977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

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	213,907,734,105円
Ⅱ　負債総額	31,151,455円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	213,876,582,650円
Ⅳ　発行済口数	80,197,697,759口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6669円
（1万口当たり純資産額）	（26,669円）

新興国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	26,241,513,067円
Ⅱ　負債総額	24,187,532円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,217,325,535円
Ⅳ　発行済口数	12,880,620,499口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0354円
（1万口当たり純資産額）	（20,354円）

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	20,287,229,453円
Ⅱ　負債総額	2,821,517円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,284,407,936円
Ⅳ　発行済口数	13,694,837,653口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4812円
（1万口当たり純資産額）	（14,812円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	74,803,512,195円
Ⅱ　負債総額	403,342,101円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	74,400,170,094円
Ⅳ　発行済口数	45,649,158,476口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6298円
（1万口当たり純資産額）	（16,298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

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	58,639,068,668円
Ⅱ　負債総額	170,309,786円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	58,468,758,882円
Ⅳ　発行済口数	35,867,382,190口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6301円
（1万口当たり純資産額）	（16,301円）

新興国ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（平成 28 年 5 月 31 日現在）

Ⅰ　資産総額	389,341,505円
Ⅱ　負債総額	15,793,045円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	373,548,460円
Ⅳ　発行済口数	487,358,442口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7665円
（1万口当たり純資産額）	（7,665円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成 28 年 5 月 31 日現在）

資本金の額　　：3 億円

発行可能株式総数　：12,000 株

発行済株式総数　　：3,000 株

最近 5 年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役 3 名以上、監査役 2 名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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、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。

監査役の任期は、選任後 4 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。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、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、取締役の中から、会長 1 名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、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、各取締役及び各監査役に対して会日の 3 日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

［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実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

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せています。

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コンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）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。

さらに、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・評価します。この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。

委託会社の機構は平成 28 年 7 月 20 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成 28 年 5 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	458	8,006,481
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	35	156,347
単位型公社債投資信託	0	0
合計	493	8,162,828

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当事業年度（自　平成 27 年 4 月 1 日　至　平成 28 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。

独立監査人の監査報告書

平成 28 年６月３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	白川　芳樹
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

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平成 27 年４月１日から平成 28 年３月 31 日までの第 30 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平成 28 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

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成 27 年 3 月 31 日現在）		当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		12,314,170		16,534,066
前払費用		125,306		102,445
未収委託者報酬		4,518,944		5,528,610
繰延税金資産		116,728		121,367
その他		8,789		5,566
流動資産合計		17,083,939		22,292,056
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	57,461	※1	55,487
器具備品	※1	116,879	※1	90,924
その他		－	※1	3,748
有形固定資産合計		174,341		150,160
無形固定資産				
ソフトウェア		197,641		215,175
その他		7,648		5,886
無形固定資産合計		205,290		221,062
投資その他の資産				
投資有価証券		60,277		63,797
長期前払費用		5,425		8,021
長期貸付金		25,838		22,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		114,415		123,235
その他		463		235
貸倒引当金		△25,838		△22,838
投資その他の資産合計		205,581		220,289
固定資産合計		585,213		591,512
資産合計		17,669,152		22,883,569

（単位：千円）

	前事業年度 （平成 27 年 3 月 31 日現在）	当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975
未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
固定負債		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	－	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	65,500	68,500
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	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,235	△1,151
評価・換算差額等合計	3,235	△1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成26年4月　1日 至　平成27年3月31日）		当事業年度 （自　平成27年4月　1日 至　平成28年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬		28,159,652		32,163,066
運用受託報酬		8,732		－
営業収益合計		28,168,384		32,163,066
営業費用				
支払手数料		12,922,655		14,102,687
広告宣伝費		130,384		126,914
公告費		880		2,765
調査費		5,994,577		6,758,898
調査費		279,702		331,886
委託調査費		5,712,946		6,425,175
図書費		1,928		1,836
営業雑経費		1,299,065		1,399,773
通信費		17,456		17,552
印刷費		330,921		349,902
協会費		23,182		26,659
諸会費		105		105
情報機器関連費		857,009		927,524
その他営業雑経費		70,390		78,029
営業費用合計		20,347,563		22,391,039
一般管理費				
給料		2,185,555		2,123,392
役員報酬		89,055		89,280
給料・手当		1,839,000		1,759,320
賞与		257,499		274,792
退職給付費用		71,270		73,742
福利費		212,286		222,276
交際費		4,491		6,004
旅費交通費		55,788		67,392
租税公課		42,868		73,989
不動産賃借料		130,938		125,339
減価償却費		129,285		126,985
業務委託費	※1	45,054	※1	209,510
諸経費		167,290		217,580
一般管理費合計		3,044,830		3,246,214
営業利益		4,775,990		6,525,812

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成26年4月　1日 至　平成27年3月31日）		当事業年度 （自　平成27年4月　1日 至　平成28年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		6,802		8,092
収益分配金		4,617		2,026
投資有価証券売却益		1,846		350
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,936		5,272
営業外収益合計		18,203		18,742
営業外費用				
長期前払費用償却	※1	27,866	※1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	※2	56,222		－
特別損失合計		56,222		－
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		△11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成 26 年 4 月 1 日　至　平成 27 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			
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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	－	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自　平成 27 年 4 月 1 日　至　平成 28 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			
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	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
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	－	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△4,386	△4,386	△4,386
当期変動額合計	△4,386	△4,386	4,308,177
当期末残高	△1,151	△1,151	17,546,904

重要な会計方針
１．有価証券の評価基準及び評価方法
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．固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定率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。
３．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事業年度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。
４．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。

会計方針の変更
(企業結合に関する会計基準等の適用)
「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第 21 号　平成 25 年９月 13 日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第７号　平成 25 年９月 13 日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当事業年度期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更しております。
企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第 58－２項（４）及び事業分離等会計基準第 57－４項（４）に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。
なお、これによる損益及び１株当たり情報に与える影響はありません。

未適用の会計基準等
・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第 26 号　平成 28 年３月 28 日）
(1)概要
繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第 66 号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を５つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。
①(分類１)から(分類５)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
②(分類２)及び(分類３)に係る分類の要件
③(分類２)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
④(分類３)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
⑤(分類４)に係る分類の要件を満たす企業が（分類２）又は（分類３）に該当する場合の取扱い
(2)適用予定日
平成 29 年３月期の期首より適用予定であります。
(3)当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更
(損益計算書関係)
前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。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っております。
この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた 212,345 千円は、「業務委託費」45,054 千円、「諸経費」167,290 千円として組み替えております。

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 （平成 27 年 3 月 31 日）		当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日）	
建　　物	45,415	千円	54,302	千円
器具備品	218,270	〃	263,257	〃
そ の 他	－	〃	841	〃
計	263,685	〃	318,401	〃

（損益計算書関係）

※1 関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 年 3 月 31 日）		当事業年度 （自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日）	
業務委託費	37,614	千円	39,733	千円
長期前払費用償却	27,866	〃	27,866	〃

※2 外国税関連費用

外国税関連費用 56,222 千円は、中国税務当局等が 平成 26 年 10 月 31 日付に発した「通達 79 号」に基づき、平成 22 年 3 月 23 日から平成 26 年 11 月 16 日までの QFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国 A 株の譲渡所得に対して税率 10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国 A 株に投資している当社の対象ファンドは「中国 A 株 SRI マザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成 26 年 4 月 1 日　至 平成 27 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
平成 26 年 6 月 28 日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成 26 年 3 月 31 日	平成 26 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
平成 27 年 6 月 30 日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成 27 年 3 月 31 日	平成 27 年 6 月 30 日

当事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日　至 平成 28 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
平成 27 年 6 月 30 日定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成 27 年 3 月 31 日	平成 27 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
平成 28 年 6 月 30 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
平成 28 年 6 月 30 日定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成 28 年 3 月 31 日	平成 28 年 6 月 30 日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項
(1) 金融商品に対する取組方針
当社は、資金運用については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、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きわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。
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
①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理
売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、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、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理
有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理
当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

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

前事業年度（平成 27 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	12,314,170	12,314,170	－
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	－
(3) 投資有価証券 その他有価証券	60,274	60,274	－
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	－
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	－

(*) 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（平成 28 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	16,534,066	16,534,066	－
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	－
(3) 投資有価証券 その他有価証券	63,794	63,794	－
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	－
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	－

(*) 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

(1) 現金及び預金、並びに (2) 未収委託者報酬
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。

(3) 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。

(4) 未払金、並びに (5) 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。

(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	平成 27 年 3 月 31 日	平成 28 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、「③投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注 3)　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成 27 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	12,314,170	－	－	－
未収委託者報酬	4,518,944	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	1,576	16,038	－

当事業年度（平成 28 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	16,534,066	－	－	－
未収委託者報酬	5,528,610	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	6,265	17,912	－

（有価証券関係）
１．その他有価証券

前事業年度（平成 27 年 3 月 31 日現在）　（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	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,066	2,186	△ 120
小計	2,066	2,186	△ 120
合計	60,274	55,492	4,781

当事業年度（平成 28 年 3 月 31 日現在）　（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	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	53,465	55,455	△ 1,989
小計	53,465	55,455	△ 1,989
合計	63,794	65,453	△ 1,659

（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。

２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成 26 年 4 月 1 日　至 平成 27 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
34,635	1,846	117

当事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日　至 平成 28 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
20,015	350	365

（デリバティブ取引関係）
該当事項はありません。

（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 （平成 27 年 3 月 31 日）	当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日）
(1) 退職給付債務	342,831	389,941
(2) 退職給付引当金	342,831	389,941

（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 （平成 27 年 3 月 31 日）	当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日）
(1) 退職給付費用	71,270	73,742

（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 14,089 千円、当事業年度で 14,434 千円であります。

４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項
当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）
１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成 27 年 3 月 31 日）		当事業年度 （平成 28 年 3 月 31 日）	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	〃	6,993	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	〃	30,437	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	〃	119,400	〃
外国税関連費用損金不算入額	18,609	〃	―	〃
その他	5,855	〃	7,674	〃
繰延税金資産 合計	239,908	〃	251,436	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	△1,546	〃	―	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	△7,217	〃	△6,833	〃
繰延税金負債 合計	△8,763	〃	△6,833	〃
繰延税金資産の純額	231,144	〃	244,602	〃

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。

３．法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正
「所得税法等の一部を改正する法律」（平成 28 年法律第 15 号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成 28 年法律第 13 号）が平成 28 年 3 月 29 日に国会で成立し、平成 28 年 4 月 1 日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の 33.06%から、平成 28 年 4 月 1 日に開始する事業年度及び平成 29 年 4 月 1 日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については 30.86%に、平成 30 年 4 月 1 日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については 30.62%となります。
この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が 15,263 千円、その他有価証券評価差額金が 27 千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が 15,236 千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（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 平成 26 年 4 月 1 日　至 平成 27 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）	3,363,914 千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・レアルコース）	3,178,319 千円

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

当事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日　至 平成 28 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）	3,979,867 千円

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

（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。

（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

重要性がないため、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

該当事項はありません。

（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 平成 26 年 4 月 1 日　至 平成 27 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日　至 平成 28 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

（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（平成 27 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（平成 28 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（平成 27 年 3 月 31 日）	当事業年度（平成 28 年 3 月 31 日）
1 株当たり純資産額	4,412,908 円 85 銭	5,848,968 円 06 銭
1 株当たり当期純利益金額	1,000,232 円 56 銭	1,447,521 円 33 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　平成 26 年 4 月 1 日 至　平成 27 年 3 月 31 日）	当事業年度（自　平成 27 年 4 月 1 日 至　平成 28 年 3 月 31 日）
当期純利益	3,000,697 千円	4,342,563 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	3,000,697 千円	4,342,563 千円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成 28 年 7 月 20 日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
SMT インデックスバランス・オープン
投資信託約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

投資信託約款第 19 条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2.運用方法

(1)投資対象

「国内株式インデックス　マザーファンド」、「国内債券インデックス　マザーファンド」、「外国株式インデックス　マザーファンド」、「外国債券インデックス　マザーファンド」、「新興国株式インデックス　マザーファンド」、「新興国債券インデックス　マザーファンド」、「J-REIT インデックス　マザーファンド」、「グローバル REIT インデックス　マザーファンド」及び「新興国 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」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。

②株式、債券及び REIT の基本資産配分比率は、原則として株式 40%、債券 40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。

③マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）の GDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

④マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域の GDP シェアの変化に応じて、原則として年 1 回見直しを行う予定です。

⑤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。

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

⑦有価証券先物取引等は、投資信託約款第 22 条の範囲で行います。

⑧スワップ取引は、投資信託約款第 23 条の範囲で行います。

⑨金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引は、投資信託約款第 24 条の範囲で行います。

(3)運用制限

①株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 60%以下とします。

②投資信託証券（REIT 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。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

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

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

3.収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

(1)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。

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

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

追加型証券投資信託
SMT インデックスバランス・オープン
投資信託約款

（信託の種類、委託者及び受託者）

第 1 条　この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、信託法（平成 18 年法律第 108 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第 2 条　受託者は、信託法第 28 条第 1 号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第 18 条第 1 項、第 18 条第 2 項及び第 30 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的及び金額）

第 3 条　委託者は、金 50 万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第 4 条　委託者は、受託者と合意のうえ、金 5,000 億円を限度として信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第 5 条　この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 48 条第 1 項、第 48 条第 2 項、第 49 条第 1 項、第 50 条第 1 項及び第 52 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第 6 条　この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第 7 条　この投資信託契約締結当初及び追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 8 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割及び再分割）

第 8 条　委託者は、第 3 条による受益権については 50 万口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 9 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法）

第 9 条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、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第 27 条に規定する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口数で除した金額をいいます。

③投資信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

④第 29 条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第 10 条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 11 条　この信託の全ての受益権は、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ることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

②委託者は、この信託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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 8 条の規定により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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、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。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第 12 条　受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

（受益権の申込単位及び価額）

第 13 条　販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 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委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第 8 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、販売会社と別に定める分配金再投資に関する契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②前項の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この信託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（第 4 項又は第 6 項

の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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。

③第 1 項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づき収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。

④第 1 項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、手数料並びに当該手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1 口につき 1 円に手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤前項の手数料の額は、販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑥第 4 項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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価額は、原則として、第 38 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑦前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、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。

（受益権の譲渡に係る記載又は記録）

第 14 条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、前項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第 1 項に規定する振替について、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、委託者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）

第 15 条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託者及び受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第 16 条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

（運用の指図範囲等）

第 17 条　委託者は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス　マザーファンド」、「国内債券インデックス　マザーファンド」、「外国株式インデックス　マザーファンド」、「外国債券インデックス　マザーファンド」、「新興国株式インデックス　マザーファンド」、「新興国債券インデックス　マザーファンド」、「J-REIT インデックス　マザーファンド」、「グローバル REIT インデックス　マザーファンド」及び「新興国 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」といいます。）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書

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。

②委託者は、信託金を、前項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

③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 60 を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）を除きます。以下本項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥前 2 項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当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（利害関係人等との取引等）

第 18 条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託者の利害関係人、第 30 条第 1 項に定める信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託者における他の信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等並びに第 21 条から第 27 条まで、第 29 条及び第 33 条から第 35 条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者又は受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役及び委託者の利害関係人等（金融商品取引法第 31 条の 4 第 3 項及び同条第 4 項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等並びに第 21 条から第 27 条まで、第 29 条及び第 33 条から第 35 条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

④前 3 項の場合、委託者及び受託者は、受益者に対して信託法第 31 条第 3 項及び同法第 32 条第 3 項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第 19 条　委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第 20 条　委託者が投資することを指図する株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、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。

②前項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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（信用取引の指図範囲）

第 21 条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②前項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書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求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

（先物取引等の運用指図、目的及び範囲）

第 22 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（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。）並びに委託者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。）

②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託者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。

③委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託者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。

（スワップ取引の運用指図、目的及び範囲）

第 23 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

②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、原則として第 5 条に定める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。

③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。

④委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲）

第 24 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

②金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第 5 条に定める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。

③金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（有価証券の貸付の指図、目的及び範囲）

第 25 条　委託者は、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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

（公社債の空売りの指図、目的及び範囲）

第 26 条　委託者は、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第 27 条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。

②前項の売付の指図は、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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

（公社債の借入れの指図、目的及び範囲）

第 27 条　委託者は、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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の借入れの指図は、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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

④第 1 項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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第 28 条　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。

（外国為替予約取引の指図、目的及び範囲）

第 29 条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②前項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

④第 2 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信託業務の委託等）

第 30 条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前各項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者及び委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 投資信託財産の保存に係る業務
2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第 31 条　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。以下本条において同じ。）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）

第 32 条　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、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

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

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

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

（一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図）

第 33 条　委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求及び投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第 34 条　委託者は、前条の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第 35 条　委託者は、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。

②一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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

③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。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第 36 条　委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第 37 条　投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③前 2 項の立替金の決済及び利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第 38 条　この信託の計算期間は、毎年 4 月 21 日から 10 月 20 日まで及び 10 月 21 日から翌年 4 月 20 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、平成 26 年 11 月 28 日から平成 27 年 4 月 20 日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により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、第 5 条に定める信託期間の終了日とします。

（投資信託財産に関する報告等）

第 39 条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類又は電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報及び当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧又は謄写の請求をすることはできないものとします。

（信託事務の諸費用）

第 40 条　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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産の監査費用及び当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、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。

（信託報酬等の総額及び支弁の方法）

第 41 条　委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第 38 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 50 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者及び受託者間の配分は別に定めます。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第 42 条　投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い）

第 43 条　収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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計算期間の末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。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者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、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、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、第 11 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載又は記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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。

④一部解約金（第 46 条第 4 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第 46 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6 営業日目から当該受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項及び第 4 項に規定する収益分配金、償還金及び一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥収益分配金、償還金及び一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金及び一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第 44 条　受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金及び一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金及び償還金の時効）

第 45 条　受益者が、収益分配金については第 43 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、並びに信託終了による償還金については第 43 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（投資信託契約の一部解約）

第 46 条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

②受益者が前項の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。

③委託者は、第 1 項の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。なお、第 1 項の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者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、社振法の規定にしたが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。

④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に 0.1％の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

⑤委託者は、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、第 1 項による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

⑥委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による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。

⑦前項により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、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

（質権口記載又は記録の受益権の取扱い）

第 47 条　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、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（投資信託契約の解約）

第 48 条　委託者は、信託期間中において、この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とき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）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投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

④前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。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、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第 3 項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。

⑥第 3 項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約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、第 3 項から前項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。

（投資信託契約に関する監督官庁の命令）

第 49 条　委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、第 53 条の規定

にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第 50 条　委託者が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、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 53 条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い）

第 51 条　委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任及び解任に伴う取扱い）

第 52 条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 53 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

（投資信託約款の変更等）

第 53 条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又はこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）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の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。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、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第 2 項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。

⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第 2 項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等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。

⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託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。

（反対者の買取請求権）

第 54 条　（削除）

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第 55 条　この信託の受益者は、委託者又は受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第 55 条の 2　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

（公告）

第 56 条　委託者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。

（投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第 57 条　この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付則）

第 1 条　第 24 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額及び当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 2 条　第 24 条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引及び当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭又はその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日に

おける現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第 3 条　第 24 条に規定する「直物為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第 4 条　第 43 条第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日　　平成 26 年 11 月 28 日

委託者　　三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者　　三井住友信託銀行株式会社