

確定拠出年金専用ファンド

DCマイセレクション75

追加型投信／内外／資産複合

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	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
追加型投信	内外	資産複合	その他資産 (注)	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	なし

(注) 投資信託証券(資産複合(株式、債券、短期金融資産)資産配分固定型)

※商品分類及び属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ<http://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

※属性区分に記載している「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。

この目論見書により行うDCマイセレクション75の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成28年12月28日に関東財務局長に提出しており、平成28年12月29日にその届出の効力が生じております。

ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

投資信託説明書(請求目論見書)については、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。その際、投資者は自ら請求したことを記録しておいてください。

- 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。
- 本書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に掲載されております。
- ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

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/>携帯サイト：<http://m.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間:営業日の午前9時～午後5時)



■委託会社(ファンドの運用の指図を行う者)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者:関東財務局長(金商)第347号

設立年月日:昭和61年11月1日

資本金:3億円

運用する投資信託財産の合計純資産総額:8兆5,037億円

(資本金、運用純資産総額は平成28年10月31日現在)

■受託会社(ファンドの財産の保管及び管理を行う者)

三井住友信託銀行株式会社

✓ ファンドの目的・特色

ファンドの目的

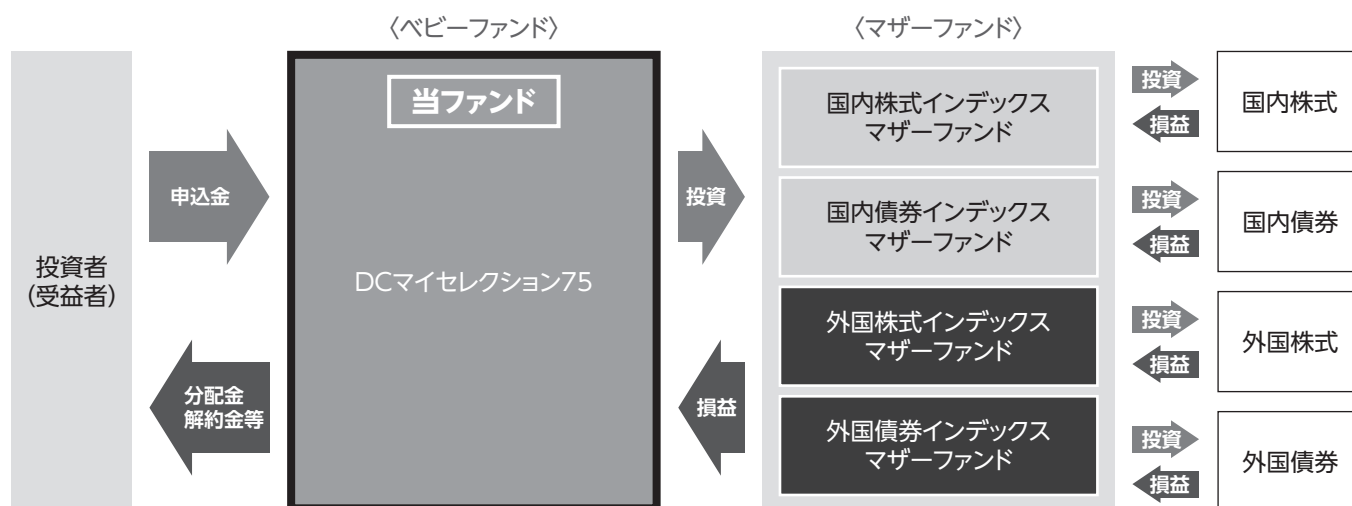
国内株式、国内債券、外国株式及び外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

ファンドの特色

1. 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



※各マザーファンド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。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
国内債券	NOMURA-BPI総合
外国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)
外国債券	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

* 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。

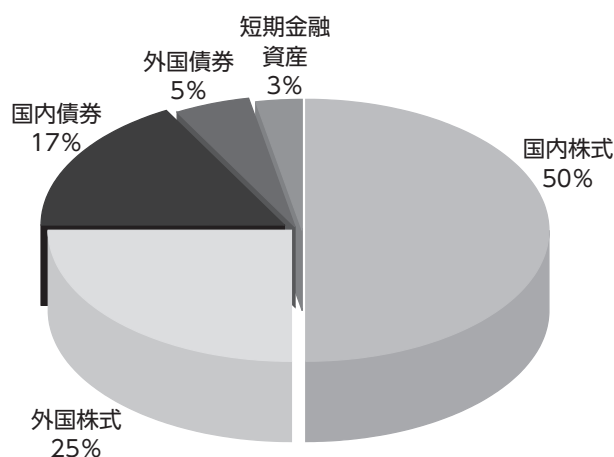
※各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは「追加的記載事項」をご覧ください。

ファンドの特色

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%を基準ポートフォリオとして運用します。

- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準ポートフォリオから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準ポートフォリオは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準ポートフォリオ



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基準ポートフォリオに基づき、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

- 基準ポートフォリオに従って、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

- 資産配分比率が基準ポートフォリオ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。

✓ ファンドの目的・特色

ファンドの特色

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 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等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

投資リスク

基準価額の変動要因

- ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク	株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
為替変動リスク	為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。
金利変動リスク	債券の価格は、一般的に金利低下(上昇)した場合は値上がり(値下がり)します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
信用リスク	有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※基準価額の変動要因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

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

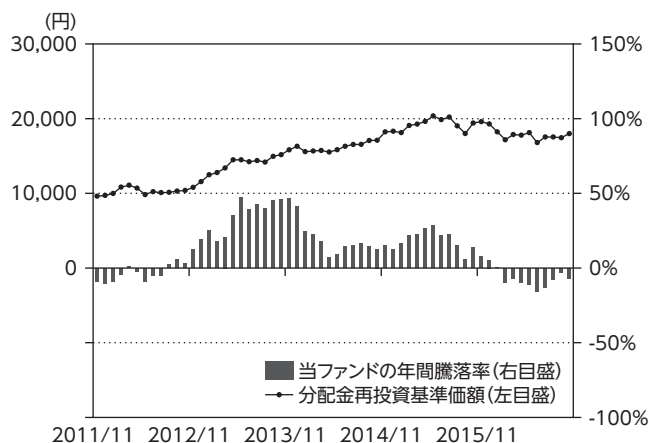
リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

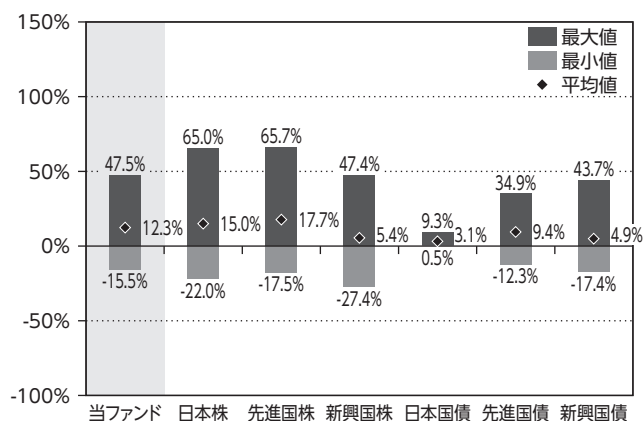
- 運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。
- 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【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。

*2011年11月～2016年10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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、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。

*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・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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国内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、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

*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.

基準価額・純資産の推移



基準価額	17,996円
純資産総額	376.52億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間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	2012年10月	2013年9月	2014年9月	2015年9月	2016年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

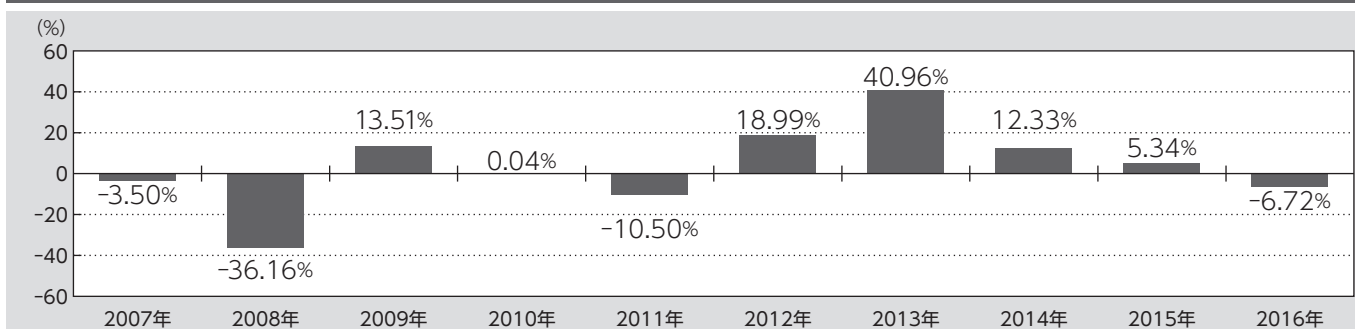
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
国内株式 インデックス マザーファンド	51.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.9%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.0%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.9%
外国株式 インデックス マザーファンド	24.8%	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	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.8%	第113回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.2%
		第116回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.2%	2018/12/20	0.2%
		第125回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2020/09/20	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.4%	T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.0%
		T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.875%	2043/05/15	0.0%
		T 2.5% 02/15/46	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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。

手続・手数料等

お申込みメモ

購入単位	1円以上1円単位とします。
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 (基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
購入の申込者の制限	ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会(同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。)による購入の申込みのみの取扱いとなります。
換金単位	1口単位とします。
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額とします。(信託財産留保額の控除はありません。)
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。 なお、確定拠出年金制度の加入者等が換金代金の支払いを受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づき、原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時までとします。
購入の申込期間	平成28年12月29日から平成29年6月30日までとします。 ※上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
換金制限	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、大口の換金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	無期限(平成13年10月1日設定)
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、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5億口を下回ることとなった場合 ●ファンドを償還することが受益者のために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
決算日	毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)です。
収益分配	年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。 [分配金再投資コース]専用ファンドです。
信託金の限度額	3,000億円
公告	日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	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。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。

ファンドの費用・税金

〈ファンドの費用〉

投資者が直接的に負担する費用			
購入時手数料	ありません。		
信託財産留保額	ありません。		
投資者が信託財産で間接的に負担する費用			
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額に対して年率0.3456%(税抜0.32%) 信託期間を通じて毎日計算し、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のとき、信託財産から支払われます。		信託報酬＝運用期間中の基準価額× 信託報酬率
運用管理費用の配分	支払先	内訳	主な役務
	委託会社	年率0.1836%(税抜0.17%)	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0.1296%(税抜0.12%)	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0.0324%(税抜0.03%)	運用財産の管理、委託会社からの指図 の実行の対価
その他の費用・手数料	監査費用、有価証券の売買・保管、信託事務に係る 諸費用等をその都度(監査費用は日々)、ファンドが 負担します。これらの費用は、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。		監査費用は、監査法人に支払うファンド の監査に係る費用 有価証券の売買・保管に係る費用は、 有価証券の売買・保管にあたり、売買 仲介人・保管機関に支払う手数料 信託事務に係る諸費用は、投資信託財 産に関する租税、信託事務の処理に要 する諸費用及び受託会社の立替えた 立替金の利息等

※上記の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。

〈税金〉

●ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドです。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、所得税及び地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※上記は、平成28年10月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、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。

追加的記載事項

投資対象としているマザーファンドの概要は以下の通りです。

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数) ^{※1} と連動する投資成果を目標として運用を行います。
国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合 ^{※2} と連動する投資成果を目標として運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ^{※3} を構成している国の株式	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。
外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債	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) ^{※4} と連動する投資成果を目標として運用を行います。

※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。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 「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。

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

※4 「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。

<メモ>

(本ページは目論見書の内容ではありません。)

DCマイセレクション75

追加型投信／内外／資産複合

【確定拠出年金専用ファンド】

投資信託説明書

(請求目論見書)

平成28年12月29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。

DCマイセレクション75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12月28日に関東財務局長に提出しており、平成28年12月29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】	1
（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】	3
第1【ファンドの状況】	3
1【ファンドの性格】	3
2【投資方針】	13
3【投資リスク】	23
4【手数料等及び税金】	26
5【運用状況】	28
第2【管理及び運営】	47
1【申込（販売）手続等】	47
2【換金（解約）手続等】	48
3【資産管理等の概要】	50
4【受益者の権利等】	54
第3【ファンドの経理状況】	55
1【財務諸表】	57
2【ファンドの現況】	218
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	220
第三部【委託会社等の情報】	221
第1【委託会社等の概況】	221
1【委託会社等の概況】	221
2【事業の内容及び営業の概況】	222
3【委託会社等の経理状況】	222
4【利害関係人との取引制限】	239
5【その他】	239
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DCマイセレクション75

(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】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7)【申込期間】

平成28年12月29日から平成29年6月30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せん。

(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>

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

<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、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。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、国内株式、国内債券、外国株式及び外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

<信託金限度額>

上限 3,000 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	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

◆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うるファンドをいう。
- (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]

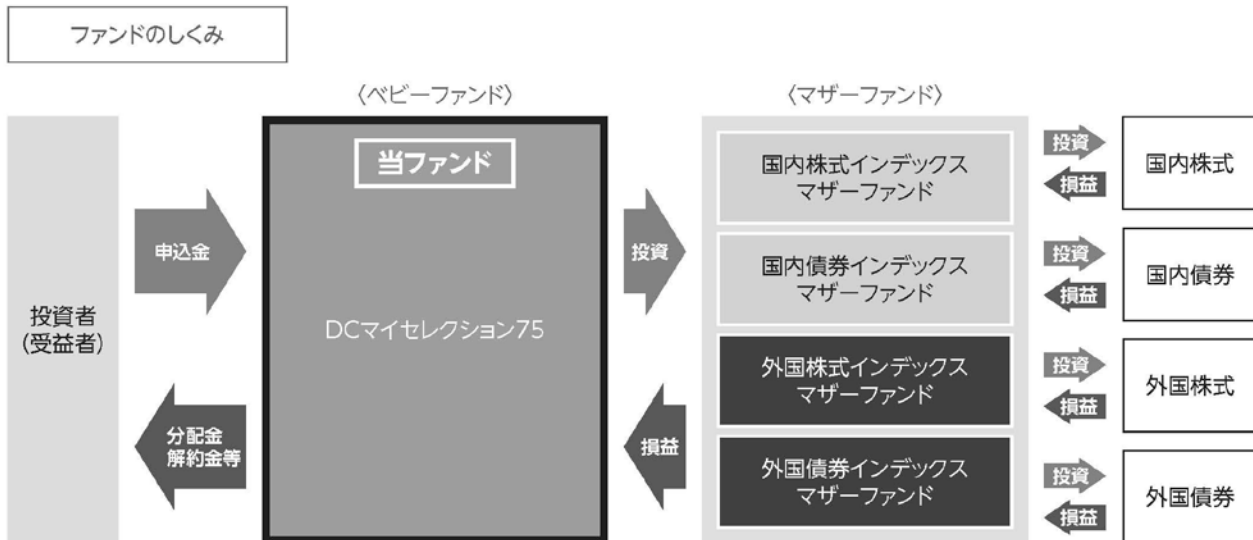
- (1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動

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。

1. 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



※各マザーファンド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。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX (東証株価指数) ※1
国内債券	NOMURA-BPI 総合※2
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス (円ベース) ※3
外国債券	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ※4

*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。

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

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

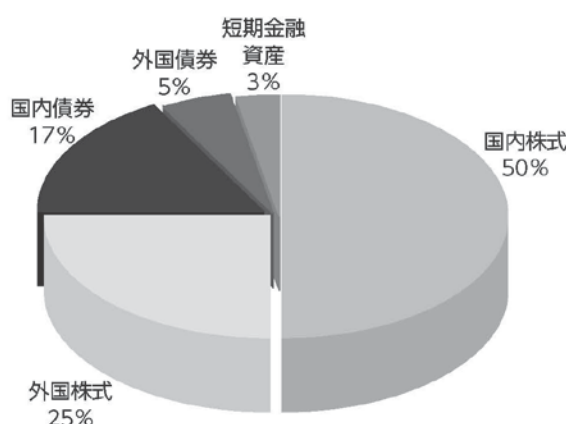
※3 「MSCI コクサイ・インデックス (円ベース)」とは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4「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。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%を基準ポートフォリオとして運用します。

- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準ポートフォリオから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準ポートフォリオは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準ポートフォリオ



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基準ポートフォリオに基づき、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

- 基準ポートフォリオに従って、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

- 資産配分比率が基準ポートフォリオ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。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 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等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

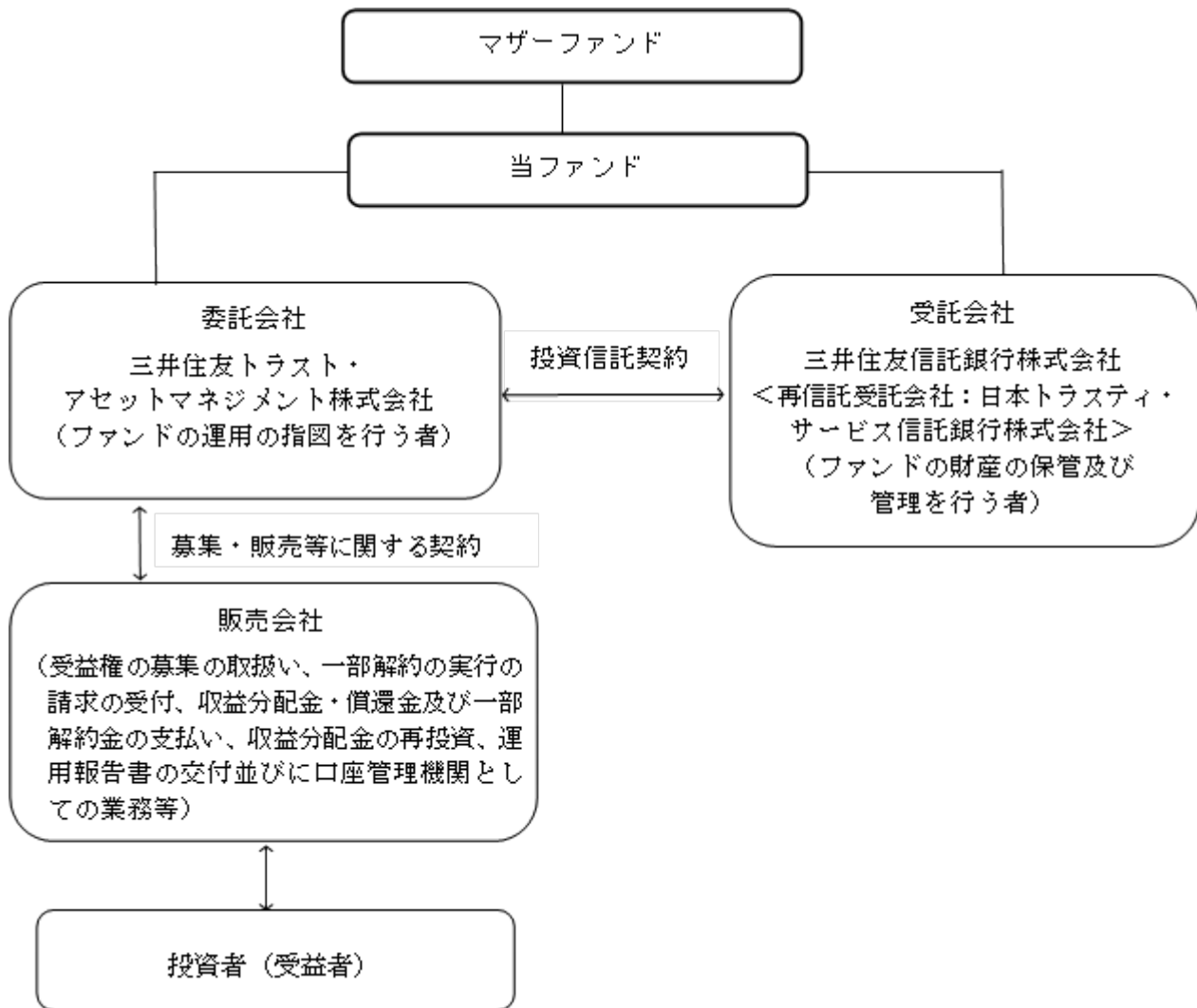
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成 13 年 10 月 1 日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
平成 24 年 4 月 1 日	本ファンドの名称を「すみしん DC マイセレクション 75」から「DC マイセレクション 75」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(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 10 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】

(イ) 基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ) 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」および「外国債券インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「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。

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して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2) 基準ポートフォリオは、国内株式 50%、国内債券 17%、外国株式 25%、外国債券 5%および短期金融資産 3%の比率で基準配分します。
- 3) 各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5) 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。また、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およ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およ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。
- 6) 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を回避するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。
- 7) 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

(イ) 本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。

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23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
 - 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

(ロ) 委託会社は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 4 号までの三井住友トラスト・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マザーファンドの受益証券ならびに第 5 号から第 26 号までの有価証券（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. 国内株式インデックス マザーファンド
 2. 国内債券インデックス マザーファンド
 3. 外国株式インデックス マザーファンド
 4. 外国債券インデックス マザーファンド
 5. 株券または新株引受権証書
 6. 国債証券
 7. 地方債証券
 8. 特別の法律により法人の発行する債券
 9. 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。）
 10. 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。）
 11. 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。）
 12. 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。）
 13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券また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。）
 14. コマーシャル・ペーパー
 15. 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。）および新株予約権証券
 16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 17. 証券投資信託または外国証券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。）
 18. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（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。）
 19. 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。）
 20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 21. 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。）
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 24. 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。）
 25. 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
 26. 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 5 号の証券または証書、第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 5 号の証券または

証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第 6 号から第 10 号までの証券および第 16 号ならびに第 21 号の証券または証券のうち第 6 号から第 10 号までの証券の性質を有するもの、および第 18 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 17 号の証券および第 18 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

(ハ) 委託会社は、信託金を、前記（ロ）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

(ニ) 前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、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、信託金を前記（ハ）第 1 号から第 4 号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（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およ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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ①原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 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新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- 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 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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およ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およ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、スワップ取引およ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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、

原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

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

資産総額の5%以下とします。

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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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およ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およ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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利また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、金利先渡取引およ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。

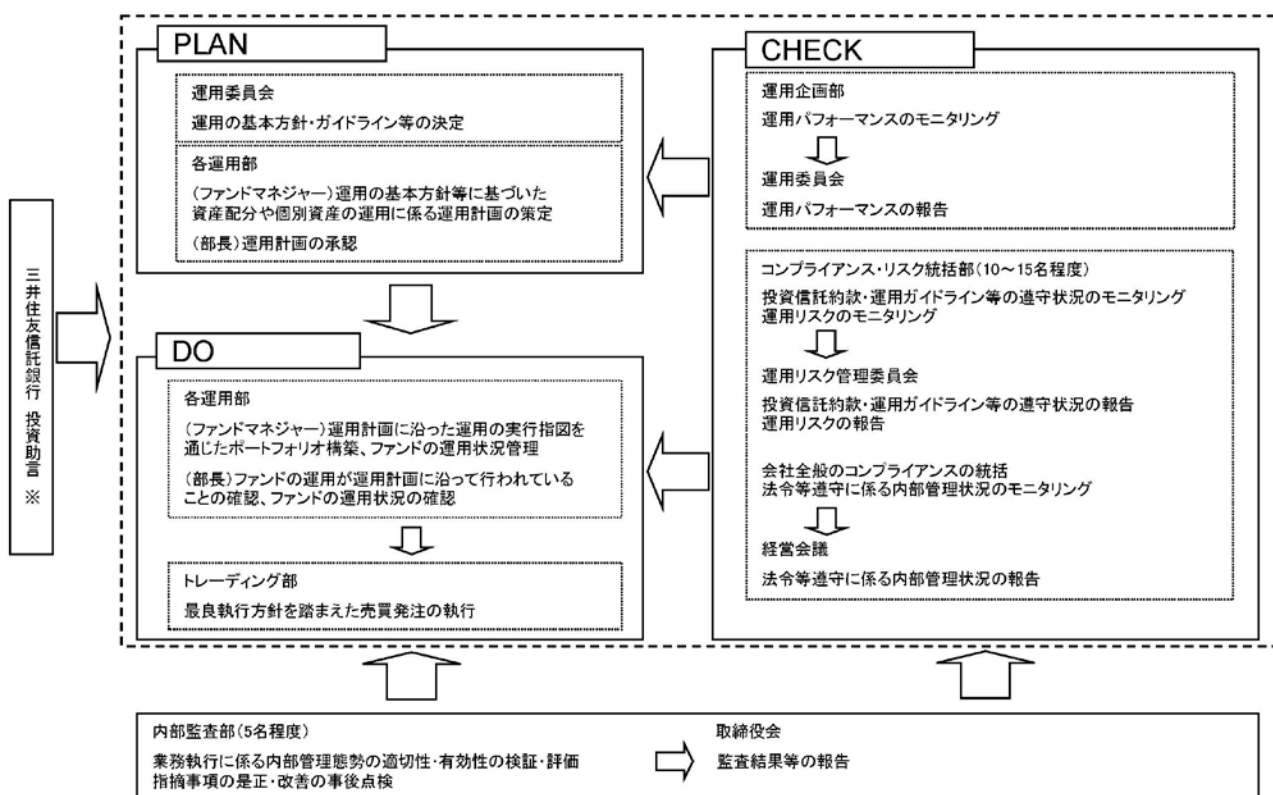
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

ポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(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】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配については、委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、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>

- ① 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 85%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ③ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ④ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑥ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑦ 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 40%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑧ 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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。（投資信託約款第 19 条）
- ⑨ 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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまた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。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。（投資信託約款第 22 条）
 1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求およ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および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投

資信託財産に属する新株予約権証券およ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

- ⑩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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所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。）およ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。）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の指図を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。）委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引および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通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引および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を指図することができます。（投資信託約款第 23 条）
- ⑪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、ならびに価格変動リスクおよ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、また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。）を行うことの指図をすることができます。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、本ファンドの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。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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を超えないものとします。（投資信託約款第 24 条）
- ⑫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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの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。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の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、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品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を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の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、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第 25 条）
- ⑬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および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第 26 条）
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。
- ⑭委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまた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、売付けの指図は、当該売付け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。（投資信託約款第 27 条）

⑮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、この指図は、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。(投資信託約款第 28 条)

⑯委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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。こ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が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。(投資信託約款第 31 条)

⑰委託会社は、投資信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。)を目的として、また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。また、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また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、解約代金およ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、借入れ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。また、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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。(投資信託約款第 39 条)

⑱一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。(投資信託約款の「運用の基本方針」)

⑲デリバティブ取引等(金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。(投資信託約款の「運用の基本方針」)

※前記①から⑦における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑦に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの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。前記⑪、⑫および⑬における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

< 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】

(イ) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 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 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

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。

※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。
- ④確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

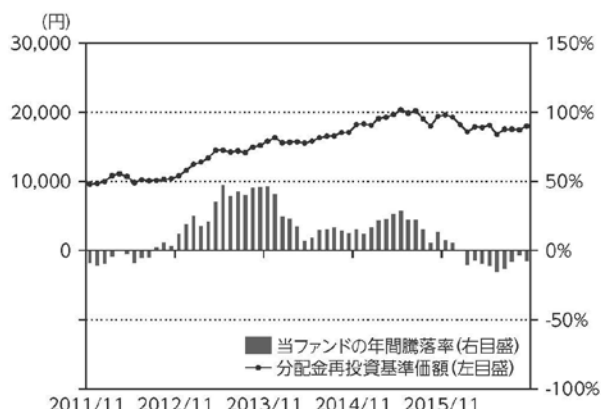
(ロ) リスクの管理体制

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】

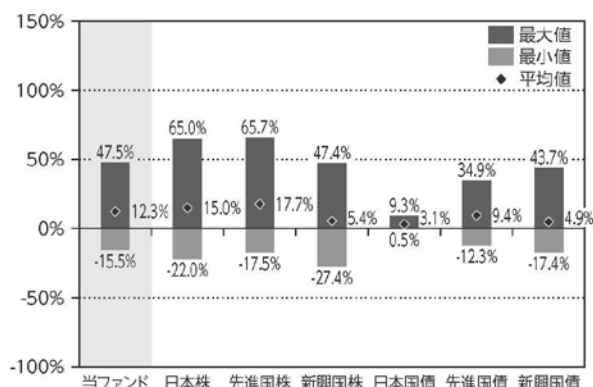
当ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



*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



*2011年11月～2016年10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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、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。

*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・マーケット・グローバル・ディバースィファイド (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】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（※）の控除はありません。

※「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 0.3456%（税抜 0.32%）（※）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 0.1836% (税抜 0.17%)	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 0.1296% (税抜 0.12%)	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 0.0324% (税抜 0.03%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

- ②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- 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があります。）。
- 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があります。）。
- 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。

(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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

※上記は、平成 28 年 10 月 31 日現在のもので、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10月31日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセレクション75】

(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	36,657,979,244	97.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	994,054,673	2.64
合計(純資産総額)		37,652,033,917	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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	国内株式インデックス マザーファンド	15,973,840,421	1.1498	18,366,721,717	1.2109	19,342,723,365	51.37
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	5,149,308,325	1.7765	9,147,793,958	1.8131	9,336,210,924	24.80
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	4,503,420,310	1.4041	6,323,584,866	1.4006	6,307,490,486	16.75
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	669,371,484	2.4925	1,668,432,939	2.4972	1,671,554,469	4.44

(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	97.36
合計	97.36

(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 6 期計算期間末 (平成 19 年 10 月 1 日)	14,820,213,543	14,820,213,543	15,717	15,717
第 7 期計算期間末 (平成 20 年 9 月 30 日)	13,376,901,179	13,376,901,179	11,770	11,770
第 8 期計算期間末 (平成 21 年 9 月 30 日)	14,737,407,779	14,737,407,779	10,647	10,647
第 9 期計算期間末 (平成 22 年 9 月 30 日)	16,131,827,028	16,131,827,028	10,338	10,338
第 10 期計算期間末 (平成 23 年 9 月 30 日)	17,023,679,540	17,023,679,540	9,740	9,740
第 11 期計算期間末 (平成 24 年 10 月 1 日)	19,440,154,386	19,440,154,386	10,260	10,260
第 12 期計算期間末 (平成 25 年 9 月 30 日)	28,620,541,787	28,620,541,787	14,959	14,959
第 13 期計算期間末 (平成 26 年 9 月 30 日)	33,482,824,281	33,482,824,281	17,076	17,076
第 14 期計算期間末 (平成 27 年 9 月 30 日)	35,594,656,829	35,594,656,829	18,009	18,009
第 15 期計算期間末 (平成 28 年 9 月 30 日)	36,342,020,872	36,342,020,872	17,450	17,450
平成 27 年 10 月末日	38,531,322,736	—	19,416	—
11 月末日	38,777,005,225	—	19,602	—
12 月末日	38,411,262,972	—	19,293	—
平成 28 年 1 月末日	36,410,246,727	—	18,231	—
2 月末日	34,312,936,435	—	17,174	—
3 月末日	36,074,033,817	—	17,865	—
4 月末日	36,026,662,852	—	17,792	—
5 月末日	36,844,406,401	—	18,120	—
6 月末日	34,512,886,217	—	16,795	—
7 月末日	36,236,770,644	—	17,553	—
8 月末日	36,488,906,798	—	17,546	—
9 月末日	36,342,020,872	—	17,450	—
10 月末日	37,652,033,917	—	17,996	—

②【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 6 期計算期間	平成 18 年 10 月 3 日～平成 19 年 10 月 1 日	0
第 7 期計算期間	平成 19 年 10 月 2 日～平成 20 年 9 月 30 日	0
第 8 期計算期間	平成 20 年 10 月 1 日～平成 21 年 9 月 30 日	0
第 9 期計算期間	平成 21 年 10 月 1 日～平成 22 年 9 月 30 日	0
第 10 期計算期間	平成 22 年 10 月 1 日～平成 23 年 9 月 30 日	0
第 11 期計算期間	平成 23 年 10 月 1 日～平成 24 年 10 月 1 日	0
第 12 期計算期間	平成 24 年 10 月 2 日～平成 25 年 9 月 30 日	0
第 13 期計算期間	平成 25 年 10 月 1 日～平成 26 年 9 月 30 日	0
第 14 期計算期間	平成 26 年 10 月 1 日～平成 27 年 9 月 30 日	0
第 15 期計算期間	平成 27 年 10 月 1 日～平成 28 年 9 月 30 日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 6 期計算期間	平成 18 年 10 月 3 日～平成 19 年 10 月 1 日	5.8
第 7 期計算期間	平成 19 年 10 月 2 日～平成 20 年 9 月 30 日	△25.1
第 8 期計算期間	平成 20 年 10 月 1 日～平成 21 年 9 月 30 日	△9.5
第 9 期計算期間	平成 21 年 10 月 1 日～平成 22 年 9 月 30 日	△2.9
第 10 期計算期間	平成 22 年 10 月 1 日～平成 23 年 9 月 30 日	△5.8
第 11 期計算期間	平成 23 年 10 月 1 日～平成 24 年 10 月 1 日	5.3
第 12 期計算期間	平成 24 年 10 月 2 日～平成 25 年 9 月 30 日	45.8
第 13 期計算期間	平成 25 年 10 月 1 日～平成 26 年 9 月 30 日	14.2
第 14 期計算期間	平成 26 年 10 月 1 日～平成 27 年 9 月 30 日	5.5
第 15 期計算期間	平成 27 年 10 月 1 日～平成 28 年 9 月 30 日	△3.1

(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6期計算期間	平成18年10月3日～平成19年10月1日	4,003,156,930	1,089,928,632	9,429,550,152
第7期計算期間	平成19年10月2日～平成20年9月30日	3,302,454,022	1,366,571,750	11,365,432,424
第8期計算期間	平成20年10月1日～平成21年9月30日	3,420,020,723	943,488,620	13,841,964,527
第9期計算期間	平成21年10月1日～平成22年9月30日	2,824,764,190	1,062,037,170	15,604,691,547
第10期計算期間	平成22年10月1日～平成23年9月30日	3,149,786,275	1,276,681,816	17,477,796,006
第11期計算期間	平成23年10月1日～平成24年10月1日	2,819,375,711	1,350,257,742	18,946,913,975
第12期計算期間	平成24年10月2日～平成25年9月30日	3,425,315,153	3,238,964,390	19,133,264,738
第13期計算期間	平成25年10月1日～平成26年9月30日	2,840,594,590	2,365,992,578	19,607,866,750
第14期計算期間	平成26年10月1日～平成27年9月30日	3,273,383,820	3,115,996,674	19,765,253,896
第15期計算期間	平成27年10月1日～平成28年9月30日	2,775,993,818	1,714,409,012	20,826,838,702

(注)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	153,336,064,180	98.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,397,471,893	1.54
合計(純資産総額)		155,733,536,073	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	2,204,100,000	1.42

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

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

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	937,700	5,664.68	5,311,770,436	6,079.00	5,700,278,300	3.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,638,600	542.64	3,059,729,904	544.60	3,070,781,560	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	597,300	4,829.93	2,884,921,383	4,660.00	2,783,418,000	1.79
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	365,400	6,156.07	2,249,427,978	6,602.00	2,412,370,800	1.55
日本	株式	KDDI	情報・通信業	736,100	3,186.96	2,345,922,640	3,192.00	2,349,631,200	1.51
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	595,800	3,506.59	2,089,228,128	3,653.00	2,176,457,400	1.40
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	678,500	3,100.29	2,103,552,234	3,144.00	2,133,204,000	1.37
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	468,200	4,366.83	2,044,553,518	3,994.00	1,869,990,800	1.20
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,102,700	171.20	1,729,582,240	177.10	1,789,188,170	1.15
日本	株式	ソニー	電気機器	532,300	3,079.00	1,638,952,940	3,361.00	1,789,060,300	1.15
日本	株式	ファナック	電気機器	76,400	16,741.32	1,279,037,010	19,680.00	1,503,552,000	0.97
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	556,000	2,742.33	1,524,738,900	2,640.50	1,468,118,000	0.94
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	296,000	4,799.63	1,420,690,480	4,700.00	1,391,200,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	311,400	4,681.86	1,457,933,256	4,383.00	1,364,866,200	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	145,900	9,991.50	1,457,760,150	9,257.00	1,350,596,300	0.87
日本	株式	キーエンス	電気機器	17,100	69,432.39	1,187,294,018	77,060.00	1,317,726,000	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	558,300	1,934.55	1,080,062,610	2,291.00	1,279,065,300	0.82
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	806,700	1,498.30	1,208,678,610	1,559.50	1,258,048,650	0.81
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	301,500	3,822.08	1,152,357,324	4,149.00	1,250,923,500	0.80
日本	株式	キャノン	電気機器	405,900	3,147.59	1,277,609,772	3,017.00	1,224,600,300	0.79
日本	株式	任天堂	その他製品	46,400	16,088.68	746,514,818	25,440.00	1,180,416,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	79,100	12,694.99	1,004,174,040	14,670.00	1,160,397,000	0.75
日本	株式	三菱地所	不動産業	553,000	2,113.04	1,168,511,960	2,081.50	1,151,069,500	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	804,200	1,310.22	1,053,682,560	1,422.50	1,143,974,500	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	141,600	6,356.16	900,033,036	7,971.00	1,128,693,600	0.72
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	62,700	19,243.94	1,206,595,038	17,865.00	1,120,135,500	0.72
日本	株式	花王	化学	200,600	6,068.92	1,217,425,860	5,405.00	1,084,243,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	266,500	3,719.60	991,275,025	3,915.00	1,043,347,500	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	102,900	9,347.47	961,854,663	10,080.00	1,037,232,000	0.67
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,810,000	497.92	901,235,200	559.20	1,012,152,000	0.65

(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	0.32
		建設業	3.05
		食料品	4.77
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.42
		医薬品	5.00
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	1.14
		非鉄金属	0.88
		金属製品	0.69
		機械	4.92
		電気機器	12.45
		輸送用機器	9.46
		精密機器	1.51
		その他製品	1.90
		電気・ガス業	1.82
		陸運業	4.14
		海運業	0.22
		空運業	0.54
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.04
		卸売業	4.29
		小売業	4.80
		銀行業	7.51
		証券、商品先物取引業	1.06
		保険業	2.37
		その他金融業	1.29
		不動産業	2.55
サービス業	3.76		
	小計	98.46	
合計		98.46	

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	158円		2,130,446,340	2,204,100,000	1.42

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

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

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	259,299,132,000	82.07
	ポーランド	200,758,000	0.06
	小計	259,499,890,000	82.13
地方債証券	日本	18,019,154,988	5.70
特殊債券	日本	23,876,622,267	7.56
社債券	日本	12,230,744,650	3.87
	オーストラリア	401,866,000	0.13
	フランス	400,392,000	0.13
	オランダ	200,704,000	0.06
	スウェーデン	200,180,000	0.06
	アメリカ	100,417,000	0.03
	イギリス	99,742,000	0.03
	小計	13,634,045,650	4.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	921,424,971	0.29
合計(純資産総額)		315,951,137,876	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	101.12	4,439,343,600	100.92	4,430,607,500	0.300	2018/6/20	1.40
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	100.99	3,868,146,800	0.200	2018/12/20	1.22
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	101.23	3,654,511,300	0.100	2020/9/20	1.16
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	101.05	3,597,593,600	0.100	2019/12/20	1.14
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	101.10	3,558,720,000	0.200	2019/3/20	1.13
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	101.20	3,552,260,400	0.200	2019/6/20	1.12
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	3,280,000,000	102.60	3,365,486,300	101.64	3,334,054,400	0.100	2026/6/20	1.06
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	104.48	3,218,261,200	0.400	2025/6/20	1.02
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	101.10	3,174,728,400	0.100	2020/3/20	1.00
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,120,000,000	102.17	3,187,922,500	101.74	3,174,537,600	0.100	2026/3/20	1.00
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	3,100,000,000	101.32	3,140,980,900	101.18	3,136,859,000	0.100	2020/6/20	0.99
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	3,050,000,000	101.62	3,099,419,500	101.40	3,092,761,000	0.100	2021/6/20	0.98
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,960,000,000	101.51	3,004,696,000	101.29	2,998,213,600	0.100	2020/12/20	0.95
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	104.52	2,968,566,800	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,710,000,000	104.15	2,822,588,300	103.63	2,808,589,800	0.300	2025/12/20	0.89
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,460,000,000	106.66	2,623,937,600	105.78	2,602,384,800	0.600	2024/6/20	0.82
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	2,540,000,000	101.46	2,577,084,000	101.27	2,572,410,400	0.200	2019/9/20	0.81
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,410,000,000	106.37	2,563,711,400	105.55	2,543,947,800	0.600	2023/12/20	0.81
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	102.03	2,540,721,300	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	101.34	2,533,675,000	0.100	2021/3/20	0.80
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	100.87	2,471,535,500	0.200	2018/9/20	0.78
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	105.85	2,424,125,300	0.800	2022/9/20	0.77
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,290,000,000	105.82	2,423,278,000	105.10	2,406,790,000	0.500	2024/9/20	0.76
日本	国債証券	第367回利付国債(2年)	2,360,000,000	100.60	2,374,183,000	100.65	2,375,434,400	0.100	2018/8/15	0.75
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	104.44	2,308,234,500	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第333回利付国債	2,060,000,000	106.42	2,192,313,800	105.67	2,176,884,400	0.600	2024/3/20	0.69

		債(10年)								
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	103.33	2,170,098,000	1.500	2018/9/20	0.69
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,010,000,000	105.48	2,120,148,000	104.80	2,106,660,900	1.300	2019/12/20	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	105.60	1,911,432,400	0.800	2022/6/20	0.60
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	105.43	1,876,814,200	104.81	1,865,635,800	1.100	2020/6/20	0.59

(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	82.13
地方債証券	5.70
特殊債券	7.56
社債券	4.32
合計	99.71

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	156,756,594,743	58.36
	イギリス	18,314,150,881	6.82
	カナダ	10,395,264,882	3.87
	スイス	10,215,014,363	3.80
	ドイツ	9,822,245,316	3.66
	フランス	9,727,774,774	3.62
	オーストラリア	6,812,931,615	2.54
	オランダ	4,717,567,496	1.76
	アイルランド	4,422,698,552	1.65
	スペイン	3,434,870,238	1.28
	スウェーデン	2,933,345,225	1.09
	香港	2,540,629,641	0.95
	イタリア	1,889,789,137	0.70
	シンガポール	1,810,805,709	0.67
	デンマーク	1,789,717,680	0.67
	ベルギー	1,409,752,420	0.52
	ジャージー	1,386,428,505	0.52
	バミューダ	1,182,917,212	0.44
	フィンランド	1,044,513,145	0.39
	キュラソー	978,875,063	0.36
	ノルウェー	689,917,859	0.26
	ケイマン	688,804,379	0.26
	イスラエル	638,944,601	0.24
	ルクセンブルク	303,943,114	0.11
	オーストリア	217,172,864	0.08
	ニュージーランド	208,544,890	0.08
	ポルトガル	160,748,581	0.06
	パナマ	158,830,640	0.06
	リベリア	115,657,976	0.04
	英ヴァージン諸島	73,157,718	0.03
パプアニューギニア	65,492,487	0.02	
マン島	24,005,062	0.01	
モーリシャス	12,464,182	0.00	
	小計	254,943,570,950	94.92
投資信託受益証券	オーストラリア	179,523,125	0.07
	香港	49,839,925	0.02

	シンガポール	21,818,849	0.01
	小計	251,181,899	0.09
投資証券	アメリカ	5,054,633,440	1.88
	オーストラリア	630,309,797	0.23
	フランス	391,595,908	0.15
	イギリス	249,807,097	0.09
	香港	143,886,600	0.05
	シンガポール	105,732,905	0.04
	カナダ	62,952,192	0.02
	小計	6,638,917,939	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,757,768,668	2.52
合計(純資産総額)		268,591,439,456	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	4,376,087,776	1.63
	買建	カナダ	351,948,038	0.13
	買建	ドイツ	1,052,137,546	0.39
	買建	イギリス	712,185,344	0.27
	買建	オーストラリア	250,851,762	0.09

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	1,445,133,200	0.54

(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	463,468	10,627.99	4,925,734,194	11,924.67	5,526,707,219	2.06
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	631,943	5,540.85	3,501,504,432	6,277.96	3,967,318,058	1.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	350,650	9,414.15	3,301,075,177	8,890.03	3,117,289,300	1.16
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	233,227	11,862.35	2,766,621,788	12,093.50	2,820,531,611	1.05
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	33,916	75,514.81	2,561,160,408	81,404.91	2,760,929,104	1.03
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	195,687	12,603.07	2,466,257,237	13,767.06	2,694,036,510	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	777,773	3,149.53	2,449,623,032	3,064.00	2,383,103,628	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	309,298	6,881.58	2,128,460,104	7,246.87	2,241,443,820	0.83
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	26,168	77,296.35	2,022,690,918	83,402.49	2,182,476,573	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,863	78,930.83	1,962,457,392	85,939.06	2,136,702,889	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	269,851	7,863.60	2,122,001,904	7,723.35	2,084,154,260	0.78
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	520,780	4,076.69	2,123,062,960	3,828.43	1,993,774,254	0.74
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	408,021	5,300.83	2,162,851,195	4,847.67	1,977,954,344	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	216,303	8,570.49	1,853,823,293	9,106.04	1,969,664,289	0.73
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	344,872	5,293.46	1,825,567,844	5,055.30	1,743,431,629	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	159,459	10,685.97	1,703,974,508	10,886.56	1,735,960,800	0.65
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	514,447	3,615.35	1,859,906,060	3,348.17	1,722,461,054	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	347,765	4,680.78	1,627,812,479	4,428.23	1,539,986,119	0.57
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	100,934	15,028.46	1,516,883,241	15,099.84	1,524,087,251	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	869,187	1,571.53	1,365,954,024	1,749.06	1,520,264,386	0.57

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	399,925	3,334.56	1,333,577,754	3,642.83	1,456,861,347	0.54
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	59,498	27,703.44	1,648,299,356	24,379.48	1,450,530,420	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	234,835	5,956.91	1,398,891,744	6,169.96	1,448,923,120	0.54
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	189,102	8,397.72	1,588,026,171	7,542.99	1,426,396,197	0.53
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	161,336	8,366.06	1,349,746,723	8,621.58	1,390,972,715	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	122,242	10,724.51	1,310,985,686	11,227.36	1,372,454,966	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	426,038	3,043.01	1,296,442,146	3,207.66	1,366,588,204	0.51
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	105,277	13,974.91	1,471,237,362	12,958.59	1,364,242,406	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,694,187	587.93	996,067,637	797.86	1,351,726,072	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	204,612	6,604.09	1,351,277,118	6,488.73	1,327,673,414	0.49

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.32
		素材	4.82
		資本財	6.93
		商業・専門サービス	0.98
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.58
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.74
		メディア	2.52
		小売	3.89
		食品・生活必需品小売り	2.02
		食品・飲料・タバコ	6.16
		家庭用品・パーソナル用品	2.22
		ヘルスケア機器・サービス	3.76
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.65
		銀行	8.68
		各種金融	3.99
		保険	4.04
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	9.20
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.59
		電気通信サービス	3.01
		公益事業	3.38
半導体・半導体製造装置	2.35		
	小計	94.92	
投資信託受益証券	—	—	0.09
投資証券	—	—	2.47
合計			97.48

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	393	アメリカドル	41,842,261	4,387,579,488	41,732,670	4,376,087,776	1.63
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	26	カナダドル	4,489,501	350,674,923	4,505,800	351,948,038	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	32	スイスフラン	2,558,474	271,428,507	2,526,400	268,025,776	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	222	ユーロ	6,765,909	778,417,830	6,815,400	784,111,770	0.29
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	24	オーストラリアドル	3,215,943	255,956,903	3,151,800	250,851,762	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	80	イギリスポンド	5,561,400	710,524,464	5,574,400	712,185,344	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	9,130,000.00	960,234,000	957,280,500	0.36
	カナダドル	買建	730,000.00	57,357,560	57,013,000	0.02
	ユーロ	買建	1,520,000.00	174,310,560	174,876,000	0.07
	イギリスポンド	買建	820,000.00	105,023,960	104,755,000	0.04
	スイスフラン	買建	480,000.00	50,827,200	50,923,200	0.02
	スウェーデンクローナ	買建	1,642,000.00	19,035,706	19,096,460	0.01
	デンマーククローネ	買建	812,000.00	12,519,416	12,561,640	0.00
	オーストラリアドル	買建	550,000.00	43,913,650	43,769,000	0.02
	香港ドル	買建	1,840,000.00	24,955,920	24,858,400	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	79,771,348,014	43.04
	フランス	18,445,653,255	9.95
	イタリア	17,442,786,767	9.41
	ドイツ	13,587,863,178	7.33
	イギリス	12,706,570,073	6.86
	スペイン	10,134,843,455	5.47
	ベルギー	4,635,513,552	2.50
	オランダ	4,278,341,411	2.31
	カナダ	3,721,354,968	2.01
	オーストラリア	3,651,919,255	1.97
	オーストリア	2,753,358,721	1.49
	メキシコ	1,612,260,254	0.87
	アイルランド	1,492,971,355	0.81
	デンマーク	1,276,167,082	0.69
	ポーランド	1,129,612,731	0.61
	フィンランド	1,079,776,469	0.58
	南アフリカ	900,478,539	0.49
	マレーシア	866,622,869	0.47
	スウェーデン	814,016,305	0.44
	シンガポール	717,117,213	0.39
ノルウェー	481,140,483	0.26	
スイス	440,499,519	0.24	
	小計	181,940,215,468	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,383,805,937	1.83
合計(純資産総額)		185,324,021,405	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	453,108,266	0.24
	買建	ドイツ	664,087,008	0.36

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	買建	—	1,442,508,500	0.78

(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% 08/15/25	12,300,000	10,630.79	1,307,588,015	10,658.31	1,310,972,664	2.000	2025/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	10,300,000	11,022.17	1,135,284,400	11,079.50	1,141,188,926	2.875	2043/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	10,700,000	10,446.72	1,117,799,748	10,234.26	1,095,066,176	2.500	2046/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.875% 07/15/18	10,000,000	10,480.75	1,048,075,700	10,493.66	1,049,366,212	0.875	2018/7/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	10,000,000	10,417.18	1,041,718,563	10,467.58	1,046,758,711	1.250	2021/3/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	10,431.31	1,043,131,719	10,459.25	1,045,925,483	0.625	2018/4/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/21	9,800,000	10,553.52	1,034,245,925	10,392.97	1,018,511,799	1.125	2021/6/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	10,795.45	982,386,850	10,728.99	976,338,212	2.750	2017/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	10,465.10	941,859,891	10,493.80	944,442,511	1.000	2019/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	10,973.02	932,707,168	11,002.13	935,181,811	2.375	2024/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,080.34	930,748,831	11,102.49	932,609,669	2.500	2024/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	8,400,000	11,074.81	930,284,776	11,054.46	928,574,878	2.875	2045/8/15	0.50
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	6,900,000	13,234.41	913,174,831	13,095.16	903,566,287	3.500	2020/4/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	10,651.07	894,690,098	10,681.40	897,237,643	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	10,866.93	885,655,346	10,897.32	888,132,371	2.250	2024/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/18	8,000,000	10,790.13	863,210,800	10,727.83	858,226,653	2.625	2018/1/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	8,270,000	10,615.71	877,920,038	10,290.23	851,002,319	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	10,623.01	849,841,150	10,627.93	850,234,786	1.500	2019/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	8,100,000	10,355.65	838,808,355	10,304.54	834,667,823	1.625	2026/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.125% 06/30/21	7,500,000	10,930.04	819,753,454	10,866.33	814,975,351	2.125	2021/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/23	7,550,000	10,556.24	796,996,725	10,605.42	800,709,266	1.750	2023/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	10,660.69	799,552,383	10,671.01	800,326,163	1.625	2019/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1% 08/31/19	7,500,000	10,512.94	788,471,177	10,489.18	786,689,057	1.000	2019/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	11,266.71	777,403,370	11,270.95	777,696,192	2.750	2023/11/15	0.42
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000	15,104.10	777,861,621	14,977.72	771,352,926	4.250	2023/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	6,500,000	11,536.44	749,868,810	11,606.36	754,413,557	3.125	2044/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	10,490.91	750,100,444	10,542.01	753,754,203	1.625	2022/11/15	0.41
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	3,750,000	20,047.59	751,784,676	20,083.99	753,149,658	5.750	2032/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,000,000	10,547.85	738,349,573	10,592.04	741,442,983	1.750	2023/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 08/31/21	6,800,000	10,776.61	732,810,011	10,801.33	734,490,714	2.000	2021/8/31	0.40

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.17
合計	98.17

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

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	17	アメリカ ドル	2,058,068.02	215,809,012	2,052,484.46	215,223,520	0.12
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	10	アメリカ ドル	1,304,102.55	136,748,193	1,295,468.8	135,842,858	0.07
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	6	アメリカ ドル	988,399	103,643,520	973,125	102,041,888	0.06
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	10	ユーロ	1,120,695	128,935,959	1,119,800	128,832,990	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,579,898	181,767,265	1,572,840	180,955,242	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	19	ユーロ	3,118,656	358,801,373	3,079,520	354,298,776	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。

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	6,480,000.00	674,434,890	679,104,000	0.37
	カナダドル	買建	790,000.00	61,783,230	61,683,200	0.03
	ユーロ	買建	5,200,000.00	594,521,750	598,260,000	0.32
	イギリスポンド	買建	810,000.00	103,143,540	103,461,300	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。

《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：2001年10月1日
作成基準日：2016年10月31日

基準価額・純資産の推移



基準価額	17,996円
純資産総額	376.52億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間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	2012年10月	2013年9月	2014年9月	2015年9月	2016年9月
分配金	0円	0円	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
国内株式 インデックス マザーファンド	51.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.0%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.9%
外国株式 インデックス マザーファンド	24.8%	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	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.8%	第113回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.3%	2018/06/20	0.2%
		第116回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.2%	2018/12/20	0.2%
		第125回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2020/09/20	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.4%	T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.0%
		T 2.875% 05/15/43	アメリカ	国債	-	2.875%	2043/05/15	0.0%
		T 2.5% 02/15/46	アメリカ	国債	-	2.500%	2046/02/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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>

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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>

当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。

※「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>

1円以上1円単位とします。

<申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

ありません。

<申込受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

<その他>

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

<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、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>

1口以上1口単位とします。

<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（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。

<一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めによりとります。

<受付不可日>

ありません。

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額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の評価方法

・株式

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

・公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

- a. 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
- b. 価格情報会社の提供する価額
- c. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

③外貨建資産の円換算

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額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、わが国における本ファンドの基準価額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。

<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13年10月1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10月1日から翌年9月30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5億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)における公告等の手続き

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、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、ファンドの繰上償還を行いません。
- ④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、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②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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。）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、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、当該約款変更を行いません。
- ④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<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。受託会社は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と重大な投資信託約款の変更手続き>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。

<反対者の買取請求権>

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

<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スャル・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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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。

(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15期計算期間(平成27年10月1日から平成28年9月30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11月30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 山田信之 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DCマイセレクション75の平成27年10月1日から平成28年9月30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、DCマイセレクション75の平成28年9月30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. XBR L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】

【DCマイセレクション75】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成27年9月30日現在)	第15期 (平成28年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,166,024,830	1,075,358,937
親投資信託受益証券	34,534,216,643	35,341,559,852
未収利息	211	-
流動資産合計	35,700,241,684	36,416,918,789
資産合計	35,700,241,684	36,416,918,789
負債の部		
流動負債		
未払解約金	36,892,257	11,560,951
未払受託者報酬	6,284,520	5,782,491
未払委託者報酬	60,750,245	55,897,350
未払利息	-	2,679
その他未払費用	1,657,833	1,654,446
流動負債合計	105,584,855	74,897,917
負債合計	105,584,855	74,897,917
純資産の部		
元本等		
元本	19,765,253,896	20,826,838,702
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	15,829,402,933	15,515,182,170
(分配準備積立金)	8,586,119,522	7,884,700,817
元本等合計	35,594,656,829	36,342,020,872
純資産合計	35,594,656,829	36,342,020,872
負債純資産合計	35,700,241,684	36,416,918,789

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期		第15期	
	自 平成26年10月1日 至 平成27年9月30日		自 平成27年10月1日 至 平成28年9月30日	
営業収益				
受取利息		508,475		235,002
有価証券売買等損益		1,969,674,470		△1,010,536,791
営業収益合計		1,970,182,945		△1,010,301,789
営業費用				
支払利息		-		339,445
受託者報酬		12,001,718		11,742,162
委託者報酬		116,016,372		113,507,482
その他費用		1,657,833		1,718,331
営業費用合計		129,675,923		127,307,420
営業利益又は営業損失(△)		1,840,507,022		△1,137,609,209
経常利益又は経常損失(△)		1,840,507,022		△1,137,609,209
当期純利益又は当期純損失(△)		1,840,507,022		△1,137,609,209
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(△)		536,739,210		7,184,645
期首剰余金又は期首欠損金(△)		13,874,957,531		15,829,402,933
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,886,992,735		2,207,460,671
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,886,992,735		2,207,460,671
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,236,315,145		1,376,887,580
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,236,315,145		1,376,887,580
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		15,829,402,933		15,515,182,170

(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14期 (平成27年9月30日現在)	第15期 (平成28年9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,765,253,896口	20,826,838,702口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,8009円 (18,009円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,7450円 (17,450円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自平成26年10月1日 至平成27年9月30日	第15期 自平成27年10月1日 至平成28年9月30日																																																												
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>450,510円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,303,317,302円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,619,865,068円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>7,282,351,710円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>18,205,984,590円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>19,765,253,896口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>9,211円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	450,510円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,303,317,302円	収益調整金額	C	9,619,865,068円	分配準備積立金額	D	7,282,351,710円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,205,984,590円	当ファンドの期末残存口数	F	19,765,253,896口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,211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	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>11,299,128,812円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>7,884,700,817円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>19,183,829,629円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>20,826,838,702口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>9,211円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	－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	11,299,128,812円	分配準備積立金額	D	7,884,700,817円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,183,829,629円	当ファンドの期末残存口数	F	20,826,838,702口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,211円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	450,510円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,303,317,302円																																																											
収益調整金額	C	9,619,865,068円																																																											
分配準備積立金額	D	7,282,351,710円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,205,984,590円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	19,765,253,896口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,211円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	－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	11,299,128,812円																																																											
分配準備積立金額	D	7,884,700,817円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,183,829,629円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	20,826,838,702口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,211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15期 自平成27年10月1日 至平成28年9月30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 15 期 (平成 28 年 9 月 30 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 14 期 自 平成 26 年 10 月 1 日 至 平成 27 年 9 月 30 日	第 15 期 自 平成 27 年 10 月 1 日 至 平成 28 年 9 月 30 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	19,607,866,750 円	19,765,253,896 円
期中追加設定元本額	3,273,383,820 円	2,775,993,818 円
期中一部解約元本額	3,115,996,674 円	1,714,409,012 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 14 期 (平成 27 年 9 月 30 日現在)	第 15 期 (平成 28 年 9 月 30 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	1,617,317,325	△972,943,812
合計	1,617,317,325	△972,943,812

(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	国内株式インデックス マザーファンド	15,961,678,904	18,352,738,403	
	外国株式インデックス マザーファンド	5,104,696,298	9,066,961,564	
	国内債券インデックス マザーファンド	4,464,239,591	6,269,578,081	
	外国債券インデックス マザーファンド	662,901,426	1,652,281,804	
合計		26,193,516,219	35,341,559,852	

(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 9 月 30 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,575,845,916
株式	146,599,763,280
派生商品評価勘定	2,473,520
未収入金	127,978,630
未収配当金	1,275,678,390
前払金	22,573,100
差入委託証拠金	80,703,900
流動資産合計	149,685,016,736
資産合計	149,685,016,736
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,057,420
未払金	11,958,000
未払解約金	236,740,450
未払利息	3,926
その他未払費用	1,077
流動負債合計	273,760,873
負債合計	273,760,873
純資産の部	
元本等	
元本	129,944,333,466
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	19,466,922,397
元本等合計	149,411,255,863
純資産合計	149,411,255,863
負債純資産合計	149,685,016,736

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 9 月 30 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 9 月 30 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	129,944,333,466 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 1.1498 円 (1 万口当たり純資産額) (11,498 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 9 月 30 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 9 月 30 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成 28 年 9 月 30 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 1 日
期首元本額	116,187,467,555 円
期中追加設定元本額	31,345,123,968 円
期中一部解約元本額	17,588,258,057 円
期末元本額	129,944,333,466 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)	1,021,484,941 円
SBI 資産設計オープン (資産成長型)	4,000,837,286 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	31,607,940 円
SMT TOPIX インデックス・オープン	8,407,598,484 円
世界経済インデックスファンド	910,999,593 円
マイセレクション 25	28,634,710 円
マイセレクション 50	70,458,483 円
マイセレクション 75	69,367,853 円
日本株式インデックス・オープン	16,562,979,159 円
DC マイセレクション 25	6,150,169,445 円
DC マイセレクション 50	17,754,715,277 円

DCマイセレクション75	15,961,678,904円
DC日本株式インデックス・オープン	4,982,511,867円
DCマイセレクションS25	2,506,209,416円
DCマイセレクションS50	6,894,779,509円
DCマイセレクションS75	4,269,469,520円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,722,392,117円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	503,675,732円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	597,504,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	320,121,263円
DC世界経済インデックスファンド	1,184,387,691円
日本株式インデックス・オープン (SMA専用)	381,882,710円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	39,431,954円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	123,892,631円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	72,774,155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)	742,955,577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)	278,117,353円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	948,265,613円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	167,657,722円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	1,058,811,144円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	3,437,034,451円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	1,256,959,423円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	6,725,176,206円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	1,150,170,872円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	829,226,064円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	1,395,064,885円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	2,538,207,119円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	767,990,086円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	1,100,893,168円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	88,453,134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)	1,677,517,574円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,986,451,476円
日本株式ファンド・シリーズ2	909,553,626円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	82,297,347円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	115,743,225円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	213,707,331円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	13,678,960円
SMT インデックスバランス・オープン	87,941,691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)	3,799,780,294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9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		△4,137,662,937
合計		△4,137,662,937

(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 9 月 30 日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,721,503,900	—	2,698,920,000	△22,583,900
合計		2,721,503,900	—	2,698,920,000	△22,583,900

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,600	2,744.00	9,878,400	
日本水産	107,300	433.00	46,460,900	
マルハニチロ	17,200	2,737.00	47,076,400	
カネコ種苗	2,900	1,464.00	4,245,600	
サカタのタネ	12,400	2,551.00	31,632,400	
ホクト	8,500	1,816.00	15,436,000	
ホクリョウ	900	758.00	682,200	
住石ホールディングス	24,700	85.00	2,099,500	
日鉄鉱業	2,300	3,905.00	8,981,500	
三井松島産業	5,500	1,168.00	6,424,000	
国際石油開発帝石	442,300	909.20	402,139,160	
日本海洋掘削	2,500	2,378.00	5,945,000	
石油資源開発	13,300	2,219.00	29,512,700	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,449.00	8,114,400	
ショーボンドホールディングス	8,800	4,695.00	41,316,000	
ミライト・ホールディングス	25,800	858.00	22,136,400	
タマホーム	6,300	514.00	3,238,200	
サンヨーホームズ	1,800	507.00	912,600	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	1,391.00	2,782,000	

安藤・間	56,100	612.00	34,333,200
東急建設	27,400	1,006.00	27,564,400
コムシスホールディングス	36,100	1,787.00	64,510,700
ミサワホーム	10,100	767.00	7,746,700
ビーアールホールディングス	6,600	215.00	1,419,000
高松コンストラクショングループ	6,300	2,336.00	14,716,800
東建コーポレーション	3,500	7,510.00	26,285,000
ソネック	900	618.00	556,200
ヤマウラ	4,000	506.00	2,024,000
大成建設	436,000	755.00	329,180,000
大林組	251,800	997.00	251,044,600
清水建設	257,000	900.00	231,300,000
飛島建設	68,200	172.00	11,730,400
長谷工コーポレーション	98,000	965.00	94,570,000
松井建設	9,300	1,180.00	10,974,000
銭高組	12,000	346.00	4,152,000
鹿島建設	394,000	704.00	277,376,000
不動テトラ	59,700	170.00	10,149,000
大末建設	3,200	857.00	2,742,400
鉄建建設	51,000	311.00	15,861,000
西松建設	97,000	469.00	45,493,000
三井住友建設	321,700	95.00	30,561,500
大豊建設	33,000	557.00	18,381,000
前田建設工業	52,000	856.00	44,512,000
佐田建設	6,100	388.00	2,366,800
ナカノフドー建設	6,600	399.00	2,633,400
奥村組	80,000	572.00	45,760,000
東鉄工業	10,100	2,890.00	29,189,000
イチケン	10,000	301.00	3,010,000
浅沼組	27,000	219.00	5,913,000
戸田建設	98,000	530.00	51,940,000
熊谷組	124,000	260.00	32,240,000
青木あすなろ建設	5,600	677.00	3,791,200
北野建設	18,000	263.00	4,734,000
植木組	11,000	215.00	2,365,000
三井ホーム	11,000	473.00	5,203,000

矢作建設工業	11,400	910.00	10,374,000
ピーエス三菱	10,100	353.00	3,565,300
日本ハウスホールディングス	17,100	409.00	6,993,900
大東建託	30,900	16,175.00	499,807,500
新日本建設	10,100	914.00	9,231,400
N I P P O	19,000	1,913.00	36,347,000
東亜道路工業	16,000	253.00	4,048,000
前田道路	26,000	1,801.00	46,826,000
日本道路	25,000	405.00	10,125,000
東亜建設工業	7,300	1,866.00	13,621,800
若築建設	48,000	144.00	6,912,000
東洋建設	26,300	437.00	11,493,100
五洋建設	93,200	574.00	53,496,800
大林道路	9,800	637.00	6,242,600
世紀東急工業	13,200	511.00	6,745,200
福田組	14,000	1,115.00	15,610,000
住友林業	57,800	1,345.00	77,741,000
日本基礎技術	9,300	344.00	3,199,200
日成ビルド工業	23,000	485.00	11,155,000
巴コーポレーション	10,800	331.00	3,574,800
パナホーム	31,000	802.00	24,862,000
大和ハウス工業	248,000	2,755.50	683,364,000
ライト工業	16,100	1,211.00	19,497,100
積水ハウス	280,700	1,711.00	480,277,700
日特建設	9,200	477.00	4,388,400
北陸電気工事	4,100	696.00	2,853,600
ユアテック	13,000	556.00	7,228,000
西部電気工業	1,400	2,045.00	2,863,000
四電工	6,000	395.00	2,370,000
中電工	12,100	2,040.00	24,684,000
関電工	33,000	931.00	30,723,000
きんでん	50,700	1,160.00	58,812,000
東京エネシス	10,000	1,054.00	10,540,000
トーエネック	12,000	495.00	5,940,000
住友電設	6,600	1,051.00	6,936,600
日本電設工業	13,700	1,889.00	25,879,300

協和エクシオ	32,900	1,433.00	47,145,700
新日本空調	7,100	1,187.00	8,427,700
NDS	1,300	2,467.00	3,207,100
九電工	15,400	3,700.00	56,980,000
三機工業	18,700	897.00	16,773,900
日揮	84,400	1,745.00	147,278,000
中外炉工業	26,000	199.00	5,174,000
ヤマト	7,600	527.00	4,005,200
太平電業	12,000	1,014.00	12,168,000
高砂熱学工業	25,000	1,496.00	37,400,000
三晃金属工業	900	2,932.00	2,638,800
朝日工業社	2,000	2,879.00	5,758,000
明星工業	15,200	480.00	7,296,000
大氣社	10,300	2,492.00	25,667,600
ダイダン	11,000	794.00	8,734,000
日比谷総合設備	10,100	1,651.00	16,675,100
東芝プラントシステム	13,600	1,627.00	22,127,200
OSJBホールディングス	17,100	213.00	3,642,300
東洋エンジニアリング	45,000	326.00	14,670,000
千代田化工建設	61,000	826.00	50,386,000
新興プランテック	17,200	719.00	12,366,800
日本製粉	27,000	1,548.00	41,796,000
日清製粉グループ本社	92,100	1,534.00	141,281,400
日東富士製粉	700	3,570.00	2,499,000
昭和産業	35,000	528.00	18,480,000
鳥越製粉	6,700	740.00	4,958,000
中部飼料	7,800	735.00	5,733,000
フィード・ワン	50,800	116.00	5,892,800
東洋精糖	13,000	107.00	1,391,000
日本甜菜製糖	4,300	1,974.00	8,488,200
三井製糖	6,600	2,434.00	16,064,400
塩水港精糖	9,100	241.00	2,193,100
日新製糖	3,600	1,390.00	5,004,000
森永製菓	15,200	4,860.00	73,872,000
中村屋	2,000	4,665.00	9,330,000
江崎グリコ	19,400	6,120.00	118,728,000

名糖産業	3,700	1,330.00	4,921,000
不二家	48,000	202.00	9,696,000
山崎製パン	61,500	2,475.00	152,212,500
第一屋製パン	13,000	129.00	1,677,000
モロゾフ	13,000	440.00	5,720,000
亀田製菓	4,700	5,630.00	26,461,000
寿スピリッツ	6,000	2,580.00	15,480,000
カルビー	31,100	3,815.00	118,646,500
森永乳業	75,000	807.00	60,525,000
六甲バター	3,800	2,909.00	11,054,200
ヤクルト本社	45,000	4,540.00	204,300,000
明治ホールディングス	49,700	9,990.00	496,503,000
雪印メグミルク	19,800	3,685.00	72,963,000
プリマハム	53,000	364.00	19,292,000
日本ハム	62,000	2,436.00	151,032,000
丸大食品	43,000	492.00	21,156,000
S F o o d s	5,300	2,642.00	14,002,600
伊藤ハム米久ホールディングス	50,200	1,053.00	52,860,600
サッポロホールディングス	27,500	2,794.00	76,835,000
アサヒグループホールディングス	157,500	3,666.00	577,395,000
キリンホールディングス	361,500	1,671.50	604,247,250
宝ホールディングス	60,800	942.00	57,273,600
オエノンホールディングス	22,000	232.00	5,104,000
養命酒製造	2,600	1,803.00	4,687,800
コカ・コーラウエスト	28,400	2,819.00	80,059,600
コカ・コーライーストジャパン	32,700	2,185.00	71,449,500
サントリー食品インターナショナル	57,500	4,350.00	250,125,000
ダイドードリンコ	4,200	5,620.00	23,604,000
伊藤園	24,900	3,580.00	89,142,000
キーコーヒー	7,400	1,892.00	14,000,800
ユニカフェ	2,300	900.00	2,070,000
ジャパンフーズ	1,100	1,161.00	1,277,100
日清オイリオグループ	44,000	469.00	20,636,000
不二製油グループ本社	22,400	2,065.00	46,256,000
かどや製油	800	3,085.00	2,468,000
J-オイルミルズ	3,500	3,590.00	12,565,000

キッコーマン	64,000	3,220.00	206,080,000
味の素	172,900	2,242.50	387,728,250
キューピー	42,700	3,115.00	133,010,500
ハウス食品グループ本社	28,700	2,310.00	66,297,000
カゴメ	30,100	2,646.00	79,644,600
焼津水産化学工業	4,000	1,017.00	4,068,000
アリアケジャパン	6,900	5,430.00	37,467,000
ピエトロ	900	1,531.00	1,377,900
エバラ食品工業	2,000	1,931.00	3,862,000
ニチレイ	45,000	2,264.00	101,880,000
東洋水産	41,300	4,270.00	176,351,000
イトアイト	900	2,037.00	1,833,300
日清食品ホールディングス	35,500	6,130.00	217,615,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,312.00	10,496,000
一正蒲鉾	2,900	1,112.00	3,224,800
フジッコ	8,200	2,321.00	19,032,200
ロック・フィールド	8,700	1,504.00	13,084,800
日本たばこ産業	465,300	4,119.00	1,916,570,700
ケンコーマヨネーズ	2,700	3,585.00	9,679,500
わらべや日洋ホールディングス	4,500	2,114.00	9,513,000
なとり	4,200	1,751.00	7,354,200
北の達人コーポレーション	1,600	456.00	729,600
ユーグレナ	26,900	1,454.00	39,112,600
ミヨシ油脂	29,000	126.00	3,654,000
理研ビタミン	2,100	4,780.00	10,038,000
片倉工業	10,000	1,202.00	12,020,000
グンゼ	64,000	325.00	20,800,000
東洋紡	311,000	169.00	52,559,000
ユニチカ	228,000	58.00	13,224,000
富士紡ホールディングス	3,800	2,904.00	11,035,200
倉敷紡績	79,000	191.00	15,089,000
シキボウ	48,000	114.00	5,472,000
日本毛織	22,100	716.00	15,823,600
トーア紡コーポレーション	3,300	505.00	1,666,500
ダイドーリミテッド	9,000	410.00	3,690,000
帝国繊維	8,200	1,573.00	12,898,600

帝人	64,200	1,948.00	125,061,600
東レ	569,000	979.00	557,051,000
サカイオーベックス	2,100	1,920.00	4,032,000
住江織物	20,000	233.00	4,660,000
日本フェルト	4,300	507.00	2,180,100
イチカワ	6,000	257.00	1,542,000
日東製網	8,000	153.00	1,224,000
芦森工業	20,000	154.00	3,080,000
アツギ	61,000	107.00	6,527,000
ダイニック	15,000	162.00	2,430,000
セーレン	19,600	1,197.00	23,461,200
ソトー	3,300	1,165.00	3,844,500
東海染工	11,000	123.00	1,353,000
小松精練	12,500	642.00	8,025,000
ワコールホールディングス	47,000	1,136.00	53,392,000
ホギメディカル	4,900	7,070.00	34,643,000
レナウン	21,200	104.00	2,204,800
クラウディア	1,800	507.00	912,600
T S I ホールディングス	35,100	585.00	20,533,500
三陽商会	43,000	167.00	7,181,000
オンワードホールディングス	51,000	727.00	37,077,000
ルック	17,000	141.00	2,397,000
ゴールドウイン	3,400	5,280.00	17,952,000
デサント	18,000	1,301.00	23,418,000
キング	3,900	395.00	1,540,500
ヤマトインターナショナル	4,900	396.00	1,940,400
特種東海製紙	4,600	3,585.00	16,491,000
王子ホールディングス	307,000	398.00	122,186,000
日本製紙	40,600	1,841.00	74,744,600
三菱製紙	12,000	683.00	8,196,000
北越紀州製紙	48,700	607.00	29,560,900
中越パルプ工業	31,000	222.00	6,882,000
巴川製紙所	12,000	202.00	2,424,000
大王製紙	34,700	1,191.00	41,327,700
レンゴー	69,000	618.00	42,642,000
トーモク	25,000	283.00	7,075,000

ザ・パック	5,600	2,707.00	15,159,200	
クラレ	132,100	1,491.00	196,961,100	
旭化成	489,000	800.80	391,591,200	
共和レザー	5,200	765.00	3,978,000	
昭和電工	52,200	1,267.00	66,137,400	
住友化学	578,000	445.00	257,210,000	
日本化成	15,000	131.00	1,965,000	
住友精化	3,200	3,565.00	11,408,000	
日産化学工業	46,900	3,055.00	143,279,500	
ラサ工業	30,000	106.00	3,180,000	
クレハ	5,900	3,685.00	21,741,500	
多木化学	5,000	729.00	3,645,000	
テイカ	13,000	532.00	6,916,000	
石原産業	14,100	635.00	8,953,500	
片倉コープアグリ	9,000	212.00	1,908,000	
日東エフシー	4,600	831.00	3,822,600	
日本曹達	51,000	430.00	21,930,000	
東ソー	212,000	618.00	131,016,000	
トクヤマ	130,000	421.00	54,730,000	
セントラル硝子	85,000	396.00	33,660,000	
東亜合成	49,100	1,092.00	53,617,200	
大阪ソーダ	34,000	413.00	14,042,000	
関東電化工業	19,000	909.00	17,271,000	
デンカ	163,000	435.00	70,905,000	
信越化学工業	140,700	7,002.00	985,181,400	
日本カーバイド工業	27,000	142.00	3,834,000	
堺化学工業	32,000	327.00	10,464,000	
エア・ウォーター	65,000	1,896.00	123,240,000	
大陽日酸	60,500	1,046.00	63,283,000	
日本化学工業	29,000	237.00	6,873,000	
日本パーカライジング	40,100	1,463.00	58,666,300	
高压ガス工業	12,000	677.00	8,124,000	
チタン工業	9,000	189.00	1,701,000	
四国化成工業	11,000	917.00	10,087,000	
戸田工業	16,000	289.00	4,624,000	
ステラ ケミファ	4,000	3,865.00	15,460,000	

保土谷化学工業	2,300	2,691.00	6,189,300
日本触媒	11,400	6,270.00	71,478,000
大日精化工業	30,000	491.00	14,730,000
カネカ	106,000	795.00	84,270,000
三菱瓦斯化学	67,500	1,441.00	97,267,500
三井化学	333,000	477.00	158,841,000
J S R	73,600	1,579.00	116,214,400
東京応化工業	15,700	3,065.00	48,120,500
大阪有機化学工業	5,200	682.00	3,546,400
三菱ケミカルホールディングス	525,700	628.20	330,244,740
ダイセル	105,800	1,267.00	134,048,600
住友ベークライト	69,000	526.00	36,294,000
積水化学工業	178,100	1,445.00	257,354,500
日本ゼオン	66,000	892.00	58,872,000
アイカ工業	23,600	2,671.00	63,035,600
宇部興産	420,000	192.00	80,640,000
積水樹脂	12,100	1,632.00	19,747,200
タキロン	18,000	460.00	8,280,000
旭有機材	25,000	196.00	4,900,000
日立化成	38,800	2,306.00	89,472,800
ニチバン	8,000	771.00	6,168,000
リケンテクノス	16,900	489.00	8,264,100
大倉工業	19,000	372.00	7,068,000
積水化成品工業	10,000	725.00	7,250,000
群栄化学工業	2,100	3,000.00	6,300,000
タイガースポリマー	3,900	702.00	2,737,800
ミライアル	2,900	707.00	2,050,300
ダイキアクシス	1,300	923.00	1,199,900
ダイキョーニシカラ	10,100	1,241.00	12,534,100
日本化薬	51,000	1,085.00	55,335,000
カーリットホールディングス	7,300	505.00	3,686,500
日本精化	6,500	791.00	5,141,500
扶桑化学工業	5,000	2,065.00	10,325,000
A D E K A	38,600	1,390.00	53,654,000
日油	59,000	1,023.00	60,357,000
ハリマ化成グループ	6,700	507.00	3,396,900

花王	199,300	5,691.00	1,134,216,300
第一工業製薬	17,000	333.00	5,661,000
ニイタカ	1,200	1,413.00	1,695,600
三洋化成工業	5,000	4,290.00	21,450,000
大日本塗料	45,000	203.00	9,135,000
日本ペイントホールディングス	60,600	3,350.00	203,010,000
関西ペイント	88,800	2,203.00	195,626,400
神東塗料	6,000	195.00	1,170,000
中国塗料	22,000	706.00	15,532,000
日本特殊塗料	5,500	1,266.00	6,963,000
藤倉化成	10,700	604.00	6,462,800
太陽ホールディングス	5,800	3,460.00	20,068,000
D I C	31,000	3,110.00	96,410,000
サカタインクス	16,000	1,217.00	19,472,000
東洋インキS Cホールディングス	78,000	451.00	35,178,000
T & K T O K A	5,700	963.00	5,489,100
富士フイルムホールディングス	179,600	3,718.00	667,752,800
資生堂	148,900	2,664.50	396,744,050
ライオン	97,000	1,632.00	158,304,000
高砂香料工業	5,200	2,703.00	14,055,600
マンダム	7,300	4,615.00	33,689,500
ミルボン	4,200	4,955.00	20,811,000
ファンケル	18,200	1,717.00	31,249,400
コーセー	12,700	10,280.00	130,556,000
コタ	2,700	1,123.00	3,032,100
シーズ・ホールディングス	10,000	2,898.00	28,980,000
シーボン	900	2,087.00	1,878,300
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	9,010.00	72,080,000
ノエビアホールディングス	5,000	3,080.00	15,400,000
アジュバンコスメジャパン	1,500	857.00	1,285,500
エステー	5,400	1,196.00	6,458,400
アグロ カネショウ	3,100	1,121.00	3,475,100
コニシ	12,300	1,259.00	15,485,700
長谷川香料	9,900	1,862.00	18,433,800
星光PMC	4,300	1,124.00	4,833,200
小林製薬	23,700	5,260.00	124,662,000

荒川化学工業	6,700	1,260.00	8,442,000
メック	6,100	1,006.00	6,136,600
日本高純度化学	2,200	2,363.00	5,198,600
タカラバイオ	16,800	1,692.00	28,425,600
JCU	2,300	3,915.00	9,004,500
新田ゼラチン	5,200	720.00	3,744,000
OATアグリオ	900	1,280.00	1,152,000
デクセリアルズ	23,500	833.00	19,575,500
アース製薬	5,600	4,765.00	26,684,000
イハラケミカル工業	10,900	896.00	9,766,400
北興化学工業	8,000	293.00	2,344,000
大成ラミック	2,200	2,859.00	6,289,800
クミアイ化学工業	16,200	533.00	8,634,600
日本農薬	17,900	509.00	9,111,100
アキレス	6,400	1,423.00	9,107,200
有沢製作所	11,600	517.00	5,997,200
日東電工	60,600	6,506.00	394,263,600
レック	2,500	2,436.00	6,090,000
きもと	12,900	232.00	2,992,800
藤森工業	6,700	2,376.00	15,919,200
前澤化成工業	5,500	991.00	5,450,500
JSP	5,100	2,290.00	11,679,000
エフピコ	7,000	5,660.00	39,620,000
天馬	5,800	1,605.00	9,309,000
信越ポリマー	15,400	674.00	10,379,600
東リ	20,000	315.00	6,300,000
ニフコ	15,000	5,340.00	80,100,000
日本バルカー工業	6,000	1,376.00	8,256,000
ユニ・チャーム	158,900	2,608.50	414,490,650
協和発酵キリン	93,900	1,586.00	148,925,400
武田薬品工業	312,600	4,823.00	1,507,669,800
アステラス製薬	851,800	1,573.50	1,340,307,300
大日本住友製薬	55,500	1,947.00	108,058,500
塩野義製薬	114,400	5,152.00	589,388,800
田辺三菱製薬	91,400	2,155.00	196,967,000
わかもと製薬	9,000	232.00	2,088,000

あすか製薬	10,000	1,848.00	18,480,000	
日本新薬	18,000	5,460.00	98,280,000	
ビオフェルミン製薬	1,300	2,678.00	3,481,400	
中外製薬	78,100	3,635.00	283,893,500	
科研製薬	13,500	6,180.00	83,430,000	
エーザイ	96,600	6,287.00	607,324,200	
ロート製薬	38,400	1,735.00	66,624,000	
小野薬品工業	178,200	2,806.50	500,118,300	
久光製薬	24,400	5,430.00	132,492,000	
有機合成薬品工業	5,100	218.00	1,111,800	
持田製薬	5,400	7,900.00	42,660,000	
参天製薬	144,600	1,483.00	214,441,800	
扶桑薬品工業	2,600	2,787.00	7,246,200	
日本ケミファ	1,100	4,245.00	4,669,500	
ツムラ	24,700	2,865.00	70,765,500	
日医工	18,300	1,925.00	35,227,500	
キッセイ薬品工業	13,900	2,687.00	37,349,300	
生化学工業	14,500	1,653.00	23,968,500	
栄研化学	6,600	2,908.00	19,192,800	
日水製薬	3,100	1,154.00	3,577,400	
鳥居薬品	5,400	2,178.00	11,761,200	
JCRファーマ	6,000	2,622.00	15,732,000	
東和薬品	3,600	4,095.00	14,742,000	
富士製薬工業	2,500	2,681.00	6,702,500	
沢井製薬	13,300	7,180.00	95,494,000	
ゼリア新薬工業	16,100	1,706.00	27,466,600	
第一三共	263,900	2,415.00	637,318,500	
キョーリン製薬ホールディングス	20,900	2,279.00	47,631,100	
大幸薬品	3,900	1,627.00	6,345,300	
ダイト	4,400	2,370.00	10,428,000	
大塚ホールディングス	168,700	4,589.00	774,164,300	
大正製薬ホールディングス	18,900	10,320.00	195,048,000	
ペプチドリーム	13,100	5,490.00	71,919,000	
日本コークス工業	63,300	82.00	5,190,600	
昭和シェル石油	70,100	935.00	65,543,500	
ニチレキ	9,600	732.00	7,027,200	

東燃ゼネラル石油	128,000	1,020.00	130,560,000	
ユシロ化学工業	4,200	1,429.00	6,001,800	
ビーピー・カストロール	3,200	1,295.00	4,144,000	
富士石油	18,200	316.00	5,751,200	
MORESCO	2,500	1,276.00	3,190,000	
出光興産	40,900	2,080.00	85,072,000	
JXホールディングス	928,900	407.10	378,155,190	
コスモエネルギーホールディングス	23,700	1,263.00	29,933,100	
横浜ゴム	47,300	1,604.00	75,869,200	
東洋ゴム工業	41,400	1,410.00	58,374,000	
ブリヂストン	264,800	3,706.00	981,348,800	
住友ゴム工業	73,400	1,518.00	111,421,200	
藤倉ゴム工業	6,500	462.00	3,003,000	
オカモト	24,000	1,262.00	30,288,000	
フコク	2,900	779.00	2,259,100	
ニッタ	8,500	2,520.00	21,420,000	
住友理工	16,900	945.00	15,970,500	
三ツ星ベルト	19,000	856.00	16,264,000	
バンドー化学	14,500	1,000.00	14,500,000	
日東紡績	52,000	330.00	17,160,000	
旭硝子	387,000	650.00	251,550,000	
日本板硝子	37,800	800.00	30,240,000	
石塚硝子	11,000	153.00	1,683,000	
日本山村硝子	32,000	173.00	5,536,000	
日本電気硝子	162,000	520.00	84,240,000	
オハラ	3,000	616.00	1,848,000	
住友大阪セメント	156,000	468.00	73,008,000	
太平洋セメント	500,000	289.00	144,500,000	
日本ヒューム	7,700	620.00	4,774,000	
日本コンクリート工業	16,300	362.00	5,900,600	
三谷セキサン	4,000	2,302.00	9,208,000	
アジアパイルホールディングス	9,900	432.00	4,276,800	
東海カーボン	74,000	273.00	20,202,000	
日本カーボン	39,000	172.00	6,708,000	
東洋炭素	4,400	1,311.00	5,768,400	
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	2,335.00	10,507,500	

TOTO	57,600	3,795.00	218,592,000
日本碍子	99,100	2,079.00	206,028,900
日本特殊陶業	67,600	1,767.00	119,449,200
MARUWA	2,900	3,805.00	11,034,500
品川リフラクトリーズ	20,000	190.00	3,800,000
黒崎播磨	18,000	260.00	4,680,000
ヨータイ	5,000	294.00	1,470,000
イソライト工業	4,200	237.00	995,400
東京窯業	10,400	162.00	1,684,800
ニッカトー	3,300	387.00	1,277,100
フジミインコーポレーテッド	6,700	1,517.00	10,163,900
ニチアス	40,000	891.00	35,640,000
ニチハ	10,500	2,245.00	23,572,500
新日鐵住金	353,700	2,056.50	727,384,050
神戸製鋼所	144,100	907.00	130,698,700
合同製鐵	4,500	1,793.00	8,068,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	214,400	1,461.00	313,238,400
日新製鋼	35,800	1,363.00	48,795,400
東京製鐵	44,100	680.00	29,988,000
共英製鋼	8,500	1,907.00	16,209,500
大和工業	17,400	2,974.00	51,747,600
東京鐵鋼	17,000	402.00	6,834,000
大阪製鐵	5,000	1,828.00	9,140,000
淀川製鋼所	11,700	2,702.00	31,613,400
東洋鋼鋳	19,700	282.00	5,555,400
丸一鋼管	26,300	3,480.00	91,524,000
モリ工業	2,600	1,609.00	4,183,400
大同特殊鋼	131,000	461.00	60,391,000
日本高周波鋼業	32,000	71.00	2,272,000
日本冶金工業	57,800	146.00	8,438,800
山陽特殊製鋼	47,000	564.00	26,508,000
愛知製鋼	4,600	5,100.00	23,460,000
日立金属	89,800	1,232.00	110,633,600
日本金属	2,000	932.00	1,864,000
大平洋金属	55,000	300.00	16,500,000
新日本電工	45,600	170.00	7,752,000

栗本鐵工所	3,800	1,716.00	6,520,800
虹技	13,000	277.00	3,601,000
日本鑄鉄管	11,000	166.00	1,826,000
三菱製鋼	55,000	167.00	9,185,000
日亜鋼業	11,300	219.00	2,474,700
日本精線	6,000	453.00	2,718,000
シンニッタン	7,700	468.00	3,603,600
新家工業	16,000	138.00	2,208,000
大紀アルミニウム工業所	12,000	359.00	4,308,000
日本軽金属ホールディングス	177,600	217.00	38,539,200
三井金属鉱業	200,000	210.00	42,000,000
東邦亜鉛	41,000	326.00	13,366,000
三菱マテリアル	48,900	2,740.00	133,986,000
住友金属鉱山	217,000	1,386.50	300,870,500
DOWAホールディングス	101,000	703.00	71,003,000
古河機械金属	122,000	157.00	19,154,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,800	1,405.00	10,959,000
東邦チタニウム	13,300	724.00	9,629,200
UACJ	110,000	301.00	33,110,000
古河電気工業	24,700	2,735.00	67,554,500
住友電気工業	314,000	1,416.00	444,624,000
フジクラ	109,000	547.00	59,623,000
昭和電線ホールディングス	93,000	70.00	6,510,000
東京特殊電線	1,200	956.00	1,147,200
タツタ電線	16,400	355.00	5,822,000
沖電線	10,000	233.00	2,330,000
カナレ電気	1,100	1,941.00	2,135,100
平河ヒューテック	3,800	833.00	3,165,400
リョービ	48,000	446.00	21,408,000
アーレスティ	9,100	1,069.00	9,727,900
アサヒホールディングス	11,800	1,721.00	20,307,800
稲葉製作所	4,200	1,273.00	5,346,600
宮地エンジニアリンググループ	24,000	151.00	3,624,000
トーカロ	5,500	2,201.00	12,105,500
アルファC o	2,600	963.00	2,503,800
SUMCO	81,900	821.00	67,239,900

川田テクノロジーズ	1,500	4,470.00	6,705,000	
東洋製罐グループホールディングス	55,700	1,772.00	98,700,400	
ホッカンホールディングス	20,000	346.00	6,920,000	
コロナ	4,100	1,019.00	4,177,900	
横河ブリッジホールディングス	14,900	1,124.00	16,747,600	
駒井ハルテック	1,400	1,966.00	2,752,400	
高田機工	7,000	203.00	1,421,000	
三和ホールディングス	77,900	971.00	75,640,900	
文化シャッター	21,900	800.00	17,520,000	
三協立山	10,300	1,639.00	16,881,700	
アルインコ	5,900	933.00	5,504,700	
東洋シャッター	2,000	583.00	1,166,000	
LIXILグループ	109,300	2,157.00	235,760,100	
日本ファイルコン	5,700	487.00	2,775,900	
ノーリツ	15,400	2,078.00	32,001,200	
長府製作所	8,400	2,640.00	22,176,000	
リンナイ	14,600	9,350.00	136,510,000	
ダイニチ工業	4,000	653.00	2,612,000	
日東精工	11,000	368.00	4,048,000	
三洋工業	10,000	175.00	1,750,000	
岡部	16,300	822.00	13,398,600	
ジーテクト	8,200	1,858.00	15,235,600	
東プレ	15,100	2,111.00	31,876,100	
高周波熱錬	14,600	770.00	11,242,000	
東京製綱	5,300	1,685.00	8,930,500	
サンコール	4,200	462.00	1,940,400	
モリテック スチール	4,000	259.00	1,036,000	
パイオラックス	4,000	6,270.00	25,080,000	
日本発條	73,800	973.00	71,807,400	
中央発條	10,000	284.00	2,840,000	
アドバネクス	1,500	1,054.00	1,581,000	
立川ブラインド工業	3,300	741.00	2,445,300	
三益半導体工業	5,800	1,194.00	6,925,200	
日本ドライケミカル	1,000	2,290.00	2,290,000	
日本製鋼所	26,000	2,282.00	59,332,000	
三浦工業	35,000	2,013.00	70,455,000	

タクマ	29,000	952.00	27,608,000	
ツガミ	23,000	526.00	12,098,000	
オークマ	51,000	767.00	39,117,000	
東芝機械	43,000	345.00	14,835,000	
アマダホールディングス	114,400	1,044.00	119,433,600	
アイダエンジニアリング	20,700	803.00	16,622,100	
滝澤鉄工所	24,000	132.00	3,168,000	
富士機械製造	25,600	1,162.00	29,747,200	
牧野フライス製作所	40,000	617.00	24,680,000	
オーエスジー	35,700	2,003.00	71,507,100	
ダイジェット工業	12,000	146.00	1,752,000	
旭ダイヤモンド工業	21,200	815.00	17,278,000	
DMG森精機	46,800	1,042.00	48,765,600	
ソディック	19,900	747.00	14,865,300	
ディスコ	10,000	11,890.00	118,900,000	
日東工器	4,600	2,361.00	10,860,600	
パンチ工業	3,100	894.00	2,771,400	
豊和工業	4,500	526.00	2,367,000	
OKK	35,000	99.00	3,465,000	
東洋機械金属	5,800	367.00	2,128,600	
島精機製作所	11,100	2,743.00	30,447,300	
NCホールディングス	2,500	870.00	2,175,000	
フリー	1,500	3,030.00	4,545,000	
ヤマシンフィルタ	1,500	529.00	793,500	
日阪製作所	9,900	850.00	8,415,000	
やまびこ	14,400	905.00	13,032,000	
ペガサスマシン製造	8,100	540.00	4,374,000	
ナブテスコ	40,800	2,845.00	116,076,000	
三井海洋開発	7,900	1,792.00	14,156,800	
レオン自動機	6,600	682.00	4,501,200	
SMC	23,500	28,890.00	678,915,000	
新川	7,000	702.00	4,914,000	
ホソカワミクロン	13,000	568.00	7,384,000	
ユニオンツール	3,400	2,680.00	9,112,000	
オイレス工業	10,100	1,712.00	17,291,200	
日精エー・エス・ビー機械	2,500	1,737.00	4,342,500	

サトーホールディングス	10,600	2,198.00	23,298,800
日本エアータック	2,500	608.00	1,520,000
日精樹脂工業	5,800	716.00	4,152,800
オカダアイヨン	1,500	773.00	1,159,500
ワイエイシイ	3,200	1,331.00	4,259,200
小松製作所	384,400	2,295.00	882,198,000
住友重機械工業	229,000	494.00	113,126,000
日立建機	35,000	1,999.00	69,965,000
日工	2,400	1,630.00	3,912,000
巴工業	3,200	1,552.00	4,966,400
井関農機	81,000	250.00	20,250,000
TOWA	7,600	1,276.00	9,697,600
丸山製作所	18,000	169.00	3,042,000
北川鉄工所	3,800	1,659.00	6,304,200
ローツェ	2,800	2,380.00	6,664,000
タカキタ	2,600	507.00	1,318,200
クボタ	376,500	1,513.50	569,832,750
荏原実業	2,200	1,227.00	2,699,400
三菱化工機	28,000	209.00	5,852,000
月島機械	14,900	1,116.00	16,628,400
帝国電機製作所	5,700	814.00	4,639,800
新東工業	17,900	927.00	16,593,300
澁谷工業	6,500	1,897.00	12,330,500
アイチ コーポレーション	11,100	737.00	8,180,700
小森コーポレーション	17,400	1,268.00	22,063,200
鶴見製作所	5,900	1,568.00	9,251,200
住友精密工業	12,000	328.00	3,936,000
酒井重工業	15,000	190.00	2,850,000
荏原製作所	34,600	2,973.00	102,865,800
石井鐵工所	1,200	1,500.00	1,800,000
西島製作所	8,400	1,053.00	8,845,200
北越工業	8,400	671.00	5,636,400
ダイキン工業	109,100	9,351.00	1,020,194,100
オルガノ	13,000	413.00	5,369,000
トーヨーカネツ	38,000	212.00	8,056,000
栗田工業	47,100	2,390.00	112,569,000

椿本チエイン	45,000	776.00	34,920,000
大同工業	17,000	218.00	3,706,000
木村化工機	7,200	356.00	2,563,200
アネスト岩田	12,600	1,036.00	13,053,600
ダイフク	40,300	1,838.00	74,071,400
サムコ	1,900	839.00	1,594,100
加藤製作所	3,600	2,105.00	7,578,000
油研工業	17,000	169.00	2,873,000
タダノ	36,200	986.00	35,693,200
フジテック	21,800	1,196.00	26,072,800
CKD	20,800	1,211.00	25,188,800
キトー	9,400	970.00	9,118,000
平和	23,200	2,240.00	51,968,000
理想科学工業	8,300	1,647.00	13,670,100
SANKYO	20,800	3,440.00	71,552,000
日本金銭機械	6,900	1,535.00	10,591,500
マースエンジニアリング	4,200	2,010.00	8,442,000
福島工業	4,600	3,300.00	15,180,000
オーイズミ	3,100	744.00	2,306,400
ダイコク電機	3,100	1,535.00	4,758,500
竹内製作所	14,800	1,683.00	24,908,400
アマノ	23,200	1,608.00	37,305,600
JUKI	11,800	733.00	8,649,400
サンデンホールディングス	46,000	300.00	13,800,000
蛇の目マシン工業	7,300	566.00	4,131,800
マックス	12,000	1,217.00	14,604,000
グローリー	25,500	3,315.00	84,532,500
新晃工業	5,200	1,290.00	6,708,000
大和冷機工業	12,000	911.00	10,932,000
セガサミーホールディングス	80,500	1,435.00	115,517,500
日本ピストンリング	3,100	1,526.00	4,730,600
リケン	3,500	3,470.00	12,145,000
T P R	9,200	2,821.00	25,953,200
ツバキ・ナカシマ	8,300	1,521.00	12,624,300
ホシザキ	16,400	9,180.00	150,552,000
大豊工業	6,000	1,109.00	6,654,000

日本精工	153,900	1,026.00	157,901,400
NTN	186,000	349.00	64,914,000
ジェイテクト	79,900	1,502.00	120,009,800
不二越	75,000	368.00	27,600,000
日本トムソン	25,600	372.00	9,523,200
THK	49,800	1,972.00	98,205,600
ユーシン精機	2,900	2,546.00	7,383,400
前澤給装工業	3,100	1,347.00	4,175,700
イーグル工業	9,300	1,224.00	11,383,200
前澤工業	5,500	297.00	1,633,500
日本ピラー工業	7,600	1,021.00	7,759,600
キット	33,400	557.00	18,603,800
日立工機	20,000	731.00	14,620,000
マキタ	48,900	7,160.00	350,124,000
日立造船	59,700	510.00	30,447,000
三菱重工業	1,334,000	419.10	559,079,400
IHI	577,000	290.00	167,330,000
日清紡ホールディングス	41,600	996.00	41,433,600
イビデン	45,900	1,348.00	61,873,200
コニカミノルタ	187,100	850.00	159,035,000
ブラザー工業	96,900	1,761.00	170,640,900
ミネベア	120,800	944.00	114,035,200
日立製作所	1,912,000	468.60	895,963,200
東芝	1,577,000	335.00	528,295,000
三菱電機	799,000	1,282.50	1,024,717,500
富士電機	226,000	460.00	103,960,000
東洋電機製造	15,000	320.00	4,800,000
安川電機	93,100	1,498.00	139,463,800
シンフォニアテクノロジー	49,000	165.00	8,085,000
明電舎	69,000	331.00	22,839,000
オリジン電気	11,000	260.00	2,860,000
山洋電気	20,000	552.00	11,040,000
デンヨー	6,900	1,048.00	7,231,200
東芝テック	54,000	407.00	21,978,000
芝浦メカトロニクス	12,000	242.00	2,904,000
マブチモーター	21,200	5,540.00	117,448,000

日本電産	90,200	9,262.00	835,432,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	2,276.00	2,048,400
東光高岳	4,200	2,125.00	8,925,000
ダブル・スコープ	7,200	2,112.00	15,206,400
ダイヘン	44,000	536.00	23,584,000
田淵電機	8,600	336.00	2,889,600
ヤーマン	1,000	3,910.00	3,910,000
JVCケンウッド	55,100	253.00	13,940,300
ミマキエンジニアリング	6,800	524.00	3,563,200
第一精工	3,500	1,023.00	3,580,500
日新電機	17,600	1,674.00	29,462,400
大崎電気工業	14,000	1,016.00	14,224,000
オムロン	84,600	3,605.00	304,983,000
日東工業	12,000	1,318.00	15,816,000
I D E C	9,800	934.00	9,153,200
不二電機工業	700	1,352.00	946,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	144,000	414.00	59,616,000
サクサホールディングス	19,000	215.00	4,085,000
メルコホールディングス	4,200	2,452.00	10,298,400
テクノメディカ	1,700	1,611.00	2,738,700
日本電気	1,030,000	259.00	266,770,000
富士通	722,000	540.00	389,880,000
沖電気工業	32,500	1,352.00	43,940,000
岩崎通信機	35,000	70.00	2,450,000
電気興業	20,000	507.00	10,140,000
サンケン電気	41,000	324.00	13,284,000
ナカヨ	7,000	349.00	2,443,000
アイホン	4,200	1,662.00	6,980,400
ルネサスエレクトロニクス	38,800	614.00	23,823,200
セイコーエプソン	111,600	1,932.00	215,611,200
ワコム	58,200	305.00	17,751,000
アルバック	13,800	2,995.00	41,331,000
アクセル	3,400	730.00	2,482,000
E I Z O	7,400	2,725.00	20,165,000
ジャパンディスプレイ	139,900	157.00	21,964,300
日本信号	20,700	846.00	17,512,200

京三製作所	18,000	383.00	6,894,000
能美防災	8,500	1,499.00	12,741,500
ホーチキ	5,500	1,120.00	6,160,000
エレコム	6,500	2,191.00	14,241,500
日本無線	4,400	1,438.00	6,327,200
パナソニック	856,000	1,002.00	857,712,000
アンリツ	45,000	576.00	25,920,000
富士通ゼネラル	23,000	2,180.00	50,140,000
日立国際電気	17,100	1,853.00	31,686,300
ソニー	528,700	3,293.00	1,741,009,100
TDK	45,200	6,700.00	302,840,000
帝国通信工業	18,000	153.00	2,754,000
ミツミ電機	28,600	564.00	16,130,400
タムラ製作所	29,000	382.00	11,078,000
アルプス電気	64,600	2,400.00	155,040,000
池上通信機	24,000	128.00	3,072,000
パイオニア	121,200	218.00	26,421,600
日本電波工業	6,800	809.00	5,501,200
鈴木	2,900	531.00	1,539,900
日本トリム	2,000	6,060.00	12,120,000
ローランド ディー. ジー.	3,800	2,263.00	8,599,400
フォスター電機	9,400	1,836.00	17,258,400
クラリオン	39,000	299.00	11,661,000
SMK	21,000	334.00	7,014,000
ヨコオ	5,400	635.00	3,429,000
ホシデン	22,700	728.00	16,525,600
ヒロセ電機	12,100	13,200.00	159,720,000
日本航空電子工業	21,000	1,570.00	32,970,000
TOA	8,800	910.00	8,008,000
日立マクセル	12,400	1,550.00	19,220,000
古野電気	9,000	546.00	4,914,000
ユニデンホールディングス	24,000	153.00	3,672,000
アルパイン	17,900	1,326.00	23,735,400
スミダコーポレーション	6,200	997.00	6,181,400
アイコム	4,100	2,006.00	8,224,600
リオン	2,900	1,333.00	3,865,700

本多通信工業	2,000	895.00	1,790,000
船井電機	7,600	826.00	6,277,600
横河電機	75,000	1,335.00	100,125,000
新電元工業	26,000	396.00	10,296,000
アズビル	24,500	3,040.00	74,480,000
東亜ディーケーケー	4,200	466.00	1,957,200
日本光電工業	31,300	2,440.00	76,372,000
チノー	2,700	1,013.00	2,735,100
共和電業	8,500	350.00	2,975,000
日本電子材料	3,000	484.00	1,452,000
堀場製作所	14,800	4,945.00	73,186,000
アドバンテスト	51,100	1,360.00	69,496,000
小野測器	3,700	864.00	3,196,800
エスベック	7,800	1,310.00	10,218,000
パナソニック デバイスSUNX	6,600	567.00	3,742,200
キーエンス	17,000	73,460.00	1,248,820,000
日置電機	3,900	1,907.00	7,437,300
シスメックス	58,200	7,440.00	433,008,000
日本マイクロニクス	14,000	1,347.00	18,858,000
メガチップス	7,500	2,066.00	15,495,000
OBARA GROUP	4,400	3,960.00	17,424,000
澤藤電機	4,000	179.00	716,000
コーセル	10,400	1,218.00	12,667,200
イリソ電子工業	2,400	5,390.00	12,936,000
新日本無線	5,500	332.00	1,826,000
オブテックス	5,500	2,390.00	13,145,000
千代田インテグレ	4,000	2,047.00	8,188,000
アイ・オー・データ機器	2,400	1,033.00	2,479,200
レーザーテック	8,800	1,931.00	16,992,800
スタンレー電気	53,600	2,707.00	145,095,200
岩崎電気	26,000	158.00	4,108,000
ウシオ電機	45,500	1,154.00	52,507,000
岡谷電機産業	4,100	376.00	1,541,600
ハリオス テクノ ホールディング	6,500	379.00	2,463,500
日本セラミック	6,100	1,880.00	11,468,000
遠藤照明	3,800	803.00	3,051,400

日本デジタル研究所	6,300	1,476.00	9,298,800
古河電池	5,000	647.00	3,235,000
双信電機	3,800	263.00	999,400
山一電機	6,500	850.00	5,525,000
図研	5,400	1,090.00	5,886,000
日本電子	30,000	406.00	12,180,000
カシオ計算機	75,100	1,403.00	105,365,300
ファナック	76,000	17,010.00	1,292,760,000
日本シイエムケイ	16,200	543.00	8,796,600
エンプラス	3,800	3,060.00	11,628,000
大真空	2,800	1,095.00	3,066,000
ローム	36,200	5,280.00	191,136,000
浜松ホトニクス	58,500	3,085.00	180,472,500
三井ハイテック	10,900	691.00	7,531,900
新光電気工業	28,400	568.00	16,131,200
京セラ	123,000	4,823.00	593,229,000
太陽誘電	36,500	988.00	36,062,000
村田製作所	79,000	13,030.00	1,029,370,000
ユーシン	10,000	723.00	7,230,000
双葉電子工業	12,300	1,640.00	20,172,000
北陸電気工業	30,000	119.00	3,570,000
ニチコン	23,600	799.00	18,856,400
日本ケミコン	61,000	164.00	10,004,000
KOA	10,400	862.00	8,964,800
市光工業	18,000	301.00	5,418,000
小糸製作所	44,900	4,880.00	219,112,000
ミツバ	12,800	1,319.00	16,883,200
スター精密	14,300	1,257.00	17,975,100
SCREENホールディングス	15,400	6,470.00	99,638,000
キヤノン電子	6,900	1,599.00	11,033,100
キヤノン	403,400	2,923.50	1,179,339,900
リコー	242,600	910.00	220,766,000
MUTOHホールディングス	9,000	230.00	2,070,000
東京エレクトロン	61,500	8,877.00	545,935,500
トヨタ紡織	26,200	2,244.00	58,792,800
ユニプレス	15,600	1,772.00	27,643,200

豊田自動織機	68,300	4,650.00	317,595,000
モリタホールディングス	13,100	1,427.00	18,693,700
三櫻工業	9,800	621.00	6,085,800
デンソー	166,300	4,000.00	665,200,000
東海理化電機製作所	22,100	1,962.00	43,360,200
三井造船	290,000	141.00	40,890,000
川崎重工業	583,000	310.00	180,730,000
名村造船所	22,700	678.00	15,390,600
サノヤスホールディングス	11,000	306.00	3,366,000
日本車輛製造	31,000	266.00	8,246,000
ニチュ三菱フォークリフト	8,600	669.00	5,753,400
近畿車輛	1,100	2,314.00	2,545,400
日産自動車	1,021,500	982.70	1,003,828,050
いすゞ自動車	217,100	1,179.50	256,069,450
トヨタ自動車	955,200	5,779.00	5,520,100,800
日野自動車	106,900	1,071.00	114,489,900
三菱自動車工業	297,500	469.00	139,527,500
エフテック	4,200	1,230.00	5,166,000
レシップホールディングス	2,500	852.00	2,130,000
GMB	1,200	984.00	1,180,800
ファルテック	1,300	1,168.00	1,518,400
武蔵精密工業	8,000	2,359.00	18,872,000
日産車体	36,600	924.00	33,818,400
新明和工業	33,000	665.00	21,945,000
極東開発工業	14,900	1,160.00	17,284,000
日信工業	16,800	1,531.00	25,720,800
トピー工業	6,200	2,072.00	12,846,400
ティラド	29,000	196.00	5,684,000
曙ブレーキ工業	38,000	202.00	7,676,000
タチエス	11,900	1,631.00	19,408,900
NOK	36,400	2,191.00	79,752,400
フタバ産業	24,000	500.00	12,000,000
KYB	84,000	449.00	37,716,000
大同メタル工業	10,500	1,101.00	11,560,500
プレス工業	40,100	428.00	17,162,800
ミクニ	10,000	327.00	3,270,000

カルソニックカンセイ	57,000	931.00	53,067,000
太平洋工業	16,700	1,152.00	19,238,400
ケーヒン	17,200	1,591.00	27,365,200
河西工業	9,500	1,048.00	9,956,000
アイシン精機	76,800	4,595.00	352,896,000
富士機工	8,700	359.00	3,123,300
マツダ	237,200	1,531.50	363,271,800
今仙電機製作所	6,900	871.00	6,009,900
本田技研工業	674,300	2,887.50	1,947,041,250
スズキ	137,100	3,360.00	460,656,000
富士重工業	232,600	3,755.00	873,413,000
安永	2,500	461.00	1,152,500
ヤマハ発動機	105,800	2,020.00	213,716,000
ショーワ	19,500	529.00	10,315,500
T B K	9,000	408.00	3,672,000
エクセディ	10,200	2,554.00	26,050,800
豊田合成	27,300	2,333.00	63,690,900
愛三工業	13,200	797.00	10,520,400
盟和産業	1,200	1,055.00	1,266,000
ヨロズ	7,000	1,475.00	10,325,000
エフ・シー・シー	12,300	2,161.00	26,580,300
シマノ	30,200	14,920.00	450,584,000
テイ・エス テック	17,400	2,539.00	44,178,600
ジャムコ	4,400	2,035.00	8,954,000
テルモ	114,900	3,865.00	444,088,500
クリエートメディック	2,500	921.00	2,302,500
日機装	27,000	902.00	24,354,000
島津製作所	96,000	1,531.00	146,976,000
J M S	14,000	270.00	3,780,000
長野計器	4,600	588.00	2,704,800
ブイ・テクノロジー	1,800	11,820.00	21,276,000
東京計器	24,000	166.00	3,984,000
愛知時計電機	1,000	3,220.00	3,220,000
オーバル	7,400	232.00	1,716,800
東京精密	14,500	2,681.00	38,874,500
マニー	10,000	2,257.00	22,570,000

ニコン	139,900	1,504.00	210,409,600
トプコン	25,200	1,429.00	36,010,800
オリンパス	111,600	3,500.00	390,600,000
理研計器	6,100	1,200.00	7,320,000
タムロン	6,700	1,629.00	10,914,300
HOYA	166,400	4,038.00	671,923,200
ノーリツ鋼機	6,800	697.00	4,739,600
エー・アンド・デイ	6,900	401.00	2,766,900
シチズンホールディングス	92,300	526.00	48,549,800
リズム時計工業	33,000	180.00	5,940,000
大研医器	6,000	757.00	4,542,000
メニコン	5,000	2,757.00	13,785,000
松風	3,700	1,408.00	5,209,600
セイコーホールディングス	48,000	317.00	15,216,000
ニプロ	55,900	1,279.00	71,496,100
スノーピーク	1,100	3,520.00	3,872,000
パラマウントベッドホールディングス	7,900	3,810.00	30,099,000
トランザクション	1,500	1,682.00	2,523,000
SHO-BI	2,500	409.00	1,022,500
ニホンフラッシュ	2,900	1,166.00	3,381,400
前田工織	7,500	1,148.00	8,610,000
永大産業	11,000	417.00	4,587,000
アートネイチャー	8,000	645.00	5,160,000
ダンロップスポーツ	4,700	1,020.00	4,794,000
バンダイナムコホールディングス	77,500	3,075.00	238,312,500
アイフイスジャパン	1,700	414.00	703,800
共立印刷	12,400	300.00	3,720,000
SHOEI	3,400	1,788.00	6,079,200
フランスベッドホールディングス	10,400	879.00	9,141,600
パイロットコーポレーション	13,100	4,190.00	54,889,000
萩原工業	2,100	2,352.00	4,939,200
トッパン・フォームズ	13,400	1,056.00	14,150,400
フジシールインターナショナル	9,100	4,145.00	37,719,500
タカラトミー	24,600	1,062.00	26,125,200
廣濟堂	7,000	305.00	2,135,000
A s - m e エステール	2,000	619.00	1,238,000

アーク	31,500	74.00	2,331,000	
タカノ	3,300	711.00	2,346,300	
プロネクサス	7,000	1,143.00	8,001,000	
ホクシン	5,900	129.00	761,100	
ウッドワン	14,000	238.00	3,332,000	
大建工業	5,800	1,972.00	11,437,600	
凸版印刷	212,000	908.00	192,496,000	
大日本印刷	216,000	986.00	212,976,000	
図書印刷	14,000	459.00	6,426,000	
共同印刷	25,000	331.00	8,275,000	
日本写真印刷	12,600	2,488.00	31,348,800	
光村印刷	7,000	213.00	1,491,000	
宝印刷	3,600	1,368.00	4,924,800	
アシックス	74,400	2,023.00	150,511,200	
ツツミ	3,700	1,675.00	6,197,500	
小松ウオール工業	2,500	1,681.00	4,202,500	
ヤマハ	55,100	3,250.00	179,075,000	
河合楽器製作所	2,800	1,768.00	4,950,400	
クリナップ	8,800	857.00	7,541,600	
ビジョン	42,500	3,040.00	129,200,000	
兼松日産農林	8,000	153.00	1,224,000	
キングジム	6,200	846.00	5,245,200	
リンテック	17,800	2,009.00	35,760,200	
TASAKI	2,100	1,488.00	3,124,800	
イトーキ	15,800	679.00	10,728,200	
任天堂	46,100	26,605.00	1,226,490,500	
三菱鉛筆	6,200	4,995.00	30,969,000	
タカラスタンダード	15,500	1,872.00	29,016,000	
コクヨ	38,900	1,464.00	56,949,600	
ナカバヤシ	15,000	237.00	3,555,000	
グローブライド	3,600	1,717.00	6,181,200	
岡村製作所	26,100	975.00	25,447,500	
美津濃	40,000	540.00	21,600,000	
アデランス	13,000	452.00	5,876,000	
東京電力ホールディングス	635,600	435.00	276,486,000	
中部電力	229,200	1,466.00	336,007,200	

関西電力	305,700	915.20	279,776,640	
中国電力	103,600	1,267.00	131,261,200	
北陸電力	73,400	1,227.00	90,061,800	
東北電力	187,200	1,315.00	246,168,000	
四国電力	67,500	995.00	67,162,500	
九州電力	165,500	946.00	156,563,000	
北海道電力	70,100	860.00	60,286,000	
沖縄電力	11,900	2,276.00	27,084,400	
電源開発	63,900	2,418.00	154,510,200	
ファーストエスコ	3,000	644.00	1,932,000	
イーレックス	2,300	3,000.00	6,900,000	
東京瓦斯	803,000	447.60	359,422,800	
大阪瓦斯	775,000	422.10	327,127,500	
東邦瓦斯	189,000	943.00	178,227,000	
北海道瓦斯	18,000	277.00	4,986,000	
広島ガス	13,100	336.00	4,401,600	
西部瓦斯	84,000	249.00	20,916,000	
静岡ガス	23,000	795.00	18,285,000	
メタウォーター	4,800	2,755.00	13,224,000	
SBSホールディングス	7,400	899.00	6,652,600	
東武鉄道	400,000	513.00	205,200,000	
相鉄ホールディングス	128,000	515.00	65,920,000	
東京急行電鉄	436,000	768.00	334,848,000	
京浜急行電鉄	205,000	1,052.00	215,660,000	
小田急電鉄	120,000	2,240.00	268,800,000	
京王電鉄	209,000	880.00	183,920,000	
京成電鉄	56,000	2,513.00	140,728,000	
富士急行	20,000	1,182.00	23,640,000	
新京成電鉄	10,000	393.00	3,930,000	
東日本旅客鉄道	135,900	9,080.00	1,233,972,000	
西日本旅客鉄道	72,100	6,238.00	449,759,800	
東海旅客鉄道	67,100	17,210.00	1,154,791,000	
西武ホールディングス	79,600	1,662.00	132,295,200	
鴻池運輸	10,600	1,372.00	14,543,200	
西日本鉄道	97,000	484.00	46,948,000	
ハマキョウレックス	5,700	1,815.00	10,345,500	

サカイ引越センター	3,000	2,563.00	7,689,000
近鉄グループホールディングス	754,000	423.00	318,942,000
阪急阪神ホールディングス	100,600	3,470.00	349,082,000
南海電気鉄道	168,000	484.00	81,312,000
京阪ホールディングス	168,000	705.00	118,440,000
神戸電鉄	18,000	361.00	6,498,000
名古屋鉄道	273,000	549.00	149,877,000
山陽電気鉄道	27,000	520.00	14,040,000
日本通運	290,000	470.00	136,300,000
ヤマトホールディングス	134,000	2,343.50	314,029,000
山九	99,000	577.00	57,123,000
丸運	4,000	235.00	940,000
丸全昭和運輸	25,000	385.00	9,625,000
センコー	33,700	702.00	23,657,400
トナミホールディングス	15,000	268.00	4,020,000
ニッコンホールディングス	23,800	2,186.00	52,026,800
日本石油輸送	900	2,242.00	2,017,800
福山通運	45,000	588.00	26,460,000
セイノーホールディングス	53,100	1,057.00	56,126,700
神奈川中央交通	9,000	714.00	6,426,000
日立物流	15,600	2,009.00	31,340,400
丸和運輸機関	2,200	2,379.00	5,233,800
C&Fロジホールディングス	7,200	902.00	6,494,400
日本郵船	673,000	188.00	126,524,000
商船三井	365,000	233.00	85,045,000
川崎汽船	328,000	259.00	84,952,000
NSユナイテッド海運	38,000	139.00	5,282,000
飯野海運	40,300	363.00	14,628,900
共栄タンカー	12,000	186.00	2,232,000
乾汽船	5,900	971.00	5,728,900
日本航空	143,400	2,959.00	424,320,600
ANAホールディングス	1,391,000	273.70	380,716,700
パスコ	7,000	312.00	2,184,000
トランコム	2,200	6,340.00	13,948,000
日新	31,000	317.00	9,827,000
三菱倉庫	53,000	1,451.00	76,903,000

三井倉庫ホールディングス	43,000	320.00	13,760,000	
住友倉庫	55,000	535.00	29,425,000	
澁澤倉庫	19,000	287.00	5,453,000	
東陽倉庫	12,800	246.00	3,148,800	
日本トランスシティ	17,000	368.00	6,256,000	
ケイヒン	14,000	131.00	1,834,000	
中央倉庫	4,300	970.00	4,171,000	
安田倉庫	5,800	607.00	3,520,600	
東洋埠頭	22,000	162.00	3,564,000	
宇徳	6,100	325.00	1,982,500	
上組	89,000	878.00	78,142,000	
サンリツ	1,800	483.00	869,400	
キムラユニティー	1,900	1,020.00	1,938,000	
キューソー流通システム	2,400	2,390.00	5,736,000	
郵船ロジスティクス	6,900	976.00	6,734,400	
近鉄エクスプレス	13,400	1,303.00	17,460,200	
東海運	4,000	286.00	1,144,000	
エーアイテイー	4,600	874.00	4,020,400	
内外トランスライン	2,200	946.00	2,081,200	
NEC ネットスエスアイ	9,300	1,715.00	15,949,500	
システナ	7,200	1,929.00	13,888,800	
デジタルアーツ	3,600	2,740.00	9,864,000	
新日鉄住金ソリューションズ	12,300	1,758.00	21,623,400	
キューブシステム	3,200	644.00	2,060,800	
コア	3,100	1,100.00	3,410,000	
ソフトクリエイトホールディングス	3,500	1,055.00	3,692,500	
T I S	24,500	2,609.00	63,920,500	
ネオス	2,200	512.00	1,126,400	
電算システム	2,600	1,575.00	4,095,000	
グリー	45,000	565.00	25,425,000	
コーエーテクモホールディングス	17,600	1,990.00	35,024,000	
三菱総合研究所	2,900	3,170.00	9,193,000	
ボルテージ	1,500	1,076.00	1,614,000	
電算	800	1,974.00	1,579,200	
A G S	1,700	1,079.00	1,834,300	
ファインデックス	5,500	1,606.00	8,833,000	

ヒト・コミュニケーションズ	1,700	1,702.00	2,893,400
ブレインパッド	1,100	1,056.00	1,161,600
K L a b	14,100	626.00	8,826,600
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4,900	938.00	4,596,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	892.00	1,427,200
ネクソン	81,200	1,575.00	127,890,000
アイスタイル	11,300	819.00	9,254,700
エムアップ	1,900	603.00	1,145,700
エイチーム	4,100	2,353.00	9,647,300
テクノスジャパン	2,100	2,174.00	4,565,400
コロプラ	20,600	1,565.00	32,239,000
モバイルクリエイト	4,900	290.00	1,421,000
ブロードリーフ	9,100	1,105.00	10,055,500
ハーツユナイテッドグループ	4,400	2,125.00	9,350,000
メディアドゥ	1,600	1,603.00	2,564,800
ブイキューブ	4,100	862.00	3,534,200
サイバーリンクス	1,100	910.00	1,001,000
ディー・エル・イー	2,100	662.00	1,390,200
VOYAGE GROUP	2,500	964.00	2,410,000
オブティム	600	5,100.00	3,060,000
ベリサーブ	900	3,760.00	3,384,000
ティーガイア	7,400	1,440.00	10,656,000
日本アジアグループ	8,400	370.00	3,108,000
豆蔵ホールディングス	5,900	1,073.00	6,330,700
テクマトリックス	3,200	2,301.00	7,363,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	172,300	247.00	42,558,100
GMOペイメントゲートウェイ	6,100	5,260.00	32,086,000
ザップラス	4,200	366.00	1,537,200
インターネットイニシアティブ	12,000	1,893.00	22,716,000
さくらインターネット	4,900	1,017.00	4,983,300
GMOクラウド	1,700	1,029.00	1,749,300
S R Aホールディングス	4,300	2,179.00	9,369,700
M i n o r i ソリューションズ	1,500	920.00	1,380,000
朝日ネット	6,700	414.00	2,773,800
フリービット	4,100	819.00	3,357,900

コムチュア	1,300	3,615.00	4,699,500
サイバーコム	900	865.00	778,500
g u m i	7,600	763.00	5,798,800
パイブドHD	1,000	1,078.00	1,078,000
L I N E	12,200	4,860.00	59,292,000
ソルクシーズ	2,100	534.00	1,121,400
フェイス	2,000	1,169.00	2,338,000
ハイマックス	1,000	1,155.00	1,155,000
野村総合研究所	50,300	3,470.00	174,541,000
サイバネットシステム	6,100	748.00	4,562,800
C Eホールディングス	1,100	1,022.00	1,124,200
インテージホールディングス	3,900	1,693.00	6,602,700
東邦システムサイエンス	2,200	595.00	1,309,000
ソースネクスト	3,700	505.00	1,868,500
ティー・ワイ・オー	14,600	143.00	2,087,800
フォーカスシステムズ	2,900	458.00	1,328,200
クレスコ	1,700	2,539.00	4,316,300
フジ・メディア・ホールディングス	77,000	1,367.00	105,259,000
オービック	25,500	5,350.00	136,425,000
ジャストシステム	13,500	894.00	12,069,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,200	928.00	2,969,600
ヤフー	530,000	402.00	213,060,000
トレンドマイクロ	39,200	3,510.00	137,592,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,400	981.00	1,373,400
日本オラクル	11,900	5,690.00	67,711,000
アルファシステムズ	2,400	1,662.00	3,988,800
フューチャー	10,000	751.00	7,510,000
CAC Holdings	5,500	857.00	4,713,500
ソフトバンク・テクノロジー	2,000	3,075.00	6,150,000
トーセ	2,000	676.00	1,352,000
オービックビジネスコンサルタント	3,800	4,865.00	18,487,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,800	2,588.00	43,478,400
アイティフォー	9,600	611.00	5,865,600
東計電算	1,300	1,929.00	2,507,700
エクスネット	700	1,523.00	1,066,100
大塚商会	19,900	4,775.00	95,022,500

サイボウズ	9,900	506.00	5,009,400
ソフトブレーン	10,100	415.00	4,191,500
電通国際情報サービス	4,600	1,891.00	8,698,600
デジタルガレージ	11,600	1,939.00	22,492,400
EMシステムズ	2,500	1,548.00	3,870,000
ウェザーニューズ	2,500	3,030.00	7,575,000
C I J	6,700	480.00	3,216,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,460.00	1,022,000
日本エンタープライズ	7,600	273.00	2,074,800
WOWOW	3,500	2,777.00	9,719,500
フュージョンパートナー	4,600	941.00	4,328,600
日本コロムビア	2,500	631.00	1,577,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,200	552.00	3,422,400
ネットワンシステムズ	32,000	702.00	22,464,000
アルゴグラフィックス	3,400	1,955.00	6,647,000
マーベラス	12,500	784.00	9,800,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,600	1,369.00	18,618,400
日本ユニシス	20,400	1,292.00	26,356,800
兼松エレクトロニクス	4,700	1,914.00	8,995,800
東京放送ホールディングス	44,300	1,571.00	69,595,300
日本テレビホールディングス	67,500	1,704.00	115,020,000
朝日放送	7,300	661.00	4,825,300
テレビ朝日ホールディングス	20,200	1,852.00	37,410,400
スカパー J S A Tホールディングス	56,200	494.00	27,762,800
テレビ東京ホールディングス	6,700	2,212.00	14,820,400
日本BS放送	1,700	977.00	1,660,900
U-NEXT	1,900	671.00	1,274,900
ワイヤレスゲート	2,500	1,710.00	4,275,000
コネクシオ	6,500	1,395.00	9,067,500
日本通信	52,400	177.00	9,274,800
クロップス	1,400	510.00	714,000
日本電信電話	571,600	4,614.00	2,637,362,400
KDDI	731,600	3,115.00	2,278,934,000
光通信	8,900	9,360.00	83,304,000
NTTドコモ	552,600	2,562.00	1,415,761,200
エムティーアイ	11,300	621.00	7,017,300

GMOインターネット	27,000	1,348.00	36,396,000
カドカワ	23,100	1,467.00	33,887,700
学研ホールディングス	25,000	309.00	7,725,000
ゼンリン	9,800	1,785.00	17,493,000
昭文社	4,100	560.00	2,296,000
インプレスホールディングス	6,100	139.00	847,900
アイネット	4,510	1,034.00	4,663,340
松竹	49,000	1,227.00	60,123,000
東宝	52,800	3,340.00	176,352,000
東映	28,000	817.00	22,876,000
AOI Pro.	3,700	822.00	3,041,400
エヌ・ティ・ティ・データ	45,700	5,030.00	229,871,000
ピー・シー・エー	1,000	1,145.00	1,145,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,100	962.00	1,058,200
DTS	8,200	2,240.00	18,368,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,300	3,470.00	108,611,000
シーイーシー	4,800	1,903.00	9,134,400
カプコン	18,900	2,475.00	46,777,500
アイ・エス・ビー	1,400	838.00	1,173,200
ジャステック	4,700	1,082.00	5,085,400
SCSK	17,600	4,075.00	71,720,000
日本システムウェア	2,800	1,789.00	5,009,200
アイネス	10,500	1,151.00	12,085,500
TKC	6,800	3,135.00	21,318,000
富士ソフト	11,000	2,815.00	30,965,000
NSD	15,700	1,618.00	25,402,600
コナミホールディングス	33,400	3,895.00	130,093,000
福井コンピュータホールディングス	2,100	2,403.00	5,046,300
JBCCHホールディングス	6,200	659.00	4,085,800
ミロク情報サービス	5,500	1,970.00	10,835,000
ソフトバンクグループ	419,000	6,522.00	2,732,718,000
ハウスイ	6,000	109.00	654,000
高千穂交易	2,900	911.00	2,641,900
伊藤忠食品	1,800	4,060.00	7,308,000
エレマテック	3,500	1,958.00	6,853,000
JALUX	2,400	1,718.00	4,123,200

あらた	3,300	2,285.00	7,540,500
トーメンデバイス	1,100	1,867.00	2,053,700
東京エレクトロン デバイス	2,700	1,516.00	4,093,200
フィールズ	6,500	1,260.00	8,190,000
双日	465,800	257.00	119,710,600
アルフレッサ ホールディングス	93,000	2,127.00	197,811,000
横浜冷凍	18,300	1,072.00	19,617,600
神栄	10,000	116.00	1,160,000
山下医科器械	600	1,763.00	1,057,800
ラサ商事	3,500	523.00	1,830,500
ラクーン	3,200	505.00	1,616,000
アルコニックス	4,200	1,407.00	5,909,400
神戸物産	4,000	2,793.00	11,172,000
あい ホールディングス	13,200	2,425.00	32,010,000
ディーブイエックス	2,600	1,286.00	3,343,600
ダイワボウホールディングス	67,000	238.00	15,946,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,300	1,151.00	15,308,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12,800	1,068.00	13,670,400
八洲電機	5,700	550.00	3,135,000
UKCホールディングス	4,800	1,651.00	7,924,800
OCHIホールディングス	2,200	1,028.00	2,261,600
TOKAIホールディングス	32,500	648.00	21,060,000
大阪工機	900	697.00	627,300
三洋貿易	4,100	1,246.00	5,108,600
ビューティガレージ	600	1,300.00	780,000
ウイン・パートナーズ	2,700	1,610.00	4,347,000
ミタチ産業	1,900	588.00	1,117,200
シップヘルスケアホールディングス	15,000	3,090.00	46,350,000
明治電機工業	2,300	996.00	2,290,800
デリカフーズ	1,600	972.00	1,555,200
スターティア	1,500	516.00	774,000
コメダホールディングス	10,000	1,613.00	16,130,000
富士興産	2,900	405.00	1,174,500
協栄産業	10,000	131.00	1,310,000
小野建	6,400	1,245.00	7,968,000
佐島電機	5,900	713.00	4,206,700

エコートレーディング	1,700	618.00	1,050,600
伯東	5,600	926.00	5,185,600
コンドーテック	5,900	748.00	4,413,200
中山福	4,600	789.00	3,629,400
ナガイレーベン	10,700	2,239.00	23,957,300
三菱食品	8,100	3,275.00	26,527,500
松田産業	5,400	1,384.00	7,473,600
第一興商	13,100	4,115.00	53,906,500
メディパルホールディングス	74,000	1,743.00	128,982,000
アドヴァン	7,500	917.00	6,877,500
S P K	1,700	2,061.00	3,503,700
萩原電気	2,500	1,839.00	4,597,500
アズワン	5,800	4,390.00	25,462,000
スズデン	2,400	969.00	2,325,600
尾家産業	2,400	943.00	2,263,200
シモジマ	5,100	1,074.00	5,477,400
ドウシシャ	8,700	2,117.00	18,417,900
小津産業	1,600	2,122.00	3,395,200
高速	4,400	957.00	4,210,800
たけびし	2,600	1,060.00	2,756,000
黒田電気	13,800	1,931.00	26,647,800
リックス	1,700	1,180.00	2,006,000
丸文	6,600	584.00	3,854,400
ハピネット	6,700	1,063.00	7,122,100
橋本総業ホールディングス	1,500	1,588.00	2,382,000
日本ライフライン	3,600	4,785.00	17,226,000
エクセル	3,600	1,253.00	4,510,800
マルカキカイ	2,400	1,173.00	2,815,200
I D O M	19,900	565.00	11,243,500
日本エム・ディ・エム	6,200	772.00	4,786,400
進和	4,400	1,505.00	6,622,000
エスケイジャパン	1,800	327.00	588,600
ダイトエレクトロン	3,400	755.00	2,567,000
シークス	5,300	4,065.00	21,544,500
田中商事	2,300	666.00	1,531,800
オーハシテクニカ	4,200	1,262.00	5,300,400

白銅	2,100	1,233.00	2,589,300
伊藤忠商事	580,300	1,262.00	732,338,600
丸紅	727,800	515.50	375,180,900
高島	14,000	167.00	2,338,000
長瀬産業	44,500	1,207.00	53,711,500
蝶理	4,700	1,486.00	6,984,200
豊田通商	82,400	2,331.00	192,074,400
三共生興	11,200	320.00	3,584,000
兼松	157,000	156.00	24,492,000
ツカモトコーポレーション	13,000	107.00	1,391,000
三井物産	668,700	1,390.50	929,827,350
日本紙パルプ商事	38,000	329.00	12,502,000
日立ハイテクノロジーズ	25,600	4,015.00	102,784,000
カメイ	9,600	877.00	8,419,200
東都水産	1,200	1,620.00	1,944,000
OUGホールディングス	11,000	255.00	2,805,000
スターゼン	2,700	5,140.00	13,878,000
山善	28,400	769.00	21,839,600
椿本興業	8,000	281.00	2,248,000
住友商事	465,500	1,123.00	522,756,500
内田洋行	18,000	415.00	7,470,000
三菱商事	554,900	2,285.00	1,267,946,500
第一実業	17,000	550.00	9,350,000
キヤノンマーケティングジャパン	21,100	1,872.00	39,499,200
西華産業	24,000	267.00	6,408,000
佐藤商事	6,600	742.00	4,897,200
菱洋エレクトロ	8,400	1,233.00	10,357,200
東京産業	7,400	392.00	2,900,800
ユアサ商事	7,000	2,309.00	16,163,000
神鋼商事	1,700	1,762.00	2,995,400
小林産業	5,400	255.00	1,377,000
阪和興業	74,000	610.00	45,140,000
カナデン	7,100	996.00	7,071,600
菱電商事	12,000	632.00	7,584,000
フルサト工業	4,100	1,462.00	5,994,200
岩谷産業	88,000	622.00	54,736,000

すてきナイスグループ	32,000	141.00	4,512,000	
昭光通商	26,000	77.00	2,002,000	
ニチモウ	12,000	151.00	1,812,000	
極東貿易	11,000	191.00	2,101,000	
イワキ	11,000	193.00	2,123,000	
三愛石油	18,200	686.00	12,485,200	
稲畑産業	17,700	1,032.00	18,266,400	
G S I クレオス	20,000	114.00	2,280,000	
明和産業	6,900	338.00	2,332,200	
ワキタ	15,800	764.00	12,071,200	
東邦ホールディングス	23,700	2,135.00	50,599,500	
サンゲツ	25,500	1,950.00	49,725,000	
ミツウロコグループホールディングス	11,900	575.00	6,842,500	
シナネンホールディングス	3,200	2,075.00	6,640,000	
伊藤忠エネクス	19,100	773.00	14,764,300	
サンリオ	22,800	1,845.00	42,066,000	
サンワテクノス	4,700	719.00	3,379,300	
リョーサン	11,700	3,060.00	35,802,000	
新光商事	8,700	1,076.00	9,361,200	
トーヨー	3,300	2,322.00	7,662,600	
三信電気	10,200	870.00	8,874,000	
東陽テクニカ	9,800	1,016.00	9,956,800	
モスフードサービス	9,700	3,210.00	31,137,000	
加賀電子	6,700	1,246.00	8,348,200	
ソーダニッカ	7,600	461.00	3,503,600	
立花エレテック	5,500	1,012.00	5,566,000	
フォーバル	3,900	729.00	2,843,100	
PAL TAC	11,800	2,359.00	27,836,200	
三谷産業	7,900	309.00	2,441,100	
ヤマタネ	3,400	1,338.00	4,549,200	
丸紅建材リース	6,000	179.00	1,074,000	
日鉄住金物産	6,500	3,565.00	23,172,500	
トラスコ中山	8,400	5,370.00	45,108,000	
オートバックスセブン	27,400	1,445.00	39,593,000	
加藤産業	11,500	2,384.00	27,416,000	
イノテック	6,800	488.00	3,318,400	

イエローハット	7,000	2,073.00	14,511,000	
J Kホールディングス	7,400	498.00	3,685,200	
日伝	3,100	2,854.00	8,847,400	
北沢産業	6,200	162.00	1,004,400	
杉本商事	4,300	1,187.00	5,104,100	
因幡電機産業	10,400	3,630.00	37,752,000	
バイテックホールディングス	3,000	1,032.00	3,096,000	
ミスミグループ本社	83,100	1,884.00	156,560,400	
アルテック	6,300	134.00	844,200	
タキヒヨー	12,000	426.00	5,112,000	
蔵王産業	1,200	1,322.00	1,586,400	
スズケン	33,700	3,320.00	111,884,000	
ジェコス	5,100	877.00	4,472,700	
ルネサスイーストン	6,200	413.00	2,560,600	
ローソン	28,000	7,970.00	223,160,000	
サンエー	5,000	5,050.00	25,250,000	
カワチ薬品	5,700	2,442.00	13,919,400	
エービーシー・マート	9,600	6,860.00	65,856,000	
ハードオフコーポレーション	3,600	1,091.00	3,927,600	
アスクル	9,000	3,815.00	34,335,000	
ゲオホールディングス	12,400	1,302.00	16,144,800	
アダストリア	13,600	2,313.00	31,456,800	
ジーフット	4,500	707.00	3,181,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,100	802.00	882,200	
くらコーポレーション	4,800	4,920.00	23,616,000	
キャンドウ	4,000	1,626.00	6,504,000	
パルグループホールディングス	4,300	2,336.00	10,044,800	
エディオン	31,500	844.00	26,586,000	
サーラコーポレーション	9,300	616.00	5,728,800	
ワッツ	3,200	1,057.00	3,382,400	
ハローズ	2,400	2,241.00	5,378,400	
あみやき亭	1,400	3,695.00	5,173,000	
ひらまつ	10,200	596.00	6,079,200	
ゲンキー	1,500	4,030.00	6,045,000	
大黒天物産	1,800	4,820.00	8,676,000	
ハニーズ	6,500	1,185.00	7,702,500	

ファーマライズホールディングス	2,000	538.00	1,076,000
アルペン	6,600	1,822.00	12,025,200
クオール	7,500	1,455.00	10,912,500
ジェイアイエヌ	5,000	4,670.00	23,350,000
ビックカメラ	42,500	837.00	35,572,500
DCMホールディングス	36,400	867.00	31,558,800
MonotaRO	26,200	2,700.00	70,740,000
東京一番フーズ	2,000	556.00	1,112,000
ダイヤモンドダイニング	1,600	1,029.00	1,646,400
きちり	2,200	661.00	1,454,200
アークランドサービスホールディングス	2,300	3,080.00	7,084,000
J. フロント リテイリング	93,600	1,315.00	123,084,000
ドトール・日レスホールディングス	13,000	1,854.00	24,102,000
マツモトキヨシホールディングス	15,300	5,200.00	79,560,000
ブロンコビリー	3,900	3,070.00	11,973,000
スタートトゥデイ	67,500	1,730.00	116,775,000
トレジャー・ファクトリー	2,100	923.00	1,938,300
物語コーポレーション	2,000	4,490.00	8,980,000
ココカラファイン	7,700	3,875.00	29,837,500
三越伊勢丹ホールディングス	147,100	989.00	145,481,900
H a m e e	600	2,006.00	1,203,600
ウエルシアホールディングス	6,400	6,940.00	44,416,000
クリエイトSDホールディングス	10,900	2,405.00	26,214,500
丸善CHIホールディングス	8,600	378.00	3,250,800
ミサワ	1,200	430.00	516,000
エー・ピーカンパニー	1,300	676.00	878,800
チムニー	2,300	2,841.00	6,534,300
シュッピン	2,800	1,070.00	2,996,000
ネクステージ	1,500	1,517.00	2,275,500
ジョイフル本田	12,000	2,626.00	31,512,000
鳥貴族	1,800	2,582.00	4,647,600
麒麟堂ホールディングス	2,400	818.00	1,963,200
ホットランド	3,500	930.00	3,255,000
すかいらーく	31,800	1,360.00	43,248,000
綿半ホールディングス	2,900	1,759.00	5,101,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールデ	24,600	997.00	24,526,200

インクス				
ブックオフコーポレーション	4,400	786.00	3,458,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,000	811.00	2,433,000	
あさひ	5,500	1,256.00	6,908,000	
日本調剤	1,900	4,415.00	8,388,500	
コスモス薬品	3,700	21,660.00	80,142,000	
トーエル	3,600	905.00	3,258,000	
一六堂	2,000	343.00	686,000	
オンリー	900	790.00	711,000	
セブン&アイ・ホールディングス	309,300	4,757.00	1,471,340,100	
薬王堂	1,400	6,010.00	8,414,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19,900	1,026.00	20,417,400	
ツルハホールディングス	17,000	11,640.00	197,880,000	
サンマルクホールディングス	5,800	2,764.00	16,031,200	
フェリシモ	2,200	998.00	2,195,600	
トリドール	9,100	2,319.00	21,102,900	
クスリのアオキ	6,600	5,150.00	33,990,000	
サツドラホールディングス	1,000	1,891.00	1,891,000	
ダイユー・リックホールディングス	2,400	597.00	1,432,800	
メディカルシステムネットワーク	8,600	474.00	4,076,400	
総合メディカル	3,600	3,285.00	11,826,000	
はるやま商事	3,300	761.00	2,511,300	
ノジマ	8,500	1,250.00	10,625,000	
カッパ・クリエイト	10,400	1,202.00	12,500,800	
ライトオン	5,500	1,039.00	5,714,500	
良品計画	8,500	20,330.00	172,805,000	
三城ホールディングス	9,300	440.00	4,092,000	
アルビス	2,000	2,071.00	4,142,000	
コナカ	9,600	473.00	4,540,800	
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,444.00	1,588,400	
G-7ホールディングス	2,200	1,213.00	2,668,600	
イオン北海道	5,100	542.00	2,764,200	
コジマ	11,300	220.00	2,486,000	
ヒマラヤ	2,400	816.00	1,958,400	
コーナン商事	10,600	1,957.00	20,744,200	
エコス	3,000	1,107.00	3,321,000	

マルシェ	2,100	821.00	1,724,100
ドンキホーテホールディングス	47,800	3,685.00	176,143,000
西松屋チェーン	14,600	1,531.00	22,352,600
ゼンショーホールディングス	38,000	1,804.00	68,552,000
幸楽苑ホールディングス	4,800	1,565.00	7,512,000
ハークスレイ	2,200	931.00	2,048,200
サイゼリヤ	12,200	2,294.00	27,986,800
V Tホールディングス	25,100	534.00	13,403,400
魚力	2,300	1,304.00	2,999,200
ポプラ	1,800	502.00	903,600
ユナイテッドアローズ	10,600	2,453.00	26,001,800
ハイデイ日高	6,700	2,434.00	16,307,800
京都きもの友禅	5,100	869.00	4,431,900
コロワイド	24,600	1,842.00	45,313,200
ピーシーデポコーポレーション	9,840	503.00	4,949,520
壺番屋	6,700	3,540.00	23,718,000
トップカルチャー	3,000	485.00	1,455,000
P L A N T	1,800	1,185.00	2,133,000
スギホールディングス	13,300	5,480.00	72,884,000
スクロール	11,300	373.00	4,214,900
ヨンドシーホールディングス	5,600	2,338.00	13,092,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	32,500	6,740.00	219,050,000
木曾路	9,100	2,274.00	20,693,400
サトレストランシステムズ	9,000	809.00	7,281,000
千趣会	13,400	702.00	9,406,800
タカキュー	6,900	177.00	1,221,300
ケーヨー	12,700	517.00	6,565,900
上新電機	18,000	866.00	15,588,000
日本瓦斯	11,300	3,135.00	35,425,500
ベスト電器	23,800	109.00	2,594,200
ロイヤルホールディングス	12,300	1,751.00	21,537,300
いなげや	8,200	1,426.00	11,693,200
島忠	19,100	2,506.00	47,864,600
チョダ	8,700	2,474.00	21,523,800
ライフコーポレーション	4,700	3,210.00	15,087,000
リンガーハット	6,700	2,344.00	15,704,800

MrMax	6,800	320.00	2,176,000
テンアライド	6,800	367.00	2,495,600
AOKIホールディングス	16,900	1,139.00	19,249,100
オークワ	12,000	946.00	11,352,000
コメリ	11,400	2,450.00	27,930,000
青山商事	14,200	3,480.00	49,416,000
しまむら	8,600	12,260.00	105,436,000
はせがわ	4,000	438.00	1,752,000
高島屋	108,000	826.00	89,208,000
松屋	15,400	711.00	10,949,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	38,200	1,430.00	54,626,000
近鉄百貨店	28,000	349.00	9,772,000
パルコ	7,200	947.00	6,818,400
丸井グループ	91,100	1,328.00	120,980,800
アクシアル リテイリング	5,700	3,505.00	19,978,500
イオン	304,300	1,489.00	453,102,700
イズミ	14,700	4,335.00	63,724,500
東武ストア	900	2,804.00	2,523,600
平和堂	15,100	1,964.00	29,656,400
フジ	8,400	2,036.00	17,102,400
ヤオコー	8,400	3,980.00	33,432,000
ゼビオホールディングス	10,100	1,507.00	15,220,700
ケーズホールディングス	31,300	1,665.00	52,114,500
Olympicグループ	4,700	502.00	2,359,400
日産東京販売ホールディングス	12,600	227.00	2,860,200
アインホールディングス	8,900	6,860.00	61,054,000
元気寿司	2,100	2,076.00	4,359,600
ヤマダ電機	225,000	500.00	112,500,000
アークランドサカモト	12,500	1,129.00	14,112,500
ニトリホールディングス	32,000	12,050.00	385,600,000
グルメ杵屋	5,000	982.00	4,910,000
愛眼	5,900	198.00	1,168,200
ケーユーホールディングス	3,900	788.00	3,073,200
吉野家ホールディングス	27,400	1,450.00	39,730,000
松屋フーズ	3,600	3,145.00	11,322,000
サガミチェーン	10,000	1,225.00	12,250,000

関西スーパーマーケット	6,000	1,608.00	9,648,000
玉将フードサービス	5,400	3,965.00	21,411,000
プレナス	8,300	1,846.00	15,321,800
ミニストップ	5,500	1,745.00	9,597,500
アークス	13,900	2,517.00	34,986,300
バローホールディングス	16,000	2,838.00	45,408,000
藤久	700	1,730.00	1,211,000
ベルク	3,700	3,830.00	14,171,000
大庄	4,000	1,515.00	6,060,000
ファーストリテイリング	12,300	32,290.00	397,167,000
サンドラッグ	15,600	8,450.00	131,820,000
サックスパー ホールディングス	7,000	1,085.00	7,595,000
ヤマザワ	1,700	1,688.00	2,869,600
やまや	1,500	1,492.00	2,238,000
ベルーナ	18,500	623.00	11,525,500
島根銀行	1,600	1,212.00	1,939,200
じもとホールディングス	53,100	143.00	7,593,300
足利ホールディングス	54,300	360.00	19,548,000
東京T Yフィナンシャルグループ	10,200	2,804.00	28,600,800
九州フィナンシャルグループ	113,200	684.00	77,428,800
ゆうちょ銀行	189,500	1,195.00	226,452,500
富山第一銀行	18,800	462.00	8,685,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	515,300	437.70	225,546,810
新生銀行	640,000	152.00	97,280,000
あおぞら銀行	468,000	347.00	162,396,000
三菱UF Jフィナンシャル・グループ	5,933,200	505.10	2,996,859,320
りそなホールディングス	865,100	422.30	365,331,730
三井住友トラスト・ホールディングス	154,400	3,270.00	504,888,000
三井住友フィナンシャルグループ	592,100	3,380.00	2,001,298,000
第四銀行	94,000	386.00	36,284,000
北越銀行	8,000	2,129.00	17,032,000
西日本シティ銀行	241,000	214.00	51,574,000
千葉銀行	285,000	570.00	162,450,000
常陽銀行	267,000	429.00	114,543,000
群馬銀行	164,300	456.00	74,920,800
武蔵野銀行	11,800	2,540.00	29,972,000

千葉興業銀行	20,300	402.00	8,160,600	
筑波銀行	30,700	289.00	8,872,300	
七十七銀行	116,000	411.00	47,676,000	
青森銀行	54,000	320.00	17,280,000	
秋田銀行	48,000	299.00	14,352,000	
山形銀行	42,000	425.00	17,850,000	
岩手銀行	5,200	3,910.00	20,332,000	
東邦銀行	66,000	354.00	23,364,000	
東北銀行	38,000	143.00	5,434,000	
みちのく銀行	37,000	199.00	7,363,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	320,000	417.00	133,440,000	
静岡銀行	217,000	804.00	174,468,000	
十六銀行	93,000	287.00	26,691,000	
スルガ銀行	70,200	2,409.00	169,111,800	
八十二銀行	133,800	523.00	69,977,400	
山梨中央銀行	46,000	434.00	19,964,000	
大垣共立銀行	99,000	335.00	33,165,000	
福井銀行	63,000	256.00	16,128,000	
北國銀行	78,000	304.00	23,712,000	
清水銀行	2,500	2,688.00	6,720,000	
富山銀行	1,400	3,920.00	5,488,000	
滋賀銀行	69,000	490.00	33,810,000	
南都銀行	7,100	3,560.00	25,276,000	
百五銀行	67,000	364.00	24,388,000	
京都銀行	141,000	734.00	103,494,000	
紀陽銀行	29,000	1,576.00	45,704,000	
三重銀行	3,300	1,992.00	6,573,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	50,300	1,351.00	67,955,300	
広島銀行	218,000	416.00	90,688,000	
山陰合同銀行	44,500	686.00	30,527,000	
中国銀行	52,400	1,225.00	64,190,000	
鳥取銀行	2,300	1,635.00	3,760,500	
伊予銀行	79,100	608.00	48,092,800	
百十四銀行	81,000	307.00	24,867,000	
四国銀行	57,000	215.00	12,255,000	
阿波銀行	59,000	620.00	36,580,000	

大分銀行	43,000	366.00	15,738,000	
宮崎銀行	49,000	267.00	13,083,000	
佐賀銀行	45,000	248.00	11,160,000	
十八銀行	45,000	298.00	13,410,000	
沖縄銀行	6,800	3,000.00	20,400,000	
琉球銀行	15,200	1,194.00	18,148,800	
セブン銀行	277,200	322.00	89,258,400	
みずほフィナンシャルグループ	10,630,600	168.60	1,792,319,160	
高知銀行	29,000	108.00	3,132,000	
山口フィナンシャルグループ	69,000	1,073.00	74,037,000	
長野銀行	2,400	1,918.00	4,603,200	
名古屋銀行	6,200	3,500.00	21,700,000	
北洋銀行	111,400	356.00	39,658,400	
愛知銀行	2,500	4,905.00	12,262,500	
第三銀行	4,200	1,660.00	6,972,000	
中京銀行	3,000	2,284.00	6,852,000	
大光銀行	26,000	216.00	5,616,000	
愛媛銀行	8,800	1,270.00	11,176,000	
トマト銀行	2,900	1,471.00	4,265,900	
みなと銀行	6,700	1,612.00	10,800,400	
京葉銀行	60,000	427.00	25,620,000	
関西アーバン銀行	10,300	1,028.00	10,588,400	
栃木銀行	38,000	408.00	15,504,000	
北日本銀行	2,300	2,713.00	6,239,900	
東和銀行	138,000	89.00	12,282,000	
福島銀行	91,000	90.00	8,190,000	
大東銀行	44,000	169.00	7,436,000	
トモニホールディングス	56,700	468.00	26,535,600	
フィデアホールディングス	60,300	158.00	9,527,400	
池田泉州ホールディングス	78,400	443.00	34,731,200	
F P G	26,800	931.00	24,950,800	
S B I ホールディングス	88,800	1,196.00	106,204,800	
ジャフコ	12,500	2,940.00	36,750,000	
大和証券グループ本社	692,000	564.40	390,564,800	
野村ホールディングス	1,423,700	446.10	635,112,570	
岡三証券グループ	63,000	515.00	32,445,000	

丸三証券	22,000	832.00	18,304,000	
東洋証券	29,000	180.00	5,220,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84,900	485.00	41,176,500	
光世証券	18,000	113.00	2,034,000	
水戸証券	23,100	238.00	5,497,800	
いちよし証券	16,600	763.00	12,665,800	
松井証券	36,200	822.00	29,756,400	
だいきょう証券ビジネス	3,600	501.00	1,803,600	
マネックスグループ	86,000	236.00	20,296,000	
カブドットコム証券	63,100	338.00	21,327,800	
極東証券	9,900	1,290.00	12,771,000	
岩井コスモホールディングス	7,000	875.00	6,125,000	
藍澤証券	13,900	556.00	7,728,400	
マネースクウェアHD	2,600	1,247.00	3,242,200	
マネーパートナーズグループ	7,700	477.00	3,672,900	
かんぽ生命保険	30,100	2,198.00	66,159,800	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	164,300	2,965.50	487,231,650	
アニコム ホールディングス	5,000	2,471.00	12,355,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	221,000	2,789.50	616,479,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	70,800	1,381.00	97,774,800	
第一生命保険	473,800	1,371.50	649,816,700	
東京海上ホールディングス	299,600	3,834.00	1,148,666,400	
T&Dホールディングス	269,500	1,129.50	304,400,250	
アドバンスクリエイト	1,700	1,644.00	2,794,800	
全国保証	19,200	4,165.00	79,968,000	
クレディセゾン	56,100	1,669.00	93,630,900	
アクリーティブ	6,100	357.00	2,177,700	
芙蓉総合リース	8,500	4,995.00	42,457,500	
興銀リース	13,900	2,027.00	28,175,300	
東京センチュリーリース	17,400	3,645.00	63,423,000	
日本証券金融	32,600	435.00	14,181,000	
アイフル	124,000	311.00	38,564,000	
ポケットカード	7,400	517.00	3,825,800	
リコーリース	5,800	2,787.00	16,164,600	
イオンフィナンシャルサービス	50,300	1,755.00	88,276,500	

アコム	148,500	473.00	70,240,500
ジャックス	41,000	386.00	15,826,000
オリエントコーポレーション	319,800	192.00	61,401,600
日立キャピタル	17,400	2,130.00	37,062,000
アプラスフィナンシャル	35,500	101.00	3,585,500
オリックス	523,600	1,477.50	773,619,000
三菱UFJリース	187,600	460.00	86,296,000
日本取引所グループ	217,200	1,565.00	339,918,000
イー・ギャランティ	2,400	2,774.00	6,657,600
アサックス	1,300	1,489.00	1,935,700
NECキャピタルソリューション	3,000	1,670.00	5,010,000
いちご	81,900	445.00	36,445,500
日本駐車場開発	89,200	141.00	12,577,200
ヒューリック	154,200	1,025.00	158,055,000
三栄建築設計	3,000	1,178.00	3,534,000
野村不動産ホールディングス	49,100	1,696.00	83,273,600
三重交通グループホールディングス	13,200	389.00	5,134,800
サムティ	6,000	1,046.00	6,276,000
ディア・ライフ	5,100	335.00	1,708,500
エー・ディー・ワークス	68,500	37.00	2,534,500
日本商業開発	3,300	1,719.00	5,672,700
プレサンスコーポレーション	10,000	1,117.00	11,170,000
ユニゾホールディングス	5,400	2,815.00	15,201,000
THEグローバル社	2,600	452.00	1,175,200
日本管理センター	5,300	1,266.00	6,709,800
サンセイランディック	1,600	650.00	1,040,000
エストラスト	1,400	525.00	735,000
フージャースホールディングス	10,300	526.00	5,417,800
オープンハウス	10,700	2,149.00	22,994,300
東急不動産ホールディングス	179,000	545.00	97,555,000
飯田グループホールディングス	68,500	2,024.00	138,644,000
ムゲンエステート	2,600	746.00	1,939,600
シーアールイー	500	3,455.00	1,727,500
パーク24	37,400	3,280.00	122,672,000
パラカ	2,100	1,692.00	3,553,200
三井不動産	392,000	2,135.50	837,116,000

三菱地所	550,000	1,888.00	1,038,400,000	
平和不動産	14,000	1,449.00	20,286,000	
東京建物	85,800	1,207.00	103,560,600	
ダイビル	19,100	918.00	17,533,800	
京阪神ビルディング	12,300	509.00	6,260,700	
住友不動産	177,000	2,597.50	459,757,500	
大京	138,000	183.00	25,254,000	
テーオーシー	28,700	837.00	24,021,900	
東京楽天地	12,000	484.00	5,808,000	
レオパレス21	87,200	664.00	57,900,800	
スターツコーポレーション	8,500	1,865.00	15,852,500	
フジ住宅	9,500	686.00	6,517,000	
空港施設	9,000	503.00	4,527,000	
明和地所	4,100	562.00	2,304,200	
住友不動産販売	5,300	2,048.00	10,854,400	
ゴールドクレスト	5,800	1,651.00	9,575,800	
日本エスリード	2,900	1,036.00	3,004,400	
日神不動産	9,900	340.00	3,366,000	
日本エスコン	9,900	312.00	3,088,800	
タカラレーベン	32,300	678.00	21,899,400	
サンヨーハウジング名古屋	3,800	896.00	3,404,800	
イオンモール	47,700	1,588.00	75,747,600	
ファースト住建	2,800	1,332.00	3,729,600	
トーセイ	10,200	758.00	7,731,600	
穴吹興産	8,000	244.00	1,952,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	46,000	973.00	44,758,000	
サンフロンティア不動産	9,000	1,015.00	9,135,000	
エフ・ジェー・ネクスト	6,500	527.00	3,425,500	
インテリックス	1,600	750.00	1,200,000	
ランドビジネス	4,400	271.00	1,192,400	
グランディハウス	6,500	346.00	2,249,000	
日本空港ビルデング	23,600	3,835.00	90,506,000	
日本工営	26,000	465.00	12,090,000	
ネクスト	22,200	823.00	18,270,600	
ジェイエイシーリクルートメント	4,800	1,211.00	5,812,800	
日本M&Aセンター	24,400	3,115.00	76,006,000	

ノバレーゼ	2,000	1,940.00	3,880,000
アコーディア・ゴルフ	21,800	1,029.00	22,432,200
中広	900	653.00	587,700
タケエイ	7,200	822.00	5,918,400
トラスト・テック	3,200	1,680.00	5,376,000
パソナグループ	6,900	818.00	5,644,200
CDS	1,800	891.00	1,603,800
リンクアンドモチベーション	19,300	253.00	4,882,900
GCA	7,000	721.00	5,047,000
エス・エム・エス	9,800	2,685.00	26,313,000
テンプホールディングス	54,900	1,765.00	96,898,500
リニカル	4,600	1,461.00	6,720,600
クックパッド	17,500	964.00	16,870,000
エスクリ	4,000	546.00	2,184,000
アイ・ケイ・ケイ	3,700	630.00	2,331,000
学情	3,300	1,117.00	3,686,100
スタジオアリス	3,200	2,217.00	7,094,400
シミックホールディングス	4,100	1,532.00	6,281,200
NJS	1,800	1,139.00	2,050,200
総合警備保障	26,100	5,400.00	140,940,000
カカクコム	56,200	1,823.00	102,452,600
アイロムグループ	2,200	1,025.00	2,255,000
ルネサンス	4,100	1,253.00	5,137,300
ディップ	8,700	3,120.00	27,144,000
オプトホールディング	5,700	746.00	4,252,200
ツクイ	18,900	719.00	13,589,100
キャリアデザインセンター	1,800	946.00	1,702,800
エムスリー	67,800	3,440.00	233,232,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,000	705.00	4,230,000
アウトソーシング	4,500	4,380.00	19,710,000
ウェルネット	5,900	1,326.00	7,823,400
ワールドホールディングス	1,900	1,637.00	3,110,300
ディー・エヌ・エー	35,100	3,655.00	128,290,500
博報堂DYホールディングス	108,500	1,178.00	127,813,000
ぐるなび	9,100	2,767.00	25,179,700
エスアールジータカミヤ	8,900	562.00	5,001,800

ファンコミュニケーションズ	19,900	741.00	14,745,900
ジェイコムホールディングス	1,700	2,125.00	3,612,500
WDBホールディングス	2,900	1,078.00	3,126,200
ティア	4,000	619.00	2,476,000
バリューコマース	7,400	356.00	2,634,400
インフォマート	16,600	1,169.00	19,405,400
J Pホールディングス	20,400	277.00	5,650,800
E P Sホールディングス	9,700	1,383.00	13,415,100
レグス	1,800	783.00	1,409,400
プレステージ・インターナショナル	13,200	821.00	10,837,200
アミューズ	4,300	1,853.00	7,967,900
ドリームインキュベータ	2,700	2,094.00	5,653,800
クイック	4,100	1,061.00	4,350,100
T A C	6,300	196.00	1,234,800
ケネディクス	105,200	448.00	47,129,600
電通	87,200	5,110.00	445,592,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	463.00	2,083,500
ぴあ	2,400	2,280.00	5,472,000
イオンファンタジー	2,800	2,885.00	8,078,000
シーティーエス	2,600	845.00	2,197,000
ネクシィーズグループ	2,900	1,431.00	4,149,900
みらかホールディングス	20,000	5,010.00	100,200,000
アルプス技研	3,100	2,207.00	6,841,700
ダイオーズ	1,400	955.00	1,337,000
日本空調サービス	6,900	574.00	3,960,600
オリエンタルランド	84,600	6,134.00	518,936,400
ダスキン	20,100	1,879.00	37,767,900
明光ネットワークジャパン	9,700	898.00	8,710,600
ファルコホールディングス	3,400	1,297.00	4,409,800
ラウンドワン	24,600	685.00	16,851,000
リゾートトラスト	32,900	2,048.00	67,379,200
ビー・エム・エル	9,200	2,653.00	24,407,600
ワタベウェディング	2,700	512.00	1,382,400
りらいあコミュニケーションズ	13,000	901.00	11,713,000
リソー教育	14,800	510.00	7,548,000
早稲田アカデミー	1,000	866.00	866,000

ユー・エス・エス	94,700	1,698.00	160,800,600
東京個別指導学院	3,800	559.00	2,124,200
サイバーエージェント	41,200	2,992.00	123,270,400
楽天	399,800	1,311.00	524,137,800
クリーク・アンド・リバー社	3,300	816.00	2,692,800
テー・オー・ダブリュー	6,300	644.00	4,057,200
セントラルスポーツ	2,700	2,403.00	6,488,100
フルキャストホールディングス	8,100	893.00	7,233,300
リポートソリューション	9,000	316.00	2,844,000
テクノプロ・ホールディングス	12,700	3,805.00	48,323,500
アトラ	1,000	1,194.00	1,194,000
インターワークス	1,400	1,132.00	1,584,800
K e e P e r 技研	900	1,439.00	1,295,100
ファーストロジック	600	1,580.00	948,000
デザインワン・ジャパン	600	1,815.00	1,089,000
リブセンス	5,400	449.00	2,424,600
ジャパンマテリアル	3,300	3,805.00	12,556,500
ベクトル	7,200	985.00	7,092,000
ウチヤマホールディングス	4,400	412.00	1,812,800
サクセスホールディングス	900	1,185.00	1,066,500
キャリアリンク	2,200	891.00	1,960,200
I B J	6,200	678.00	4,203,600
アサンテ	2,900	1,622.00	4,703,800
N・フィールド	3,700	1,546.00	5,720,200
M&Aキャピタルパートナーズ	1,000	2,165.00	2,165,000
ライドオン・エクスプレス	1,800	968.00	1,742,400
E R I ホールディングス	2,000	808.00	1,616,000
アビスト	1,200	2,388.00	2,865,600
ウィルグループ	1,900	1,004.00	1,907,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	600	2,440.00	1,464,000
日本ビューホテル	1,200	1,299.00	1,558,800
リクルートホールディングス	157,800	4,110.00	648,558,000
エラン	1,100	1,252.00	1,377,200
日本郵政	230,100	1,263.00	290,616,300
ベルシステム24ホールディングス	15,800	868.00	13,714,400
ソラスト	3,600	1,134.00	4,082,400

リログループ	2,900	16,770.00	48,633,000	
東祥	2,400	4,470.00	10,728,000	
エイチ・アイ・エス	12,800	2,635.00	33,728,000	
ラックランド	1,400	1,754.00	2,455,600	
共立メンテナンス	5,900	6,280.00	37,052,000	
イチネンホールディングス	8,600	956.00	8,221,600	
建設技術研究所	5,100	908.00	4,630,800	
スペース	4,200	1,228.00	5,157,600	
燦ホールディングス	1,600	1,446.00	2,313,600	
スバル興業	6,000	401.00	2,406,000	
東京テアトル	30,000	117.00	3,510,000	
ナガワ	1,400	3,635.00	5,089,000	
よみうりランド	16,000	478.00	7,648,000	
東京都競馬	54,000	201.00	10,854,000	
カナモト	11,000	2,582.00	28,402,000	
東京ドーム	31,600	943.00	29,798,800	
西尾レントオール	6,300	2,957.00	18,629,100	
トランス・コスモス	9,100	2,660.00	24,206,000	
乃村工藝社	16,700	1,564.00	26,118,800	
藤田観光	27,000	356.00	9,612,000	
KNT-CTホールディングス	44,000	112.00	4,928,000	
日本管財	6,700	1,497.00	10,029,900	
トーカイ	3,500	3,575.00	12,512,500	
白洋舎	900	2,390.00	2,151,000	
セコム	81,400	7,508.00	611,151,200	
セントラル警備保障	3,500	1,919.00	6,716,500	
丹青社	14,700	749.00	11,010,300	
メイテック	9,500	3,545.00	33,677,500	
アサツー ディ・ケイ	12,800	2,680.00	34,304,000	
応用地質	7,400	1,141.00	8,443,400	
船井総研ホールディングス	10,100	1,507.00	15,220,700	
進学会	3,800	512.00	1,945,600	
オオバ	5,900	422.00	2,489,800	
学究社	1,100	1,220.00	1,342,000	
ベネッセホールディングス	26,200	2,574.00	67,438,800	
イオンディライト	7,600	3,075.00	23,370,000	

ナック	5,000	875.00	4,375,000	
ニチイ学館	14,100	786.00	11,082,600	
ダイセキ	14,700	1,964.00	28,870,800	
ステップ	2,600	1,142.00	2,969,200	
合 計	114,777,750		146,599,763,280	

(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 9 月 30 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,676,810,516
国債証券	259,174,091,000
地方債証券	17,740,755,011
特殊債券	23,813,690,857
社債券	13,601,957,810
未収入金	1,396,247,012
未収利息	429,980,526
前払費用	6,521,345
差入委託証拠金	100,000
流動資産合計	317,840,154,077
資産合計	317,840,154,077
負債の部	
流動負債	
未払金	2,599,140,796
未払解約金	75,514,925
未払利息	4,177
その他未払費用	564
流動負債合計	2,674,660,462
負債合計	2,674,660,462
純資産の部	
元本等	
元本	224,413,183,266
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	90,752,310,349
元本等合計	315,165,493,615
純資産合計	315,165,493,615
負債純資産合計	317,840,154,077

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 9 月 30 日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成 28 年 9 月 30 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	224, 413, 183, 266 口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 106, 216, 000 円</p>
3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	<p>1 口当たり純資産額 1. 4044 円 (1 万口当たり純資産額 (14, 044 円))</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成 28 年 9 月 30 日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成 28 年 9 月 30 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 9 月 30 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 1 日
期首元本額	247,877,657,762 円
期中追加設定元本額	41,103,388,428 円
期中一部解約元本額	64,567,862,924 円
期末元本額	224,413,183,266 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)	2,958,876,381 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	22,762,739 円
SMT 国内債券インデックス・オープン	7,988,600,439 円
世界経済インデックスファンド	638,652,231 円
マイセレクション 25	66,490,175 円
マイセレクション 50	67,233,240 円
マイセレクション 75	18,290,896 円
DCマイセレクション 25	14,175,065,602 円
DCマイセレクション 50	16,489,261,109 円
DCマイセレクション 75	4,464,239,591 円
DC日本債券インデックス・オープン	428,496,187 円
DC日本債券インデックス・オープン S	65,965,172,470 円
DC日本債券インデックス・オープン P	28,598,229,510 円
DCマイセレクション S 25	5,791,303,148 円
DCマイセレクション S 50	6,403,030,035 円

DCマイセレクションS75	1,200,115,379円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,198,513,992円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	760,251,041円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	205,188,048円
DC世界経済インデックスファンド	740,696,653円
日本債券インデックス・オープン (SMA専用)	984,789,466円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	10,588,058円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	110,141,815円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	20,460,979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)	433,757,296円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	613,486,193円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	129,548,436円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	238,697,775円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	6,403,829,117円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	1,247,051,300円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	4,480,371,873円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	1,111,213,565円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	1,465,697,519円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	1,658,972,757円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	1,526,089,371円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	1,833,052,258円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	2,609,526,704円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	196,033,095円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,959,318,801円
日本債券ファンド・シリーズ1	7,158,107,688円
コア投資戦略ファンド (安定型)	3,348,846,721円
コア投資戦略ファンド (成長型)	1,976,420,167円
分散投資コア戦略ファンドA	1,106,239,278円
分散投資コア戦略ファンドS	481,549,463円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	19,491,945円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	289,164,360円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	16,120,340,931円
コア投資戦略ファンド (切替型)	786,389,648円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	59,771,385円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	35,227,094円
SMT インデックスバランス・オープン	80,863,225円
債券コア戦略ファンド	7,485,292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)	663,597,604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)	5,063,508,857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9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△2,246,488,750	
地方債証券	△75,001,677	
特殊債券	△76,867,728	
社債券	△37,269,380	
合計	△2,435,627,535	

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

(デリバティブ取引に関する注記)
該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第360回利付国債(2年)	600,000,000	603,318,000	
	第362回利付国債(2年)	1,390,000,000	1,398,465,100	
	第364回利付国債(2年)	1,790,000,000	1,802,010,900	
	第365回利付国債(2年)	400,000,000	402,792,000	
	第366回利付国債(2年)	1,580,000,000	1,591,581,400	
	第367回利付国債(2年)	2,300,000,000	2,317,664,000	
	第368回利付国債(2年)	300,000,000	302,379,000	
	第369回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,068,183,200	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,127,078,400	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	593,009,000	
	第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,197,318,500	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	706,349,000	
	第111回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,212,648,000	
	第112回利付国債(5年)	900,000,000	910,980,000	
	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,436,007,200	
	第114回利付国債(5年)	810,000,000	819,744,300	
	第115回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,474,647,000	
	第116回利付国債(5年)	3,830,000,000	3,872,589,600	
	第117回利付国債(5年)	3,520,000,000	3,563,120,000	
	第118回利付国債(5年)	3,510,000,000	3,556,963,800	
	第119回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,010,650,000	
	第120回利付国債(5年)	2,540,000,000	2,576,779,200	
	第121回利付国債(5年)	630,000,000	637,238,700	
	第122回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,603,823,600	
第123回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,181,102,600		
第124回利付国債(5年)	3,100,000,000	3,142,966,000		

第 1 2 5 回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,662,742,100	
第 1 2 6 回利付国債（5年）	2,960,000,000	3,005,347,200	
第 1 2 7 回利付国債（5年）	2,500,000,000	2,540,000,000	
第 1 2 8 回利付国債（5年）	3,150,000,000	3,202,510,500	
第 1 2 9 回利付国債（5年）	20,000,000	20,351,600	
第 1 回利付国債（40年）	150,000,000	234,808,500	
第 2 回利付国債（40年）	420,000,000	638,097,600	
第 3 回利付国債（40年）	420,000,000	643,083,000	
第 4 回利付国債（40年）	530,000,000	817,662,800	
第 5 回利付国債（40年）	490,000,000	730,055,900	
第 6 回利付国債（40年）	690,000,000	1,011,264,000	
第 7 回利付国債（40年）	730,000,000	1,027,431,200	
第 8 回利付国債（40年）	670,000,000	877,231,000	
第 9 回利付国債（40年）	590,000,000	564,966,300	
第 2 8 9 回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,545,078,800	
第 2 9 0 回利付国債（10年）	470,000,000	481,872,200	
第 2 9 1 回利付国債（10年）	840,000,000	859,983,600	
第 2 9 2 回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,142,911,500	
第 2 9 3 回利付国債（10年）	370,000,000	383,416,200	
第 2 9 4 回利付国債（10年）	180,000,000	186,217,200	
第 2 9 5 回利付国債（10年）	100,000,000	103,110,000	
第 2 9 6 回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,175,012,000	
第 2 9 7 回利付国債（10年）	560,000,000	581,184,800	
第 2 9 8 回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,719,112,600	
第 2 9 9 回利付国債（10年）	1,310,000,000	1,361,548,500	
第 3 0 0 回利付国債（10年）	830,000,000	866,769,000	
第 3 0 1 回利付国債（10年）	640,000,000	671,193,600	
第 3 0 2 回利付国債（10年）	200,000,000	209,202,000	
第 3 0 3 回利付国債（10年）	1,390,000,000	1,459,736,300	
第 3 0 4 回利付国債（10年）	480,000,000	502,646,400	
第 3 0 5 回利付国債（10年）	2,010,000,000	2,112,550,200	
第 3 0 6 回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,238,398,200	
第 3 0 7 回利付国債（10年）	700,000,000	738,479,000	
第 3 0 8 回利付国債（10年）	990,000,000	1,048,043,700	
第 3 0 9 回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,871,011,400	
第 3 1 0 回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,145,197,600	

第311回利付国債（10年）	610,000,000	636,004,300	
第312回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,773,807,200	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,765,681,500	
第314回利付国債（10年）	910,000,000	965,591,900	
第315回利付国債（10年）	900,000,000	961,956,000	
第316回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,159,847,200	
第317回利付国債（10年）	620,000,000	661,881,000	
第318回利付国債（10年）	1,010,000,000	1,073,155,300	
第319回利付国債（10年）	750,000,000	803,032,500	
第320回利付国債（10年）	1,220,000,000	1,299,824,600	
第321回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,752,454,800	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	797,280,000	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,034,010,300	
第324回利付国債（10年）	1,810,000,000	1,918,962,000	
第325回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,434,041,000	
第326回利付国債（10年）	600,000,000	635,556,000	
第327回利付国債（10年）	740,000,000	788,521,800	
第328回利付国債（10年）	1,720,000,000	1,814,754,800	
第329回利付国債（10年）	1,750,000,000	1,874,110,000	
第330回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,760,130,000	
第331回利付国債（10年）	680,000,000	720,181,200	
第332回利付国債（10年）	2,560,000,000	2,714,803,200	
第333回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,186,401,600	
第334回利付国債（10年）	2,620,000,000	2,784,116,800	
第335回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,417,713,300	
第336回利付国債（10年）	890,000,000	940,436,300	
第337回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,404,000,000	
第338回利付国債（10年）	2,210,000,000	2,318,091,100	
第339回利付国債（10年）	3,080,000,000	3,230,889,200	
第340回利付国債（10年）	2,840,000,000	2,980,523,200	
第341回利付国債（10年）	2,810,000,000	2,922,624,800	
第342回利付国債（10年）	3,120,000,000	3,184,116,000	
第343回利付国債（10年）	3,280,000,000	3,344,288,000	
第344回利付国債（10年）	900,000,000	916,722,000	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	54,270,800	

第2回利付国債（30年）	160,000,000	210,116,800	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	156,537,600	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	153,551,200	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	65,228,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	254,936,300	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	239,997,600	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	62,996,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	287,248,800	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	183,528,000	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	112,190,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	249,836,700	
第13回利付国債（30年）	290,000,000	377,165,300	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	410,637,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	472,134,200	
第16回利付国債（30年）	370,000,000	514,873,500	
第17回利付国債（30年）	330,000,000	454,370,400	
第18回利付国債（30年）	445,000,000	605,947,600	
第19回利付国債（30年）	280,000,000	381,911,600	
第20回利付国債（30年）	420,000,000	589,474,200	
第21回利付国債（30年）	270,000,000	369,427,500	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	562,816,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	606,042,000	
第24回利付国債（30年）	260,000,000	367,382,600	
第25回利付国債（30年）	350,000,000	482,009,500	
第26回利付国債（30年）	550,000,000	769,653,500	
第27回利付国債（30年）	730,000,000	1,041,585,900	
第28回利付国債（30年）	570,000,000	817,853,100	
第29回利付国債（30年）	760,000,000	1,081,039,200	
第30回利付国債（30年）	660,000,000	929,900,400	
第31回利付国債（30年）	740,000,000	1,032,055,800	
第32回利付国債（30年）	880,000,000	1,253,348,800	
第33回利付国債（30年）	920,000,000	1,254,199,200	
第34回利付国債（30年）	1,090,000,000	1,544,290,200	
第35回利付国債（30年）	1,180,000,000	1,625,084,200	
第36回利付国債（30年）	1,120,000,000	1,548,344,000	
第37回利付国債（30年）	1,160,000,000	1,582,251,600	

第 3 8 回利付国債 (3 0 年)	590,000,000	793,314,000	
第 3 9 回利付国債 (3 0 年)	880,000,000	1,207,272,000	
第 4 0 回利付国債 (3 0 年)	630,000,000	849,819,600	
第 4 1 回利付国債 (3 0 年)	580,000,000	768,801,600	
第 4 2 回利付国債 (3 0 年)	670,000,000	889,887,300	
第 4 3 回利付国債 (3 0 年)	800,000,000	1,064,736,000	
第 4 4 回利付国債 (3 0 年)	720,000,000	960,220,800	
第 4 5 回利付国債 (3 0 年)	670,000,000	860,099,100	
第 4 6 回利付国債 (3 0 年)	750,000,000	963,240,000	
第 4 7 回利付国債 (3 0 年)	820,000,000	1,076,168,000	
第 4 8 回利付国債 (3 0 年)	1,060,000,000	1,335,112,400	
第 4 9 回利付国債 (3 0 年)	630,000,000	794,770,200	
第 5 0 回利付国債 (3 0 年)	720,000,000	789,645,600	
第 5 1 回利付国債 (3 0 年)	1,180,000,000	1,129,165,600	
第 3 8 回利付国債 (2 0 年)	20,000,000	20,882,800	
第 3 9 回利付国債 (2 0 年)	500,000,000	521,300,000	
第 4 0 回利付国債 (2 0 年)	100,000,000	105,130,000	
第 4 1 回利付国債 (2 0 年)	330,000,000	344,661,900	
第 4 2 回利付国債 (2 0 年)	80,000,000	85,732,800	
第 4 3 回利付国債 (2 0 年)	140,000,000	153,318,200	
第 4 4 回利付国債 (2 0 年)	170,000,000	186,433,900	
第 4 5 回利付国債 (2 0 年)	290,000,000	316,967,100	
第 4 6 回利付国債 (2 0 年)	170,000,000	185,721,600	
第 4 7 回利付国債 (2 0 年)	90,000,000	98,847,900	
第 4 8 回利付国債 (2 0 年)	130,000,000	145,254,200	
第 4 9 回利付国債 (2 0 年)	140,000,000	154,883,400	
第 5 0 回利付国債 (2 0 年)	220,000,000	241,401,600	
第 5 1 回利付国債 (2 0 年)	100,000,000	110,676,000	
第 5 2 回利付国債 (2 0 年)	110,000,000	122,931,600	
第 5 3 回利付国債 (2 0 年)	80,000,000	89,830,400	
第 5 4 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	225,632,000	
第 5 5 回利付国債 (2 0 年)	140,000,000	157,306,800	
第 5 6 回利付国債 (2 0 年)	150,000,000	169,401,000	
第 5 7 回利付国債 (2 0 年)	240,000,000	269,652,000	
第 5 8 回利付国債 (2 0 年)	300,000,000	338,829,000	
第 5 9 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	224,392,000	

第 6 0 回利付国債 (2 0 年)	350,000,000	386,190,000	
第 6 1 回利付国債 (2 0 年)	240,000,000	259,519,200	
第 6 2 回利付国債 (2 0 年)	320,000,000	342,694,400	
第 6 3 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	227,744,000	
第 6 4 回利付国債 (2 0 年)	320,000,000	368,089,600	
第 6 5 回利付国債 (2 0 年)	220,000,000	254,080,200	
第 6 6 回利付国債 (2 0 年)	330,000,000	378,701,400	
第 6 7 回利付国債 (2 0 年)	130,000,000	150,723,300	
第 6 8 回利付国債 (2 0 年)	190,000,000	224,604,700	
第 6 9 回利付国債 (2 0 年)	390,000,000	458,078,400	
第 7 0 回利付国債 (2 0 年)	400,000,000	481,244,000	
第 7 1 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	237,492,000	
第 7 2 回利付国債 (2 0 年)	630,000,000	746,323,200	
第 7 3 回利付国債 (2 0 年)	360,000,000	425,052,000	
第 7 4 回利付国債 (2 0 年)	200,000,000	237,804,000	
第 7 5 回利付国債 (2 0 年)	130,000,000	155,188,800	
第 7 6 回利付国債 (2 0 年)	270,000,000	317,684,700	
第 7 7 回利付国債 (2 0 年)	290,000,000	343,702,200	
第 7 8 回利付国債 (2 0 年)	170,000,000	200,664,600	
第 7 9 回利付国債 (2 0 年)	270,000,000	321,227,100	
第 8 0 回利付国債 (2 0 年)	220,000,000	263,681,000	
第 8 1 回利付国債 (2 0 年)	390,000,000	465,741,900	
第 8 2 回利付国債 (2 0 年)	600,000,000	721,974,000	
第 8 3 回利付国債 (2 0 年)	290,000,000	350,125,700	
第 8 4 回利付国債 (2 0 年)	670,000,000	802,666,700	
第 8 5 回利付国債 (2 0 年)	290,000,000	351,082,700	
第 8 6 回利付国債 (2 0 年)	210,000,000	258,243,300	
第 8 7 回利付国債 (2 0 年)	550,000,000	671,099,000	
第 8 8 回利付国債 (2 0 年)	420,000,000	518,322,000	
第 8 9 回利付国債 (2 0 年)	350,000,000	428,505,000	
第 9 0 回利付国債 (2 0 年)	630,000,000	774,622,800	
第 9 1 回利付国債 (2 0 年)	450,000,000	557,824,500	
第 9 2 回利付国債 (2 0 年)	880,000,000	1,075,835,200	
第 9 3 回利付国債 (2 0 年)	410,000,000	498,617,400	
第 9 4 回利付国債 (2 0 年)	610,000,000	748,262,600	
第 9 5 回利付国債 (2 0 年)	610,000,000	763,933,500	

第 9 6 回利付国債（20年）	320,000,000	393,865,600	
第 9 7 回利付国債（20年）	540,000,000	672,802,200	
第 9 8 回利付国債（20年）	440,000,000	543,369,200	
第 9 9 回利付国債（20年）	870,000,000	1,078,443,300	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	600,000,000	752,964,000	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	315,000,000	402,538,500	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	380,000,000	487,646,400	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	360,000,000	457,758,000	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	420,000,000	524,197,800	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	670,000,000	839,302,300	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	330,000,000	417,337,800	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	150,000,000	188,464,500	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	450,000,000	554,400,000	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	340,000,000	419,951,000	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	790,000,000	995,423,700	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	330,000,000	421,198,800	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	750,000,000	947,760,000	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	1,040,000,000	1,317,950,400	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	590,000,000	749,718,900	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	720,000,000	924,372,000	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	550,000,000	708,070,000	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	820,000,000	1,044,704,600	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	590,000,000	745,636,100	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	380,000,000	469,908,000	
第 1 2 0 回利付国債（20年）	330,000,000	399,102,000	
第 1 2 1 回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,366,740,100	
第 1 2 2 回利付国債（20年）	280,000,000	347,214,000	
第 1 2 3 回利付国債（20年）	920,000,000	1,181,951,600	
第 1 2 4 回利付国債（20年）	420,000,000	533,681,400	
第 1 2 5 回利付国債（20年）	430,000,000	559,885,800	
第 1 2 6 回利付国債（20年）	430,000,000	547,605,000	
第 1 2 7 回利付国債（20年）	460,000,000	579,236,600	
第 1 2 8 回利付国債（20年）	720,000,000	908,524,800	
第 1 2 9 回利付国債（20年）	420,000,000	523,882,800	
第 1 3 0 回利付国債（20年）	630,000,000	787,292,100	
第 1 3 1 回利付国債（20年）	380,000,000	469,277,200	

	第132回利付国債(20年)	630,000,000	778,692,600	
	第133回利付国債(20年)	680,000,000	851,285,200	
	第134回利付国債(20年)	560,000,000	702,240,000	
	第135回利付国債(20年)	480,000,000	594,643,200	
	第136回利付国債(20年)	410,000,000	501,704,700	
	第137回利付国債(20年)	290,000,000	359,814,600	
	第138回利付国債(20年)	390,000,000	471,892,200	
	第139回利付国債(20年)	410,000,000	502,397,600	
	第140回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,440,279,200	
	第141回利付国債(20年)	360,000,000	447,598,800	
	第142回利付国債(20年)	820,000,000	1,032,486,600	
	第143回利付国債(20年)	750,000,000	920,962,500	
	第144回利付国債(20年)	590,000,000	715,050,500	
	第145回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,718,859,000	
	第146回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,820,751,400	
	第147回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,686,305,600	
	第148回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,335,587,000	
	第149回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,834,755,700	
	第150回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,570,310,100	
	第151回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,593,912,800	
	第152回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,582,360,000	
	第153回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,547,542,300	
	第154回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,372,989,000	
	第155回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,587,829,200	
	第156回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,102,938,300	
	第157回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,612,590,400	
	第158回利付国債(20年)	330,000,000	338,916,600	
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,056,000	
	国債証券合計	231,070,000,000	259,174,091,000	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,699,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,734,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	137,474,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	135,447,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	123,215,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	124,326,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	243,406,000	

第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	242,034,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	105,379,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,635,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	105,090,000	
第702回東京都公募公債	200,000,000	210,962,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	104,692,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	103,973,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	105,739,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	104,543,000	
平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	112,184,600	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,206,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,790,000	
平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,970,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,962,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	141,090,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	121,010,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,531,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	102,043,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	209,330,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	206,990,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	244,170,000	
第91回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,246,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,381,000	
第322回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,788,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,356,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,332,000	
第361回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,334,000	
第371回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,639,000	
第375回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,561,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,031,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	104,639,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	121,886,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	105,392,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	108,259,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,503,000	

第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,986,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,190,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	105,438,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	123,747,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	103,159,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,043,253	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,210,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	104,253,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,704,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	126,036,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	210,010,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,337,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,665,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,200,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,011,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,842,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	125,689,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,025,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,861,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,191,000	
平成20年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,485,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,474,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	203,925,730	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,910,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,214,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,706,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	122,588,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	124,656,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,240,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	136,305,000	

第 1 3 回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	121,083,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,921,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,007,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,625,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	104,488,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,983,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,874,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,110,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,165,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,151,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,834,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,426,228	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,675,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,313,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,376,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,661,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	378,488,520	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,510,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,737,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,556,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,853,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,087,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,763,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,353,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,974,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,487,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,621,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,532,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,370,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,226,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,571,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,263,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,905,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,480,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,046,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10	200,000,000	209,458,000	

	年)			
	平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,206,000	
	第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	249,484,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	104,775,000	
	第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	139,896,000	
	第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	122,827,000	
	第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	128,575,000	
	第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	104,498,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,441,080	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,597,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,724,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	105,277,000	
	平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,211,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,617,000	
	第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	124,166,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	208,388,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,907,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,407,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	104,846,000	
	平成25年度第2回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,541,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,323,000	
	第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	121,823,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	103,887,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	104,533,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,500,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	208,286,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,670,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	157,146,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	210,926,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	205,072,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	123,160,000	
	地方債証券合計	16,334,590,000	17,740,755,011	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,676,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,411,000	

第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,891,000	
第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,681,000	
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	108,612,000	
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	217,526,000	
第14回道路債券	100,000,000	111,639,000	
第17回道路債券	100,000,000	109,342,000	
第21回道路債券	100,000,000	137,819,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,095,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	156,113,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,001,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,110,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,132,000	
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	101,937,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,142,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,232,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,116,000	
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	30,647,100	
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	113,518,590	
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	103,248,000	
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	186,842,680	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,185,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,926,000	
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	151,888,000	
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	249,072,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,795,000	
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	313,641,000	

第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,388,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,472,000	
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	144,883,440	
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	136,633,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,107,000	
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	104,161,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,853,000	
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	208,498,000	
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	207,932,000	
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	210,628,000	
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	126,039,000	
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	105,424,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,197,000	
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	105,569,000	
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	316,005,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	136,200,000	
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	316,212,540	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,744,000	
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	105,416,000	
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	105,019,000	
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	314,040,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,010,000	
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	105,384,000	
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	315,981,000	
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	208,830,000	

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	207,316,000	
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	312,408,000	
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	212,108,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	156,240,640	
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	104,794,000	
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	236,312,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	107,132,640	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,945,000	
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	104,666,000	
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	104,316,000	
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	103,797,000	
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	307,875,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	208,859,920	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,225,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,525,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,067,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,783,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	331,377,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	117,068,600	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	111,801,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,922,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	138,961,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,518,000	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,836,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,929,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,237,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,630,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,971,320	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,266,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,074,140	

第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,206,450	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,439,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	120,664,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,039,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,245,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,708,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,302,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,647,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,110,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,715,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,666,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,063,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,302,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	81,735,200	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,079,390	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	126,425,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,126,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	117,561,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,748,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,332,200	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,812,000	25,418,595	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,438,000	23,023,340	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,981,000	23,808,280	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	105,193,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,079,000	26,999,800	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	23,570,000	25,343,878	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	18,776,000	19,781,830	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,302,000	42,215,457	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,901,000	24,453,916	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,731,000	22,261,777	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,344,000	25,997,444	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,441,000	21,966,103	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構	24,204,000	25,653,093	

債券			
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	28,872,000	30,101,081	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	29,274,000	30,476,575	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,720,000	36,787,508	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,587,000	37,828,493	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,207,000	39,578,233	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,210,000	44,562,845	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,862,000	47,353,853	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,710,000	48,105,277	
第 3 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,011,000	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,940,000	102,106,071	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,227,000	24,568,823	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,091,000	54,707,731	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,582,000	24,916,741	
第 4 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,874,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,178,000	24,958,070	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,119,000	63,515,680	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,297,000	22,838,263	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,011,000	64,634,847	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,609,000	61,095,829	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,986,000	25,902,001	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,904,000	119,535,852	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,834,000	65,024,245	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,041,000	25,781,327	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,849,000	76,289,268	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,894,000	74,207,158	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,816,000	75,244,124	
第 5 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,145,000	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,650,000	153,036,807	
第 6 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,563,000	
第 6 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,681,000	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,572,000	159,958,010	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,608,000	81,234,621	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,672,000	82,072,118	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,619,000	83,207,991	

第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,877,000	78,053,266	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,674,000	78,230,722	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,746,000	83,605,415	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	187,824,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,007,000	79,633,293	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,824,000	85,562,538	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,290,000	87,171,314	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,478,000	86,019,605	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,712,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,994,000	178,350,161	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,437,000	89,719,877	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,732,000	183,005,308	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,736,000	94,870,619	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,093,000	95,955,609	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,978,000	96,400,520	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,742,000	197,390,500	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,825,000	98,393,264	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,152,000	100,937,041	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,450,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,204,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	133,890,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	121,659,000	
第11回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,395,000	
い第750号商工債	100,000,000	100,347,000	
い第752号商工債	200,000,000	200,792,000	
い第756号商工債	100,000,000	100,497,000	
い第779号商工債	100,000,000	100,750,000	
い第752号農林債	200,000,000	200,792,000	
い第780号農林債	100,000,000	100,986,000	
い第796号農林債	200,000,000	200,100,000	
第290回信金中金債(5年)	100,000,000	100,696,000	
第299回信金中金債(5年)	100,000,000	100,583,000	
第300回信金中金債(5年)	300,000,000	302,037,000	
第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,819,000	

	第309回信金中金債(5年)	100,000,000	100,937,000	
	第317回信金中金債(5年)	200,000,000	200,366,000	
	第178号商工債(3年)	300,000,000	300,519,000	
	第179号商工債(3年)	200,000,000	200,346,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,408,000	
	第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,101,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,155,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	210,660,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,428,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	200,000,000	209,496,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券	100,000,000	104,484,000	
	特殊債券合計	22,219,105,000	23,813,690,857	
社債券	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エ ー円貨社債	100,000,000	100,588,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,536,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,189,000	
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエ ルシー円貨社債	100,000,000	100,007,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,545,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,793,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,813,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,571,000	
	第11回ウエストバック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	100,000,000	100,751,000	
	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	100,844,000	
	第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,292,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,251,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,106,000	
	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	100,464,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	102,491,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	104,831,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,222,000	
	第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	104,922,000	

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	103,737,000	
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	103,384,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,572,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,056,000	
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	103,062,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,309,000	
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	100,430,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,852,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,594,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,401,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,063,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,441,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,167,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,413,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	203,514,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,020,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,374,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,479,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,202,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,958,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,204,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,658,000	
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	100,882,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	104,806,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,209,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,327,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,507,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,261,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,621,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,449,000	

第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	102,838,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,349,000	
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	129,272,000	
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	104,768,000	
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	106,748,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	122,242,000	
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	103,299,000	
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	106,456,000	
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	105,947,000	
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	103,843,000	
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	105,871,000	
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	105,115,000	
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	107,004,000	
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	205,100,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,485,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,055,000	
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	101,430,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,567,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,651,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,606,000	
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	101,156,000	
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	101,215,000	
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	104,074,000	
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	101,025,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,513,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,442,000	
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	104,888,000	

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	105,610,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,077,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,769,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,957,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,286,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,696,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,028,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,719,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	249,314,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,727,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,234,780	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	124,114,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,317,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,386,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	134,497,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	128,394,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	104,853,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	207,116,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	104,415,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	104,017,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,507,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,554,400	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,134,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,907,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,126,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,997,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,289,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	107,023,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,942,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,073,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,770,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,547,000	

第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,854,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,255,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,436,000	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,095,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	134,124,480	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,415,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,379,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,845,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,205,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,497,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,722,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	31,971,230	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	103,092,720	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,699,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,026,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,848,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	105,059,000	
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	102,058,000	
社債券合計	13,027,000,000	13,601,957,810	
合計		314,330,494,678	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

貸借対照表

	平成 28 年 9 月 30 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,330,671,347
コール・ローン	250,880,174
株式	235,582,023,301
投資信託受益証券	259,093,267
投資証券	6,546,861,161
派生商品評価勘定	41,871,830
未収入金	114,484,955
未収配当金	368,322,840
差入委託証拠金	853,064,305
流動資産合計	248,347,273,180
資産合計	248,347,273,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,626,704
前受金	34,344,916
未払解約金	48,578,275
未払利息	625
その他未払費用	110
流動負債合計	90,550,630
負債合計	90,550,630
純資産の部	
元本等	
元本	139,771,484,726
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	108,485,237,824
元本等合計	248,256,722,550
純資産合計	248,256,722,550
負債純資産合計	248,347,273,180

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 9 月 30 日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成 28 年 9 月 30 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,771,484,726 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 1.7762 円 (1 万口当たり純資産額) (17,762 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 9 月 30 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 9 月 30 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 9 月 30 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 1 日
期首元本額	130,465,120,039 円
期中追加設定元本額	23,751,263,254 円
期中一部解約元本額	14,444,898,567 円
期末元本額	139,771,484,726 円
期末元本額の内訳	
SBI 資産設計オープン (資産成長型)	2,545,670,322 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	19,935,877 円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	27,421,276,338 円
世界経済インデックスファンド	3,044,511,868 円
マイセレクション 25	4,465,124 円
マイセレクション 50	19,857,118 円
マイセレクション 75	22,118,446 円
外国株式インデックス・オープン	1,135,975,892 円
DCマイセレクション 25	951,642,783 円
DCマイセレクション 50	4,690,657,916 円
DCマイセレクション 75	5,104,696,298 円
DC外国株式インデックス・オープン	6,761,731,257 円
DCマイセレクション S 25	385,635,345 円
DCマイセレクション S 50	1,821,911,199 円
DCマイセレクション S 75	1,374,685,509 円
DCターゲット・イヤール ファンド 2025	158,892,690 円
DCターゲット・イヤール ファンド 2035	188,504,813 円
DCターゲット・イヤール ファンド 2045	100,994,364 円
DC世界経済インデックスファンド	3,860,498,895 円
外国株式インデックス・オープン (SMA 専用)	1,791,381,589 円
マイセレクション 50 VA 1 (適格機関投資家専用)	33,363,003 円
マイセレクション 75 VA 1 (適格機関投資家専用)	23,101,736 円
外国株式インデックス・オープン VA 1 (適格機関投資家専用)	124,706,153 円
バランス 30 VA 1 (適格機関投資家専用)	169,013,133 円
バランス 50 VA 1 (適格機関投資家専用)	611,425,631 円
バランス 25 VA 2 (適格機関投資家専用)	105,365,714 円
バランス 50 VA 2 (適格機関投資家専用)	665,467,626 円
バランス A (25) VA 1 (適格機関投資家専用)	1,422,552,936 円
バランス B (37.5) VA 1 (適格機関投資家専用)	685,512,669 円
バランス C (50) VA 1 (適格機関投資家専用)	4,284,548,349 円
世界バランス VA 1 (適格機関投資家専用)	3,573,126,225 円
世界バランス VA 2 (適格機関投資家専用)	1,538,824,484 円
バランス D (35) VA 1 (適格機関投資家専用)	659,102,245 円
グローバルバランスファンド VA 35 (適格機関投資家専用)	667,703,559 円
バランス E (25) VA 1 (適格機関投資家専用)	207,417,404 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	1,650,448,557 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)	3,532,601,649 円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,087,825,048 円

コア投資戦略ファンド（安定型）	4,689,823,407円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,486,322,974円
分散投資コア戦略ファンドA	1,516,364,762円
分散投資コア戦略ファンドS	2,604,441,005円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	283,516,808円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	399,593,626円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,086,709,577円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	725,961,543円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	46,569,360円
SMT インデックスバランス・オープン	304,643,601円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,692,365,500円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,768,765,891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）	1,719,256,908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9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,084,535,144	
投資信託受益証券	1,456,767	
投資証券	169,599,523	
合計	6,255,591,434	

(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9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,804,115,434	—	5,838,460,350	34,344,916
合計		5,804,115,434	—	5,838,460,350	34,344,916

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成 28 年 9 月 30 日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	285,654,990	—	285,555,200	△99,790
	アメリカドル	187,060,500	—	187,035,000	△25,500
	ユーロ	30,623,940	—	30,604,500	△19,440
	イギリスポンド	23,686,250	—	23,576,400	△109,850
	スイスフラン	20,847,400	—	20,924,000	76,600
	デンマーククローネ	11,884,080	—	11,863,800	△20,280
	オーストラリアドル	11,552,820	—	11,551,500	△1,320
合計		285,654,990	—	285,555,200	△99,790

(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	40,840	62.58	2,555,767.20	
	ANTERO RESOURCES CORP	12,683	26.14	331,533.62	
	APACHE CORP	30,327	63.74	1,933,042.98	
	BAKER HUGHES	33,793	50.21	1,696,746.53	
	CABOT OIL & GAS CORP	36,248	25.47	923,236.56	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	43.37	680,518.67	
	CHEVRON CORP	150,279	101.27	15,218,754.33	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	130.73	993,417.27	
	CONCHO RESOURCES INC	11,288	133.66	1,508,754.08	
	CONOCOPHILLIPS	98,213	43.66	4,287,979.58	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	50.99	389,920.53	

CORE LABORATORIES N. V.	3, 346	110. 48	369, 666. 08
DEVON ENERGY CORPORATION	36, 356	43. 04	1, 564, 762. 24
EOG RESOURCES INC	43, 750	95. 05	4, 158, 437. 50
EQT CORPORATION	13, 878	69. 55	965, 214. 90
EXXON MOBIL	330, 542	86. 46	28, 578, 661. 32
FMC TECHNOLOGIES INC	17, 553	29. 51	517, 989. 03
HALLIBURTON CO	68, 434	44. 18	3, 023, 414. 12
HELMERICH & PAYNE	8, 315	65. 26	542, 636. 90
HESS CORP	22, 044	52. 15	1, 149, 594. 60
HOLLYFRONTIER CORP	12, 448	23. 61	293, 897. 28
KINDER MORGAN INC	151, 659	22. 76	3, 451, 758. 84
MARATHON OIL CORP	66, 489	15. 90	1, 057, 175. 10
MARATHON PETROLEUM CORP	41, 706	39. 74	1, 657, 396. 44
MURPHY OIL CORP	13, 898	30. 33	421, 526. 34
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30, 311	36. 86	1, 117, 263. 46
NEWFIELD EXPLORATION CO	16, 073	42. 78	687, 602. 94
NOBLE ENERGY INC	34, 708	35. 55	1, 233, 869. 40
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	60, 712	72. 14	4, 379, 763. 68
ONEOK INC	15, 568	50. 94	793, 033. 92
PHILLIPS 66	37, 681	79. 28	2, 987, 349. 68
PIONEER NATURAL RESOURCES	13, 066	185. 36	2, 421, 913. 76
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	17, 636	12. 90	227, 504. 40
RANGE RESOURCES CORP	12, 769	37. 56	479, 603. 64
SCHLUMBERGER	110, 323	77. 37	8, 535, 690. 51
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38, 763	13. 20	511, 671. 60
SPECTRA ENERGY CORP	55, 942	42. 32	2, 367, 465. 44
TESORO CORP	9, 230	77. 57	715, 971. 10
VALERO ENERGY CORP	36, 681	51. 71	1, 896, 774. 51
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	73, 816	5. 68	419, 274. 88
WILLIAMS COS	56, 360	30. 39	1, 712, 780. 40
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16, 491	150. 51	2, 482, 060. 41
ALBEMARLE CORP	8, 689	83. 15	722, 490. 35
ALCOA	103, 592	9. 96	1, 031, 776. 32
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	4, 845	116. 87	566, 235. 15
AVERY DENNISON CORP	7, 457	77. 05	574, 561. 85
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17, 606	27. 93	491, 735. 58

BALL CORP	13,571	80.90	1,097,893.90
CELANESE CORP-SERIES A	11,407	65.62	748,527.34
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	24.20	418,829.40
CROWN HOLDINGS INC	10,494	56.68	594,799.92
DOW CHEMICAL CO	89,390	51.73	4,624,144.70
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	69,706	66.37	4,626,387.22
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	66.38	787,134.04
ECOLAB INC	21,426	120.73	2,586,760.98
FMC CORP	10,402	48.24	501,792.48
FREEMONT-MCMORAN INC	92,169	10.69	985,286.61
INT'L PAPER CO	30,554	47.32	1,445,815.28
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	141.98	855,855.44
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	80.47	2,340,952.77
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	182.50	910,492.50
MONSANTO CO	35,250	101.79	3,588,097.50
MOSAIC CO/THE	27,677	24.25	671,167.25
NEWMONT MINING CORP	42,965	39.05	1,677,783.25
NUCOR CORP	24,843	48.86	1,213,828.98
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	79.72	549,031.64
PPG INDUSTRIES INC	20,895	102.06	2,132,543.70
PRAXAIR INC	22,925	118.86	2,724,865.50
SEALED AIR CORP	14,781	45.72	675,787.32
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,175	277.30	1,712,327.50
VALSPAR CORP/THE	6,135	106.17	651,352.95
VULCAN MATERIALS CO	10,471	114.89	1,203,013.19
WESTROCK CO	20,913	47.31	989,394.03
WR GRACE & CO	5,635	73.31	413,101.85
3 M COMPANY	48,383	175.37	8,484,926.71
ACUITY BRANDS INC	3,505	260.41	912,737.05
AERCAP HOLDINGS NV	14,355	37.76	542,044.80
AGCO CORP	5,969	47.83	285,497.27
AMETEK INC	18,866	47.23	891,041.18
B/E AEROSPACE INC	8,805	50.94	448,526.70
BOEING CO	48,294	131.03	6,327,962.82
CATERPILLAR	46,437	87.47	4,061,844.39
CUMMINS INC	13,051	124.26	1,621,717.26

DEERE&CO	21,343	83.86	1,789,823.98
DOVER CORP	11,832	71.87	850,365.84
EATON CORP	35,858	64.16	2,300,649.28
EMERSON ELECTRIC CO	50,628	53.02	2,684,296.56
FASTENAL CO	23,228	40.84	948,631.52
FLOWSERVE CORP	10,826	47.33	512,394.58
FLUOR CORP	11,267	50.69	571,124.23
FORTIVE CORP	24,565	50.70	1,245,445.50
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	57.91	741,827.10
GENERAL DYNAMICS CORP	20,489	155.61	3,188,293.29
GENERAL ELECTRIC CO	733,082	29.53	21,647,911.46
GRAINGER (WW) INC	4,749	220.32	1,046,299.68
HONEYWELL INTL INC	57,961	116.19	6,734,488.59
ILLINOIS TOOL WORKS	26,160	119.04	3,114,086.40
INGERSOLL-RAND PLC	19,750	67.10	1,325,225.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	51.96	503,648.28
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,600	60.79	1,191,484.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	150.75	922,137.75
LOCKHEED MARTIN CORP	21,080	242.34	5,108,527.20
MASCO CORP	25,921	34.22	887,016.62
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,719	213.61	2,930,515.59
PACCAR INC	28,272	57.89	1,636,666.08
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	123.99	1,356,698.58
PENTAIR PLC	13,583	62.95	855,049.85
RAYTHEON COMPANY	23,861	136.54	3,257,980.94
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,366	117.12	1,214,065.92
ROCKWELL COLLIN	10,382	84.23	874,475.86
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,142	181.30	1,476,144.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.87	523,666.36
SMITH (A. O.) CORP	6,073	97.91	594,607.43
SNAP-ON INC	4,317	149.20	644,096.40
STANLEY BLACK&DECKER	11,781	121.73	1,434,101.13
TEXTRON	21,877	39.50	864,141.50
TRANSDIGM GROUP INC	4,129	287.09	1,185,394.61
UNITED RENTALS INC	7,302	76.34	557,434.68
UNITED TECHNOLOGIES CORP	62,919	101.06	6,358,594.14

WABCO HOLDINGS INC	3,875	111.20	430,900.00
WABTEC CORP	7,158	78.92	564,909.36
XYLEM INC	13,941	51.82	722,422.62
CINTAS CORP	7,407	111.36	824,843.52
DUN & BRADSTREET CORP	3,101	134.72	417,766.72
EQUIFAX INC	9,605	133.33	1,280,634.65
IHS MARKIT LTD	28,842	37.31	1,076,095.02
MANPOWER GROUP	5,272	70.47	371,517.84
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,029	53.47	1,552,180.63
REPUBLIC SERVICES INC	18,168	50.07	909,671.76
ROBERT HALF INTL INC	9,340	37.02	345,766.80
STERICYCLE INC	6,767	80.50	544,743.50
VERISK ANALYTICS INC	12,693	81.05	1,028,767.65
WASTE CONNECTIONS INC	14,407	74.91	1,079,228.37
WASTE MANAGEMENT INC	34,711	63.27	2,196,164.97
AMERCO	602	322.94	194,409.88
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	35.82	441,875.52
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	70.31	804,908.88
CSX CORP	75,690	29.99	2,269,943.10
DELTA AIR LINES INC	15,095	39.03	589,157.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	51.34	726,666.36
FEDEX CORP	20,425	175.12	3,576,826.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	80.40	573,573.60
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	92.66	810,126.38
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,257	95.15	2,212,903.55
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	38.15	504,114.10
UNION PACIFIC CORP	67,192	95.96	6,447,744.32
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,417	51.14	379,305.38
UNITED PARCEL SERVICE B	54,821	108.21	5,932,180.41
AUTOLIV INC	6,636	104.15	691,139.40
BORGWARNER INC	15,914	34.30	545,850.20
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,378	69.68	1,559,299.04
FORD MOTOR COMPANY	294,807	11.97	3,528,839.79
GENERAL MOTORS CO	110,724	31.48	3,485,591.52
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	31.73	686,224.71
HARLEY-DAVIDSON	14,677	52.48	770,248.96

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	76,000	45.91	3,489,160.00
LEAR CORP	6,134	118.77	728,535.18
TESLA MOTORS INC	9,341	200.70	1,874,738.70
COACH INC	22,032	36.21	797,778.72
DR HORTON INC	28,586	30.14	861,582.04
GARMIN LTD	9,564	48.15	460,506.60
HANESBRANDS INC	31,136	25.16	783,381.76
HARMAN INTL INDS INC	5,462	83.16	454,219.92
HASBRO INC	9,007	79.39	715,065.73
LEGGETT & PLATT INC	10,594	45.71	484,251.74
LENNAR CORP-CL A	14,466	42.19	610,320.54
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	60.99	516,707.28
MATTEL INC	27,399	30.77	843,067.23
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	46.87	652,430.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	198.86	1,006,629.32
NEWELL BRANDS INC	35,445	52.01	1,843,494.45
NIKE B	107,135	52.16	5,588,161.60
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	75.47	354,029.77
PULTE GROUP INC	24,602	19.81	487,365.62
PVH CORP	6,800	106.66	725,288.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	99.65	456,197.70
TOLL BROTHERS INC	14,067	29.56	415,820.52
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,365	38.60	515,889.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	13,459	33.68	453,299.12
VF CORP	26,289	55.39	1,456,147.71
WHIRLPOOL CORP	6,165	160.35	988,557.75
ARAMARK	17,044	37.90	645,967.60
BLOCK H & R INC	16,984	22.65	384,687.60
CARNIVAL CORPORATION	29,311	48.26	1,414,548.86
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,441	420.73	1,027,001.93
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	60.63	608,179.53
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	151.75	620,354.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	44,309	22.82	1,011,131.38
LAS VEGAS SANDS CORP	34,979	56.93	1,991,354.47
MARRIOTT INTL A	27,183	67.10	1,823,979.30
MCDONALD'S CORP	70,035	114.79	8,039,317.65

MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	17,662	16.02	282,945.24
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	25.85	934,322.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	12,935	37.16	480,664.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,092	74.25	972,081.00
STARBUCKS CORP	117,269	53.45	6,268,028.05
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	9,314	67.06	624,596.84
WYNN RESORTS LTD	6,619	100.59	665,805.21
YUM BRANDS INC	32,844	89.81	2,949,719.64
CBS CORP-CL B	33,884	54.57	1,849,049.88
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,140	271.83	4,659,166.20
COMCAST CORP-CL A	192,754	66.25	12,769,952.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	26.81	343,275.24
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,923	26.09	545,881.07
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	55.04	1,002,718.72
INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	22.09	679,731.39
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	71.81	622,090.03
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,234	32.82	762,539.88
LIBERTY GLOBAL PLC-C	49,777	31.85	1,585,397.45
LIBERTY LILAC GROUP-C	9,040	28.24	255,289.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	32.92	501,470.36
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.58	214,374.72
NEWS CORP-CLASS A	27,721	13.89	385,044.69
OMNICOM GROUP	19,285	84.05	1,620,904.25
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	63.94	406,402.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	4.14	688,140.46
TEGNA INC	15,014	21.55	323,551.70
THE WALT DISNEY CO	122,760	91.80	11,269,368.00
TIME WARNER INC	62,838	78.61	4,939,695.18
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	89,479	24.04	2,151,075.16
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	34,104	24.62	839,640.48
VIACOM INC-CLASS B	27,473	37.77	1,037,655.21
ADVANCE AUTO PARTS	5,791	146.74	849,771.34
AMAZON.COM	31,971	829.05	26,505,557.55
AUTONATION INC	5,015	47.26	237,008.90
AUTOZONE INC	2,362	765.76	1,808,725.12
BED BATH & BEYOND INC	12,615	42.18	532,100.70

BEST BUY COMPANY INC	22,277	37.41	833,382.57
CARMAX INC	14,601	52.17	761,734.17
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	56.57	358,880.08
DOLLAR GENERAL CORP	22,550	69.32	1,563,166.00
DOLLAR TREE INC	18,797	77.36	1,454,135.92
EXPEDIA INC	9,436	118.40	1,117,222.40
FOOT LOCKER INC	10,566	66.83	706,125.78
GAP	17,852	21.70	387,388.40
GENUINE PARTS CO	11,752	99.58	1,170,264.16
HOME DEPOT	99,202	127.93	12,690,911.86
KOHL'S CORP	14,309	42.80	612,425.20
L BRANDS INC	19,081	69.85	1,332,807.85
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	19.84	695,808.64
LKQ CORP	24,693	35.24	870,181.32
LOWE'S COMPANIES	70,731	72.01	5,093,339.31
MACY'S INC	23,893	36.05	861,342.65
NETFLIX INC	34,029	96.67	3,289,583.43
NORDSTROM INC	10,094	51.48	519,639.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,660	278.90	2,136,374.00
PRICELINE GROUP INC/THE	3,940	1,472.98	5,803,541.20
ROSS STORES INC	31,869	63.35	2,018,901.15
SIGNET JEWELERS LTD	5,419	73.16	396,454.04
STAPLES INC	47,470	8.34	395,899.80
TARGET (DAYTON HUDSON)	44,608	67.72	3,020,853.76
TIFFANY & CO	10,306	71.37	735,539.22
TJX COMPANIES INC	53,223	73.87	3,931,583.01
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	68.24	683,150.64
TRIPADVISOR INC	8,771	63.00	552,573.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,911	237.12	1,164,496.32
COSTCO WHOLESALE CORP	34,916	147.49	5,149,760.84
CVS HEALTH CORP	85,685	89.55	7,673,091.75
KROGER CO	73,957	29.50	2,181,731.50
RITE AID CORP	83,480	7.57	631,943.60
SYSCO CORP	43,181	49.03	2,117,164.43
WAL-MART STORES	125,191	70.73	8,854,759.43
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,743	79.21	5,761,973.03

WHOLE FOODS MKT INC	25,128	28.01	703,835.28
ALTRIA GROUP INC	155,116	62.82	9,744,387.12
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,662	41.53	1,979,402.86
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,830	47.08	792,356.40
BUNGE LIMITED	10,583	58.76	621,857.08
CAMPBELL SOUP CO (US)	16,395	54.38	891,560.10
COCA-COLA CO	327,722	42.03	13,774,155.66
CONAGRA	32,330	46.25	1,495,262.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,057	163.67	2,300,709.19
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,905	90.72	1,352,181.60
GENERAL MILLS INC	47,336	63.66	3,013,409.76
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,601	94.64	1,097,918.64
HORMEL FOODS CORP	23,465	37.88	888,854.20
INGREDION INC	5,835	131.73	768,644.55
JM SMUCKER CO	9,201	134.77	1,240,018.77
KELLOGG CO	20,764	77.26	1,604,226.64
KRAFT HEINZ CO/THE	48,229	88.57	4,271,642.53
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	97.39	903,389.64
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,072	78.24	1,179,233.28
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,095	108.44	1,636,901.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	124,607	43.14	5,375,545.98
MONSTER BEVERAGE CORP	10,670	145.37	1,551,097.90
PEPSICO INC	115,188	107.76	12,412,658.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,710	97.78	12,096,363.80
REYNOLDS AMERICAN INC	68,161	47.13	3,212,427.93
TYSON FOODS INC	23,213	74.83	1,737,028.79
WHITEWAVE FOODS CO	14,578	54.36	792,460.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	47.56	1,004,752.56
CLOROX COMPANY	10,377	124.66	1,293,596.82
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,422	73.29	4,941,358.38
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	78.05	351,537.20
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,252	86.87	1,498,681.24
KIMBERLY-CLARK CORP	28,710	125.22	3,595,066.20
PROCTER & GAMBLE CO	212,224	88.23	18,724,523.52
ABBOTT LABORATORIES	117,587	41.44	4,872,805.28
AETNA INC	27,927	115.03	3,212,442.81

AMERISOURCEBERGEN CORP	14,832	81.25	1,205,100.00
ANTHEM INC	20,923	124.93	2,613,910.39
BARD C R INC	5,711	223.74	1,277,779.14
BAXTER INTERNATIONAL	39,265	46.92	1,842,313.80
BECTON DICKINSON & CO	16,937	176.44	2,988,364.28
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,135	23.30	2,519,545.50
CARDINAL HEALTH	26,486	76.90	2,036,773.40
CENTENE CORP	13,787	67.65	932,690.55
CERNER CORP	24,798	61.53	1,525,820.94
CIGNA CORP	20,487	130.80	2,679,699.60
DANAHER CORP	49,131	77.13	3,789,474.03
DAVITA INC	13,384	65.46	876,116.64
DENTSPLY SIRONA INC	19,455	59.10	1,149,790.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,270	119.26	2,059,620.20
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	21.90	281,305.50
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	50,709	69.84	3,541,516.56
HCA HOLDINGS INC	25,490	75.26	1,918,377.40
HENRY SCHEIN INC	6,510	161.15	1,049,086.50
HOLOGIC INC	19,280	38.14	735,339.20
HUMANA INC	11,932	175.82	2,097,884.24
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	111.87	815,644.17
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,329	30.35	374,185.15
INTUITIVE SURGICAL INC	3,057	719.99	2,201,009.43
LABORATORY CRP OF AMER	7,995	135.46	1,083,002.70
MCKESSON CORP	18,268	164.42	3,003,624.56
MEDNAX INC	6,946	65.93	457,949.78
MEDTRONIC PLC	111,791	85.40	9,546,951.40
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	45.46	321,947.72
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	83.55	955,728.45
RESMED INC	10,525	64.21	675,810.25
ST JUDE MEDICAL INC	22,795	78.96	1,799,893.20
STRYKER CORP	26,867	115.70	3,108,511.90
THE COOPER COS INC	3,727	176.04	656,101.08
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,100	138.32	10,526,152.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	122.18	885,560.64
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	98.54	770,779.88

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,037	127.84	2,050,170.08
ABBVIE INC	129,478	62.82	8,133,807.96
AGILENT TECHNOLOGIES	26,114	46.41	1,211,950.74
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,050	120.06	2,167,083.00
ALKERMES PLC	12,547	46.71	586,070.37
ALLERGAN PLC	31,670	230.80	7,309,436.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	69.94	375,507.86
AMGEN	59,787	165.45	9,891,759.15
BIOGEN INC	17,449	305.78	5,335,555.22
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,137	92.78	1,218,850.86
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,708	53.87	7,148,979.96
CELGENE CORP	62,209	102.77	6,393,218.93
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,990	20.93	334,670.70
GILEAD SCIENCES INC	106,618	77.86	8,301,277.48
ILLUMINA INC	11,802	176.56	2,083,761.12
INCYTE CORP	13,213	92.29	1,219,427.77
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	123.01	611,482.71
JOHNSON & JOHNSON	220,040	117.27	25,804,090.80
LILLY (ELI) & CO	79,254	79.74	6,319,713.96
MALLINCKRODT PLC	8,200	68.99	565,718.00
MERCK & CO	220,504	61.91	13,651,402.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,100	407.33	855,393.00
MYLAN NV	36,685	38.47	1,411,271.95
PERRIGO CO PLC	11,238	93.24	1,047,831.12
PFIZER	485,255	33.32	16,168,696.60
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	79.06	521,242.58
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,177	406.36	2,510,085.72
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	113.39	165,322.62
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,568	156.06	4,926,502.08
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	115.02	371,054.52
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,852	85.00	1,687,420.00
WATERS CORP	6,513	156.34	1,018,242.42
ZOETIS INC	36,933	51.02	1,884,321.66
BANK OF AMERICA CORP	817,770	15.16	12,397,393.20
BB&T CORP	64,754	37.28	2,414,029.12
CIT GROUP INC	16,516	35.75	590,447.00

CITIGROUP	233,548	45.80	10,696,498.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,979	24.05	1,033,644.95
COMERICA INC	13,561	46.63	632,349.43
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	20.24	1,260,041.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,670	76.87	897,072.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	9.71	848,828.78
JPMORGAN CHASE & CO	291,532	65.65	19,139,075.80
KEY CORP	87,033	12.05	1,048,747.65
M & T BANK CORP	11,315	114.54	1,296,020.10
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	14.10	551,239.50
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	15.62	341,093.94
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,943	88.99	3,554,527.57
REGIONS FINL CORP	104,639	9.67	1,011,859.13
SIGNATURE BANK	4,354	117.27	510,593.58
SUNTRUST BANKS	40,538	43.15	1,749,214.70
US BANCORP	137,844	42.48	5,855,613.12
WELLS FARGO & CO	384,542	44.37	17,062,128.54
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	140.61	623,324.13
ALLY FINANCIAL INC	36,028	19.24	693,178.72
AMERICAN EXPRESS	64,220	63.37	4,069,621.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,641	97.42	1,328,906.22
BANK NEW YORK CO	86,054	39.06	3,361,269.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	95,116	143.59	13,657,706.44
BLACKROCK INC	9,783	357.23	3,494,781.09
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,344	70.36	2,908,963.84
CME GROUP INC	26,956	104.72	2,822,832.32
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	56.02	1,794,152.54
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,839	28.42	677,504.38
EATON VANCE CORP	7,881	38.27	301,605.87
FRANKLIN RESOURCES INC	30,723	34.74	1,067,317.02
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,207	158.95	4,801,402.65
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,488	268.40	2,546,579.20
INVESCO LTD	33,107	30.44	1,007,777.08
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	18.74	481,730.44
MOODY'S CORP	14,021	107.75	1,510,762.75
MORGAN STANLEY	116,971	31.04	3,630,779.84

MSCI INC	7,670	83.52	640,598.40
NASDAQ INC	9,070	67.48	612,043.60
NAVIENT CORP	29,884	14.31	427,640.04
NORTHERN TRUST CORP	17,404	66.70	1,160,846.80
PRICE T ROWE GROUP INC	19,603	65.54	1,284,780.62
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	56.65	562,647.80
S&P GLOBAL INC	20,959	125.02	2,620,294.18
SCHWAB (CHARLES) CORP	94,737	30.69	2,907,478.53
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	45.11	487,278.22
STATE STREET CORP	31,437	68.59	2,156,263.83
SYNCHRONY FINANCIAL	64,788	27.37	1,773,247.56
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	34.47	694,191.33
VOYA FINANCIAL INC	16,094	28.31	455,621.14
AFLAC	33,143	71.56	2,371,713.08
ALLEGHANY CORP	1,276	521.93	665,982.68
ALLSTATE CORP	29,595	68.64	2,031,400.80
AMERICAN INT'L GROUP	89,329	58.40	5,216,813.60
AON PLC	20,838	110.92	2,311,350.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	79.78	805,937.56
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,324	50.32	670,463.68
ASSURANT INC	4,769	91.47	436,220.43
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	54.27	396,279.54
CHUBB LTD	36,622	124.39	4,555,410.58
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	74.54	925,265.02
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	190.40	638,411.20
FNF GROUP	18,683	36.85	688,468.55
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,750	42.35	1,302,262.50
LINCOLN NATIONAL CORP	19,698	45.87	903,547.26
LOEWS CORP	21,888	40.77	892,373.76
MARKEL CORP	1,132	915.74	1,036,617.68
MARSH & MCLENNAN COS	41,672	66.40	2,767,020.80
METLIFE INC	74,274	43.66	3,242,802.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,970	50.50	1,109,485.00
PROGRESSIVE CORP	46,994	31.25	1,468,562.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,626	79.97	2,849,011.22
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	120.18	390,464.82

TORCHMARK CORP	9,592	63.23	606,502.16
TRAVELERS COS INC/THE	23,150	113.87	2,636,090.50
UNUM GROUP	18,574	34.69	644,332.06
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,118	129.79	1,313,215.22
WR BERKLEY CORP	7,065	57.52	406,378.80
XL GROUP LTD	23,714	33.64	797,738.96
CBRE GROUP INC-A	24,306	27.64	671,817.84
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.05	695,835.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	111.64	410,053.72
REALOGY HOLDINGS CORP	11,351	25.67	291,380.17
WEYERHAEUSER CO	61,061	31.86	1,945,403.46
ACCENTURE PLC-CL A	49,869	121.64	6,066,065.16
ACTIVISION BLIZZARD INC	46,765	44.21	2,067,480.65
ADOBE SYSTEMS INC	39,646	107.80	4,273,838.80
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	52.41	743,068.98
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,727	212.95	1,006,614.65
ALPHABET INC-CL A	23,436	802.64	18,810,671.04
ALPHABET INC-CL C	24,639	775.01	19,095,471.39
ANSYS INC	6,865	91.00	624,715.00
AUTODESK INC	16,171	71.59	1,157,681.89
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,544	87.21	3,187,002.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	67.38	650,217.00
CA INC	24,426	32.83	801,905.58
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,646	25.22	621,572.12
CDK GLOBAL INC	10,687	57.02	609,372.74
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	76.73	828,760.73
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	84.94	1,062,684.34
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,586	55.00	2,672,230.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	17,269	47.57	821,486.33
EBAY	89,575	32.30	2,893,272.50
ELECTRONIC ARTS INC	24,281	84.26	2,045,917.06
FACEBOOK INC-A	184,478	128.09	23,629,787.02
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	24,676	76.84	1,896,103.84
FISERV INC	17,335	99.72	1,728,646.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,470	172.66	1,289,770.20
FORTINET INC	10,871	35.93	390,595.03

GARTNER INC	6,094	88.10	536,881.40
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	76.09	952,114.17
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,800	158.11	11,510,408.00
INTUIT INC	19,187	109.31	2,097,330.97
LINKEDIN CORP - A	9,458	190.87	1,805,248.46
MASTERCARD INC-CLASS A	77,838	100.61	7,831,281.18
MICROSOFT CORP	595,067	57.40	34,156,845.80
MOBILEYE NV	14,784	41.67	616,049.28
NETSUITE INC	3,217	109.85	353,387.45
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	14.38	251,995.12
ORACLE CORP	249,922	39.12	9,776,948.64
PAYCHEX INC	26,208	57.16	1,498,049.28
PAYPAL HOLDINGS INC	87,661	40.39	3,540,627.79
RED HAT INC	14,162	80.16	1,135,225.92
SABRE CORP	17,243	28.18	485,907.74
SALESFORCE.COM INC	51,452	71.20	3,663,382.40
SERVICENOW INC	13,102	78.48	1,028,244.96
SPLUNK INC	10,741	57.73	620,077.93
SYMANTEC CORP	52,499	25.01	1,312,999.99
SYNOPSYS INC	12,264	59.08	724,557.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,531	46.72	585,448.32
TWITTER INC	42,396	23.01	975,531.96
VANTIV INC - CL A	12,864	55.99	720,255.36
VERISIGN INC	7,494	78.21	586,105.74
VISA INC-CLASS A SHARES	152,146	81.92	12,463,800.32
VMWARE INC-CLASS A	5,459	73.08	398,943.72
WESTERN UNION CO	38,757	20.49	794,130.93
WORKDAY INC-CLASS A	9,247	90.36	835,558.92
XEROX CORP	66,872	10.18	680,756.96
YAHOO	71,836	42.57	3,058,058.52
ZILLOW GROUP INC-C	9,847	35.96	354,098.12
AMPHENOL CORPORATION	24,850	64.68	1,607,298.00
APPLE INC	436,990	112.18	49,021,538.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	63.37	416,911.23
AVNET INC	10,936	40.59	443,892.24
CDW CORP/DE	10,704	45.29	484,784.16

CISCO SYSTEMS	401,483	31.39	12,602,551.37
CORNING	90,000	23.52	2,116,800.00
F5 NETWORKS INC	5,350	123.40	660,190.00
FLEX LTD	45,803	13.38	612,844.14
FLIR SYSTEMS INC	11,686	31.31	365,888.66
HARRIS CORP	9,931	90.61	899,847.91
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	139,171	22.90	3,187,015.90
HP INC	140,099	15.39	2,156,123.61
JUNIPER NETWORKS INC	27,826	23.71	659,754.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,652	77.21	976,860.92
NETAPP INC	23,085	34.73	801,742.05
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	156.08	1,125,492.88
SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	37.79	874,725.13
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	63.31	1,864,796.05
TRIMBLE NAVIGATION LTD	20,622	28.12	579,890.64
WESTERN DIGITAL CORP	22,034	58.27	1,283,921.18
AT&T INC	490,824	40.73	19,991,261.52
CENTURYLINK INC	43,331	27.52	1,192,469.12
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	4.25	351,249.75
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	46.43	1,137,581.43
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,958	111.60	1,111,312.80
SPRINT CORP	64,825	6.66	431,734.50
T-MOBILE US INC	22,613	46.46	1,050,599.98
VERIZON COMMUNICATIONS	325,009	52.12	16,939,469.08
AES CORP	52,646	12.90	679,133.40
ALLIANT ENERGY CORPORATION	17,042	38.86	662,252.12
AMEREN CORPORATION	19,175	49.60	951,080.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,234	64.50	2,530,593.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	74.98	1,070,939.34
ATMOS ENERGY CORP	8,018	74.88	600,387.84
CALPINE CORP	25,284	12.76	322,623.84
CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	23.58	719,590.86
CMS ENERGY CORP	21,027	42.31	889,652.37
CONSOLIDATED EDISON INC	24,254	76.53	1,856,158.62
DOMINION RESOURCES	49,227	74.75	3,679,718.25
DTE ENERGY COMPANY	14,510	93.05	1,350,155.50

DUKE ENERGY CORP	54,749	80.31	4,396,892.19
EDISON INTL	25,385	72.68	1,844,981.80
ENTERGY CORP	13,902	77.33	1,075,041.66
EVERSOURCE ENERGY	25,446	54.69	1,391,641.74
EXELON CORP	73,717	33.29	2,454,038.93
FIRSTENERGY CORP	32,383	33.17	1,074,144.11
NEXTERA ENERGY INC	36,621	123.70	4,530,017.70
NISOURCE INC	26,021	24.21	629,968.41
NRG ENERGY INC	25,186	11.10	279,564.60
OGE ENERGY CORP	15,686	32.11	503,677.46
PG&E CORP	39,374	61.76	2,431,738.24
PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	76.76	639,410.80
PPL CORPORATION	54,207	34.82	1,887,487.74
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,418	42.11	1,659,891.98
SCANA CORP	10,178	72.71	740,042.38
SEMPRA ENERGY	18,975	106.95	2,029,376.25
SOUTHERN CO	74,970	52.05	3,902,188.50
UGI CORP	13,950	45.81	639,049.50
WEC ENERGY GROUP INC	25,306	60.38	1,527,976.28
WESTAR ENERGY INC	11,492	56.73	651,941.16
XCEL ENERGY INC	40,743	41.81	1,703,464.83
ANALOG DEVICES	25,018	63.74	1,594,647.32
APPLIED MATERIALS	88,942	29.58	2,630,904.36
BROADCOM LTD	31,034	172.46	5,352,123.64
INTEL CORP	376,906	37.32	14,066,131.92
KLA-TENCOR CORP	11,893	68.77	817,881.61
LAM RESEARCH CORP	12,545	93.23	1,169,570.35
LINEAR TECHNOLOGY CORP	19,003	59.11	1,123,267.33
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	13.24	474,442.16
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	39.49	926,751.32
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,416	61.97	1,079,269.52
MICRON TECHNOLOGY	80,552	17.54	1,412,882.08
NVIDIA CORP	42,741	67.40	2,880,743.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	23,641	96.12	2,272,372.92
QORVO INC	10,609	53.68	569,491.12
QUALCOMM	117,312	67.45	7,912,694.40

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,621	73.26	1,144,394.46
	TEXAS INSTRUMENTS	79,950	69.84	5,583,708.00
	XILINX INC	20,299	53.49	1,085,793.51
	アメリカドル 小計	24,814,727		1,512,047,088.73 (152,898,201,612)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	33.36	396,516.96
	ARC RESOURCES LTD	27,117	23.44	635,622.48
	CAMECO CORP	28,709	11.43	328,143.87
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,210	42.14	3,632,889.40
	CENOVUS ENERGY INC	68,484	18.80	1,287,499.20
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	17.44	670,637.76
	ENBRIDGE	73,411	57.72	4,237,282.92
	ENCANA CORP	72,581	13.29	964,601.49
	HUSKY ENERGY INC	31,439	16.08	505,539.12
	IMPERIAL OIL	24,763	41.55	1,028,902.65
	INTER PIPELINE LTD	25,744	27.77	714,910.88
	KEYERA CORP	14,929	42.77	638,513.33
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,431	40.34	1,227,586.54
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	37.33	471,589.89
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,978	26.84	509,369.52
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	31.48	629,914.80
	SUNCOR ENERGY	134,813	36.41	4,908,541.33
	TOURMALINE OIL CORP	15,316	35.78	548,006.48
	TRANSCANADA CORP	65,026	62.60	4,070,627.60
	VERESEN INC	23,263	13.07	304,047.41
	VERMILION ENERGY INC	10,067	50.90	512,410.30
	AGNICO EAGLE MINES	16,929	72.51	1,227,521.79
	AGRIUM INC	10,925	119.25	1,302,806.25
	BARRICK GOLD CORP	95,340	23.58	2,248,117.20
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,100	258.53	542,913.00
	ELDORADO GOLD CORP	67,212	5.29	355,551.48
	FRANCO-NEVADA CORP	14,192	93.11	1,321,417.12
	GOLDCORP INC	66,632	21.87	1,457,241.84
	KINROSS GOLD CORP	107,615	5.60	602,644.00
	METHANEX CORP	6,468	47.10	304,642.80
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	71,204	21.34	1,519,493.36

SILVER WHEATON CORP	36,838	36.37	1,339,798.06
TECK RESOURCES LTD-CL B	49,377	24.59	1,214,180.43
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.96	281,160.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	39.90	172,647.30
YAMANA GOLD INC	85,214	5.85	498,501.90
BOMBARDIER B	157,835	1.68	265,162.80
CAE INC	18,429	18.69	344,438.01
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	24.62	289,629.68
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	51.10	619,945.20
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,041	84.85	5,349,028.85
CP RAILWAY LIMITED	11,451	198.00	2,267,298.00
LINAMAR CORP	3,889	53.29	207,244.81
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,782	55.02	1,693,625.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	36.54	645,259.86
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	57.94	1,064,473.68
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	26.83	964,458.01
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	130.40	705,333.60
DOLLARAMA INC	10,038	104.36	1,047,565.68
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,632	63.42	2,196,361.44
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	19.91	228,945.09
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	20.26	111,713.64
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	67.66	1,241,763.98
METRO INC	19,179	43.38	831,985.02
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	109.70	523,817.50
SAPUTO INC	19,855	45.59	905,189.45
BANK MONTREAL	51,500	85.99	4,428,485.00
BANK NOVA SCOTIA	95,957	70.63	6,777,442.91
CANADIAN IMPERIAL BANK	31,170	101.05	3,149,728.50
NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	46.64	1,313,522.32
ROYAL BANK OF CANADA	118,165	81.23	9,598,542.95
TORONTO-DOMINION BANK	147,647	58.28	8,604,867.16
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	71,395	46.43	3,314,869.85
CI FINANCIAL CORP	18,671	25.07	468,081.97
ELEMENT FINANCIAL CORP	28,986	16.48	477,689.28
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.78	274,969.30
ONEX CORP	5,970	83.99	501,420.30

	THOMSON REUTERS CORP	27,142	53.77	1,459,425.34
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,946	755.39	1,469,988.94
	GREAT-WEST LIFE CO INC	22,628	32.24	729,526.72
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,888	47.48	469,482.24
	INTACT FINANCIAL CORP	9,906	95.38	944,834.28
	MANULIFE FINANCIAL CORP	158,758	18.35	2,913,209.30
	POWER CORP OF CANADA	28,343	27.88	790,202.84
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	30.43	631,118.20
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,653	42.35	2,102,804.55
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	22.22	276,972.30
	CGI GROUP INC - CL A	17,086	62.73	1,071,804.78
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	592.68	858,200.64
	OPEN TEXT CORP	9,997	85.36	853,343.92
	BCE INC	12,539	60.95	764,252.05
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	29,051	56.05	1,628,308.55
	TELUS CORP	16,454	43.28	712,129.12
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	46.90	245,802.90
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	37.28	384,878.72
	FORTIS INC	24,449	42.31	1,034,437.19
	HYDRO ONE LTD	15,938	25.99	414,228.62
	カナダドル 小計	3,139,497		122,779,601.14 (9,430,701,163)
ユーロ	ENI	203,725	12.92	2,632,127.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	12.19	485,978.73
	NESTE OIL OYJ	9,335	38.00	354,730.00
	OMV AG	13,475	25.52	343,882.00
	REPSOL SA	87,346	12.10	1,057,323.33
	SAIPEM	590,236	0.36	216,321.49
	TECHNIP S. A.	9,226	54.25	500,510.50
	TENARIS SA	34,866	12.51	436,173.66
	TOTAL SA	178,185	42.67	7,603,153.95
	VOPAK	6,360	46.90	298,315.80
	AIR LIQUIDE	27,578	95.34	2,629,286.52
	AKZO NOBEL	18,901	60.96	1,152,204.96
	ARCELORMITTAL	152,837	5.55	848,245.35
	ARKEMA	5,986	82.39	493,186.54

BASF SE	73,127	74.36	5,437,723.72
COVESTRO AG	6,408	51.20	328,089.60
CRH	68,263	29.65	2,024,339.26
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	29.98	403,418.19
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	40.35	232,525.51
HEIDELBERGCEMENT AG	11,619	83.62	971,580.78
IMERYS SA	3,000	64.19	192,570.00
K+S AG	14,355	16.51	237,001.05
KONINKLIJKE DSM NV	13,482	59.90	807,571.80
LANXESS	7,293	55.25	402,938.25
LINDE AG	14,966	148.00	2,214,968.00
OCI NV	5,400	13.00	70,227.00
SOLVAY SA	5,674	103.05	584,705.70
STORA ENSO OYJ R	48,306	7.90	381,858.93
SYMRISE AG	9,404	64.99	611,165.96
THYSSEN KRUPP	29,964	21.26	637,184.46
UMICORE	6,892	55.99	385,883.08
UPM KYMMENE CORP	44,370	18.66	827,944.20
VOESTALPINE AG	7,829	31.41	245,948.03
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,977	26.91	483,761.07
AIRBUS GROUP SE	47,211	53.30	2,516,346.30
ALSTOM	11,216	23.41	262,622.64
ANDRITZ AG	5,242	49.00	256,884.21
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	31.14	182,291.68
BOUYGUES ORD	16,815	29.54	496,799.17
BRENTAG AG	11,535	48.82	563,196.37
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	6.36	546,817.15
EIFFAGE	4,952	69.29	343,124.08
FERROVIAL SA	42,255	18.68	789,323.40
GEA GROUP AG	13,801	49.34	680,941.34
HOCHTIEF AG	1,912	125.60	240,147.20
KONE OYJ-B	26,144	44.93	1,174,649.92
KONINKLIJKE PHILIPS	74,872	26.33	1,971,754.12
LEGRAND SA	20,583	52.69	1,084,518.27
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	28,941	10.07	291,435.87
MAN SE	2,329	93.13	216,899.77

METSO OYJ	9,561	25.95	248,107.95
OSRAM LICHT AG	7,897	50.60	399,588.20
PRYSMIAN SPA	14,715	23.19	341,240.85
REXEL SA	24,339	13.62	331,497.18
SAFRAN SA	25,317	63.74	1,613,705.58
SAINT-GOBAIN	38,624	38.39	1,482,968.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,749	61.83	2,766,830.67
SIEMENS	60,649	103.25	6,262,009.25
THALES SA	7,875	81.91	645,041.25
VINCI S. A.	40,093	67.76	2,716,701.68
WARTSILA OYJ	11,462	38.50	441,287.00
ZARDOYA OTIS SA	13,496	8.54	115,255.84
ZODIAC AEROSPACE	17,832	21.49	383,298.84
BUREAU VERITAS SA	19,558	19.01	371,895.37
EDENRED	18,941	20.95	396,813.95
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	40.88	392,005.38
RELX NV	79,145	16.00	1,266,320.00
SOCIETE BIC SA	2,424	131.25	318,150.00
WOLTERS KLUWER	22,399	38.05	852,281.95
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	55,946	13.76	770,096.69
ADP	2,382	88.32	210,378.24
AENA SA	5,610	131.85	739,678.50
ATLANTIA SPA	33,587	22.30	748,990.10
BOLLORE	61,805	3.09	191,348.28
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	9.77	207,078.48
DEUTSCHE POST AG-REG	76,258	27.56	2,102,051.77
FRAPORT AG	3,561	48.68	173,367.28
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	9.65	352,231.56
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	4.55	274,656.95
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,673	73.70	1,965,800.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	64.69	231,654.89
CONTINENTAL AG	8,665	185.95	1,611,256.75
DAIMLER AG	76,716	62.10	4,764,063.60
FERRARI NV	10,924	45.50	497,042.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	5.55	371,095.20
MICHELIN	14,817	98.08	1,453,251.36

NOKIAN RENKAAT OYJ	11,080	32.11	355,778.80
PEUGEOT SA	40,815	13.44	548,757.67
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	44.81	576,211.79
RENAULT SA	15,635	72.23	1,129,316.05
SCHAEFFLER AG	15,247	13.88	211,704.59
VALEO SA	19,350	51.06	988,011.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,936	115.55	1,725,854.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	126.50	328,141.00
ADIDAS AG	15,108	153.60	2,320,588.80
CHRISTIAN DIOR	4,454	158.50	705,959.00
HERMES INTERNATIONAL	2,148	359.80	772,850.40
HUGO BOSS AG	4,852	48.68	236,195.36
KERING	5,932	177.40	1,052,336.80
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	43.10	574,048.90
LVMH	22,284	150.70	3,358,198.80
ACCOR	14,931	35.33	527,586.88
PADDY POWER PLC	6,543	100.40	656,917.20
SODEXO	7,055	105.75	746,066.25
ALTICE NV -A	28,394	16.19	459,840.83
ALTICE NV -B	10,461	16.35	171,089.65
AXEL SPRINGER SE	3,827	45.45	173,956.28
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	18.12	217,065.00
JC DECAUX SA	4,674	28.81	134,681.31
LAGADERE S. C. A	9,057	22.59	204,642.91
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	16,172	38.18	617,446.96
PUBLICIS GROUPE	14,973	67.27	1,007,233.71
RTL GROUP	3,513	74.03	260,077.92
SES	26,910	21.88	588,925.35
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	46.07	230,257.86
VIVENDI	93,716	17.92	1,679,859.30
INDITEX	87,453	33.12	2,896,880.62
ZALANDO SE	6,805	36.50	248,382.50
CARREFOUR	42,603	23.05	982,212.16
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	42.68	157,379.59
COLRUYT SA	6,317	50.28	317,618.76
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.49	254,038.35

JERONIMO MARTINS	20,234	15.36	310,895.41
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,188	20.11	2,075,110.68
METRO STAMM	13,712	26.48	363,162.32
ANHEUSER-BUSCH INBEV	63,880	116.65	7,451,602.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	35.14	600,050.64
DANONE (GROUPE)	47,172	65.84	3,105,804.48
HEINEKEN HOLDING NV	7,613	71.29	542,730.77
HEINEKEN NV	18,670	77.73	1,451,219.10
KERRY GROUP PLC-A	13,457	73.06	983,168.42
PERNOD-RICARD	16,708	105.10	1,756,010.80
REMY COINTREAU	1,575	76.07	119,810.25
BEIERSDORF AG	7,534	83.55	629,465.70
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	103.65	893,255.70
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,315	120.40	1,723,526.00
LOREAL	20,234	167.65	3,392,230.10
UNILEVER NV-CVA	129,664	41.02	5,318,817.28
ESSILOR INTERNATIONAL	16,136	114.55	1,848,378.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,626	77.11	1,359,140.86
FRESENIUS SE&CO KGAA	32,858	70.11	2,303,674.38
BAYER	65,789	88.30	5,809,168.70
GRIFOLS SA	22,728	19.20	436,491.24
MERCK KGAA	10,480	95.88	1,004,822.40
ORION OYJ-CLASS B	7,975	34.91	278,407.25
QIAGEN N. V.	18,223	23.97	436,805.31
SANOFI	92,545	68.03	6,295,836.35
UCB (GROUPE)	10,465	68.86	720,619.90
ABN AMRO GROUP NV-CVA	20,336	18.27	371,640.40
BANCO BILBAO VIZCAYA	524,914	5.35	2,808,814.81
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.12	497,002.24
BANCO SANTANDER SA	1,160,593	3.94	4,580,860.57
BANKINTER SA	58,881	6.22	366,298.70
BNP PARIBAS	85,270	45.40	3,871,684.35
CAIXABANK	225,466	2.21	499,632.65
COMMERZBANK AG	89,792	5.80	521,511.93
CREDIT AGRICOLE SA	83,725	8.69	727,988.87
ERSTE GROUP BANK AG	25,921	26.20	679,259.80

ING GROEP NV-CVA	311,928	10.85	3,385,978.44
INTESA SANPAOLO	1,028,317	1.94	2,001,104.88
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	1.84	119,925.00
KBC GROEP NV	19,728	51.19	1,009,876.32
MEDIOBANCA	41,923	5.75	241,057.25
NATIXIS	69,996	4.10	287,053.59
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	13.56	124,711.32
SOCIETE GENERALE	62,045	30.81	1,911,916.67
UNICREDIT SPA	416,827	2.03	848,659.77
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	1.99	130,740.33
DEUTSCHE BANK NAMEN	106,948	10.87	1,163,059.50
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	15,014	72.24	1,084,611.36
EURAZEO	2,901	51.69	149,952.69
EXOR SPA	9,778	35.76	349,661.28
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	78.67	491,451.49
WENDEL	1,898	104.50	198,341.00
AEGON	153,883	3.42	527,510.92
AGEAS	16,065	32.36	519,863.40
ALLIANZ SE-REG	36,717	131.30	4,820,942.10
ASSICURAZIONI GENERALI	90,605	10.96	993,030.80
AXA	155,067	18.72	2,902,854.24
CNP ASSURANCES	11,830	14.94	176,799.35
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	94.78	446,034.68
MAPFRE SA	90,939	2.43	221,436.46
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,043	164.60	2,146,877.80
NN GROUP NV	26,436	27.36	723,421.14
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.06	278,972.10
SAMPO OYJ-A SHS	35,389	39.67	1,403,881.63
SCOR SE	13,354	27.63	368,971.02
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.42	135,108.68
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	27,553	32.33	890,788.49
VONOVIA SE	36,559	33.75	1,233,866.25
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,606	44.35	1,579,126.10
ATOS SE	6,536	95.24	622,488.64
CAP GEMINI SA	13,366	87.48	1,169,257.68
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	77.07	806,845.83

GEMALTO	6,158	56.85	350,082.30
SAP SE	78,184	80.74	6,312,576.16
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	39.37	374,574.37
INGENICO GROUP	4,681	78.05	365,352.05
NOKIA OYJ	462,845	5.12	2,372,080.62
DEUTSCHE TELEKOM	257,085	14.95	3,843,420.75
ELISA A	10,064	32.55	327,583.20
ILIAD SA	2,053	184.85	379,497.05
KPN (KON.)	258,436	2.98	771,173.02
ORANGE	159,424	13.95	2,223,964.80
PROXIMUS	13,141	27.08	355,858.28
SFR GROUP SA	7,526	26.57	199,965.82
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.74	634,298.68
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.60	283,968.78
TELEFONICA	357,794	9.39	3,361,474.63
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.59	240,746.36
E.ON SE	162,253	6.33	1,028,197.26
ELECTRICITE DE FRANCE	22,799	10.86	247,597.14
ENAGAS	18,299	26.60	486,753.40
ENDESA	24,774	19.04	471,820.83
ENEL	599,730	3.97	2,383,327.02
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	2.98	577,213.85
ENGIE	115,121	13.89	1,599,030.69
FORTUM OYJ	33,469	14.41	482,288.29
GAS NATURAL SDG SA	31,393	18.27	573,550.11
IBERDROLA SA	428,185	6.06	2,597,370.21
RED ELECTRICA CORPORACION SA	37,798	19.17	724,587.66
RWE STAMM	36,844	15.35	565,555.40
SNAM SPA	200,612	4.97	997,442.86
SUEZ	28,043	14.80	415,176.61
TERNA SPA	113,720	4.59	522,657.12
VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	20.48	754,237.21
ASML HOLDING NV	29,492	96.63	2,849,811.96
INFINEON TECHNOLOGIES	87,730	15.21	1,334,811.95
STMICROELECTRONICS	53,368	6.99	373,042.32
ユーロ 小計	15,808,999		256,557,916.35

				(29,083,405,397)
イギリスポンド	BP PLC	1,491,468	4.51	6,726,520.68
	PETROFAC LTD	16,711	8.79	146,973.24
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,970	19.24	6,581,212.65
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	298,353	20.22	6,032,697.66
	ANGLO AMERICAN PLC	114,934	9.80	1,126,468.13
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	5.22	132,809.05
	BHP BILLTON PLC	170,541	11.68	1,991,918.88
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	34.63	354,715.09
	FRESNILLO PLC	17,743	18.10	321,148.30
	GLENCORE PLC	985,732	2.15	2,127,702.52
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,364	32.81	471,282.84
	MONDI PLC	27,264	16.25	443,040.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	78.85	575,131.90
	RIO TINTO PLC REG	99,559	26.34	2,622,384.06
	ASHTED GROUP PLC	38,400	12.49	479,616.00
	BAE SYSTEMS PLC	247,437	5.24	1,296,569.88
	BUNZL PLC	27,712	22.77	631,002.24
	COBHAM PLC	151,109	1.69	255,978.64
	DCC PLC	7,320	69.30	507,276.00
	IMI PLC	23,923	10.65	254,779.95
	MEGGITT PLC	66,268	4.53	300,591.64
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	141,186	7.12	1,005,950.25
	SMITHS GROUP PLC	29,684	14.60	433,386.40
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	15.16	281,293.80
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	16.58	308,155.88
	WOLSELEY LTD	20,207	43.08	870,517.56
	AGGREKO PLC	19,830	9.56	189,673.95
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	10.46	205,988.78
	CAPITA GROUP PLC	53,334	6.98	372,271.32
	EXPERIAN PLC	75,104	15.52	1,165,614.08
	G4S PLC	132,555	2.26	299,574.30
INTERTEK GROUP PLC	12,430	35.00	435,050.00	
RELX PLC	85,261	14.65	1,249,073.65	
EASYJET PLC	11,633	10.21	118,772.93	
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.82	362,742.12	

NEW GKN	123,433	3.21	396,713.66
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	4.72	346,229.00
BURBERRY GROUP PLC	32,866	13.53	444,676.98
PERSIMMON PLC	22,640	17.41	394,162.40
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.50	405,894.00
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	25.06	265,610.94
CARNIVAL PLC	15,765	37.43	590,083.95
COMPASS GROUP PLC	132,576	14.96	1,983,336.96
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,585	31.26	455,927.10
MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.42	214,657.23
TUI AG-DI	42,055	10.98	461,763.90
WHITBREAD PLC	14,664	38.74	568,083.36
WILLIAM HILL	70,325	3.00	211,256.30
ITV PLC	295,435	1.84	545,373.01
PEARSON	66,305	7.49	496,955.97
SKY PLC	79,121	9.10	720,396.70
WPP PLC	100,815	18.23	1,837,857.45
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	3.65	303,826.00
KINGFISHER PLC	187,310	3.73	699,602.85
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.21	434,329.49
NEXT PLC	11,202	48.01	537,808.02
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.18	366,512.50
SAINSBURY (J) PLC	114,102	2.42	276,583.24
TESCO	658,838	1.79	1,185,578.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,296	26.05	711,060.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	147,952	49.46	7,318,445.68
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	17.75	248,482.25
DIAGEO	200,269	22.23	4,452,981.21
IMPERIAL BRANDS PLC	76,482	39.60	3,029,069.61
SABMILLER PLC	77,478	44.95	3,482,636.10
TATE & LYLE	40,576	7.40	300,262.40
RECKITT BENCKISER PLC	50,641	72.05	3,648,684.05
UNILEVER PLC	102,279	36.51	3,734,717.68
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	9.34	280,602.31
SMITH & NEPHEW PLC	68,928	12.38	853,328.64
ASTRAZENECA	100,560	50.26	5,054,145.60

GLAXOSMITHKLINE	386,675	16.47	6,370,470.62
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	20.49	250,121.43
SHIRE PLC	71,638	50.61	3,625,599.18
BARCLAYS	1,354,458	1.67	2,266,008.23
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,598,202	5.78	9,242,402.16
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,157,087	0.55	2,861,667.57
ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	1.77	523,373.00
STANDARD CHARTERED PLC	260,607	6.30	1,643,908.95
3I GROUP PLC	74,066	6.50	481,429.00
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	74,245	3.30	245,082.74
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	12.70	259,956.30
ICAP PLC	43,892	4.66	204,624.50
INVESTEC PLC	54,280	4.77	259,132.72
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	28.33	737,089.94
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	29.90	332,308.60
SCHRODERS PLC	9,867	27.00	266,409.00
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.84	338,754.20
AVIVA PIC	332,203	4.43	1,473,984.71
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.69	420,176.92
LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.18	1,062,096.77
OLD MUTUAL PLC	397,509	2.02	806,148.25
PRUDENTIAL	207,045	13.90	2,878,960.72
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.49	475,526.31
ST JAMES' S PLACE PLC	44,750	9.65	431,837.50
STANDARD LIFE PLC	164,930	3.45	569,173.43
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.02	322,200.27
SAGE GROUP PLC	89,321	7.34	655,616.14
WORLDPAY GROUP PLC	120,066	2.92	350,952.91
BT GROUP PLC	675,123	3.91	2,641,756.29
INMARSAT PLC	33,632	6.96	234,078.72
VODAFONE GROUP PLC	2,109,917	2.22	4,694,565.32
CENTRICA PLC	440,558	2.31	1,021,213.44
NATIONAL GRID PLC	298,692	11.06	3,303,533.52
SEVERN TRENT PLC	18,112	25.09	454,430.08
SSE PLC	78,889	15.77	1,244,079.53
UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	10.02	505,519.02

	イギリスポンド 小計	23,898,553		141,389,708.68 (18,522,051,837)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	523.00	351,456.00
	GIVAUDAN-REG	727	1,967.00	1,430,009.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	35,859	52.65	1,887,976.35
	SIKA AG-BR	164	4,641.00	761,124.00
	SYNGENTA AG	7,448	423.10	3,151,248.80
	ABB LTD	157,216	21.79	3,425,736.64
	GEBERIT AG-REG	3,003	422.80	1,269,668.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	182.40	246,604.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,393	180.80	613,454.40
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	55.00	727,320.00
	SGS SA	437	2,151.00	939,987.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	140.50	572,116.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,957	59.30	2,488,050.10
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	275.00	682,825.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	54.20	213,439.60
	DUFREY AG-REG	3,918	122.10	478,387.80
	ARYZTA AG	7,596	42.25	320,931.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,274.00	264,992.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,535.00	415,125.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	65,220.00	521,760.00
	NESTLE SA - REGISTERED	254,091	77.10	19,590,416.10
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	137.40	568,836.00
	ACTELION LTD-REG	8,148	168.40	1,372,123.20
	GALENICA AG-REG	291	1,069.00	311,079.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	184.70	736,583.60
	NOVARTIS	177,960	77.25	13,747,410.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,990	241.80	13,538,382.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	151,167	12.60	1,904,704.20
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	39.36	740,086.08
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	66.45	225,730.65
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	488.75	724,327.50	
UBS GROUP AG	294,572	13.03	3,838,273.16	
BALOISE HOLDING AG	3,877	117.40	455,159.80	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	250.90	616,712.20	

	SWISS RE LTD	27,320	86.95	2,375,474.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,170	250.60	3,049,802.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,038	85.45	430,497.10	
	SWISSCOM	2,064	462.60	954,806.40	
	スイスフラン 小計	1,314,706		85,942,614.88 (8,991,316,368)	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	155.50	2,206,700.50	
	BOLIDEN AB	23,983	202.50	4,856,557.50	
	ALFA LAVAL AB	25,732	136.10	3,502,125.20	
	ASSA ABLOY AB-B	81,312	174.10	14,156,419.20	
	ATLAS COPCO A	54,420	256.00	13,931,520.00	
	ATLAS COPCO B	29,087	231.60	6,736,549.20	
	SANDVIK AB	87,313	93.45	8,159,399.85	
	SKANSKA B	28,530	199.30	5,686,029.00	
	SKF AB-B	33,479	146.70	4,911,369.30	
	VOLVO B	118,891	97.25	11,562,149.75	
	SECURITAS B	22,844	144.00	3,289,536.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	212.20	3,855,674.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	74.05	2,055,479.90	
	HENNES & MAURITZ B	76,393	249.10	19,029,496.30	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	282.60	1,619,298.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	312.20	4,729,517.80	
	SCA SV CELLULOSA B	49,201	254.30	12,511,814.30	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	164.60	2,608,087.00	
	NORDEA BANK AB	246,611	84.55	20,850,960.05	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	118,857	85.65	10,180,102.05	
	SVENSKA HANDELSBK A	123,917	117.20	14,523,072.40	
	SWEDBANK AB-A	74,009	200.40	14,831,403.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	157.20	2,010,902.40	
	INVESTOR AB-B SHS	35,537	311.90	11,083,990.30	
	KINNEVIK AB - B	18,104	217.40	3,935,809.60	
	ERICSSON (LM) B	248,169	60.60	15,039,041.40	
HEXAGON AB-B SHS	21,517	375.30	8,075,330.10		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	444.00	1,922,076.00		
TELE2 AB-B SHS	21,310	72.95	1,554,564.50		
TELIA CO AB	202,889	38.30	7,770,648.70		

	スウェーデンクローナ 小計	1,856,069		237,185,623.90 (2,794,046,649)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	86,962	134.00	11,652,908.00	
	NORSK HYDRO	106,150	34.81	3,695,081.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	268.40	3,615,348.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	218.60	1,523,860.60	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	238.30	1,428,608.50	
	MARINE HARVEST	32,238	139.90	4,510,096.20	
	ORKLA	60,218	82.45	4,964,974.10	
	DNB ASA	80,217	106.70	8,559,153.90	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	148.10	1,996,536.10	
	TELENOR ASA	60,821	137.40	8,356,805.40	
	ノルウェークローネ 小計	466,523		50,303,372.30 (630,804,288)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	392.00	2,901,192.00	
	NOVOZYMES A/S	17,281	288.40	4,983,840.40	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,462	546.00	9,534,252.00	
	ISS A/S	14,253	273.10	3,892,494.30	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	9,300.00	2,780,700.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,710.00	4,932,680.00	
	DSV A/S	14,580	323.20	4,712,256.00	
	PANDORA A/S	9,443	805.00	7,601,615.00	
	CARLSBERG AS-B	8,005	636.50	5,095,182.50	
	COLOPLAST-B	10,121	514.00	5,202,194.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	135.70	1,006,894.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,128.00	5,089,536.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	153,399	280.00	42,951,720.00	
	DANSKE BANK A/S	54,625	192.80	10,531,700.00	
	TRYG A/S	9,828	133.30	1,310,072.40	
TDC A/S	72,376	39.54	2,861,747.04		
	デンマーククローネ 小計	401,513		115,388,075.64 (1,755,052,630)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	34.11	703,655.19	
	OIL SEARCH LTD	101,778	7.00	712,446.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	131,447	5.36	704,555.92	
	SANTOS	128,132	3.67	470,244.44	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	59,282	28.45	1,686,572.90
ALUMINA LIMITED	170,458	1.46	248,868.68
AMCOR	92,604	15.23	1,410,358.92
BHP BILLITON LTD	256,725	22.40	5,750,640.00
BORAL LIMITED	68,971	6.79	468,313.09
FORTESCUE METALS GROUP LTD	136,041	5.09	692,448.69
INCITEC PIVOT LTD	150,599	2.86	430,713.14
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	20.44	763,699.72
NEWCREST MINING LIMITED	58,258	22.40	1,304,979.20
ORICA LTD	29,211	15.29	446,636.19
RIO TINTO LTD	34,814	51.85	1,805,105.90
SOUTH32 LTD	455,699	2.44	1,111,905.56
CIMIC GROUP LIMITED	9,220	28.98	267,195.60
BRAMBLES LTD	129,297	12.00	1,551,564.00
SEEK LTD	26,358	15.80	416,456.40
AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.67	744,804.29
QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	3.13	106,905.15
TRANSURBAN GROUP	162,664	11.44	1,860,876.16
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	15.93	696,539.25
CROWN RESORTS LTD	30,328	13.07	396,386.96
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	70.85	391,304.55
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	35.95	117,304.85
TABCORP HOLDINGS	62,731	5.06	317,418.86
TATTS GROUP LTD	124,218	3.67	455,880.06
REA GROUP LTD	3,593	57.01	204,836.93
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	5.23	236,202.49
WESFARMERS LTD	89,886	44.15	3,968,466.90
WOOLWORTHS LTD	102,131	23.33	2,382,716.23
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.15	468,219.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	11.04	644,460.00
COCHLEAR LIMITED	5,007	141.35	707,739.45
HEALTHSCOPE LTD	140,279	3.09	433,462.11
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	80.00	861,840.00
SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	22.28	707,991.56
CSL LIMITED	37,071	107.78	3,995,512.38
AUST AND NZ BANKING GROUP	232,866	27.82	6,478,332.12

	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	11.38	277,410.26	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	10.53	328,588.65	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	136,811	73.50	10,055,608.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	210,497	28.14	5,923,385.58	
	WESTPAC BANKING	265,481	29.92	7,943,191.52	
	AMP LTD	244,230	5.28	1,289,534.40	
	ASX LTD	15,814	48.60	768,560.40	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	10.18	448,612.24	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,495	83.28	2,039,943.60	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	5.06	102,348.62	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	202,082	5.50	1,111,451.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.40	514,828.80	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	9.33	1,055,157.69	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	12.35	1,271,074.35	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	10.40	320,496.80	
	TELSTRA CORP	340,642	5.15	1,754,306.30	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.68	273,203.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	41,989	6.28	263,690.92	
	AGL ENERGY LTD	50,606	18.99	961,007.94	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.64	197,778.35	
	オーストラリアドル 小計	5,791,603		84,023,738.26 (6,473,188,795)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	10.77	501,343.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.30	620,135.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.50	345,011.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.54	514,889.46	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.05	297,763.15	
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.04	188,001.34	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.62	289,625.28	
	ニュージーランドドル 小計	544,514		2,756,769.23 (201,519,830)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	216,996	99.70	21,634,501.20	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	13.06	1,292,940.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	10.92	939,120.00	
	MTR CORP	114,000	43.10	4,913,400.00	
	LI & FUNG	378,800	4.04	1,530,352.00	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	29.65	3,528,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	76,000	31.75	2,413,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	29.85	5,253,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	13.68	919,296.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	34.20	6,935,760.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.50	833,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.94	784,080.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	13.16	1,352,848.00	
	WH GROUP LTD	476,500	6.33	3,016,245.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	32.80	2,780,128.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	26.40	7,972,800.00	
	HANG SENG BANK	59,700	140.00	8,358,000.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	5.60	716,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,200	206.80	19,687,360.00	
	AIA GROUP LTD	959,400	52.55	50,416,470.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	207,496	57.35	11,899,895.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.80	3,079,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	94,996	46.95	4,460,062.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	36.95	1,478,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	25.50	981,750.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	507,500	10.22	5,186,650.00	
	SINO LAND CO	235,400	13.80	3,248,520.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,000	118.50	13,983,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	84.50	3,422,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.85	2,198,170.00	
	WHARF HOLDINGS	119,000	56.85	6,765,150.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	46.65	3,032,250.00	
	PCCW LTD	357,000	4.84	1,727,880.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	67.65	3,382,500.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	80.15	10,700,025.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	595,846	14.94	8,901,939.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	77.35	8,585,850.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	63.75	879,750.00	
	香港ドル 小計	6,970,894		239,191,092.24 (3,119,051,842)	
シンガポールド	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.42	608,666.00	

ル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	2.60	148,200.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	1.33	80,997.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.27	356,430.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	0.75	99,750.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	206,400	2.86	590,304.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	10.63	460,629.79	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.74	316,625.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	3.83	486,793.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	43.74	433,026.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.36	150,840.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	155,000	3.22	499,100.00	
	DBS GROUP	139,800	15.48	2,164,104.00	
	OCBC BANK	245,000	8.68	2,126,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	99,600	18.96	1,888,416.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	76,900	7.44	572,136.00	
	CAPITALAND LTD	185,500	3.22	597,310.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	43,900	9.11	399,929.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	1.87	466,875.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	5.68	184,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	628,943	4.02	2,528,350.86	
STARHUB LTD	38,000	3.44	130,720.00		
シンガポールドル 小計		3,597,076		15,290,401.65 (1,131,642,626)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	14.60	478,237.60	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	73,424	179.90	13,208,977.60	
	BANK HAPOLIM BM	80,056	21.26	1,701,990.56	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	14.25	1,650,064.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	47.65	390,730.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	164.50	711,133.50	
	NICE LTD	4,894	250.90	1,227,904.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	7.06	1,092,909.81	
イスラエルシェケル 小計		474,053		20,461,948.17 (551,040,264)	
合 計		89,078,727		235,582,023,301 (235,582,023,301)	

(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	212,805.00	
		アメリカドル 小計		472,900	212,805.00 (21,518,841)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	766,727.76	
		DUET GROUP	177,921	444,802.50	
		LENDLEASE GROUP	44,009	613,045.37	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	629,020.00	
	オーストラリアドル 小計		401,361	2,453,595.63 (189,025,007)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,673,595.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	2,049,520.00	
	香港ドル 小計		407,500	3,723,115.00 (48,549,419)	
投資信託受益証券合計			1,281,761	259,093,267 (259,093,267)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,956	653,909.24	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	27,108	526,166.28	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,719	3,826,432.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	856,868.65	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,614	1,904,151.60	
		BOSTON PROPERTIES	12,348	1,683,155.88	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	691,947.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	601,543.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	26,693	2,509,408.93	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,788	1,253,224.00	
		DUKE REALTY CORP	26,052	716,951.04	
		EQUINIX INC	5,524	1,988,363.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,283	1,886,703.69	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,199	1,173,050.37	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	816,644.64	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,512	856,123.84	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	43,970	1,212,252.90	
HCP INC	37,641	1,450,684.14			

		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	929,422.20	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	773,459.75	
		KIMCO REALTY CORP	32,727	959,228.37	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	479,618.54	
		MACERICH CO/THE	10,128	815,304.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,929	570,073.35	
		PROLOGIS INC	40,917	2,200,925.43	
		PUBLIC STORAGE	11,736	2,640,482.64	
		REALTY INCOME CORP	20,668	1,397,156.80	
		REGENCY CENTERS CORP	7,269	565,964.34	
		SIMON PROPERTY GROUP	24,583	5,102,939.14	
		SL GREEN REALTY CORP	8,067	870,509.97	
		UDR INC	20,960	763,572.80	
		VENTAS INC	27,071	1,946,675.61	
		VEREIT INC	77,798	796,651.52	
		VORNADO REALTY TRUST	13,714	1,392,382.42	
		WELLTOWER INC	28,486	2,159,523.66	
		アメリカドル 小計	827,912	48,971,472.62 (4,951,995,311)	
カナダドル		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	212,832.05	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	420,708.40	
		SMART REAL ESTATE INVWSTMENT	5,631	194,945.22	
		カナダドル 小計	30,576	828,485.67 (63,635,984)	
ユーロ		FONCIERE DES REGIONS	2,310	190,182.30	
		GECINA SA	3,549	492,956.10	
		ICADE	2,845	196,105.85	
		KLEPIERRE	16,799	682,627.36	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	7,841	1,883,016.15	
		ユーロ 小計	33,344	3,444,887.76 (390,512,476)	
イギリスポンド		BRITISH LAND CO PLC	74,136	466,686.12	
		HAMMERSON PLC	61,184	357,620.48	
		INTU PROPERTIES PLC	73,489	215,396.25	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	62,454	652,644.30	

	SEGRO PLC	64,553	288,164.59	
	イギリスポンド 小計	335,816	1,980,511.74 (259,447,037)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	683,850.70	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,023,978.30	
	GPT GROUP	136,015	688,235.90	
	MIRVAC GROUP	306,089	685,639.36	
	SCENTRE GROUP	422,912	2,004,602.88	
	STOCKLAND	182,732	858,840.40	
	VICINITY CENTERS	254,887	802,894.05	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,583,736.21	
	オーストラリアドル 小計	1,678,437	8,331,777.80 (641,880,161)	
香港ドル	LINK REIT	177,000	10,097,850.00	
	香港ドル 小計	177,000	10,097,850.00 (131,675,964)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	489,800.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	231,660.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	434,651.00	
	SUNTEC REIT	173,000	299,290.00	
	シンガポールドル 小計	713,800	1,455,401.00 (107,714,228)	
	投資証券合計	3,796,885	6,546,861,161 (6,546,861,161)	
	合計		6,805,954,428 (6,805,954,428)	

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 590 銘柄	96.8%	—	—	63.1%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	0.0%	—	0.0%

	投資証券 35 銘柄	—	—	3.1%	2.0%
カナダドル	株式 87 銘柄	99.3%	—	—	3.9%
	投資証券 3 銘柄	—	—	0.7%	0.0%
ユーロ	株式 229 銘柄	98.7%	—	—	12.0%
	投資証券 5 銘柄	—	—	1.3%	0.2%
イギリスポンド	株式 107 銘柄	98.6%	—	—	7.6%
	投資証券 5 銘柄	—	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 38 銘柄	100.0%	—	—	3.7%
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 10 銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.7%
オーストラリアドル	株式 60 銘柄	88.6%	—	—	2.7%
	投資信託受 4 銘柄 益証券	—	2.6%	—	0.1%
	投資証券 8 銘柄	—	—	8.8%	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	94.5%	—	—	1.3%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.5%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	4.0%	0.1%
シンガポールドル	株式 22 銘柄	91.3%	—	—	0.5%
	投資証券 4 銘柄	—	—	8.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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 9 月 30 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	171,150,533
コール・ローン	1,246,642,978
国債証券	196,862,511,114
派生商品評価勘定	4,797,978
未収入金	3,873,075
未収利息	1,584,695,944
前払費用	43,715,335
差入委託証拠金	108,656,535
流動資産合計	200,026,043,492
資産合計	200,026,043,492
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,247,115
前受金	3,076,991
未払金	5,165,248
未払解約金	75,723,354
未払利息	3,106
その他未払費用	1,416
流動負債合計	85,217,230
負債合計	85,217,230
純資産の部	
元本等	
元本	80,217,978,572
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	119,722,847,690
元本等合計	199,940,826,262
純資産合計	199,940,826,262
負債純資産合計	200,026,043,492

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 9 月 30 日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成 28 年 9 月 30 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,217,978,572 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 2.4925 円 (1 万口当たり純資産額) (24,925 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 9 月 30 日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> <p>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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成 28 年 9 月 30 日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成 28 年 9 月 30 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 1 日
期首元本額	77,672,917,030 円
期中追加設定元本額	13,899,539,224 円
期中一部解約元本額	11,354,477,682 円
期末元本額	80,217,978,572 円

期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,676,237,350円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,014,376,900円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	702,351,901円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,743,673,919円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,110,763円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,407,715,643円
世界経済インデックスファンド	2,135,955,174円
マイセクション25	6,093,573円
マイセクション50	4,722,968円
マイセクション75	3,075,587円
DCマイセクション25	1,299,268,159円
DCマイセクション50	1,122,568,685円
DCマイセクション75	662,901,426円
DC外国債券インデックス・オープン	1,525,740,971円
DCマイセクションS25	547,100,520円
DCマイセクションS50	435,995,238円
DCマイセクションS75	178,287,529円
DCターゲット・イヤーフンド2025	56,550,490円
DCターゲット・イヤーフンド2035	46,275,001円
DCターゲット・イヤーフンド2045	18,443,784円
DC世界経済インデックスファンド	2,675,265,196円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	472,871,630円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	168,638,458円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,576,336円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,298,982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）	93,116,677円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	280,081,094円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	417,968,422円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	361,821,666円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	761,764,577円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,448,747,291円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	904,421,468円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,904,273,747円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,292,921,720円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,303,264,258円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	936,797,445円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,143,280,016円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	330,203,613円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	468,371,697円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,562,877,127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）	919,291,877円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	589,059,567円
外国債券ファンド・シリーズ1	496,971,188円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,752,327,838円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,771,052,503円
分散投資コア戦略ファンドA	877,088,078円
分散投資コア戦略ファンドS	1,521,321,513円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	66,199,935円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	843,137,450円
コア投資戦略ファンド（切替型）	622,986,743円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	168,188,153円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	97,716,422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）	528,315,711円
SMT インデックスバランス・オープン	213,932,937円
外国債券SMTBセクション（SMA専用）	21,874,132,513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)	943,716,276 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)	793,532,867 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 9 月 30 日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,384,838,206
合計		4,384,838,206

(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 9 月 30 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	964,414,566	—	967,491,557	3,076,991
合計		964,414,566	—	967,491,557	3,076,991

(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 9 月 30 日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	1,214,442,428	—	1,214,916,300	473,872
	アメリカドル	576,040,590	—	576,995,500	954,910
	カナダドル	56,348,524	—	56,034,800	△313,724
	ユーロ	468,631,404	—	469,269,000	637,596
	イギリスポンド	113,421,910	—	112,617,000	△804,910
合計		1,214,442,428	—	1,214,916,300	473,872

(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。

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 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,988,679.00	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	7,000,174.93	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	999,849.23	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,998,357.85	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,403,223.00	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	3,001,980.81	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,902,514.59	
		T 0.875% 01/15/18	5,200,000.00	5,213,545.16	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,514,271.95	
		T 0.875% 07/15/18	10,000,000.00	10,023,049.30	
		T 0.875% 07/31/19	5,500,000.00	5,506,402.88	
		T 0.875% 10/15/17	6,200,000.00	6,214,585.19	
		T 0.875% 10/15/18	4,000,000.00	4,008,982.92	
		T 0.875% 11/15/17	1,500,000.00	1,503,555.78	
		T 1.125% 01/15/19	5,800,000.00	5,843,098.52	
		T 1.125% 04/30/20	4,000,000.00	4,022,524.20	
		T 1.125% 06/15/18	3,000,000.00	3,019,887.69	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,805,664.00	
		T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,070,690.86	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	909,443.28	
		T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,609,253.90	
		T 1.25% 02/29/20	3,400,000.00	3,435,223.25	
		T 1.25% 03/31/21	10,000,000.00	10,070,055.50	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,515,429.14	
T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,562,701.40			
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,561,853.16			
T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,614,777.20			

T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	5,071,779.60	
T 1.375% 01/31/21	4,800,000.00	4,860,707.04	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,128,500.78	
T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	5,072,214.80	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,950,712.12	
T 1.375% 04/30/20	10,000,000.00	10,144,162.60	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,571,651.90	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,224,271.78	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,005,667.95	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,946,707.02	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	4,053,601.20	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	6,079,205.58	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,038,858.34	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,032,259.66	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,568,513.31	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,032,915.14	
T 1.5% 02/28/23	2,400,000.00	2,425,703.40	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,475,594.15	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,040,596.76	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,141,141.44	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,882,258.21	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,615,974.30	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,092,543.60	
T 1.5% 12/31/18	11,500,000.00	11,679,955.22	
T 1.625% 02/15/26	5,500,000.00	5,533,104.17	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,059,669.79	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,102,323.70	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,317,427.29	
T 1.625% 06/30/20	3,000,000.00	3,069,141.87	
T 1.625% 07/31/20	5,000,000.00	5,115,922.55	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,592,327.94	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,664,626.20	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,289,385.17	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,748,225.25	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,570,717.02	
T 1.75% 03/31/22	7,000,000.00	7,196,421.12	

T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,910,961.36	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,905,022.08	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	7,177,614.36	
T 1.75% 09/30/22	2,000,000.00	2,054,648.22	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,111,961.56	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,366,814.90	
T 1.875% 08/31/17	5,200,000.00	5,258,857.86	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,138,100.16	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	860,453.64	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,532,807.37	
T 1.875% 10/31/22	3,150,000.00	3,257,811.52	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,588,415.34	
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,812,381.34	
T 1% 05/15/18	5,550,000.00	5,574,791.40	
T 1% 05/31/18	5,000,000.00	5,022,867.85	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	9,043,262.91	
T 1% 08/31/19	7,500,000.00	7,531,426.35	
T 1% 09/15/18	5,200,000.00	5,223,922.65	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	4,015,891.48	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,319,316.11	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,132,138.45	
T 2.125% 05/15/25	12,450,000.00	13,067,313.95	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,845,443.32	
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,669,571.15	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,381,978.96	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,772,245.02	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,093,768.60	
T 2.125% 12/31/21	4,500,000.00	4,713,579.49	
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,203,309.13	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,678,047.10	
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,445,531.05	
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,156,674.73	
T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,635,306.42	
T 2.25% 11/15/25	2,900,000.00	3,073,709.15	
T 2.25% 11/30/17	5,000,000.00	5,091,868.55	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,108,893.80	

T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	9,086,937.66	
T 2.375% 12/31/20	2,300,000.00	2,424,335.26	
T 2.5% 02/15/45	6,300,000.00	6,589,751.11	
T 2.5% 02/15/46	8,700,000.00	9,101,543.97	
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	9,055,164.80	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,890,113.13	
T 2.625% 01/31/18	8,000,000.00	8,205,206.48	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,150,252.45	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,834,746.77	
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,126,894.38	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,812,505.69	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,284,422.89	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,909,771.96	
T 2.75% 08/15/42	2,000,000.00	2,205,757.16	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,543,145.96	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,627,468.81	
T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,333,836.87	
T 2.875% 03/31/18	5,250,000.00	5,419,003.84	
T 2.875% 05/15/43	10,300,000.00	11,604,557.00	
T 2.875% 08/15/45	8,400,000.00	9,467,067.79	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,604,107.15	
T 2% 02/15/23	2,600,000.00	2,708,127.34	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,731,122.12	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,155,675.84	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,952,005.54	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,392,274.16	
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,124,936.53	
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,780,415.86	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	7,077,038.25	
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,187,997.55	
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,454,058.82	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,498,602.15	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,710,422.96	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,083,113.08	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,178,785.42	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,299,516.25	

T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,778,379.32	
T 3.125% 08/15/44	6,500,000.00	7,675,277.02	
T 3.125% 11/15/41	4,800,000.00	5,650,348.80	
T 3.375% 05/15/44	5,610,000.00	6,924,417.77	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	5,917,927.58	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,503,015.36	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,095,577.51	
T 3.625% 02/15/44	5,000,000.00	6,441,208.75	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,913,323.94	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,576,139.34	
T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	4,157,202.81	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,314,185.65	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	3,028,637.81	
T 3.875% 08/15/40	2,700,000.00	3,560,093.34	
T 3% 05/15/42	3,950,000.00	4,555,539.46	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,037,341.38	
T 3% 11/15/44	6,300,000.00	7,268,090.63	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,246,594.59	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,652,496.94	
T 4.25% 11/15/40	1,450,000.00	2,017,674.59	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,408,815.54	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,682,701.16	
T 4.375% 05/15/41	1,500,000.00	2,129,471.68	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,803,884.76	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,613,020.89	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,433,372.09	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	357,969.26	
T 4.625% 02/15/40	3,900,000.00	5,685,479.55	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,663,179.10	
T 5.25% 02/15/29	400,000.00	559,128.14	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,809,583.41	
T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,348,436.06	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,695,827.29	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,365,270.23	
T 6.125% 11/15/27	950,000.00	1,385,872.08	
T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,707,468.69	

	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,183,275.39	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,279,159.67	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,534,419.77	
	アメリカドル 小計	792,320,000.00	837,061,760.34 (84,643,685,205)	
カナダドル	CAN 0.25% 05/01/18	900,000.00	896,539.50	
	CAN 0.75% 03/01/21	1,250,000.00	1,261,700.00	
	CAN 0.75% 09/01/20	1,700,000.00	1,716,167.00	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,730,000.00	1,745,388.35	
	CAN 1.25% 02/01/18	2,000,000.00	2,019,820.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	3,100,000.00	3,132,906.50	
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	507,370.00	
	CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,499,343.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,550,000.00	1,629,817.25	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,480,000.00	1,555,265.40	
	CAN 1.5% 09/01/17	2,800,000.00	2,825,214.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,442,714.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	1,350,000.00	1,399,315.50	
	CAN 1% 06/01/27	270,000.00	268,563.60	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,731,497.25	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,918,968.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,550,000.00	1,732,915.50	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,200,000.00	1,539,438.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	420,000.00	584,035.20	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,690,000.00	1,901,511.95	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,800,000.00	1,995,120.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,810,000.00	2,596,390.70	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,200,000.00	3,476,880.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,970,000.00	2,913,767.90	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,100,000.00	2,230,410.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,370,918.75	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,560,000.00	2,542,542.60	
CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,556,280.00		
CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	611,703.00		
	カナダドル 小計	45,540,000.00	52,602,503.95 (4,040,398,328)	

メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,739,640.00	
	MBONO 10% 12/05/24	22,700,000.00	28,701,653.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	20,949,815.25	
	MBONO 5% 12/11/19	12,300,000.00	12,064,885.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	12,175,063.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	37,300,000.00	38,383,192.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	16,230,564.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	21,600,000.00	24,446,772.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	11,300,000.00	13,067,489.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	1,500,000.00	1,706,265.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	25,700,000.00	26,540,133.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	18,656,196.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	20,351,595.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	19,600,000.00	20,817,258.00	
	MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	15,615,847.50	
	MBONO 8% 12/07/23	27,600,000.00	31,012,326.00	
	メキシコペソ 小計	285,850,000.00	317,458,694.75	(1,638,086,864)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,570,000.00	1,683,000.75	
	BGB 1.25% 06/22/18	980,000.00	1,012,197.90	
	BGB 1.6% 06/22/47	460,000.00	524,110.20	
	BGB 1.9% 06/22/38	710,000.00	866,377.50	
	BGB 1% 06/22/26	1,550,000.00	1,679,975.25	
	BGB 1% 06/22/31	1,200,000.00	1,284,450.00	
	BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	444,291.75	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,660,000.00	1,952,948.50	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,605,664.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,010,000.00	1,722,196.45	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,936,075.00	
	BGB 3% 06/22/34	1,000,000.00	1,404,195.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,230,000.00	1,363,178.25	
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,897,863.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	3,329,055.45	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,300,000.00	2,851,551.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,250,000.00	2,890,462.50	
BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,212,152.25		

BGB 4% 03/28/18	550,000.00	588,161.75	
BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,386,539.85	
BGB 4% 03/28/32	1,030,000.00	1,572,392.85	
BGB 5.5% 03/28/28	2,000,000.00	3,207,430.00	
BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,015,909.50	
BGB 5% 03/28/35	2,020,000.00	3,576,773.60	
BTPS 0.1% 04/15/19	1,000,000.00	1,002,635.00	
BTPS 0.3% 10/15/18	1,000,000.00	1,007,495.00	
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,411,725.00	
BTPS 0.65% 11/01/20	1,500,000.00	1,532,175.00	
BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,630,134.00	
BTPS 0.95% 03/15/23	1,500,000.00	1,531,380.00	
BTPS 1.05% 12/01/19	1,200,000.00	1,239,210.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	550,000.00	549,274.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	3,250,000.00	3,411,898.75	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,000,000.00	1,055,475.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,600,000.00	1,661,240.00	
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,501,760.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,600,000.00	1,657,288.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,300,000.00	2,330,026.50	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,730,462.50	
BTPS 2.25% 09/01/36	950,000.00	1,013,754.50	
BTPS 2.5% 05/01/19	2,500,000.00	2,660,975.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,744,980.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,470,000.00	1,617,521.85	
BTPS 2% 12/01/25	1,450,000.00	1,559,786.75	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,550,000.00	1,901,633.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,460,000.00	3,061,543.80	
BTPS 3.5% 06/01/18	1,600,000.00	1,695,528.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	4,000,000.00	4,159,520.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,447,504.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,436,043.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,796,837.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,667,640.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	4,009,236.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,179,810.00	

BTPS 4.25% 03/01/20	4,500,000.00	5,143,387.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,977,818.25	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,548,032.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,893,927.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	2,650,000.00	2,940,307.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,950,000.00	3,728,623.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,632,146.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,560,870.25	
BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	1,950,840.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,652,892.25	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,921,388.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,762,192.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,800,000.00	2,768,391.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	4,127,931.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,550,000.00	4,090,097.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,200,000.00	3,388,968.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,300,000.00	4,791,534.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	4,392,749.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	1,950,000.00	2,527,609.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	3,248,184.00	
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,800,687.50	
BTPS 5% 03/01/25	3,950,000.00	5,222,848.00	
BTPS 5% 08/01/34	2,650,000.00	3,954,396.25	
BTPS 5% 09/01/40	2,550,000.00	3,946,176.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	1,770,000.00	2,711,330.25	
BTPS 6% 05/01/31	4,350,000.00	6,867,845.25	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,200,100.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,255,612.00	
DBR 0.5% 02/15/25	2,400,000.00	2,569,500.00	
DBR 0.5% 02/15/26	2,480,000.00	2,641,968.80	
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	3,108,531.25	
DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,212,216.50	
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,893,279.40	
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,628,734.25	
DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,457,302.75	
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,065,836.50	

	DBR 1% 08/15/24	1,680,000.00	1,866,379.20	
	DBR 1% 08/15/25	3,000,000.00	3,342,015.00	
	DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,794,037.50	
	DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,287,160.00	
	DBR 2.5% 01/04/21	3,600,000.00	4,093,092.00	
	DBR 2.5% 07/04/44	2,000,000.00	3,093,190.00	
	DBR 2.5% 08/15/46	2,100,000.00	3,302,334.00	
	DBR 2% 01/04/22	3,150,000.00	3,583,833.75	
	DBR 2% 08/15/23	2,600,000.00	3,051,230.00	
	DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,315,559.00	
	DBR 3.25% 07/04/21	2,250,000.00	2,673,821.25	
	DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	3,234,769.00	
	DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,910,445.00	
	DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,571,764.50	
	DBR 3% 07/04/20	3,500,000.00	3,991,750.00	
	DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,807,807.50	
	DBR 4.0% 01/04/37	2,700,000.00	4,706,248.50	
	DBR 4.25% 07/04/18	4,550,000.00	4,948,056.75	
	DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	3,079,271.25	
	DBR 4.75% 07/04/28	1,740,000.00	2,741,239.50	
	DBR 4.75% 07/04/34	2,450,000.00	4,431,021.00	
	DBR 4.75% 07/04/40	2,000,000.00	4,020,010.00	
	DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,918,904.00	
	DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,565,203.50	
	DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,395,456.00	
	DBR 6.25% 01/04/30	1,050,000.00	1,937,150.25	
	DBR 6.5% 07/04/27	1,200,000.00	2,068,968.00	
	FRTR 0.25% 11/25/20	3,500,000.00	3,609,847.50	
	FRTR 0.5% 05/25/25	4,200,000.00	4,391,310.00	
	FRTR 0.5% 05/25/26	3,400,000.00	3,523,998.00	
	FRTR 0.5% 11/25/19	3,350,000.00	3,464,972.00	
	FRTR 1.25% 05/25/36	1,100,000.00	1,199,000.00	
	FRTR 1.5% 05/25/31	2,500,000.00	2,860,762.50	
	FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,276,022.40	
	FRTR 1.75% 05/25/66	450,000.00	523,424.25	
	FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,685,536.00	

	FRTR 1% 05/25/18	4,750,000.00	4,878,321.25	
	FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,389,945.00	
	FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,589,025.00	
	FRTR 1% 11/25/25	3,700,000.00	4,025,008.00	
	FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	5,226,672.00	
	FRTR 2.25% 10/25/22	4,100,000.00	4,756,902.00	
	FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,480,017.50	
	FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	6,127,407.75	
	FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	5,239,000.50	
	FRTR 3.25% 05/25/45	2,450,000.00	3,837,386.00	
	FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,183,580.00	
	FRTR 3.5% 04/25/20	6,050,000.00	6,934,358.75	
	FRTR 3.5% 04/25/26	4,230,000.00	5,620,401.00	
	FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000.00	5,619,155.50	
	FRTR 3.75% 10/25/19	4,930,000.00	5,590,767.90	
	FRTR 3% 04/25/22	4,700,000.00	5,602,494.00	
	FRTR 4.25% 04/25/19	5,100,000.00	5,741,223.00	
	FRTR 4.25% 10/25/17	3,450,000.00	3,630,469.50	
	FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,295,440.50	
	FRTR 4.25% 10/25/23	5,150,000.00	6,817,673.00	
	FRTR 4.5% 04/25/41	3,320,000.00	6,007,042.00	
	FRTR 4.75% 04/25/35	2,950,000.00	5,076,905.75	
	FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,805,852.80	
	FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	3,315,725.00	
	FRTR 4% 04/25/60	1,430,000.00	2,801,913.40	
	FRTR 4% 10/25/38	3,250,000.00	5,371,470.00	
	FRTR 5.5% 04/25/29	3,750,000.00	6,172,743.75	
	FRTR 5.75% 10/25/32	3,750,000.00	6,794,643.75	
	FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,711,984.00	
	FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,586,145.00	
	FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,434,630.40	
	IRISH 0.8% 03/15/22	1,000,000.00	1,058,080.00	
	IRISH 1% 05/15/26	770,000.00	819,472.50	
	IRISH 2.4% 05/15/30	800,000.00	980,288.00	
	IRISH 2% 02/18/45	670,000.00	804,897.80	
	IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,123,501.50	

IRISH 3.9% 03/20/23	750,000.00	946,777.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,245,546.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,950,000.00	2,293,131.75	
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	980,530.80	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,500,000.00	2,148,360.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	800,000.00	849,856.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	896,085.00	
NETHER 0.25% 01/15/20	1,900,000.00	1,957,237.50	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,690,000.00	1,745,406.65	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,410,000.00	1,478,800.95	
NETHER 1.25% 01/15/18	2,050,000.00	2,101,188.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	2,700,000.00	2,818,260.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,294,430.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,300,000.00	2,669,311.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,510,000.00	2,061,353.85	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,250,000.00	2,030,381.25	
NETHER 2% 07/15/24	1,500,000.00	1,766,520.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	1,850,000.00	2,191,593.25	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,259,777.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,320,000.00	1,674,862.20	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,920,000.00	3,454,972.80	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,350,000.00	2,546,965.25	
NETHER 4% 01/15/37	1,630,000.00	2,809,899.95	
NETHER 4% 07/15/19	1,800,000.00	2,035,629.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,579,274.15	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	301,825.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,130,355.50	
OBL 0.25% 10/11/19	1,150,000.00	1,183,810.00	
OBL 0.25% 10/16/20	2,400,000.00	2,491,152.00	
OBL 0.5% 02/23/18	4,900,000.00	4,981,903.50	
OBL 0.5% 04/12/19	1,440,000.00	1,484,193.60	
OBL 0.5% 10/13/17	2,750,000.00	2,783,893.75	
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,224,916.75	
RAGB 0.25% 10/18/19	1,050,000.00	1,077,373.50	
RAGB 0.75% 10/20/26	700,000.00	745,951.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	750,000.00	835,968.75	

	RAGB 1.65% 10/21/24	1,080,000.00	1,239,462.00	
	RAGB 1.75% 10/20/23	1,750,000.00	2,010,496.25	
	RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	855,716.00	
	RAGB 2.4% 05/23/34	740,000.00	984,392.40	
	RAGB 3.15% 06/20/44	820,000.00	1,325,558.70	
	RAGB 3.4% 11/22/22	1,200,000.00	1,483,596.00	
	RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,125,000.05	
	RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,352,758.00	
	RAGB 3.8% 01/26/62	450,000.00	920,992.50	
	RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,696,833.50	
	RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,467,755.00	
	RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,465,856.00	
	RAGB 4.35% 03/15/19	1,950,000.00	2,188,758.00	
	RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,442,448.00	
	RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,394,595.25	
	RAGB 6.25% 07/15/27	1,060,000.00	1,768,922.70	
	RFGB 0.375% 09/15/20	630,000.00	653,436.00	
	RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	491,441.40	
	RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	533,877.50	
	RFGB 0.875% 09/15/25	550,000.00	595,696.75	
	RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	569,349.00	
	RFGB 1.5% 04/15/23	560,000.00	628,308.80	
	RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	663,398.95	
	RFGB 2.625% 07/04/42	500,000.00	752,100.00	
	RFGB 2.75% 07/04/28	640,000.00	839,184.00	
	RFGB 2% 04/15/24	570,000.00	667,250.55	
	RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	684,768.00	
	RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	829,213.00	
	RFGB 3.875% 09/15/17	570,000.00	594,649.65	
	RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,196,228.25	
	RFGB 4% 07/04/25	800,000.00	1,091,668.00	
	SPGB 0.25% 01/31/19	140,000.00	141,272.60	
	SPGB 0.25% 04/30/18	3,200,000.00	3,223,488.00	
	SPGB 0.5% 10/31/17	2,230,000.00	2,248,297.15	
	SPGB 0.75% 07/30/21	800,000.00	826,700.00	
	SPGB 1.15% 07/30/20	1,350,000.00	1,410,804.00	

	SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,935,842.00	
	SPGB 1.6% 04/30/25	2,300,000.00	2,462,886.00	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,350,000.00	2,572,028.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	1,800,000.00	1,953,189.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,450,000.00	2,727,707.50	
	SPGB 2.75% 04/30/19	2,250,000.00	2,416,905.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	2,950,000.00	3,429,360.25	
	SPGB 2.9% 10/31/46	900,000.00	1,078,335.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	380,000.00	478,733.50	
	SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,515,486.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,463,096.00	
	SPGB 4.1% 07/30/18	2,730,000.00	2,944,932.90	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	3,023,790.00	
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,348,014.00	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,150,000.00	1,466,537.50	
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	3,008,007.00	
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,030,000.00	3,432,126.45	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	3,449,693.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,665,149.50	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,989,766.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,576,603.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,970,000.00	3,142,632.65	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,433,860.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,400,000.00	4,921,466.00	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,400,000.00	2,367,519.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,700,000.00	3,562,960.50	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,000,000.00	3,750,585.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,270,000.00	3,682,121.60	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,649,674.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,458,940.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,329,822.50	
	ユーロ 小計	571,540,000.00	707,191,367.45 (80,167,213,414)	
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	350,000.00	353,449.25	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,780,000.00	3,860,476.20	
	UKT 1.5% 01/22/21	3,430,000.00	3,621,171.05	

UKT 1.5% 07/22/26	1,700,000.00	1,825,171.00	
UKT 1.75% 07/22/19	3,550,000.00	3,716,051.25	
UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	3,093,361.50	
UKT 1% 09/07/17	3,550,000.00	3,580,388.00	
UKT 2.25% 09/07/23	2,800,000.00	3,157,728.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,250,000.00	1,778,856.25	
UKT 2.75% 09/07/24	2,900,000.00	3,407,471.00	
UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,532,138.50	
UKT 2% 09/07/25	2,190,000.00	2,452,865.70	
UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	4,084,055.50	
UKT 3.5% 01/22/45	3,000,000.00	4,439,145.00	
UKT 3.5% 07/22/68	2,250,000.00	4,083,918.75	
UKT 3.75% 07/22/52	2,000,000.00	3,351,080.00	
UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	609,853.75	
UKT 3.75% 09/07/20	2,500,000.00	2,859,262.50	
UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,348,850.00	
UKT 4.25% 03/07/36	2,650,000.00	3,997,737.00	
UKT 4.25% 06/07/32	2,400,000.00	3,481,608.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,870,000.00	2,918,957.80	
UKT 4.25% 12/07/27	1,440,000.00	1,967,608.80	
UKT 4.25% 12/07/40	2,080,000.00	3,308,864.00	
UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	3,568,131.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,690,000.00	2,972,684.65	
UKT 4.25% 12/07/55	1,920,000.00	3,627,206.40	
UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,551,033.50	
UKT 4.5% 09/07/34	2,770,000.00	4,225,371.85	
UKT 4.5% 12/07/42	2,300,000.00	3,852,753.00	
UKT 4.75% 03/07/20	3,900,000.00	4,526,886.00	
UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	3,443,272.50	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,134,221.00	
UKT 4% 01/22/60	1,750,000.00	3,306,275.00	
UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,469,481.25	
UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	1,928,232.00	
UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,593,110.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,990,975.00	
UKT 8% 06/07/21	1,250,000.00	1,705,568.75	

	イギリスポンド 小計	88,470,000.00	117,725,271.20 (15,422,010,527)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	400,000.00	448,916.00	
	SWISS 2% 04/28/21	540,000.00	612,411.30	
	SWISS 3% 01/08/18	1,210,000.00	1,272,774.80	
	SWISS 4% 02/11/23	1,060,000.00	1,389,516.90	
	SWISS 4% 04/08/28	530,000.00	808,446.10	
	スイスフラン 小計	3,740,000.00	4,532,065.10 (474,144,650)	
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,600,000.00	10,783,296.00	
	SGB 1% 11/12/26	6,500,000.00	7,039,240.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,600,000.00	9,278,612.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,470,000.00	8,222,367.25	
	SGB 3.5% 06/01/22	11,000,000.00	13,431,935.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	10,750,000.00	12,057,898.75	
	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	14,809,860.00	
	スウェーデンクローナ 小計	62,920,000.00	75,623,209.00 (890,841,402)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	4,270,000.00	4,387,873.35	
	NGB 1.75% 03/13/25	3,250,000.00	3,413,052.50	
	NGB 2% 05/24/23	7,040,000.00	7,486,969.60	
	NGB 3.75% 05/25/21	9,170,000.00	10,364,117.40	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,316,538.25	
	NGB 4.5% 05/22/19	8,450,000.00	9,284,184.00	
	ノルウェークローネ 小計	37,730,000.00	41,252,735.10 (517,309,298)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/18	5,050,000.00	5,141,329.25	
	DGB 1.5% 11/15/23	5,800,000.00	6,513,371.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,250,000.00	9,587,985.00	
	DGB 3% 11/15/21	11,450,000.00	13,476,134.75	
	DGB 4.5% 11/15/39	15,180,000.00	28,586,292.90	
	DGB 4% 11/15/17	5,900,000.00	6,207,124.50	
	DGB 4% 11/15/19	11,450,000.00	13,100,517.50	
	DGB 7% 11/10/24	5,000,000.00	7,952,425.00	
	デンマーククローネ 小計	68,080,000.00	90,565,179.90 (1,377,496,386)	

ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	2,600,000.00	2,550,587.00	
	POLGB 1.75% 07/25/21	1,400,000.00	1,363,138.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	5,200,000.00	5,275,920.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	3,044,049.75	
	POLGB 2% 04/25/21	3,500,000.00	3,464,352.50	
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,905,924.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,260,000.00	3,366,194.50	
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,857,987.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,650,000.00	3,967,860.25	
	POLGB 5.25% 10/25/17	2,800,000.00	2,908,472.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,530,000.00	2,832,967.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,875,327.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,778,140.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,415,084.10	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,950,000.00	3,425,009.00	
ポーランドズロチ 小計		42,530,000.00	45,031,012.60 (1,185,666,561)	
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	2,200,000.00	2,211,440.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,130,000.00	1,149,379.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	3,122,397.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	750,000.00	775,376.25	
	ACGB 2.75% 10/21/19	2,150,000.00	2,225,196.25	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,200,000.00	1,284,690.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,200,000.00	3,536,112.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,883,221.20	
	ACGB 3.25% 06/21/39	610,000.00	668,322.10	
	ACGB 3.25% 10/21/18	2,050,000.00	2,118,982.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,100,000.00	1,303,115.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,560,000.00	4,274,171.60	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,020,000.00	3,321,984.90	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,300,000.00	1,683,045.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	3,350,000.00	4,228,118.75	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,000,000.00	3,265,080.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,770,000.00	2,909,054.00	
ACGB 5.5% 04/21/23	2,650,000.00	3,253,166.50		
ACGB 5.75% 05/15/21	2,850,000.00	3,367,189.50		

	ACGB 5.75% 07/15/22	2,570,000.00	3,135,361.45	
	オーストラリアドル 小計	44,080,000.00	49,715,404.10 (3,830,074,731)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	596,625.00	
	SIGB 1.375% 10/01/17	340,000.00	341,861.50	
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	111,602.15	
	SIGB 2.125% 06/01/26	250,000.00	255,788.75	
	SIGB 2.25% 06/01/21	570,000.00	593,164.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	270,000.00	281,896.20	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	933,826.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	210,000.00	234,083.85	
	SIGB 2.75% 04/01/42	590,000.00	652,424.95	
	SIGB 2.75% 07/01/23	560,000.00	598,953.60	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	218,377.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	327,031.50	
	SIGB 2% 07/01/20	400,000.00	411,190.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	720,000.00	784,483.20	
	SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	1,001,340.30	
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	466,722.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	814,575.90	
SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	839,438.60		
SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	666,552.60		
	シンガポールドル 小計	9,460,000.00	10,129,938.40 (749,716,740)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	2,700,000.00	2,727,418.50	
	MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	1,009,015.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,498,587.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,050,000.00	2,051,250.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	2,000,000.00	2,021,870.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	775,788.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,189,452.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,631,248.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,281,319.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,150,000.00	1,105,144.25	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,536,090.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,138,768.80	

	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	552,673.80	
	MGS 4.012% 09/15/17	1,000,000.00	1,014,670.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	1,700,000.00	1,761,531.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,300,000.00	1,303,438.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,715,562.75	
	MGS 4.181% 07/15/24	3,000,000.00	3,121,860.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	1,150,000.00	1,175,834.75	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,706,483.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,800,000.00	1,899,945.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	528,335.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,350,000.00	1,433,693.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,350,000.00	1,521,126.00	
	マレーシアリングット 小計	37,820,000.00	38,701,105.60 (944,693,987)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	23,100,000.00	25,940,260.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	9,620,000.00	7,065,841.90	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,850,000.00	6,472,845.75	
	SAGB 6.75% 03/31/21	8,020,000.00	7,633,275.60	
	SAGB 7.25% 01/15/20	6,400,000.00	6,286,208.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,850,000.00	6,657,617.75	
	SAGB 7% 02/28/31	16,300,000.00	13,638,047.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	7,400,000.00	6,858,431.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,245,198.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	10,450,000.00	9,675,968.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	7,350,000.00	6,885,333.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	14,950,000.00	14,052,925.25	
	SAGB 8.875% 02/28/35	6,600,000.00	6,381,771.00	
	SAGB 8% 01/31/30	3,200,000.00	2,946,816.00	
	SAGB 8% 12/21/18	5,750,000.00	5,788,553.75	
SAGB 9% 01/31/40	3,100,000.00	2,992,042.50		
	南アフリカランド 小計	144,140,000.00	135,521,135.50 (981,173,021)	
	合計		196,862,511,114 (196,862,511,114)	

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 174 銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 29 銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 265 銘柄	100.0%	40.7%
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%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6 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%
マレーシアリングgit	国債証券 24 銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 16 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。

2【ファンドの現況】

【DCマイセレクション75】

【純資産額計算書】

(平成28年10月31日現在)

I 資産総額	37,693,272,606円
II 負債総額	41,238,689円
III 純資産総額 (I - II)	37,652,033,917円
IV 発行済口数	20,922,371,234口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.7996円
(1万口当たり純資産額)	(17,996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10月31日現在)

I 資産総額	158,947,089,310円
II 負債総額	3,213,553,237円
III 純資産総額 (I - II)	155,733,536,073円
IV 発行済口数	128,604,655,386口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2109円
(1万口当たり純資産額)	(12,109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10月31日現在)

I 資産総額	318,687,690,158円
II 負債総額	2,736,552,282円
III 純資産総額 (I - II)	315,951,137,876円
IV 発行済口数	225,576,772,524口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.4006円
(1万口当たり純資産額)	(14,006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 10 月 31 日現在)

I 資産総額	268,781,103,847円
II 負債総額	189,664,391円
III 純資産総額 (I - II)	268,591,439,456円
IV 発行済口数	148,136,236,334口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.8131円
(1万口当たり純資産額)	(18,131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 10 月 31 日現在)

I 資産総額	185,389,300,005円
II 負債総額	65,278,600円
III 純資産総額 (I - II)	185,324,021,405円
IV 発行済口数	74,214,178,994口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.4972円
(1万口当たり純資産額)	(24,972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）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10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

会社に取り締役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發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役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、ファンドマネー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ージャーは、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12月28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10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	468	8,303,126
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	42	200,569
単位型公社債投資信託	0	0
合計	510	8,503,695

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 公認会計士 白川 芳樹
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成 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. XBR L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		当事業年度	
	(自 平成 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 年 3 月 31 日)		(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		当事業年度	
	(自 平成 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 年 3 月 31 日)		(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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		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
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
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・リアルコース)	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) 通常の見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

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託会社は、平成 28 年 6 月 30 日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成 28 年 12 月 28 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
DC マイセレクション 75
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

約款第 18 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、確定拠出年金法（平成 13 年法律第 88 号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざ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 マザーファンドの受益証券、国内債券インデックス マザーファンドの受益証券、外国株式インデックス マザーファンドの受益証券、および外国債券インデックス マザーファンドの受益証券（以下、それぞれを総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）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して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- ②基準ポートフォリオは、国内株式 50%、国内債券 17%、外国株式 25%、外国債券 5%および短期金融資産 3%の比率で基準配分します。
- ③各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは 1 年に 1 回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- ④実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- ⑤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。また、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およ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および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）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ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。）を行うことができます。
- ⑦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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 運用制限

- ①株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 85%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。

- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。
- ⑥マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 40%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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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。

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) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

(3) 留保益の運用方針

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
DC マイセレクション 75
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

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、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および限度額)

第3条 委託者は、当初設定日に金100,000円を信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③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4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第53条第1項、同条第2項、第54条第1項、第55条第1項および第57条第2項の規定による信託終了の日までとします。

(受益権の分割および再分割)

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権については100,000口に、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8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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

(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。

②受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条第1項に規定される契約に基づいて受益権の取得申込みを企図する者および同法第55条に規定される規約に基づいて受益権の取得申込みを企図する同法第2条第5項に定める連合会（同法第61条に基づき連合会が事務を委託した者を含みます。）に対してのみ行うものとします。

(受益者)

第7条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第86条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②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5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。

③受益権取得申込者は、指定販売会社（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およ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。) と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約(以下「別に定める契約」といいます。)を締結するものとします。

(追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第 8 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て得た金額とします。

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および第 28 条に規定する借入有価証券を除きます。)を法令およ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。なお、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、わが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③第 31 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 9 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 10 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。)およ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または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載また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また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、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 5 条第 1 項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また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または記録を行います。

④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成 18 年 12 月 29 日現在のすべての受益権(受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成 19 年 1 月 4 日以降となるものを含まず。)を受益者を代理して平成 19 年 1

月 4 日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、指定販売会社に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 受託者は、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、価額および手数料)

第 12 条 指定販売会社は、第 5 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ては、1 口の整数倍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指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込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または記録を行うことができます。

③第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（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の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料およ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。

④前項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑤前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、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取得価額は、原則として、第 42 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥前各項の規定にかかわらず、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およ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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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または記録)

第 12 条の 2 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また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およ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また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また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また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またはやむをえ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 13 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または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第 14 条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第 15 条 (削除)

(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 23 条、第 24 条および第 25 条に定めるものに限り。）
 - 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、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 4 号までの三井住友トラスト・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（以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第 5 号から第 26 号までの有価証券（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. 国内株式インデックス マザーファンド
2. 国内債券インデックス マザーファンド
3. 外国株式インデックス マザーファンド
4. 外国債券インデックス マザーファンド
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 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。）
10. 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。）

11. 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。)
 12. 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。)
 13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券また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。)
 14. コマーシャル・ペーパー
 15. 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。)および新株予約権証券
 16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 17. 証券投資信託または外国証券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。)
 18. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(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。)
 19. 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。)
 20. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
 21. 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。)
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 23. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
 24. 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。)
 25. 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
 26. 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 5 号の証券または証書、第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 5 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 6 号から第 10 号までの証券および第 16 号ならびに第 21 号の証券または証書のうち第 6 号から第 10 号までの証券の性質を有するもの、および第 18 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 17 号および第 18 号の証券(「投資法人債券」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、信託金を前項第1号から第4号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85を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の85を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
- ⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額と、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委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券およ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新株引受権証券およ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10を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑦前3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の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株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(運用の基本方針)

第18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19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券およ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、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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。

(同一銘柄の株式等への投資制限)

第20条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該株式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10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券およ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当該新株引受権証券および当該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5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ③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

の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株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第 21 条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債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 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②前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転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第 22 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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

- 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および新株引受権証券の権利行使より取得する株券
 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およ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および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券およ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、目的および範囲)

第 23 条 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を回避するため、わが国の取引所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。）およ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。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うこと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、および範囲)

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、ならびに価格変動リスクおよ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、また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。)を行うことの指図を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 4 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スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- ④前項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額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スワップ取引の想定元本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の受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- ⑤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。

- ⑥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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 25 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第 4 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金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の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(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属

るとみなした額との合計額(以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- ④前項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額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金利先渡取引の想定元本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の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ヘッジ対象金利商品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は、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品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投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の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(以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥前項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額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先渡取引の想定元本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の受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑨本条に規定する「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または海外において代表的利率として公表される預金契約また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およ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。
- ⑩本条に規定する「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およ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また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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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、投資信託財産に属する株式およ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、委託者はすみやかに、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、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(投資信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまた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前項の売付けの指図は、当該売付け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、前項の売付け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、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付け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)

第28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、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借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。

(外貨建資産への投資制限)

第 29 条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産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 40 を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により 100 分の 40 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- ②前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の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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 30 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。

(外国為替予約の指図)

第 31 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- ③前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の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の受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- ④第 2 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。

(保管業務の委任)

第 32 条 受託者は、委託者と協議のうえ、投資信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。保管費用は、受益者の負担とし、投資信託財産中より支弁します。

(有価証券等の保管)

第 33 条 受託者は、投資信託財産に属する有価証券等を、法令等に基づき、保管振替機構等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 34 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託で

きるものとしします。

(一括登録)

第 35 条 (削除)

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 36 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記また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、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとしします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第 37 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに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 38 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

(資金の借入れ)

第 39 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、また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また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、解約代金およ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、借入れ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 40 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および損失は、すべて受益者に帰

属します。

(受託者による資金の立替え)

第 41 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、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、株式の配当金およ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も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 項の立替金の決済および利息については、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 42 条 この信託の計算期間は、毎年 10 月 1 日から翌年 9 月 30 日までとするを原則とします。

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 4 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)

第 43 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。

(信託事務の諸費用)

第 44 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およ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投資信託財産に係る会計監査費用(消費税を含みます。)は、第 42 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一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 45 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 42 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 69 以内の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日および毎計算期末また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、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

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 46 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およ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、投資信託財産に係る会計監査費用(消費税等を含みます。)、信託報酬およ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、投資信託財産に係る会計監査費用(消費税等を含みます。)、信託報酬およ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、償還金およ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 47 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に、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。)については第 49 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 49 条第 2 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、償還金およ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。

(収益分配金の再投資)

第 48 条 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、収益分配金が指定販売会社に交付されます。

②指定販売会社は、別に定める契約に基づき、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けを行います。当該売付により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎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、

(償還金および一部解約金の支払い)

第 49 条 償還金は、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また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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。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または記録が行われます。

②一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として 5 営業日目から受益者に支払います。

③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとし、

④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎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、

⑤第 48 条第 3 項および前項に規定する「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、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、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、また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎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。

(受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

第 50 条 (削除)

(償還金の時効)

第 51 条 受益者が、信託終了による償還金について第 49 条第 1 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 52 条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権を、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口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。
- ③平成 19 年 1 月 4 日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。
- ④委託者は、第 2 項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、前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または記録が行われます。
- ⑤前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑥委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第 2 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およ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け付け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付けたものとして、第 5 項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第 52 条の 2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金およ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したがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第 53 条 委託者は、第 4 条の規定による信託終了前に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また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5億口を下回るようになった場合には、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ④前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑤前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項および第2項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑦第4項から前項までの規定は、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4項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第54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、その命令に従い、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を変更しようとするときは、第58条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第55条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまた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58条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第56条 委託者は、事業の全部また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また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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第57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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第58条の規定に従い、新受託者を選任します。

- 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)

第 58 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまた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ができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の投資信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 59 条 第 53 条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第 53 条第 4 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 59 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 60 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 61 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 平成 18 年 12 月 29 日現在の投資信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条、第 50 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 13 年 10 月 1 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社