

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和1年11月14日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

上記3ファンドの愛称として「マイパッケージ」という名称を用いることがあります。

以下3ファンドを総称して、あるいはそれぞれを「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また、「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」、「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」をそれぞれ「マイパッケージ30」「マイパッケージ50」「マイパッケージ70」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

\*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、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関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。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、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。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、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また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）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

### （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なります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DCマ30」、「DCマ50」、「DCマ70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます

す。

( 5 ) 【申込手数料】

無手数料です。

( 6 ) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「( 4 ) 発行( 売出 ) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

( 7 ) 【申込期間】

2019年11月15日から2020年5月14日まで

申込期間は、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。

( 8 ) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱いますので、委託会社は販売会社としての役割も有します。

販売会社の詳細につきましては、前記「( 4 ) 発行( 売出 ) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

( 9 ) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額( 取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数 ) を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

( 10 ) 【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。( 販売会社は前記「( 4 ) 発行( 売出 ) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。 )

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの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】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

八 クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

二 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該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。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 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】

- イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券の組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単体型・追加型	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います。

投資 対象 地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を實質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
----------------	----	--

投資対象資産（収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約において、株式、債券、不動産投信、その他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います。
---------------	------	--

補足 分類	イン デッ クス 型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	---------------------	---

## (口) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（合成指数）	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。



単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり	日経225
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			
債券	年4回	北米			
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
	日々	オセアニア			
	その他	中南米			
不動産投信	( )	アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産配 分固定型))		中近東(中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			その他 (合成指数)

(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。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ

(<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年9月30日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

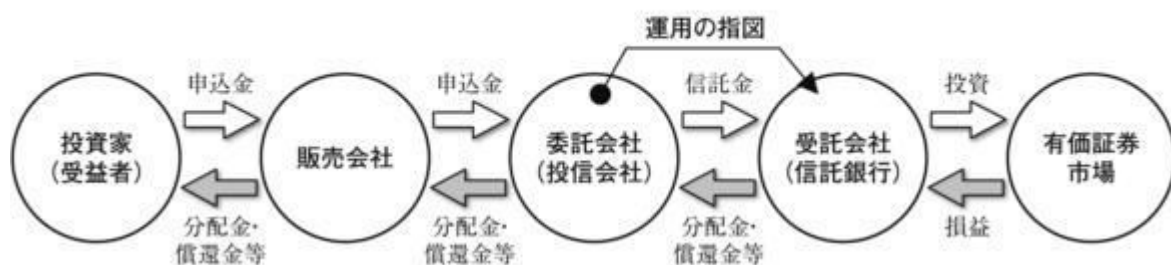
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

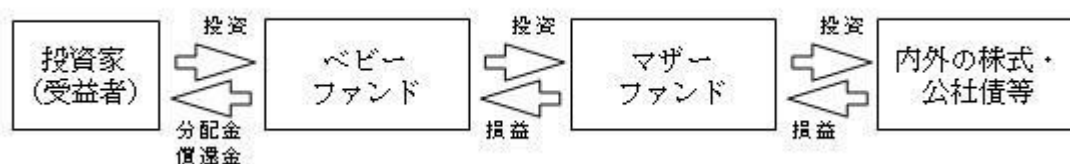
委託会社は販売会社としての役割も有します。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2019年8月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

## (八) 大株主の状況

(2019年8月30日現在)

名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

## ロ 投資態度

(イ) 各ファンドにつき、マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
株式	30%	50%	70%
国内株式	20%	35%	50%
外国株式	10%	15%	20%
債券	65%	45%	25%

国内債券	55%	35%	15%
外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

(ロ) 各ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

	マイパッケージ 30	マイパッケージ 50	マイパッケージ 70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

(ハ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

(二) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージ30

制限はありません。

b. マイパッケージ50

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c. マイパッケージ70

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

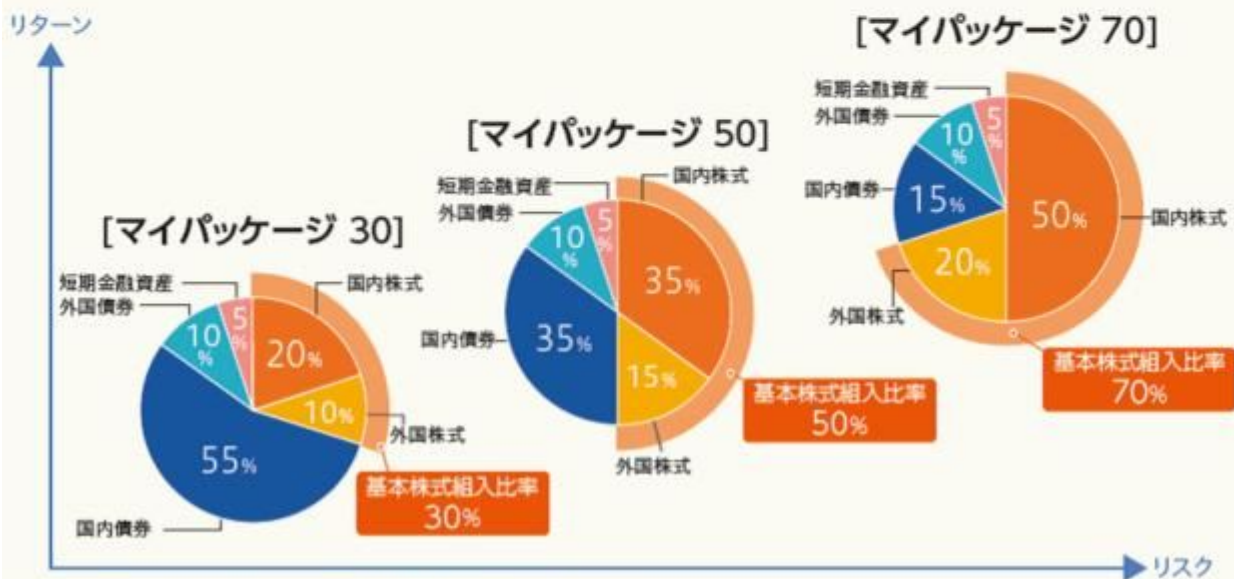
## ファンドの特色

**1** 内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

**2** 各ファンドにつき、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

- それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

### [各ファンドの基本資産配分イメージ]



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

## 3

運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

## 〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

	投資対象資産	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%

TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。

TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の代表的な指数であり、各ファンドの合成指数を構成するものです。なお、外国株式および外国債券のベンチマークは、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により委託会社が円換算したものです。

※指数を公表する各社は各ファンドの運用と何ら関係ありません。

## 4

実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式で運用を行います。



## 各マザーファンドの投資方針等

### ▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

- 主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

### ▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお、事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA-BPI(総合)から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。

### ▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

### ▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に近づけたポートフォリオを構築します。



#### 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

#### 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出してファンドを構築する方法です。指数を構成するすべての銘柄を保有する完全法に比べて、少ない銘柄数でポートフォリオを構築することができるため、銘柄入れ替えに伴う取引コストの抑制や、低流動性銘柄の組入れを避けることができるというメリットがあり、債券パッシブ運用に適しています。

## ベンチマークの推移

- ・以下のグラフは、ファンドのベンチマーク(合成指数)の推移を記載したものであり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの実際の運用実績は、後掲「基準価額・純資産の推移」をご覧ください。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。



※データは1999年8月末～2019年8月末。1999年8月末を100として指数化。

※有価証券売買時のコストや信託報酬等の費用負担、組入有価証券の売買のタイミング差等の影響から、当ファンドの値動きは上記推移とは異なります。

※ベンチマークである合成指数のデータは、当ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。

(出所)FactSetのデータを基に委託会社作成

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

- 1．有価証券
- 2．デリバティブ取引にかかる権利
- 3．金銭債権
- 4．約束手形

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券（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. 株券または新株引受権証書
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 特定目的会社にかか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。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 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
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券もしくは投資法人債券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。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（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、有価証券にかかるものに限りません。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  20. 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
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1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2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、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。

#### 八 投資対象とする金融商品

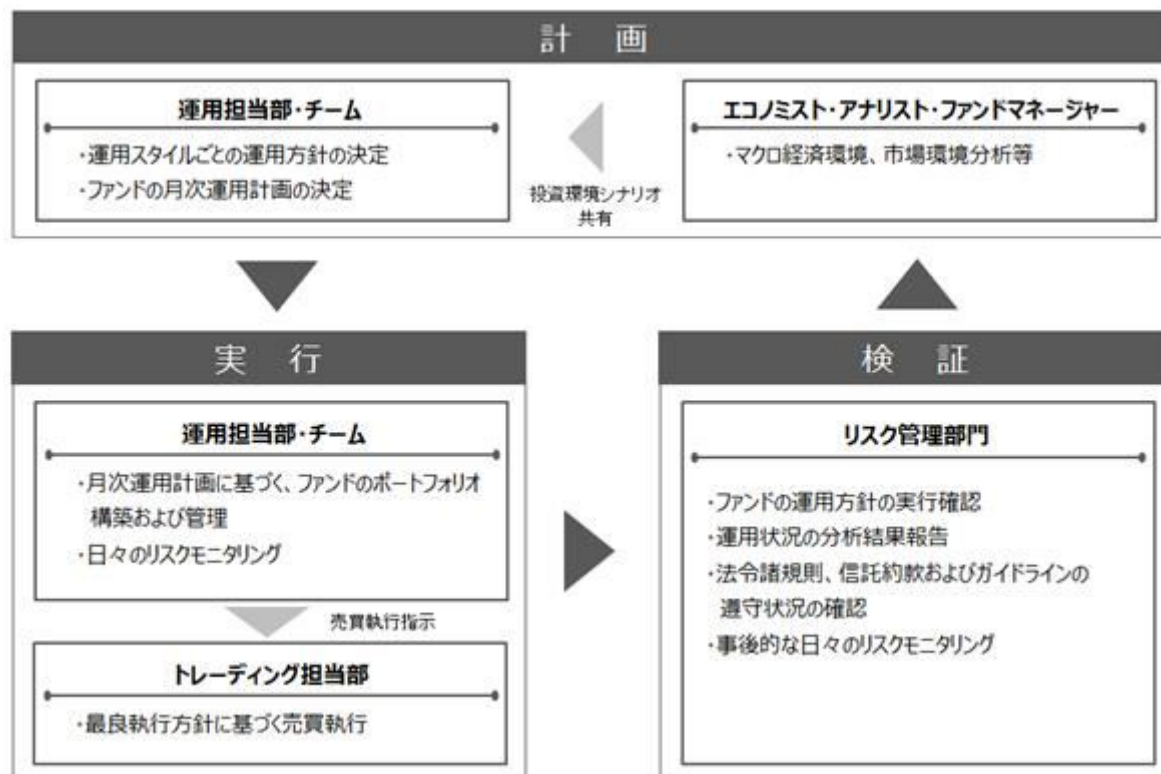
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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）【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

- ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制  
 ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

### （4）【分配方針】

毎決算時（原則として毎年2月18日、ただし決算当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（1）投資方針」と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

## (5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。
- |           |       |
|-----------|-------|
| マイパッケージ30 | 50%未満 |
| マイパッケージ50 | 25%以上 |
| マイパッケージ70 | 50%以上 |
- 実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)
- ロ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ホ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ト デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- チ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場し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。
- (ロ) 上記(イ)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す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。
- ロ 信用取引の指図
- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付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。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、信用取引の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

## 八 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本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。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）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。以下同じ。）ならびに外国の取引所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り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所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。

## ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、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。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、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信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 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により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 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、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、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、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 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により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、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。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、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。）までの期間にかか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、その取決めにかか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。

- (ト)「為替先渡取引」とは、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かか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。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかか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決めにかか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かか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。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

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

#### ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証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。
- (ロ) 有価証券の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### チ 有価証券の借入れの指図

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

#### リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本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。

## 又 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  - (ロ) 上記(イ)の資金借入れ額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
    1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
    2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
    3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
  - (ハ) 上記(ロ)の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

## ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

## 法令に基づく投資制限

- イ 同一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第9条）

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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（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かかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図

しないものとしてします。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第10号、第13号、第18号および第19号に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

(ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、N O M U R A - B P I (総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## □ 投資態度

- (イ) NOMURA - B P I (総合) をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号まで)に掲げるものに投資します。

### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCI コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号(ただし、投資法人債券を除きます。)に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## (外国債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

(イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

(ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

(ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号まで)に掲げるものに投資します(ただし、投資法人債券を除きます。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 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割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式や債券を投資対象としています(マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。)。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。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。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等(当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。)のうち主要なものは、以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となり

ます。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

(ハ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ニ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ト) 指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物等とインデックスの動きとの不一致等から、上記合成指数の動きに連動しないことがあります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、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。

□ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

#### ■マイパッケージ30



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



#### ■マイパッケージ50



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ■マイパッケージ70



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なり得ます。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX (配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
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・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的財産権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

無手数料です。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

各ファンドの信託報酬率および実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
マイパッケージ 30	年0.242% （税抜き0.22%）	年0.09%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ 50	年0.253% （税抜き0.23%）	年0.10%	年0.1%	年0.03%
マイパッケージ 70	年0.264% （税抜き0.24%）	年0.11%	年0.1%	年0.03%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	交付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	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

## (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0055%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 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会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## (5)【課税上の取扱い】

## イ 個別元本について

(イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

(ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

(ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

## ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

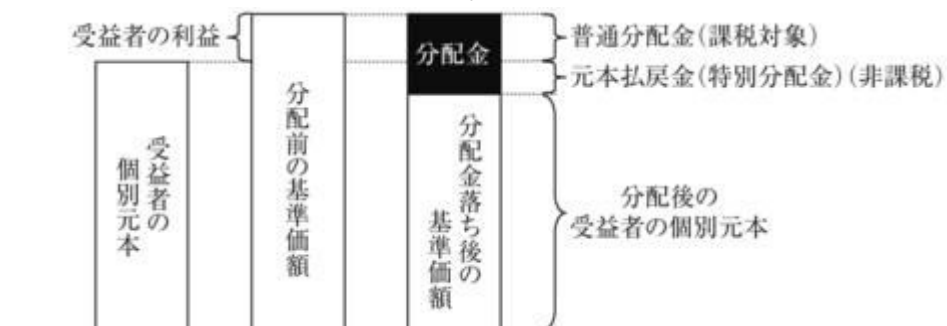
## ハ 収益分配金の課税について

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

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆



するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。


### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISA（ニーサ）での取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

つみたてNISA（ニーサ）、NISA（ニーサ）、ジュニアNISA（ニーサ）をご利用になる場合、それぞれの制度の違いにご留意ください。また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資 非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	公募株式投資信託 (新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象と なる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)		0～19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の 1月1日現在)
非課税の期間	最長 <b>20</b> 年間 (投資期間は2037年まで)	最長 <b>5</b> 年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	<b>40万円</b> /年 (最大 <b>800万円</b> )	<b>120万円</b> /年 (最大 <b>600万円</b> )	<b>80万円</b> /年 (最大 <b>400万円</b> )
留意事項	 同一年において、つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。		

< 配当控除の適用の可否 >

a . マイパッケージ30

配当控除の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

b . マイパッケージ50

配当控除の適用が可能です。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c . マイパッケージ70

配当控除の適用が可能です。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2019年8月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

2019年 8月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	10,620,958,889	95.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		551,011,262	4.93
合計(純資産総額)		11,171,970,151	100.00

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

## 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

2019年 8月30日現在

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	28,301,135,690	95.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,453,155,290	4.88
合計(純資産総額)		29,754,290,980	100.00

## 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

2019年 8月30日現在

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	13,966,261,319	95.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		721,767,819	4.91
合計(純資産総額)		14,688,029,138	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

## イ 主要投資銘柄

2019年 8月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	4,638,166,623	1.2789	5,932,133,474	1.3174	6,110,320,709	54.69
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(B号)	944,536,722	2.4829	2,345,280,086	2.3885	2,256,025,960	20.19
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	324,923,476	3.4671	1,126,570,591	3.4963	1,136,029,949	10.17
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	624,034,740	1.7409	1,086,394,115	1.7925	1,118,582,271	10.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.07
合計	95.07

### 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

#### イ 主要投資銘柄

2019年 8月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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(B号)	4,383,582,159	2.4869	10,901,805,033	2.3885	10,470,185,986	35.19
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	7,855,301,937	1.2789	10,046,145,648	1.3174	10,348,574,771	34.78
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	1,289,610,420	3.4632	4,466,300,888	3.4963	4,508,864,911	15.15
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,658,861,937	1.7406	2,887,460,295	1.7925	2,973,510,022	9.99

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.12
合計	95.12

### 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

#### イ 主要投資銘柄

2019年 8月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	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(B号)	3,081,349,945	2.4897	7,671,763,117	2.3885	7,359,804,343	50.11
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	845,770,614	3.4637	2,929,554,636	3.4963	2,957,067,797	20.13
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,660,552,413	1.2794	2,124,606,397	1.3174	2,187,611,748	14.89
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	815,496,475	1.7406	1,419,472,188	1.7925	1,461,777,431	9.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.09
合計	95.09

#### 【投資不動産物件】

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

年月日	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5期 (2010年 2月18日)	1,428,892,994	1,428,892,994	9,699	9,699
第6期 (2011年 2月18日)	1,960,814,211	1,960,814,211	10,043	10,043
第7期 (2012年 2月20日)	2,456,937,455	2,456,937,455	9,914	9,914
第8期 (2013年 2月18日)	3,050,834,550	3,050,834,550	10,966	10,966
第9期 (2014年 2月18日)	3,743,242,037	3,743,242,037	12,196	12,196
第10期 (2015年 2月18日)	4,426,547,408	4,426,547,408	13,381	13,381
第11期 (2016年 2月18日)	4,963,496,383	4,963,496,383	13,158	13,158
第12期 (2017年 2月20日)	6,522,850,554	6,522,850,554	13,891	13,891
第13期 (2018年 2月19日)	8,363,355,544	8,363,355,544	14,611	14,611
第14期 (2019年 2月18日)	10,162,610,006	10,162,610,006	14,609	14,609
2018年 8月末日	9,444,869,853		14,706	
9月末日	9,727,579,956		14,913	
10月末日	9,605,176,460		14,485	
11月末日	9,836,400,488		14,603	
12月末日	9,654,477,597		14,194	
2019年 1月末日	10,018,013,561		14,446	
2月末日	10,227,237,222		14,644	
3月末日	10,430,372,447		14,730	
4月末日	10,518,973,052		14,812	
5月末日	10,676,842,947		14,560	
6月末日	10,948,582,078		14,756	
7月末日	11,152,485,745		14,835	
8月末日	11,171,970,151		14,779	

## 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

年月日	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5期 (2010年 2月18日)	4,608,495,307	4,608,495,307	8,983	8,983
第6期 (2011年 2月18日)	6,082,088,735	6,082,088,735	9,470	9,470
第7期 (2012年 2月20日)	6,937,357,284	6,937,357,284	9,064	9,064

第8期	(2013年 2月18日)	8,682,766,317	8,682,766,317	10,415	10,415
第9期	(2014年 2月18日)	10,955,496,410	10,955,496,410	12,155	12,155
第10期	(2015年 2月18日)	13,231,559,031	13,231,559,031	13,865	13,865
第11期	(2016年 2月18日)	14,015,482,569	14,015,482,569	13,215	13,215
第12期	(2017年 2月20日)	17,864,219,936	17,864,219,936	14,480	14,480
第13期	(2018年 2月19日)	23,340,195,738	23,340,195,738	15,652	15,652
第14期	(2019年 2月18日)	27,693,471,936	27,693,471,936	15,452	15,452
	2018年 8月末日	26,300,916,172		15,805	
	9月末日	27,319,882,887		16,188	
	10月末日	26,577,124,624		15,420	
	11月末日	27,211,831,435		15,581	
	12月末日	26,020,652,439		14,801	
	2019年 1月末日	27,176,386,226		15,205	
	2月末日	27,948,507,506		15,510	
	3月末日	28,491,501,756		15,587	
	4月末日	28,838,460,584		15,757	
	5月末日	28,420,673,050		15,265	
	6月末日	29,171,854,292		15,542	
	7月末日	29,809,967,709		15,664	
	8月末日	29,754,290,980		15,444	

## 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

年月日	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5期	(2010年 2月18日)	2,060,345,540	2,060,345,540	8,216	8,216
第6期	(2011年 2月18日)	2,906,265,010	2,906,265,010	8,802	8,802
第7期	(2012年 2月20日)	3,235,878,337	3,235,878,337	8,153	8,153
第8期	(2013年 2月18日)	4,273,161,707	4,273,161,707	9,718	9,718
第9期	(2014年 2月18日)	5,675,436,056	5,675,436,056	11,894	11,894
第10期	(2015年 2月18日)	7,091,879,077	7,091,879,077	14,104	14,104
第11期	(2016年 2月18日)	7,026,639,080	7,026,639,080	13,019	13,019
第12期	(2017年 2月20日)	9,067,400,207	9,067,400,207	14,788	14,788
第13期	(2018年 2月19日)	12,058,838,561	12,058,838,561	16,422	16,422
第14期	(2019年 2月18日)	14,023,320,486	14,023,320,486	15,991	15,991
	2018年 8月末日	13,631,872,669		16,628	
	9月末日	14,258,418,526		17,204	
	10月末日	13,570,616,008		16,064	
	11月末日	13,926,105,361		16,268	
	12月末日	13,035,871,187		15,095	
	2019年 1月末日	13,729,805,127		15,657	

2月末日	14,141,627,014		16,073
3月末日	14,365,872,660		16,138
4月末日	14,549,190,305		16,401
5月末日	14,152,751,961		15,657
6月末日	14,554,565,496		16,015
7月末日	14,880,164,212		16,181
8月末日	14,688,029,138		15,788

## 【分配の推移】

## 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0
第14期	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0

## 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0
第14期	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0

## 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)



	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第5期	2009年 2月19日～2010年 2月18日	0
第6期	2010年 2月19日～2011年 2月18日	0
第7期	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0
第8期	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0
第9期	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0
第10期	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0
第11期	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0
第12期	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0
第13期	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0
第14期	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

	収益率（％）
第5期	10.4
第6期	3.5
第7期	1.3
第8期	10.6
第9期	11.2
第10期	9.7
第11期	1.7
第12期	5.6
第13期	5.2
第14期	0.0
第15期（中間期）	0.3

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

	収益率（％）
第5期	15.8
第6期	5.4
第7期	4.3
第8期	14.9
第9期	16.7
第10期	14.1
第11期	4.7

第12期	9.6
第13期	8.1
第14期	1.3
第15期（中間期）	1.2

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

	収益率（％）
第5期	21.3
第6期	7.1
第7期	7.4
第8期	19.2
第9期	22.4
第10期	18.6
第11期	7.7
第12期	13.6
第13期	11.0
第14期	2.6
第15期（中間期）	2.8

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### （４）【設定及び解約の実績】

#### 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	495,358,440	76,369,973
第6期	638,803,489	159,741,067
第7期	624,991,852	99,146,353
第8期	506,925,623	202,932,959
第9期	608,587,945	321,655,472
第10期	556,143,284	317,096,474
第11期	866,745,890	402,710,540
第12期	1,313,785,041	390,304,402
第13期	1,682,239,634	653,756,318
第14期	1,810,013,111	577,755,487
第15期（中間期）	999,838,727	471,327,371

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	1,554,846,560	153,223,574
第6期	1,758,746,053	466,119,658
第7期	1,598,782,670	367,412,865
第8期	1,152,916,388	470,633,628
第9期	1,302,773,482	626,264,800
第10期	1,157,116,236	626,892,999
第11期	2,020,562,533	958,102,870
第12期	2,542,481,389	811,014,755
第13期	3,756,094,069	1,181,645,961
第14期	4,241,062,383	1,230,606,145
第15期（中間期）	1,892,385,167	763,044,269

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	884,174,334	103,452,149
第6期	1,002,632,701	208,523,447
第7期	823,696,243	156,788,011
第8期	707,190,254	278,967,034
第9期	956,256,090	581,638,142
第10期	858,360,534	601,602,705
第11期	1,106,054,113	737,015,945
第12期	1,323,647,752	589,291,932
第13期	2,006,562,694	794,980,782
第14期	2,171,658,591	745,653,991
第15期（中間期）	950,559,435	510,645,056

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年 8月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	157,515,482,630	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,339,366,199	2.08
合計(純資産総額)		160,854,848,829	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,231,400,000	2.00
合計	買建	-	3,231,400,000	2.00

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

2019年 8月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	112,781,362,260	75.25
地方債証券	日本	10,980,132,735	7.33
特殊債券	日本	17,626,921,077	11.76
社債券	日本	6,701,250,000	4.47
	フランス	201,444,000	0.13
	オーストラリア	200,576,000	0.13
	小計	7,103,270,000	4.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,378,701,592	0.92
合計(純資産総額)		149,870,387,664	100.00

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2019年 8月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	107,721,943,627	62.13
	イギリス	9,641,185,248	5.56
	カナダ	6,444,943,611	3.72
	スイス	6,371,554,385	3.67

フランス	6,227,176,994	3.59	
ドイツ	5,153,826,427	2.97	
オーストラリア	3,655,939,942	2.11	
アイルランド	3,130,873,225	1.81	
オランダ	3,011,747,881	1.74	
スペイン	1,740,123,459	1.00	
香港	1,566,078,265	0.90	
スウェーデン	1,420,305,026	0.82	
イタリア	1,186,447,545	0.68	
デンマーク	1,106,939,771	0.64	
シンガポール	713,624,846	0.41	
バミューダ	688,665,237	0.40	
フィンランド	688,016,200	0.40	
ベルギー	618,136,876	0.36	
ジャージー	594,314,608	0.34	
ノルウェー	390,096,043	0.22	
ケイマン諸島	353,032,104	0.20	
イスラエル	352,811,374	0.20	
キュラソー	206,919,142	0.12	
ルクセンブルグ	163,132,513	0.09	
ニュージーランド	148,252,567	0.09	
オーストリア	135,056,353	0.08	
ポルトガル	94,083,634	0.05	
リベリア	85,482,319	0.05	
パプアニューギニア	28,276,485	0.02	
マン島	19,472,348	0.01	
英ヴァージン諸島	17,606,349	0.01	
モーリシャス	7,049,653	0.00	
小計	163,683,114,057	94.40	
投資証券	アメリカ	3,393,445,897	1.96
	オーストラリア	530,234,819	0.31
	フランス	176,737,545	0.10
	香港	140,377,918	0.08
	イギリス	103,614,989	0.06
	シンガポール	79,479,740	0.05
	カナダ	31,705,506	0.02

	小計	4,455,596,414	2.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,252,185,084	3.03
合計(純資産総額)		173,390,895,555	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,754,496,608	2.16
	買建	ドイツ	878,706,686	0.50
	買建	イギリス	297,828,275	0.17
	買建	オーストラリア	231,954,990	0.13
合計	買建	-	5,162,986,559	2.96

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		104,396,800	0.06
	売建		45,093,600	0.02

外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年 8月30日現在

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	73,286,268,184	47.50
	フランス	15,330,800,653	9.94
	イタリア	13,699,251,982	8.88
	イギリス	9,521,911,846	6.17
	ドイツ	9,080,614,945	5.89
	スペイン	8,562,118,722	5.55
	ベルギー	3,647,854,042	2.36
	オーストラリア	2,968,132,865	1.92
	カナダ	2,929,113,320	1.90
	オランダ	2,825,199,816	1.83
	オーストリア	2,399,508,728	1.56
	アイルランド	1,353,237,986	0.88
	メキシコ	1,132,963,472	0.73

	フィンランド	1,045,609,657	0.68
	ポーランド	856,195,645	0.55
	デンマーク	802,585,633	0.52
	南アフリカ	801,561,570	0.52
	マレーシア	709,045,692	0.46
	シンガポール	622,119,515	0.40
	スウェーデン	509,180,148	0.33
	ノルウェー	348,906,754	0.23
	小計	152,432,181,175	98.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,857,276,171	1.20
合計(純資産総額)		154,289,457,346	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年 8月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	811,200	6,793.06	5,510,530,272	6,960.00	5,645,952,000	3.51
日本	株式	ソニー	電気機器	488,100	5,908.12	2,883,753,372	6,042.00	2,949,100,200	1.83
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	566,500	4,742.05	2,686,371,325	4,824.00	2,732,796,000	1.70
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,938,000	621.54	3,069,164,520	510.40	2,520,355,200	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	488,400	4,674.36	2,282,957,424	5,096.00	2,488,886,400	1.55
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	635,300	4,375.58	2,779,805,974	3,590.00	2,280,727,000	1.42
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,700	61,470.28	2,194,488,996	62,900.00	2,245,530,000	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	505,700	4,165.83	2,106,660,231	3,484.00	1,761,858,800	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	41,700	34,404.96	1,434,686,832	40,290.00	1,680,093,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	584,800	2,661.02	1,556,164,496	2,835.00	1,657,908,000	1.03
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	497,700	3,110.80	1,548,245,160	3,219.00	1,602,096,300	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	613,900	3,191.16	1,959,053,124	2,523.50	1,549,176,650	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,747,600	187.62	1,828,844,712	154.70	1,507,953,720	0.94
日本	株式	第一三共	医薬品	208,100	4,151.47	863,920,907	7,018.00	1,460,445,800	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	256,800	5,591.31	1,435,848,408	5,472.00	1,405,209,600	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,100	23,330.78	1,518,833,778	21,015.00	1,368,076,500	0.85
日本	株式	信越化学工業	化学	125,700	10,077.65	1,266,760,605	10,715.00	1,346,875,500	0.84
日本	株式	花王	化学	174,200	8,353.92	1,455,252,864	7,674.00	1,336,810,800	0.83

日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	129,400	10,308.09	1,333,866,846	10,115.00	1,308,881,000	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	99,200	12,578.07	1,247,744,544	13,155.00	1,304,976,000	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	502,900	3,063.22	1,540,493,338	2,585.00	1,299,996,500	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	69,100	19,290.84	1,332,997,044	18,455.00	1,275,240,500	0.79
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	82,100	11,298.60	927,615,060	15,470.00	1,270,087,000	0.79
日本	株式	HOYA	精密機器	146,500	6,891.11	1,009,547,615	8,649.00	1,267,078,500	0.79
日本	株式	資生堂	化学	144,600	7,217.74	1,043,685,204	8,690.00	1,256,574,000	0.78
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	452,300	2,621.85	1,185,862,755	2,682.00	1,213,068,600	0.75
日本	株式	日本電産	電気機器	87,500	15,023.20	1,314,530,000	13,855.00	1,212,312,500	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	327,200	3,281.62	1,073,746,064	3,629.00	1,187,408,800	0.74
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	757,700	1,367.10	1,035,851,670	1,490.50	1,129,351,850	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	300,200	4,933.32	1,480,982,664	3,757.00	1,127,851,400	0.70

## □ 種類別・業種別の投資比率

2019年 8月30日現在

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	0.26
		建設業	2.78
		食料品	4.00
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.10
		医薬品	5.60
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.54
		機械	4.78
		電気機器	13.42
		輸送用機器	7.61
		精密機器	2.14
		その他製品	2.21
		電気・ガス業	1.68
陸運業	4.71		
海運業	0.15		
空運業	0.55		
倉庫・運輸関連業	0.19		



	情報・通信業	8.89
	卸売業	4.78
	小売業	4.70
	銀行業	5.60
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.24
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.50
	サービス業	5.15
合計		97.92

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年 8月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	103.98	2,110,976,700	104.40	2,119,421,500	0.800	2023/6/20	1.41
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	106.72	1,552,848,750	106.76	1,553,488,950	1.700	2022/12/20	1.04
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.23	1,339,471,150	104.70	1,345,420,700	0.800	2023/9/20	0.90
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	103.25	1,306,112,500	103.46	1,308,819,600	0.800	2022/9/20	0.87
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	104.50	1,269,760,050	104.80	1,273,417,200	1.000	2023/3/20	0.85
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	111.01	1,132,302,000	111.26	1,134,892,800	2.100	2024/3/20	0.76
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	1,090,000,000	103.35	1,126,515,500	103.82	1,131,714,300	0.100	2029/6/20	0.76
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	109.52	1,117,124,400	109.77	1,119,664,200	1.900	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	108.99	1,117,229,500	109.19	1,119,269,250	1.900	2023/9/20	0.75
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,057,000,000	103.12	1,089,978,400	104.32	1,102,662,400	0.300	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	103.02	1,097,184,300	103.10	1,098,057,600	0.900	2022/3/20	0.73
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,021,000,000	101.92	1,040,644,040	103.47	1,056,489,960	0.100	2026/9/20	0.70
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,000,000,000	101.82	1,018,200,000	103.94	1,039,430,000	0.100	2028/6/20	0.69
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	990,000,000	101.86	1,008,414,000	103.96	1,029,233,700	0.100	2028/3/20	0.69
日本	特殊債券	第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	102.57	1,025,750,000	102.27	1,022,740,000	1.200	2021/6/30	0.68
日本	国債証券	第54回利付国債(20年)	965,000,000	106.09	1,023,768,500	105.79	1,020,950,700	2.200	2021/12/20	0.68
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	133.08	987,468,440	136.79	1,015,041,160	2.400	2034/3/20	0.68
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	980,000,000	103.25	1,011,918,600	103.25	1,011,869,600	1.100	2021/12/20	0.68

日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	970,000,000	101.90	988,430,000	103.97	1,008,596,300	0.100	2027/12/20	0.67
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	960,000,000	103.30	991,718,400	103.36	992,256,000	1.000	2022/3/20	0.66
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	960,000,000	103.00	988,800,000	103.02	988,992,000	1.000	2021/12/20	0.66
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	950,000,000	101.86	967,670,000	103.15	979,944,000	0.100	2026/3/20	0.65
日本	国債証券	第84回利付国債（20年）	850,000,000	114.36	972,119,500	115.20	979,276,500	2.000	2025/12/20	0.65
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	938,000,000	101.95	956,291,000	103.64	972,161,960	0.100	2026/12/20	0.65
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	920,000,000	101.78	936,376,000	103.96	956,450,400	0.100	2028/9/20	0.64
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	910,000,000	101.73	925,743,000	103.92	945,717,500	0.100	2028/12/20	0.63
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	910,000,000	101.89	927,211,000	103.31	940,148,300	0.100	2026/6/20	0.63
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	895,000,000	102.69	919,120,250	102.68	918,986,000	1.000	2021/9/20	0.61
日本	国債証券	第70回利付国債（20年）	780,000,000	113.12	882,367,200	113.41	884,652,600	2.400	2024/6/20	0.59
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	742,000,000	117.53	872,080,020	118.53	879,522,280	2.300	2026/6/20	0.59

## □ 種類別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	75.25
地方債証券	7.33
特殊債券	11.76
社債券	4.74
合計	99.08

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年 8月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	309,676	11,822.38	3,661,108,278	14,704.25	4,553,554,933	2.63
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	195,982	19,061.66	3,735,742,838	22,251.20	4,360,835,580	2.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,799	179,248.94	3,190,451,916	190,180.14	3,385,016,383	1.95
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	102,320	15,120.49	1,547,128,984	19,755.78	2,021,411,635	1.17
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,371	116,011.59	1,551,190,986	126,990.81	1,697,994,134	0.98

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	12,733	116,659.93	1,485,430,922	127,138.79	1,618,858,218	0.93
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	137,739	11,659.49	1,605,967,760	11,627.56	1,601,568,652	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	130,284	9,277.89	1,208,761,754	11,898.06	1,550,126,979	0.89
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	112,914	15,400.50	1,738,932,463	13,652.43	1,541,550,526	0.89
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	74,178	14,998.08	1,112,527,935	19,287.35	1,430,697,657	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	107,000	10,040.04	1,074,284,562	12,900.82	1,380,388,040	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	179,561	8,345.39	1,498,508,262	7,285.05	1,308,112,264	0.75
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,232	22,960.22	1,268,139,324	21,632.67	1,194,815,740	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	38,655	21,383.55	826,581,342	29,955.71	1,157,938,156	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	309,424	3,259.80	1,008,661,964	3,742.06	1,157,885,958	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	46,821	18,907.29	885,258,506	24,200.48	1,133,091,011	0.65
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	76,658	12,339.64	945,932,779	14,674.44	1,124,913,712	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	384,750	2,978.75	1,146,074,370	2,909.55	1,119,450,055	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	176,160	6,298.78	1,109,593,658	6,168.29	1,086,606,389	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	81,139	12,638.36	1,025,464,099	12,511.17	1,015,144,569	0.59
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	109,228	8,310.26	907,713,909	9,232.21	1,008,415,965	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	171,869	5,218.66	896,927,456	5,860.62	1,007,259,414	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	40,621	29,666.14	1,205,068,419	24,551.80	997,318,879	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	190,267	5,077.07	966,000,285	4,989.78	949,390,509	0.55
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	182,337	5,061.10	922,827,322	5,032.36	917,586,191	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	192,927	4,199.01	810,103,476	4,702.33	907,208,002	0.52
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	182,804	5,677.51	1,037,871,867	4,917.38	898,918,086	0.52
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	234,850	4,813.05	1,130,346,342	3,761.23	883,325,288	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	22,688	36,716.98	833,035,055	38,617.30	876,149,311	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	29,883	27,621.19	825,404,086	29,195.01	872,434,648	0.50

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.27
		素材	4.13
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.25
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.02
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	1.92
		メディア・娯楽	5.93
		小売	4.80
		食品・生活必需品小売り	1.52
		食品・飲料・タバコ	5.02
		家庭用品・パーソナル用品	2.20
		ヘルスケア機器・サービス	4.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.84
		銀行	7.22
		各種金融	4.15
		保険	3.72
		不動産	0.85
		ソフトウェア・サービス	9.52
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.10		
電気通信サービス	2.36		
公益事業	3.58		
半導体・半導体製造装置	2.91		
投資証券			2.57
合計			96.97

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年 8月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,600,000	10,669.54	810,885,773	11,163.32	848,413,008	2.250	2026/3/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,900,000	10,816.54	746,341,895	11,679.82	805,908,025	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,200,000	10,992.07	681,508,800	11,461.91	710,638,800	2.375	2029/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,300,000	10,783.65	679,370,125	11,091.80	698,783,479	2.125	2026/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,329.94	650,786,653	11,080.98	698,102,304	2.250	2024/11/15	0.45

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	10,649.32	660,258,266	11,209.90	695,014,129	2.750	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	10,992.00	626,544,361	12,110.65	690,307,436	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,100,000	10,654.31	649,913,348	11,180.79	682,028,507	2.750	2023/8/31	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	18,801.97	545,257,396	22,847.39	662,574,383	4.500	2041/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,800,000	10,686.49	619,816,608	11,388.72	660,546,044	2.625	2025/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,162.67	614,841,898	10,748.30	650,272,237	1.625	2026/5/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,086.21	654,310,994	12,982.70	649,135,274	3.000	2022/4/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,499.61	598,478,198	11,158.33	636,025,309	2.500	2024/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,600,000	10,123.28	566,903,759	11,263.96	630,782,156	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,417.11	583,358,216	11,120.07	622,724,463	2.375	2024/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,207.68	581,838,003	10,767.43	613,743,563	1.750	2023/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,332.44	568,284,315	10,841.45	596,279,968	2.000	2023/2/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000	19,046.64	533,306,188	21,224.92	594,297,814	5.750	2032/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	10,621.04	584,157,664	10,764.10	592,025,723	2.625	2020/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,144.47	527,512,630	11,254.81	585,250,543	2.250	2027/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,180.23	529,372,350	11,225.70	583,736,817	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	4,900,000	9,373.47	459,300,044	11,811.23	578,750,662	2.500	2046/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	4,000,000	11,780.46	471,218,575	14,376.25	575,050,346	3.750	2043/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	10,638.51	542,564,243	11,244.83	573,486,713	2.750	2024/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,511.86	546,616,741	11,012.78	572,664,977	2.250	2024/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,000,000	10,611.89	530,594,979	11,413.67	570,683,823	2.750	2025/6/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,300,000	10,528.84	558,028,803	10,680.93	566,089,405	2.000	2020/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	10,527.89	505,339,005	11,700.61	561,629,730	2.750	2028/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	10,307.45	505,065,403	11,339.65	555,643,018	2.375	2027/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	10,527.89	526,394,797	11,077.66	553,883,104	2.500	2023/8/15	0.36

□ 種類別の投資比率

2019年 8月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.80
合計	98.80

投資不動産物件

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年 8月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	214	日本円	3,253,556,120	3,231,400,000	2.00

(注) 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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

2019年 8月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (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	SPMINI 1909	買建	241	米ドル	35,215,310.5	3,749,021,956	35,266,735	3,754,496,608	2.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1909	買建	219	ユーロ	7,434,398	874,508,236	7,470,090	878,706,686	0.50
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200 1909	買建	20	オースト ラリアド ル	3,258,365	233,233,767	3,240,500	231,954,990	0.13
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1909	買建	32	英ポンド	2,320,669	300,944,356	2,296,640	297,828,275	0.17

(注) 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。

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	米ドル	買建	710,000.00	75,352,400	75,558,200	0.04
	カナダドル	買建	70,000.00	5,575,500	5,606,300	0.00
	ユーロ	買建	110,000.00	12,927,300	12,939,300	0.00
	英ポンド	買建	30,000.00	3,885,300	3,889,800	0.00
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,242,100	3,236,100	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	100,000.00	1,091,000	1,088,000	0.00
	ノルウェークローネ	買建	10,000.00	117,200	116,800	0.00
	デンマーククローネ	買建	50,000.00	788,000	789,000	0.00
	香港ドル	買建	30,000.00	405,300	406,800	0.00
	シンガポールドル	買建	10,000.00	763,600	766,500	0.00
	カナダドル	売建	100,000.00	8,010,000	8,009,000	0.00
	英ポンド	売建	30,000.00	3,889,200	3,889,800	0.00
	スイスフラン	売建	80,000.00	8,626,400	8,629,600	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	230,000.00	2,502,400	2,502,400	0.00
	ノルウェークローネ	売建	40,000.00	467,600	467,200	0.00
	デンマーククローネ	売建	110,000.00	1,735,800	1,735,800	0.00
	オーストラリアドル	売建	130,000.00	9,301,500	9,302,800	0.00
	香港ドル	売建	510,000.00	6,915,600	6,915,600	0.00
	シンガポールドル	売建	20,000.00	1,532,600	1,533,000	0.00
	イスラエルシェケル	売建	70,000.00	2,109,100	2,108,400	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報

基準日:2019年8月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

### ■マイパッケージ30



決算期	分配金
2019年2月	0円
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

### ■マイパッケージ50



決算期	分配金
2019年2月	0円
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

### ■マイパッケージ70



決算期	分配金
2019年2月	0円
2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。



## 主要な資産の状況

### ■マイパッケージ30

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.93
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	54.69
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(B号)	20.19
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	10.17
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.01

### ■マイパッケージ50

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.88
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	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(B号)	35.19
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	34.78
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	15.15
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	9.99

### ■マイパッケージ70

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.91
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	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(B号)	50.11
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	20.13
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	14.89
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	9.95

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.08
合計(純資産総額)		100.00

\*株価指数先物取引の買建て 2.00%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.51
日本	株式	ソニー	電気機器	1.83
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.70
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.55
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.42
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.03

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	75.25
特殊債券	日本	11.76
地方債証券	日本	7.33
社債券	日本	4.47
	フランス	0.13
	オーストラリア	0.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.92
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.41
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.04
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.90
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	0.87
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.85
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.76
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	0.100	2029/06/20	0.76
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1.900	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1.900	2023/09/20	0.75
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	0.300	2025/12/20	0.74

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	62.13
	イギリス	5.56
	カナダ	3.72
	スイス	3.67
	フランス	3.59
	ドイツ	2.97
	その他	12.76
投資証券	アメリカ・その他	2.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.03
合計(純資産総額)		100.00

\*株価指数先物取引の買建て 2.96%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.63
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	2.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.95
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.17
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	0.93
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.89
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	0.89
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.83

\*比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	47.50
	フランス	9.94
	イタリア	8.88
	イギリス	6.17
	ドイツ	5.89
	スペイン	5.55
	ベルギー	2.36
	その他	12.51
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1.20
合計(純資産総額)	100.00	

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2026/03/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2029/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2026/05/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/08/31	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2025/12/31	0.43

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■マイパッケージ30



### ■マイパッケージ50



### ■マイパッケージ70



※2019年の収益率は、年初から2019年8月30日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金(解約)手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求(一部解約の実行請求)により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約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かか

るファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社(電話:0120-88-2976)にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、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け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、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。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、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「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(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本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。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DCマ30」、「DCマ50」、「DCマ70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

#### (2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

2005年9月30日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、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会社は、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。
- b. 委託会社は、上記a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当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドの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。
- c. 上記b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。
- d. 上記c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2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、当ファンドの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。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、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c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。

##### (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

##### (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社は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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### (イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の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(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため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て)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の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(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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て)に支払われます。

#### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの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内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、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当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドの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。
- (ハ) 上記(ロ)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。
- (ニ) 上記(ハ)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2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、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。

#### 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

#### ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

#### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

## 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の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（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため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します。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の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（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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します。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

### ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

### 二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解



約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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)ならびに同規則第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14期(平成30年2月20日から平成31年2月18日まで)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。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （平成30年 2月19日現在）	第14期 （平成31年 2月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	304,082,432
コール・ローン	355,919,031	169,039,886
親投資信託受益証券	7,958,601,651	9,676,623,686
未収入金	65,000,000	30,000,000
流動資産合計	8,379,520,682	10,179,746,004
資産合計	8,379,520,682	10,179,746,004
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,371,260	5,341,572
未払受託者報酬	1,305,625	1,572,240
未払委託者報酬	8,268,903	9,957,500
未払利息	1,000	492
その他未払費用	218,350	264,194
流動負債合計	16,165,138	17,135,998
負債合計	16,165,138	17,135,998
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,724,182,209	6,956,439,833
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,639,173,335	3,206,170,173
元本等合計	8,363,355,544	10,162,610,006
純資産合計	8,363,355,544	10,162,610,006
負債純資産合計	8,379,520,682	10,179,746,004

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第13期		第14期	
	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自	平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		385,639,943		23,422,035
営業収益合計		385,639,943		23,422,035
営業費用				
支払利息		312,362		211,558
受託者報酬		2,432,535		2,996,897
委託者報酬		15,405,968		18,980,285
その他費用		447,828		756,848
営業費用合計		18,598,693		22,945,588
営業利益又は営業損失 ( )		367,041,250		476,447
経常利益又は経常損失 ( )		367,041,250		476,447
当期純利益又は当期純損失 ( )		367,041,250		476,447
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 ( )		27,869,700		1,395,799
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		1,827,151,661		2,639,173,335
剰余金増加額又は欠損金減少額		730,126,162		831,745,414
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		730,126,162		831,745,414
剰余金減少額又は欠損金増加額		257,276,038		266,620,822
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		257,276,038		266,620,822
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		2,639,173,335		3,206,170,173

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第14期	
	自平成30年2月20日 至平成31年2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成30年2月20日から平成31年2月18日までとなっております。</p>	

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第13期		第14期	
	(平成30年2月19日現在)		(平成31年2月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,724,182,209口		6,956,439,833口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4611円	1口当たり純資産額	1.4609円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,611円	(10,000口当たりの純資産額)	14,609円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期	第14期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(105,120,550円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(234,051,000円)、収益調整金(2,018,310,508円)、および分配準備積立金(812,508,112円)より、分配対象収益は3,169,990,170円(1万口当たり5,537.87円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(117,172,831円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,802,845,345円)、および分配準備積立金(1,051,590,119円)より、分配対象収益は3,971,608,295円(1万口当たり5,709.22円)であります。分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期
	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	345,192,211円
合計	345,192,211円

第14期（自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	20,510,592円
合計	20,510,592円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成30年 2月19日現在）	第14期 （平成31年 2月18日現在）
期首元本額	4,695,698,893円	5,724,182,209円
期中追加設定元本額	1,682,239,634円	1,810,013,111円
期中一部解約元本額	653,756,318円	577,755,487円

## （4）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式



該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	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( B号)	829,093,530	2,069,997,816	
	外国株式インデックス・マザーファンド	301,486,997	1,042,722,927	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	575,643,684	1,000,986,802	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	4,352,148,444	5,562,916,141	
合計		6,058,372,655	9,676,623,686	

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。

## 【三井住友・DC年金バランス50(標準型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 (平成30年 2月19日現在)	第14期 (平成31年 2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	870,576,427
コール・ローン	909,178,053	483,954,758
親投資信託受益証券	22,224,159,988	26,328,010,558
未収入金	250,000,000	70,000,000
流動資産合計	23,383,338,041	27,752,541,743
資産合計	23,383,338,041	27,752,541,743
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,601,221	25,198,188
未払受託者報酬	3,642,928	4,323,079
未払委託者報酬	24,286,142	28,820,488
未払利息	2,556	1,411
その他未払費用	609,456	726,641
流動負債合計	43,142,303	59,069,807
負債合計	43,142,303	59,069,807
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,911,517,227	17,921,973,465
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,428,678,511	9,771,498,471
元本等合計	23,340,195,738	27,693,471,936
純資産合計	23,340,195,738	27,693,471,936
負債純資産合計	23,383,338,041	27,752,541,743

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第13期		第14期	
	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自	平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,630,063,585		272,769,430
営業収益合計		1,630,063,585		272,769,430
営業費用				
支払利息		851,699		585,005
受託者報酬		6,733,757		8,288,258
委託者報酬		44,891,585		55,254,965
その他費用		1,238,987		2,089,907
営業費用合計		53,716,028		66,218,135
営業利益又は営業損失 ( )		1,576,347,557		338,987,565
経常利益又は経常損失 ( )		1,576,347,557		338,987,565
当期純利益又は当期純損失 ( )		1,576,347,557		338,987,565
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 ( )		88,984,331		10,333,967
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		5,527,150,817		8,428,678,511
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,950,859,812		2,367,331,093
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,950,859,812		2,367,331,093
剰余金減少額又は欠損金増加額		536,695,344		695,857,535
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		536,695,344		695,857,535
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		8,428,678,511		9,771,498,471

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第14期	
	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末が休日のため、平成30年 2月20日から平成31年 2月18日までとなっております。</p>	

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第13期		第14期	
	(平成30年 2月19日現在)		(平成31年 2月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,911,517,227口		17,921,973,465口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5652円	1口当たり純資産額	1.5452円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,652円	(10,000口当たりの純資産額)	15,452円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期	第14期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(333,086,489円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,154,276,737円)、収益調整金(6,221,126,387円)、および分配準備積立金(3,436,796,216円)より、分配対象収益は11,145,285,829円(1万口当たり7,474.25円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(379,799,081円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,829,746,005円)、および分配準備積立金(4,571,447,700円)より、分配対象収益は13,780,992,786円(1万口当たり7,689.42円)であります。分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期
	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,504,719,337円
合計	1,504,719,337円

第14期（自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	293,251,667円
合計	293,251,667円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成30年 2月19日現在）	第14期 （平成31年 2月18日現在）
期首元本額	12,337,069,119円	14,911,517,227円
期中追加設定元本額	3,756,094,069円	4,241,062,383円
期中一部解約元本額	1,181,645,961円	1,230,606,145円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	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( B号)	3,915,114,983	9,774,867,578	
	外国株式インデックス・マザーファンド	1,220,412,888	4,220,920,014	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,577,450,241	2,743,028,224	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	7,502,108,232	9,589,194,742	
合計		14,215,086,344	26,328,010,558	

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。



## 【三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 (平成30年 2月19日現在)	第14期 (平成31年 2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	425,786,875
コール・ローン	494,609,119	236,695,570
親投資信託受益証券	11,487,565,645	13,356,968,331
未収入金	110,000,000	25,000,000
流動資産合計	12,092,174,764	14,044,450,776
資産合計	12,092,174,764	14,044,450,776
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	18,090,996	3,102,309
未払受託者報酬	1,866,446	2,207,066
未払委託者報酬	13,065,099	15,449,396
未払利息	1,390	690
その他未払費用	312,272	370,829
流動負債合計	33,336,203	21,130,290
負債合計	33,336,203	21,130,290
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,343,316,412	8,769,321,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,715,522,149	5,253,999,474
元本等合計	12,058,838,561	14,023,320,486
純資産合計	12,058,838,561	14,023,320,486
負債純資産合計	12,092,174,764	14,044,450,776

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期		第14期	
	自	平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自	平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,097,328,918		321,937,314
営業収益合計		1,097,328,918		321,937,314
営業費用				
支払利息		437,608		300,603
受託者報酬		3,423,253		4,261,946
委託者報酬		23,962,690		29,833,487
その他費用		630,148		1,074,281
営業費用合計		28,453,699		35,470,317
営業利益又は営業損失( )		1,068,875,219		357,407,631
経常利益又は経常損失( )		1,068,875,219		357,407,631
当期純利益又は当期純損失( )		1,068,875,219		357,407,631
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( )		78,549,697		10,467,067
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,935,665,707		4,715,522,149
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,177,501,917		1,364,118,588
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,177,501,917		1,364,118,588
剰余金減少額又は欠損金増加額		387,970,997		478,700,699
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		387,970,997		478,700,699
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,715,522,149		5,253,999,474

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第14期	
	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末が休日のため、平成30年 2月20日から平成31年 2月18日までとなっております。</p>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第13期		第14期	
	（平成30年 2月19日現在）		（平成31年 2月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,343,316,412口		8,769,321,012口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6422円	1口当たり純資産額	1.5991円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,422円)	(10,000口当たりの純資産額)	15,991円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第13期	第14期
	自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(188,609,584円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(801,715,938円)、収益調整金(3,881,114,524円)、および分配準備積立金(1,881,707,257円)より、分配対象収益は6,753,147,303円(1万口当たり9,196.30円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(224,755,351円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(5,446,823,835円)、および分配準備積立金(2,621,239,143円)より、分配対象収益は8,292,818,329円(1万口当たり9,456.60円)であります。分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期
	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第13期（自 平成29年 2月21日 至 平成30年 2月19日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,026,396,179円
合計	1,026,396,179円

第14期（自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	330,946,704円
合計	330,946,704円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第14期 自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成30年 2月19日現在）	第14期 （平成31年 2月18日現在）
期首元本額	6,131,734,500円	7,343,316,412円
期中追加設定元本額	2,006,562,694円	2,171,658,591円
期中一部解約元本額	794,980,782円	745,653,991円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	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（B号）	2,826,368,014	7,056,593,020	
	外国株式インデックス・マザーファンド	819,335,496	2,833,753,746	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	794,781,744	1,382,045,974	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,630,868,089	2,084,575,591	
合計		6,071,353,343	13,356,968,331	

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)

「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」および「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・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「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,040,047,499
コール・ローン	2,786,649,006	1,134,065,503
株式	185,261,262,630	170,172,936,360
派生商品評価勘定	41,517,400	59,147,640
未収入金	6,717,392	882,840
未収配当金	264,957,200	272,566,562
前払金	44,170,000	-
差入委託証拠金	52,560,000	54,470,000
流動資産合計	188,457,833,628	173,734,116,404
資産合計	188,457,833,628	173,734,116,404
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	85,880,720	-
前受金	-	59,355,000

	（平成30年 2月19日現在）	（平成31年 2月18日現在）
未払解約金	76,767,000	381,420,512
未払利息	7,834	3,306
その他未払費用	4,126	12,975
流動負債合計	162,659,680	440,791,793
負債合計	162,659,680	440,791,793
純資産の部		
元本等		
元本	69,684,287,877	69,410,111,137
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	118,610,886,071	103,883,213,474
元本等合計	188,295,173,948	173,293,324,611
純資産合計	188,295,173,948	173,293,324,611
負債純資産合計	188,457,833,628	173,734,116,404

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成30年 2月19日現在）	（平成31年 2月18日現在）
1. 担保資産	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。	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。



	株式	3,689,500,000円	株式	2,662,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		69,684,287,877口		69,410,111,137口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.7021円 27,021円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.4967円 24,967円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年 2月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320
	東証株価指数先物	3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320
合計		3,210,873,320	-	3,166,510,000	44,363,320

（平成31年 2月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,023,412,360	-	3,082,560,000	59,147,640
	東証株価指数先物	3,023,412,360	-	3,082,560,000	59,147,640
合計		3,023,412,360	-	3,082,560,000	59,147,640

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に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います。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います。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年 2月20日

至 平成31年 2月18日

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成30年 2月19日現在）

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	94,226,159,685円
同期中における追加設定元本額	9,581,959,783円
同期中における一部解約元本額	34,123,831,591円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,811,777,456円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	638,526,687円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,080,226,224円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,271,789,019円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	134,223,760円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,072,256円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	21,977,451円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	54,543,383円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	62,737,591円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	35,055,593円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	97,562,483円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,612,896,348円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	4,282,050,855円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,069,532,241円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,213,867,144円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,135,822,135円
イオン・バランス戦略ファンド	23,458,196円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,853,991円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	263,856円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,161,752円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	10,557,399円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,490,423円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,667,970円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	1,497,787円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,628,143,731円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	29,332,036円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	2,852,615,400円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	3,892,930,593円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	2,575,394,920円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	9,423,534,192円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	54,641,962円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	229,178,880円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	1,346,769円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	1,058,651,349円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	57,201,706円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	394,439,565円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,139,461,875円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,228,823,342円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,292,030,822円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	57,274,907円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,434,434,866円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	70,349,641円
S M A M・バランスファンドV A 2 0 <適格機関投資家専用>	109,096,653円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	107,737,120円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	47,862,698円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	24,251,578円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	213,046,805円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	393,506,462円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	162,861,286円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	113,765,518円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	58,297,842円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	10,726,854円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	75,815,538円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	997,354,799円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A ( 適格機関投資家専用 )	196,489,306円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	19,532,457円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,806,219,572円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	265,581,987円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,772,189,307円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	373,132,170円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	148,268円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	88,696,522円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	42,476,846円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	85,809,974円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	34,991円
合計	69,684,287,877円

(平成31年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,684,287,877円
同期中における追加設定元本額	13,801,629,783円
同期中における一部解約元本額	14,075,806,523円
平成31年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,400,979,621円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	829,093,530円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	3,915,114,983円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	2,826,368,014円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	143,917,418円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	7,875,609円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	26,372,361円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	66,053,043円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	95,782,988円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	55,644,200円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	140,557,308円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	2,023,412,321円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	8,514,588,918円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	653,857,235円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	808,794,070円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	794,635,166円
イオン・バランス戦略ファンド	36,309,356円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,702,600円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	16,347,537円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	18,940,771円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	66,626,428円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	41,906,104円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	75,606,267円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,442,211円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,733,823,793円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	24,212,175円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	348,418,250円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,581,846,500円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,533,201,794円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,300,548,392円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	60,378,794円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	229,701,782円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	769,813円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	940,339,797円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	57,187,516円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	384,921,677円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,139,861,258円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	969,905,888円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,205,278,206円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,573,523円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,100,001,615円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	65,794,715円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	70,436,588円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,621,114,917円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	110,574,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	50,037,523円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	23,142,893円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	215,349,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	400,461,531円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	174,466,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	123,026,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	63,077,694円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,748,679円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	80,911,569円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	999,728,986円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	202,419,746円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,843,619円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	1,695,989,501円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	240,578,553円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	137,865,272円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	11,293,581円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 >	94,617,684円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 05 < 適格機関投資家限定 >	45,298,042円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	111,641,952円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	15,672円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	77,868,853円
合計	69,410,111,137円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	2,963.00	10,370,500	
日本水産	101,000	732.00	73,932,000	
マルハニチロ	14,600	3,705.00	54,093,000	
カネコ種苗	4,000	1,324.00	5,296,000	
サカタのタネ	12,100	3,725.00	45,072,500	
ホクト	8,100	1,935.00	15,673,500	
日鉄鉱業	2,400	4,595.00	11,028,000	
三井松島ホールディングス	5,300	1,566.00	8,299,800	
国際石油開発帝石	405,400	1,142.00	462,966,800	
石油資源開発	14,400	2,359.00	33,969,600	
K & O エナジーグループ	5,100	1,524.00	7,772,400	
ヒノキヤグループ	2,700	2,276.00	6,145,200	
ショーボンドホールディングス	7,800	8,090.00	63,102,000	
ミライト・ホールディングス	28,100	1,669.00	46,898,900	
タマホーム	7,700	1,098.00	8,454,600	
ベステラ	2,700	1,335.00	3,604,500	
T A T E R U	14,000	268.00	3,752,000	
スペースバリューホールディングス	12,800	891.00	11,404,800	
安藤・間	64,700	765.00	49,495,500	
東急建設	29,600	967.00	28,623,200	
コムシスホールディングス	35,900	2,839.00	101,920,100	
ミサワホーム	9,700	729.00	7,071,300	
ビーアールホールディングス	11,500	357.00	4,105,500	

高松コンストラクショングループ	6,300	2,718.00	17,123,400
東建コーポレーション	3,100	6,570.00	20,367,000
大成建設	82,900	4,970.00	412,013,000
大林組	249,200	1,054.00	262,656,800
清水建設	254,300	935.00	237,770,500
飛島建設	8,200	1,505.00	12,341,000
長谷工コーポレーション	104,100	1,334.00	138,869,400
松井建設	11,200	741.00	8,299,200
銭高組	1,300	5,300.00	6,890,000
鹿島建設	195,000	1,595.00	311,025,000
不動テトラ	7,000	1,588.00	11,116,000
大末建設	5,400	958.00	5,173,200
鉄建建設	5,400	2,705.00	14,607,000
西松建設	18,600	2,461.00	45,774,600
三井住友建設	61,900	698.00	43,206,200
大豊建設	5,800	3,010.00	17,458,000
前田建設工業	60,600	1,124.00	68,114,400
奥村組	14,300	3,350.00	47,905,000
東鉄工業	9,900	3,000.00	29,700,000
浅沼組	3,300	2,647.00	8,735,100
戸田建設	97,700	708.00	69,171,600
熊谷組	11,900	3,205.00	38,139,500
北野建設	2,300	3,125.00	7,187,500
矢作建設工業	13,900	749.00	10,411,100
ピーエス三菱	11,100	626.00	6,948,600
日本ハウスホールディングス	20,000	440.00	8,800,000
大東建託	29,800	15,580.00	464,284,000
新日本建設	10,800	990.00	10,692,000
N I P P O	21,700	2,122.00	46,047,400
東亜道路工業	2,300	3,080.00	7,084,000
前田道路	26,300	2,161.00	56,834,300
日本道路	2,400	6,580.00	15,792,000
東亜建設工業	8,300	1,586.00	13,163,800
若築建設	5,800	1,504.00	8,723,200
東洋建設	32,900	422.00	13,883,800
五洋建設	100,700	541.00	54,478,700
世紀東急工業	15,400	630.00	9,702,000
福田組	3,100	4,360.00	13,516,000
住友林業	59,200	1,421.00	84,123,200
巴コーポレーション	16,600	387.00	6,424,200
大和ハウス工業	230,800	3,333.00	769,256,400
ライト工業	16,300	1,488.00	24,254,400



積水ハウス	255,900	1,616.00	413,534,400
日特建設	9,500	616.00	5,852,000
ユアテック	14,300	882.00	12,612,600
中電工	10,700	2,363.00	25,284,100
関電工	37,700	1,030.00	38,831,000
きんでん	55,600	1,813.00	100,802,800
東京エネシス	9,400	1,020.00	9,588,000
トーエネック	2,900	3,290.00	9,541,000
住友電設	6,200	1,872.00	11,606,400
日本電設工業	13,900	2,291.00	31,844,900
協和エクシオ	32,800	2,809.00	92,135,200
新日本空調	7,500	1,992.00	14,940,000
九電工	16,400	3,830.00	62,812,000
三機工業	18,800	1,172.00	22,033,600
日揮	72,200	1,740.00	125,628,000
中外炉工業	3,200	1,732.00	5,542,400
ヤマト	10,600	464.00	4,918,400
太平電業	5,800	2,468.00	14,314,400
高砂熱学工業	20,700	1,794.00	37,135,800
朝日工業社	2,300	2,948.00	6,780,400
明星工業	16,600	726.00	12,051,600
大気社	11,500	3,200.00	36,800,000
ダイダン	5,900	2,443.00	14,413,700
日比谷総合設備	8,200	1,883.00	15,440,600
東芝プラントシステム	18,000	2,067.00	37,206,000
OSJBホールディングス	41,700	283.00	11,801,100
新興プランテック	15,500	1,218.00	18,879,000
日本製粉	23,600	1,893.00	44,674,800
日清製粉グループ本社	83,300	2,345.00	195,338,500
日東富士製粉	800	6,290.00	5,032,000
昭和産業	6,600	3,005.00	19,833,000
鳥越製粉	9,100	780.00	7,098,000
中部飼料	9,200	1,110.00	10,212,000
フィード・ワン	52,400	180.00	9,432,000
日本甜菜製糖	5,300	1,815.00	9,619,500
三井製糖	5,700	2,919.00	16,638,300
日新製糖	3,800	2,059.00	7,824,200
森永製菓	18,800	4,940.00	92,872,000
中村屋	2,500	4,255.00	10,637,500
江崎グリコ	22,500	5,710.00	128,475,000
名糖産業	5,400	1,367.00	7,381,800
井村屋グループ	3,600	2,493.00	8,974,800

不二家	4,500	2,335.00	10,507,500
山崎製パン	60,900	1,905.00	116,014,500
モロゾフ	1,600	4,995.00	7,992,000
亀田製菓	4,600	5,190.00	23,874,000
寿スピリッツ	7,800	4,365.00	34,047,000
カルビー	34,000	3,160.00	107,440,000
森永乳業	15,100	3,445.00	52,019,500
六甲バター	5,700	1,966.00	11,206,200
ヤクルト本社	55,200	7,390.00	407,928,000
明治ホールディングス	52,700	8,760.00	461,652,000
雪印メグミルク	18,000	2,725.00	49,050,000
プリマハム	10,300	2,146.00	22,103,800
日本ハム	32,100	4,350.00	139,635,000
丸大食品	8,300	1,931.00	16,027,300
S Foods	6,600	4,065.00	26,829,000
伊藤ハム米久ホールディングス	46,600	661.00	30,802,600
サッポロホールディングス	27,400	2,388.00	65,431,200
アサヒグループホールディングス	156,200	4,769.00	744,917,800
キリンホールディングス	337,400	2,577.50	869,648,500
宝ホールディングス	56,200	1,221.00	68,620,200
オエノンホールディングス	24,800	377.00	9,349,600
養命酒製造	3,200	2,102.00	6,726,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	57,100	3,000.00	171,300,000
サントリー食品インターナショナル	49,700	4,760.00	236,572,000
ダイドーグループホールディングス	4,100	5,390.00	22,099,000
伊藤園	22,700	5,090.00	115,543,000
キーコーヒー	7,200	2,072.00	14,918,400
日清オイリオグループ	9,400	3,420.00	32,148,000
不二製油グループ本社	18,200	3,620.00	65,884,000
かどや製油	1,000	4,980.00	4,980,000
J - オイルミルズ	3,700	4,080.00	15,096,000
キッコーマン	49,000	5,470.00	268,030,000
味の素	165,000	1,662.50	274,312,500
キューピー	41,600	2,553.00	106,204,800
ハウス食品グループ本社	28,400	4,345.00	123,398,000
カゴメ	29,900	2,976.00	88,982,400
焼津水産化学工業	7,700	1,143.00	8,801,100
アリアケジャパン	6,700	5,940.00	39,798,000
ニチレイ	38,700	2,739.00	105,999,300
東洋水産	38,300	4,140.00	158,562,000
イトアンド	3,800	1,682.00	6,391,600
日清食品ホールディングス	31,500	7,600.00	239,400,000

永谷園ホールディングス	4,600	2,409.00	11,081,400
一正蒲鉾	3,900	1,080.00	4,212,000
フジッコ	8,000	2,328.00	18,624,000
ロック・フィールド	7,800	1,610.00	12,558,000
日本たばこ産業	430,900	2,800.00	1,206,520,000
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,251.00	10,579,700
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,949.00	9,939,900
なとり	5,500	1,692.00	9,306,000
ピククルスコーポレーション	2,300	1,981.00	4,556,300
北の達人コーポレーション	30,000	424.00	12,720,000
ユーグレナ	32,100	637.00	20,447,700
ミヨシ油脂	5,300	1,048.00	5,554,400
理研ビタミン	3,600	3,560.00	12,816,000
片倉工業	10,000	1,211.00	12,110,000
グンゼ	5,200	5,110.00	26,572,000
東洋紡	31,700	1,641.00	52,019,700
ユニチカ	22,300	500.00	11,150,000
富士紡ホールディングス	4,300	2,875.00	12,362,500
倉敷紡績	6,900	2,295.00	15,835,500
シキボウ	6,300	1,053.00	6,633,900
日本毛織	23,800	891.00	21,205,800
ダイドーリミテッド	23,000	346.00	7,958,000
帝国繊維	8,400	2,447.00	20,554,800
帝人	59,000	1,870.00	110,330,000
東レ	565,700	796.90	450,806,330
住江織物	2,500	2,659.00	6,647,500
アツギ	8,700	959.00	8,343,300
ダイニック	6,200	748.00	4,637,600
セーレン	17,900	1,932.00	34,582,800
小松マテーレ	13,100	835.00	10,938,500
ワコールホールディングス	21,400	2,849.00	60,968,600
ホギメディカル	9,200	3,835.00	35,282,000
T S Iホールディングス	27,000	699.00	18,873,000
マツオカコーポレーション	2,600	3,135.00	8,151,000
ワールド	8,000	2,085.00	16,680,000
三陽商会	5,100	1,710.00	8,721,000
オンワードホールディングス	45,400	671.00	30,463,400
ゴールドウイン	6,600	13,110.00	86,526,000
デサント	17,600	2,529.00	44,510,400
特種東海製紙	4,600	3,960.00	18,216,000
王子ホールディングス	325,500	662.00	215,481,000
日本製紙	34,600	2,024.00	70,030,400

三菱製紙	14,800	553.00	8,184,400
北越コーポレーション	46,900	636.00	29,828,400
中越パルプ工業	4,000	1,373.00	5,492,000
巴川製紙所	3,700	1,024.00	3,788,800
大王製紙	34,400	1,302.00	44,788,800
レンゴー	75,100	908.00	68,190,800
トーモク	5,200	1,638.00	8,517,600
ザ・パック	5,400	3,270.00	17,658,000
クラレ	122,300	1,540.00	188,342,000
旭化成	518,200	1,171.50	607,071,300
昭和電工	48,400	3,885.00	188,034,000
住友化学	573,500	560.00	321,160,000
住友精化	3,500	4,295.00	15,032,500
日産化学	44,600	5,600.00	249,760,000
ラサ工業	3,600	1,434.00	5,162,400
クレハ	6,600	7,030.00	46,398,000
多木化学	2,200	5,590.00	12,298,000
テイカ	6,500	2,090.00	13,585,000
石原産業	14,300	1,122.00	16,044,600
日本曹達	11,500	2,969.00	34,143,500
東ソー	112,200	1,649.00	185,017,800
トクヤマ	21,100	2,872.00	60,599,200
セントラル硝子	16,500	2,552.00	42,108,000
東亜合成	46,100	1,228.00	56,610,800
大阪ソーダ	7,900	2,790.00	22,041,000
関東電化工業	17,700	893.00	15,806,100
デンカ	28,600	3,490.00	99,814,000
信越化学工業	128,300	9,497.00	1,218,465,100
日本カーバイド工業	3,200	1,566.00	5,011,200
堺化学工業	5,200	2,460.00	12,792,000
第一稀元素化学工業	7,100	906.00	6,432,600
エア・ウォーター	59,800	1,809.00	108,178,200
大陽日酸	60,000	1,581.00	94,860,000
日本化学工業	2,900	2,379.00	6,899,100
日本パーカライズン	40,400	1,449.00	58,539,600
高压ガス工業	12,800	814.00	10,419,200
四国化成工業	12,300	1,318.00	16,211,400
戸田工業	2,200	2,249.00	4,947,800
ステラ ケミファ	4,600	3,135.00	14,421,000
保土谷化学工業	3,100	2,846.00	8,822,600
日本触媒	12,300	7,560.00	92,988,000
大日精化工業	6,000	3,115.00	18,690,000

カネカ	19,200	4,490.00	86,208,000
三菱瓦斯化学	74,900	1,800.00	134,820,000
三井化学	65,700	2,799.00	183,894,300
J S R	73,200	1,894.00	138,640,800
東京応化工業	12,700	3,420.00	43,434,000
大阪有機化学工業	7,500	1,202.00	9,015,000
三菱ケミカルホールディングス	486,200	821.00	399,170,200
K Hネオケム	11,100	2,950.00	32,745,000
ダイセル	113,000	1,131.00	127,803,000
住友ベークライト	12,700	4,245.00	53,911,500
積水化学工業	159,100	1,749.00	278,265,900
日本ゼオン	65,900	1,174.00	77,366,600
アイカ工業	21,900	3,865.00	84,643,500
宇部興産	36,700	2,601.00	95,456,700
積水樹脂	11,800	2,160.00	25,488,000
タキロンシーアイ	16,900	616.00	10,410,400
旭有機材	5,700	1,670.00	9,519,000
日立化成	33,500	2,040.00	68,340,000
ニチバン	4,300	2,282.00	9,812,600
リケンテクノス	21,800	475.00	10,355,000
大倉工業	4,400	1,800.00	7,920,000
積水化成品工業	12,000	957.00	11,484,000
群栄化学工業	2,500	2,798.00	6,995,000
ダイキョーニシカワ	15,100	1,313.00	19,826,300
森六ホールディングス	4,400	2,606.00	11,466,400
日本化薬	46,400	1,299.00	60,273,600
カーリットホールディングス	9,500	854.00	8,113,000
日本精化	7,300	1,206.00	8,803,800
扶桑化学工業	7,300	2,179.00	15,906,700
トリケミカル研究所	1,800	5,150.00	9,270,000
A D E K A	36,200	1,714.00	62,046,800
日油	28,100	3,780.00	106,218,000
ハリマ化成グループ	7,300	1,109.00	8,095,700
花王	180,500	8,212.00	1,482,266,000
第一工業製薬	3,000	3,095.00	9,285,000
石原ケミカル	2,800	1,811.00	5,070,800
三洋化成工業	4,700	5,540.00	26,038,000
大日本塗料	9,300	1,121.00	10,425,300
日本ペイントホールディングス	60,000	3,960.00	237,600,000
関西ペイント	81,800	2,010.00	164,418,000
中国塗料	24,000	1,005.00	24,120,000
日本特殊塗料	6,100	1,381.00	8,424,100

藤倉化成	12,600	610.00	7,686,000
太陽ホールディングス	5,900	3,790.00	22,361,000
D I C	32,900	3,560.00	117,124,000
サカタインクス	15,800	1,249.00	19,734,200
東洋インキS Cホールディングス	15,000	2,655.00	39,825,000
T & K T O K A	6,600	1,017.00	6,712,200
富士フィルムホールディングス	154,500	5,033.00	777,598,500
資生堂	147,800	7,254.00	1,072,141,200
ライオン	103,600	2,232.00	231,235,200
高砂香料工業	5,200	3,615.00	18,798,000
マンダム	16,500	2,730.00	45,045,000
ミルボン	9,200	5,310.00	48,852,000
ファンケル	33,200	2,487.00	82,568,400
コーセー	12,600	18,590.00	234,234,000
コタ	4,400	1,475.00	6,490,000
ポーラ・オルビスホールディングス	31,700	3,365.00	106,670,500
ノエビアホールディングス	4,600	5,310.00	24,426,000
エステー	5,800	1,893.00	10,979,400
アグロ カネショウ	3,400	2,088.00	7,099,200
コニシ	13,100	1,710.00	22,401,000
長谷川香料	9,100	1,743.00	15,861,300
星光P M C	6,000	837.00	5,022,000
小林製薬	20,800	8,910.00	185,328,000
荒川化学工業	7,300	1,358.00	9,913,400
メック	5,900	1,145.00	6,755,500
日本高純度化学	3,200	2,349.00	7,516,800
タカラバイオ	19,300	2,366.00	45,663,800
J C U	9,800	1,864.00	18,267,200
デクセリアルズ	19,400	788.00	15,287,200
アース製薬	5,500	4,910.00	27,005,000
北興化学工業	10,500	554.00	5,817,000
大成ラミック	3,600	2,876.00	10,353,600
クミアイ化学工業	30,500	717.00	21,868,500
日本農薬	19,700	490.00	9,653,000
アキレス	5,900	2,086.00	12,307,400
有沢製作所	13,100	825.00	10,807,500
日東電工	56,200	6,016.00	338,099,200
レック	8,100	1,689.00	13,680,900
藤森工業	6,400	3,035.00	19,424,000
前澤化成工業	7,700	1,032.00	7,946,400
未来工業	4,000	2,399.00	9,596,000
J S P	4,800	2,458.00	11,798,400

エフピコ	6,100	6,430.00	39,223,000
天馬	5,600	2,032.00	11,379,200
信越ポリマー	14,000	829.00	11,606,000
東リ	24,400	269.00	6,563,600
ニフコ	29,700	2,802.00	83,219,400
バルカー	6,200	2,303.00	14,278,600
ユニ・チャーム	157,800	3,509.00	553,720,200
協和発酵キリン	92,600	2,149.00	198,997,400
武田薬品工業	471,700	4,508.00	2,126,423,600
アステラス製薬	685,600	1,689.50	1,158,321,200
大日本住友製薬	55,100	2,681.00	147,723,100
塩野義製薬	97,200	6,954.00	675,928,800
田辺三菱製薬	77,400	1,630.00	126,162,000
あすか製薬	9,800	1,223.00	11,985,400
日本新薬	19,500	7,000.00	136,500,000
中外製薬	77,200	7,080.00	546,576,000
科研製薬	13,500	5,380.00	72,630,000
エーザイ	89,000	8,760.00	779,640,000
ロート製薬	38,200	3,025.00	115,555,000
小野薬品工業	175,900	2,273.50	399,908,650
久光製薬	22,000	5,640.00	124,080,000
持田製薬	5,700	11,190.00	63,783,000
参天製薬	140,800	1,559.00	219,507,200
扶桑薬品工業	3,800	2,489.00	9,458,200
日本ケミファ	1,700	2,932.00	4,984,400
ツムラ	23,200	3,545.00	82,244,000
日医工	18,900	1,599.00	30,221,100
キッセイ薬品工業	13,400	2,932.00	39,288,800
生化学工業	14,600	1,309.00	19,111,400
栄研化学	13,100	2,530.00	33,143,000
鳥居薬品	4,200	2,257.00	9,479,400
JCRファーマ	5,300	5,750.00	30,475,000
東和薬品	3,600	8,820.00	31,752,000
富士製薬工業	5,300	1,790.00	9,487,000
沢井製薬	15,200	5,910.00	89,832,000
ゼリア新薬工業	14,700	1,919.00	28,209,300
第一三共	212,900	3,798.00	808,594,200
キョーリン製薬ホールディングス	16,700	2,257.00	37,691,900
大幸薬品	4,100	1,818.00	7,453,800
ダイト	4,500	2,825.00	12,712,500
大塚ホールディングス	141,700	4,447.00	630,139,900
大正製薬ホールディングス	16,600	11,360.00	188,576,000

ペプチドリーム	37,300	5,030.00	187,619,000
日本コークス工業	75,000	100.00	7,500,000
昭和シェル石油	68,400	1,726.00	118,058,400
ニチレキ	10,100	1,143.00	11,544,300
ユシロ化学工業	5,100	1,312.00	6,691,200
富士石油	21,300	287.00	6,113,100
MORESCO	3,800	1,629.00	6,190,200
出光興産	57,500	4,090.00	235,175,000
JXTGホールディングス	1,249,800	573.90	717,260,220
コスモエネルギーホールディングス	21,200	2,466.00	52,279,200
横浜ゴム	43,300	2,345.00	101,538,500
TOYO TIRE	38,900	1,531.00	59,555,900
ブリヂストン	228,800	4,402.00	1,007,177,600
住友ゴム工業	67,300	1,427.00	96,037,100
オカモト	5,200	5,880.00	30,576,000
ニッタ	8,400	3,810.00	32,004,000
住友理工	14,600	1,070.00	15,622,000
三ツ星ベルト	10,300	2,196.00	22,618,800
バンドー化学	15,200	1,195.00	18,164,000
日東紡績	11,100	1,979.00	21,966,900
AGC	73,100	3,925.00	286,917,500
日本板硝子	33,500	980.00	32,830,000
日本山村硝子	4,500	1,505.00	6,772,500
日本電気硝子	32,300	2,974.00	96,060,200
オハラ	3,100	1,764.00	5,468,400
住友大阪セメント	15,200	4,745.00	72,124,000
太平洋セメント	46,900	3,725.00	174,702,500
日本ヒューム	8,900	813.00	7,235,700
日本コンクリート工業	20,500	281.00	5,760,500
三谷セキサン	3,700	2,793.00	10,334,100
アジアパイルホールディングス	11,700	636.00	7,441,200
東海カーボン	67,700	1,534.00	103,851,800
日本カーボン	3,600	5,320.00	19,152,000
東洋炭素	4,600	2,122.00	9,761,200
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	5,170.00	23,265,000
TOTO	57,000	4,340.00	247,380,000
日本碍子	90,200	1,670.00	150,634,000
日本特殊陶業	62,600	2,364.00	147,986,400
MARUWA	2,600	6,420.00	16,692,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,350.00	7,370,000
黒崎播磨	1,500	5,740.00	8,610,000
ヨータイ	8,700	603.00	5,246,100



東京窯業	12,600	388.00	4,888,800
ニッカトー	4,800	1,015.00	4,872,000
フジインコーポレーテッド	6,700	2,341.00	15,684,700
ニチアス	20,000	2,057.00	41,140,000
ニチハ	10,300	3,075.00	31,672,500
新日鐵住金	341,500	2,059.00	703,148,500
神戸製鋼所	135,100	882.00	119,158,200
中山製鋼所	13,000	485.00	6,305,000
合同製鐵	4,300	1,782.00	7,662,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,900	1,944.00	386,661,600
東京製鐵	39,300	894.00	35,134,200
共英製鋼	8,400	1,661.00	13,952,400
大和工業	15,900	3,035.00	48,256,500
東京鐵鋼	4,700	1,166.00	5,480,200
大阪製鐵	5,700	1,828.00	10,419,600
淀川製鋼所	9,700	2,231.00	21,640,700
丸一鋼管	26,200	3,280.00	85,936,000
モリ工業	2,700	2,547.00	6,876,900
大同特殊鋼	12,100	4,595.00	55,599,500
日本冶金工業	62,700	241.00	15,110,700
山陽特殊製鋼	9,400	2,486.00	23,368,400
愛知製鋼	4,100	3,520.00	14,432,000
日立金属	79,100	1,109.00	87,721,900
大平洋金属	5,200	2,832.00	14,726,400
新日本電工	50,200	237.00	11,897,400
栗本鐵工所	4,600	1,504.00	6,918,400
三菱製鋼	6,300	1,662.00	10,470,600
シンニッタン	14,700	341.00	5,012,700
大紀アルミニウム工業所	13,100	624.00	8,174,400
日本輕金属ホールディングス	203,400	244.00	49,629,600
三井金属鉱業	20,200	2,659.00	53,711,800
東邦亜鉛	4,100	3,165.00	12,976,500
三菱マテリアル	48,600	3,070.00	149,202,000
住友金属鉱山	101,100	3,035.00	306,838,500
D O W A ホールディングス	17,300	3,510.00	60,723,000
古河機械金属	12,300	1,462.00	17,982,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,700	1,869.00	16,260,300
東邦チタニウム	13,400	979.00	13,118,600
U A C J	11,100	2,200.00	24,420,000
C K サンエツ	1,800	3,035.00	5,463,000
古河電気工業	21,400	3,560.00	76,184,000
住友電気工業	275,200	1,530.00	421,056,000

フジクラ	90,900	490.00	44,541,000
タツタ電線	16,300	522.00	8,508,600
平河ヒューテック	4,000	1,632.00	6,528,000
リョービ	9,100	2,667.00	24,269,700
アーレスティ	11,000	715.00	7,865,000
アサヒホールディングス	13,900	2,174.00	30,218,600
稲葉製作所	5,700	1,268.00	7,227,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,070.00	6,831,000
トーカロ	19,600	949.00	18,600,400
アルファC o	4,300	1,380.00	5,934,000
SUMCO	81,500	1,590.00	129,585,000
川田テクノロジーズ	1,700	6,790.00	11,543,000
RS Technologies	2,200	3,180.00	6,996,000
東洋製罐グループホールディングス	46,700	2,223.00	103,814,100
ホッカンホールディングス	4,800	1,789.00	8,587,200
コロナ	5,900	1,063.00	6,271,700
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,961.00	27,061,800
三和ホールディングス	75,700	1,293.00	97,880,100
文化シャッター	22,400	803.00	17,987,200
三協立山	10,500	1,425.00	14,962,500
アルインコ	8,900	991.00	8,819,900
LIXILグループ	108,600	1,607.00	174,520,200
ノーリツ	16,300	1,655.00	26,976,500
長府製作所	7,400	2,238.00	16,561,200
リンナイ	13,200	7,500.00	99,000,000
日東精工	14,000	550.00	7,700,000
岡部	15,500	956.00	14,818,000
ジーテクト	8,300	1,782.00	14,790,600
東プレ	13,300	2,406.00	31,999,800
高周波熱錬	14,900	898.00	13,380,200
東京製綱	7,000	1,053.00	7,371,000
パイオラックス	11,600	2,417.00	28,037,200
エイチワン	9,300	1,134.00	10,546,200
日本発條	73,700	1,060.00	78,122,000
三益半導体工業	6,800	1,497.00	10,179,600
日本製綱所	22,500	2,061.00	46,372,500
三浦工業	31,900	2,577.00	82,206,300
タクマ	26,800	1,474.00	39,503,200
ツガミ	17,000	753.00	12,801,000
オークマ	9,400	6,030.00	56,682,000
東芝機械	8,200	2,321.00	19,032,200
アマダホールディングス	113,100	1,180.00	133,458,000

アイダエンジニアリング	20,100	827.00	16,622,700
F U J I	21,400	1,552.00	33,212,800
牧野フライス製作所	8,400	4,470.00	37,548,000
オーエスジー	36,500	2,265.00	82,672,500
旭ダイヤモンド工業	19,800	785.00	15,543,000
D M G 森精機	46,500	1,529.00	71,098,500
ソディック	16,600	836.00	13,877,600
ディスコ	10,000	16,640.00	166,400,000
日東工器	4,400	2,312.00	10,172,800
日進工具	2,400	2,500.00	6,000,000
豊和工業	5,300	884.00	4,685,200
津田駒工業	2,200	1,966.00	4,325,200
島精機製作所	10,200	3,710.00	37,842,000
オプトラン	7,200	2,150.00	15,480,000
フリュー	7,600	1,038.00	7,888,800
ヤマシンフィルタ	13,200	684.00	9,028,800
日阪製作所	10,500	894.00	9,387,000
やまびこ	13,900	1,056.00	14,678,400
平田機工	3,500	6,800.00	23,800,000
ペガサスミシン製造	8,600	658.00	5,658,800
ナプテスコ	40,500	3,145.00	127,372,500
三井海洋開発	7,900	3,105.00	24,529,500
レオン自動機	7,500	1,586.00	11,895,000
S M C	21,800	39,250.00	855,650,000
ホソカワミクロン	2,800	4,845.00	13,566,000
ユニオンツール	3,300	3,100.00	10,230,000
オイレス工業	10,200	1,947.00	19,859,400
日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,010.00	9,223,000
サトーホールディングス	8,900	2,696.00	23,994,400
技研製作所	5,200	3,280.00	17,056,000
日精樹脂工業	7,300	938.00	6,847,400
オカダアイヨン	3,200	1,486.00	4,755,200
小松製作所	336,700	2,764.50	930,807,150
住友重機械工業	42,300	3,805.00	160,951,500
日立建機	29,600	2,882.00	85,307,200
日工	2,800	2,228.00	6,238,400
巴工業	3,700	2,403.00	8,891,100
井関農機	7,900	1,684.00	13,303,600
T O W A	7,800	707.00	5,514,600
北川鉄工所	3,800	2,438.00	9,264,400
ローツェ	3,600	1,782.00	6,415,200
クボタ	398,800	1,532.50	611,161,000

荏原実業	3,500	2,194.00	7,679,000
三菱化工機	3,900	1,559.00	6,080,100
月島機械	15,000	1,412.00	21,180,000
帝国電機製作所	6,000	1,240.00	7,440,000
新東工業	17,600	1,017.00	17,899,200
澁谷工業	6,500	3,315.00	21,547,500
アイチ コーポレーション	14,200	716.00	10,167,200
小森コーポレーション	20,200	1,180.00	23,836,000
鶴見製作所	6,000	1,803.00	10,818,000
住友精密工業	2,000	2,893.00	5,786,000
酒井重工業	2,000	2,407.00	4,814,000
荏原製作所	33,200	3,170.00	105,244,000
西島製作所	9,800	956.00	9,368,800
北越工業	8,100	1,196.00	9,687,600
ダイキン工業	101,500	12,090.00	1,227,135,000
オルガノ	3,100	3,090.00	9,579,000
トーヨーカネツ	3,300	2,412.00	7,959,600
栗田工業	40,200	2,979.00	119,755,800
椿本チエイン	9,400	4,125.00	38,775,000
大同工業	5,700	920.00	5,244,000
アネスト岩田	11,800	1,067.00	12,590,600
ダイフク	40,800	5,790.00	236,232,000
加藤製作所	4,200	2,681.00	11,260,200
タダノ	36,300	1,208.00	43,850,400
フジテック	26,600	1,213.00	32,265,800
C K D	20,600	1,094.00	22,536,400
キトー	6,100	1,880.00	11,468,000
平和	20,700	2,211.00	45,767,700
理想科学工業	6,700	1,873.00	12,549,100
S A N K Y O	18,700	4,070.00	76,109,000
日本金銭機械	9,400	1,094.00	10,283,600
マースグループホールディングス	5,200	2,171.00	11,289,200
福島工業	4,600	3,925.00	18,055,000
ダイコク電機	4,300	1,498.00	6,441,400
竹内製作所	12,200	2,031.00	24,778,200
アマノ	21,500	2,411.00	51,836,500
J U K I	10,400	1,302.00	13,540,800
サンデンホールディングス	9,700	851.00	8,254,700
蛇の目ミシン工業	10,400	489.00	5,085,600
マックス	11,400	1,479.00	16,860,600
グローリー	20,700	2,700.00	55,890,000
新晃工業	7,400	1,542.00	11,410,800

大和冷機工業	10,800	1,248.00	13,478,400
セガサミーホールディングス	74,100	1,291.00	95,663,100
日本ピストンリング	3,500	1,725.00	6,037,500
リケン	3,400	5,190.00	17,646,000
T P R	9,700	2,469.00	23,949,300
ツバキ・ナカシマ	11,500	1,933.00	22,229,500
ホシザキ	21,800	7,350.00	160,230,000
大豊工業	6,900	1,048.00	7,231,200
日本精工	150,900	1,055.00	159,199,500
N T N	158,600	353.00	55,985,800
ジェイテクト	70,500	1,413.00	99,616,500
不二越	7,100	4,470.00	31,737,000
日本トムソン	23,600	584.00	13,782,400
T H K	46,400	2,873.00	133,307,200
ユーシン精機	6,300	1,053.00	6,633,900
前澤給装工業	4,100	1,879.00	7,703,900
イーグル工業	9,300	1,311.00	12,192,300
日本ピラー工業	8,300	1,425.00	11,827,500
キッツ	30,000	881.00	26,430,000
マキタ	90,400	4,025.00	363,860,000
日立造船	57,800	358.00	20,692,400
三菱重工業	124,500	4,307.00	536,221,500
I H I	57,100	3,280.00	187,288,000
スター精密	12,800	1,661.00	21,260,800
日清紡ホールディングス	41,900	956.00	40,056,400
イビデン	45,900	1,567.00	71,925,300
コニカミノルタ	162,100	1,079.00	174,905,900
ブラザー工業	96,700	2,125.00	205,487,500
ミネベアミツミ	137,700	1,811.00	249,374,700
日立製作所	334,600	3,512.00	1,175,115,200
三菱電機	743,100	1,444.50	1,073,407,950
富士電機	48,200	3,440.00	165,808,000
東洋電機製造	4,400	1,328.00	5,843,200
安川電機	86,200	3,265.00	281,443,000
シンフォニアテクノロジー	10,500	1,419.00	14,899,500
明電舎	14,700	1,638.00	24,078,600
オリジン電気	3,200	2,311.00	7,395,200
山洋電気	3,700	4,115.00	15,225,500
デンヨー	7,700	1,426.00	10,980,200
東芝テック	9,600	2,958.00	28,396,800
芝浦メカトロニクス	1,700	3,485.00	5,924,500
マブチモーター	20,500	3,865.00	79,232,500

日本電産	89,500	13,540.00	1,211,830,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	1,844.00	7,744,800
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,152.00	3,916,800
東光高岳	4,600	1,432.00	6,587,200
ダブル・スコープ	11,200	1,314.00	14,716,800
ダイヘン	8,200	2,805.00	23,001,000
ヤーマン	10,800	1,358.00	14,666,400
JVCケンウッド	57,500	266.00	15,295,000
ミマキエンジニアリング	7,300	790.00	5,767,000
第一精工	3,900	1,143.00	4,457,700
日新電機	17,700	1,026.00	18,160,200
大崎電気工業	16,200	717.00	11,615,400
オムロン	78,800	4,935.00	388,878,000
日東工業	12,100	2,268.00	27,442,800
I D E C	10,200	2,071.00	21,124,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	27,100	2,268.00	61,462,800
サクサホールディングス	2,700	1,845.00	4,981,500
メルコホールディングス	3,200	4,010.00	12,832,000
日本電気	96,100	3,740.00	359,414,000
富士通	71,700	7,741.00	555,029,700
沖電気工業	33,000	1,304.00	43,032,000
電気興業	4,500	2,661.00	11,974,500
サンケン電気	8,900	2,274.00	20,238,600
アイホン	5,400	1,748.00	9,439,200
ルネサスエレクトロニクス	76,400	723.00	55,237,200
セイコーエプソン	92,000	1,675.00	154,100,000
ワコム	55,300	493.00	27,262,900
アルバック	14,300	3,225.00	46,117,500
E I Z O	6,800	4,745.00	32,266,000
日本信号	18,800	992.00	18,649,600
京三製作所	18,500	407.00	7,529,500
能美防災	9,900	2,037.00	20,166,300
ホーチキ	5,500	1,120.00	6,160,000
エレコム	6,800	3,355.00	22,814,000
パナソニック	849,200	1,042.00	884,866,400
シャープ	74,000	1,325.00	98,050,000
アンリツ	48,300	2,201.00	106,308,300
富士通ゼネラル	23,300	1,486.00	34,623,800
ソニー	498,600	5,080.00	2,532,888,000
T D K	38,800	8,830.00	342,604,000
帝国通信工業	5,400	1,226.00	6,620,400
タムラ製作所	28,600	608.00	17,388,800

アルプスアルパイン	77,200	2,346.00	181,111,200
日本トリム	1,600	5,570.00	8,912,000
ローランド ディー・ジー	4,300	2,311.00	9,937,300
フォスター電機	9,400	1,636.00	15,378,400
クラリオン	6,200	2,500.00	15,500,000
S M K	2,600	2,688.00	6,988,800
ヨコオ	5,700	1,632.00	9,302,400
ホシデン	22,100	917.00	20,265,700
ヒロセ電機	10,700	11,990.00	128,293,000
日本航空電子工業	17,100	1,499.00	25,632,900
T O A	8,600	1,064.00	9,150,400
マクセルホールディングス	16,100	1,676.00	26,983,600
古野電気	10,100	944.00	9,534,400
ユニデンホールディングス	2,900	2,350.00	6,815,000
スミダコーポレーション	7,000	1,497.00	10,479,000
アイコム	4,700	2,175.00	10,222,500
リオン	4,000	1,909.00	7,636,000
本多通信工業	8,300	556.00	4,614,800
船井電機	10,700	719.00	7,693,300
横河電機	74,500	2,142.00	159,579,000
新電元工業	2,800	4,670.00	13,076,000
アズビル	48,100	2,436.00	117,171,600
東亜ディーケーケー	4,600	826.00	3,799,600
日本光電工業	32,900	3,470.00	114,163,000
チノー	4,500	1,297.00	5,836,500
共和電業	15,800	370.00	5,846,000
堀場製作所	14,900	6,060.00	90,294,000
アドバンテスト	50,900	2,711.00	137,989,900
エスベック	6,900	2,062.00	14,227,800
キーエンス	36,500	62,500.00	2,281,250,000
日置電機	4,000	4,540.00	18,160,000
シスメックス	58,100	6,670.00	387,527,000
日本マイクロニクス	13,400	829.00	11,108,600
メガチップス	6,100	2,281.00	13,914,100
O B A R A G R O U P	4,300	4,095.00	17,608,500
コーセル	11,400	1,169.00	13,326,600
イリソ電子工業	6,800	4,945.00	33,626,000
オブテックスグループ	13,300	2,240.00	29,792,000
千代田インテグレ	3,600	2,143.00	7,714,800
アイ・オー・データ機器	4,300	1,207.00	5,190,100
レーザーテック	15,200	4,345.00	66,044,000
スタンレー電気	52,500	3,270.00	171,675,000

岩崎電気	4,700	1,375.00	6,462,500
ウシオ電機	45,900	1,314.00	60,312,600
ハリオス テクノ ホールディング	8,800	708.00	6,230,400
日本セラミック	7,800	2,741.00	21,379,800
古河電池	6,800	736.00	5,004,800
山一電機	5,800	1,218.00	7,064,400
図研	5,400	1,627.00	8,785,800
日本電子	14,700	1,774.00	26,077,800
カシオ計算機	66,000	1,537.00	101,442,000
ファナック	70,700	19,400.00	1,371,580,000
日本シイエムケイ	19,400	713.00	13,832,200
エンプラス	3,700	3,100.00	11,470,000
ローム	35,900	7,770.00	278,943,000
浜松ホトニクス	53,300	4,080.00	217,464,000
三井ハイテック	8,700	1,058.00	9,204,600
新光電気工業	24,300	860.00	20,898,000
京セラ	113,400	6,246.00	708,296,400
太陽誘電	33,400	2,384.00	79,625,600
村田製作所	78,000	17,285.00	1,348,230,000
ユーシン	13,900	983.00	13,663,700
双葉電子工業	12,100	1,761.00	21,308,100
ニチコン	23,800	1,016.00	24,180,800
日本ケミコン	5,400	2,162.00	11,674,800
K O A	11,500	1,632.00	18,768,000
市光工業	11,700	670.00	7,839,000
小糸製作所	44,400	6,710.00	297,924,000
ミツバ	14,300	725.00	10,367,500
S C R E E Nホールディングス	13,000	4,750.00	61,750,000
キャノン電子	6,600	1,871.00	12,348,600
キャノン	399,900	3,198.00	1,278,880,200
リコー	223,600	1,116.00	249,537,600
象印マホービン	14,200	1,179.00	16,741,800
東京エレクトロン	49,600	15,895.00	788,392,000
トヨタ紡織	26,100	1,825.00	47,632,500
ユニプレス	14,500	2,067.00	29,971,500
豊田自動織機	59,800	5,590.00	334,282,000
モリタホールディングス	12,900	1,817.00	23,439,300
三櫻工業	11,900	572.00	6,806,800
デンソー	163,500	4,801.00	784,963,500
東海理化電機製作所	19,900	2,017.00	40,138,300
三井E & Sホールディングス	27,900	1,211.00	33,786,900
川崎重工業	57,800	2,855.00	165,019,000



名村造船所	24,400	444.00	10,833,600	
日本車輛製造	3,300	2,600.00	8,580,000	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,389.00	12,778,800	
日産自動車	877,100	948.10	831,578,510	
いすゞ自動車	235,000	1,579.00	371,065,000	
トヨタ自動車	828,600	6,655.00	5,514,333,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	92,600	1,032.00	95,563,200	
三菱自動車工業	275,100	640.00	176,064,000	
エフテック	6,700	1,041.00	6,974,700	
武蔵精密工業	17,900	1,553.00	27,798,700	
日産車体	14,800	995.00	14,726,000	
新明和工業	34,400	1,388.00	47,747,200	
極東開発工業	14,900	1,528.00	22,767,200	
日信工業	13,600	1,584.00	21,542,400	
トピー工業	6,300	2,398.00	15,107,400	
ティラド	3,500	2,331.00	8,158,500	
タチエス	13,000	1,662.00	21,606,000	
N O K	40,100	1,824.00	73,142,400	
フタバ産業	21,300	609.00	12,971,700	
K Y B	7,900	3,135.00	24,766,500	
大同メタル工業	13,900	796.00	11,064,400	
プレス工業	37,100	631.00	23,410,100	
ミクニ	11,800	503.00	5,935,400	
太平洋工業	15,500	1,673.00	25,931,500	
ケーヒン	17,000	1,951.00	33,167,000	
河西工業	9,900	880.00	8,712,000	
アイシン精機	60,900	4,365.00	265,828,500	
マツダ	234,200	1,283.50	300,595,700	
今仙電機製作所	8,800	1,041.00	9,160,800	
本田技研工業	627,100	3,003.00	1,883,181,300	
スズキ	136,000	5,738.00	780,368,000	
S U B A R U	230,900	2,853.00	658,757,700	
安永	4,100	1,574.00	6,453,400	
ヤマハ発動機	104,600	2,231.00	233,362,600	
ショーワ	17,600	1,540.00	27,104,000	
T B K	16,500	418.00	6,897,000	
エクセディ	10,100	2,719.00	27,461,900	
豊田合成	24,200	2,440.00	59,048,000	
愛三工業	12,900	757.00	9,765,300	
日本プラスト	7,800	837.00	6,528,600	
ヨロズ	7,900	1,679.00	13,264,100	
エフ・シー・シー	13,500	2,631.00	35,518,500	

シマノ	29,900	16,840.00	503,516,000
テイ・エス テック	17,500	3,350.00	58,625,000
ジャムコ	4,000	2,579.00	10,316,000
テルモ	105,200	6,699.00	704,734,800
日機装	23,700	1,139.00	26,994,300
島津製作所	95,200	2,774.00	264,084,800
JMS	12,000	659.00	7,908,000
長野計器	7,400	791.00	5,853,400
ブイ・テクノロジー	1,700	14,720.00	25,024,000
東京計器	6,000	1,081.00	6,486,000
インターアクション	4,300	1,811.00	7,787,300
東京精密	13,300	3,090.00	41,097,000
マニー	8,900	4,985.00	44,366,500
ニコン	129,300	1,754.00	226,792,200
トプコン	40,000	1,533.00	61,320,000
オリンパス	110,600	4,775.00	528,115,000
理研計器	6,400	2,246.00	14,374,400
タムロン	6,800	2,015.00	13,702,000
HOYA	149,700	6,790.00	1,016,463,000
シード	3,500	1,281.00	4,483,500
ノーリツ鋼機	6,100	2,151.00	13,121,100
エー・アンド・デイ	7,900	747.00	5,901,300
朝日インテック	31,900	5,440.00	173,536,000
シチズン時計	82,300	631.00	51,931,300
リズム時計工業	3,500	1,649.00	5,771,500
大研医器	8,500	590.00	5,015,000
メニコン	10,000	2,949.00	29,490,000
松風	5,100	1,272.00	6,487,200
セイコーホールディングス	11,300	2,570.00	29,041,000
ニプロ	51,900	1,487.00	77,175,300
スノーピーク	3,600	1,354.00	4,874,400
パラマウントベッドホールディングス	8,500	5,120.00	43,520,000
トランザクション	5,100	705.00	3,595,500
ニホンフラッシュ	3,600	2,058.00	7,408,800
前田工織	8,200	2,809.00	23,033,800
永大産業	16,800	447.00	7,509,600
アートネイチャー	10,700	632.00	6,762,400
バンダイナムコホールディングス	76,800	4,845.00	372,096,000
SHOEI	3,700	4,160.00	15,392,000
フランスベッドホールディングス	12,800	878.00	11,238,400
パイロットコーポレーション	13,100	5,270.00	69,037,000
萩原工業	4,700	1,732.00	8,140,400

トッパン・フォームズ	15,700	969.00	15,213,300
フジシールインターナショナル	16,500	4,140.00	68,310,000
タカラトミー	31,300	1,117.00	34,962,100
廣濟堂	12,500	709.00	8,862,500
プロネクサス	7,900	1,230.00	9,717,000
大建工業	5,800	1,962.00	11,379,600
凸版印刷	104,300	1,745.00	182,003,500
大日本印刷	104,400	2,520.00	263,088,000
図書印刷	8,800	940.00	8,272,000
共同印刷	3,300	2,544.00	8,395,200
N I S S H A	15,400	1,429.00	22,006,600
宝印刷	5,100	1,657.00	8,450,700
アシックス	74,100	1,519.00	112,557,900
ヤマハ	44,200	5,290.00	233,818,000
河合楽器製作所	2,600	3,305.00	8,593,000
クリナップ	9,500	624.00	5,928,000
ピジョン	45,000	4,755.00	213,975,000
キングジム	8,800	817.00	7,189,600
リンテック	17,900	2,526.00	45,215,400
イトーキ	15,800	585.00	9,243,000
任天堂	45,800	29,675.00	1,359,115,000
三菱鉛筆	12,200	2,298.00	28,035,600
タカラスタンダード	14,800	1,719.00	25,441,200
コクヨ	36,000	1,608.00	57,888,000
ナカバヤシ	10,000	538.00	5,380,000
グローブライド	3,900	2,837.00	11,064,300
オカムラ	25,600	1,343.00	34,380,800
美津濃	7,500	2,602.00	19,515,000
東京電力ホールディングス	592,400	654.00	387,429,600
中部電力	227,200	1,707.50	387,944,000
関西電力	303,500	1,595.00	484,082,500
中国電力	102,300	1,470.00	150,381,000
北陸電力	73,400	892.00	65,472,800
東北電力	172,800	1,441.00	249,004,800
四国電力	67,100	1,450.00	97,295,000
九州電力	152,200	1,320.00	200,904,000
北海道電力	70,100	805.00	56,430,500
沖縄電力	13,800	2,063.00	28,469,400
電源開発	59,000	2,797.00	165,023,000
エフオン	5,800	859.00	4,982,200
イーレックス	13,400	791.00	10,599,400
レノバ	8,200	1,028.00	8,429,600

東京瓦斯	145,800	2,985.00	435,213,000
大阪瓦斯	143,500	2,209.00	316,991,500
東邦瓦斯	36,700	4,805.00	176,343,500
北海道瓦斯	5,600	1,452.00	8,131,200
広島ガス	21,900	346.00	7,577,400
西部瓦斯	8,400	2,495.00	20,958,000
静岡ガス	22,600	900.00	20,340,000
メタウォーター	3,800	3,135.00	11,913,000
SBSホールディングス	7,800	1,973.00	15,389,400
東武鉄道	78,000	3,090.00	241,020,000
相鉄ホールディングス	25,500	3,260.00	83,130,000
東京急行電鉄	200,800	1,810.00	363,448,000
京浜急行電鉄	101,800	1,814.00	184,665,200
小田急電鉄	118,500	2,457.00	291,154,500
京王電鉄	41,400	6,250.00	258,750,000
京成電鉄	55,500	3,715.00	206,182,500
富士急行	10,200	3,925.00	40,035,000
新京成電鉄	3,600	2,099.00	7,556,400
東日本旅客鉄道	132,200	10,380.00	1,372,236,000
西日本旅客鉄道	66,700	8,079.00	538,869,300
東海旅客鉄道	66,600	24,080.00	1,603,728,000
西武ホールディングス	94,800	1,965.00	186,282,000
鴻池運輸	11,600	1,773.00	20,566,800
西日本鉄道	20,900	2,677.00	55,949,300
ハマキョウレックス	5,800	4,190.00	24,302,000
サカイ引越センター	3,900	6,490.00	25,311,000
近鉄グループホールディングス	70,000	4,860.00	340,200,000
阪急阪神ホールディングス	93,500	4,035.00	377,272,500
南海電気鉄道	31,600	2,946.00	93,093,600
京阪ホールディングス	31,200	4,540.00	141,648,000
神戸電鉄	2,700	3,945.00	10,651,500
名古屋鉄道	56,200	3,015.00	169,443,000
山陽電気鉄道	6,000	2,188.00	13,128,000
日本通運	27,600	6,690.00	184,644,000
ヤマトホールディングス	123,600	2,948.00	364,372,800
山九	19,600	5,410.00	106,036,000
丸全昭和運輸	5,900	2,796.00	16,496,400
センコーグループホールディングス	38,800	914.00	35,463,200
トナミホールディングス	1,800	6,520.00	11,736,000
ニッコンホールディングス	27,000	2,849.00	76,923,000
福山通運	9,100	4,390.00	39,949,000
セイノーホールディングス	53,000	1,547.00	81,991,000

神奈川中央交通	2,500	3,715.00	9,287,500
日立物流	15,000	3,195.00	47,925,000
丸和運輸機関	3,800	3,535.00	13,433,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,272.00	10,939,200
九州旅客鉄道	59,200	3,700.00	219,040,000
S Gホールディングス	66,500	3,080.00	204,820,000
日本郵船	58,700	1,797.00	105,483,900
商船三井	41,800	2,634.00	110,101,200
川崎汽船	22,100	1,600.00	35,360,000
N S ユナイテッド海運	4,100	2,644.00	10,840,400
飯野海運	35,500	405.00	14,377,500
乾汽船	8,400	717.00	6,022,800
日本航空	129,100	4,040.00	521,564,000
A N Aホールディングス	128,900	4,092.00	527,458,800
トランコム	2,300	6,880.00	15,824,000
日新	6,600	1,965.00	12,969,000
三菱倉庫	24,400	2,724.00	66,465,600
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,992.00	17,131,200
住友倉庫	26,100	1,445.00	37,714,500
澁澤倉庫	5,500	1,616.00	8,888,000
東陽倉庫	25,300	321.00	8,121,300
日本トランスシティ	19,500	439.00	8,560,500
川西倉庫	2,800	1,225.00	3,430,000
安田倉庫	8,700	910.00	7,917,000
東洋埠頭	3,800	1,479.00	5,620,200
上組	42,700	2,546.00	108,714,200
キューソー流通システム	2,300	2,020.00	4,646,000
近鉄エクスプレス	13,600	1,833.00	24,928,800
エーアイティー	5,700	1,074.00	6,121,800
N E C ネットエスアイ	7,900	2,495.00	19,710,500
システナ	26,100	1,132.00	29,545,200
デジタルアーツ	4,000	8,530.00	34,120,000
新日鉄住金ソリューションズ	10,900	3,020.00	32,918,000
キューブシステム	6,800	893.00	6,072,400
コア	4,400	1,376.00	6,054,400
ソリトンシステムズ	5,700	1,005.00	5,728,500
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,495.00	6,578,000
T I S	24,400	5,240.00	127,856,000
ネオス	3,200	974.00	3,116,800
電算システム	3,900	2,437.00	9,504,300
グリー	49,700	467.00	23,209,900
コーエーテクモホールディングス	15,000	1,848.00	27,720,000

三菱総合研究所	3,300	3,300.00	10,890,000
ファインデックス	8,100	746.00	6,042,600
ブレインパッド	1,700	5,050.00	8,585,000
K L a b	13,400	819.00	10,974,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	10,300	894.00	9,208,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,550.00	2,635,000
ネクソン	185,900	1,652.00	307,106,800
アイスタイル	18,900	650.00	12,285,000
エムアップ	2,700	2,232.00	6,026,400
エイチーム	5,100	1,922.00	9,802,200
テクノスジャパン	6,900	783.00	5,402,700
コロプラ	21,600	706.00	15,249,600
ブロードリーフ	37,200	571.00	21,241,200
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,358.00	5,839,400
メディアドゥホールディングス	2,700	2,308.00	6,231,600
じげん	9,300	676.00	6,286,800
フィックスターズ	7,500	1,282.00	9,615,000
C A R T A H O L D I N G S	4,800	1,018.00	4,886,400
オブティム	1,800	4,055.00	7,299,000
セレス	2,800	1,809.00	5,065,200
ティーガイア	7,100	1,983.00	14,079,300
セック	1,400	3,695.00	5,173,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,023.00	7,263,300
テクマトリックス	5,500	1,843.00	10,136,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	180,000	307.00	55,260,000
G M O ペイメントゲートウェイ	12,200	6,530.00	79,666,000
システムリサーチ	1,400	3,025.00	4,235,000
インターネットイニシアティブ	12,000	2,551.00	30,612,000
さくらインターネット	11,000	493.00	5,423,000
ヴィンクス	3,000	1,123.00	3,369,000
G M O クラウド	2,000	3,455.00	6,910,000
S R A ホールディングス	4,300	2,684.00	11,541,200
e B A S E	2,900	1,748.00	5,069,200
アドソル日進	3,000	1,641.00	4,923,000
フリービット	5,800	982.00	5,695,600
コムチュア	4,400	3,065.00	13,486,000
アステリア	4,800	835.00	4,008,000
マークライنز	3,600	1,454.00	5,234,400
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,042.00	7,294,000
g u m i	9,500	594.00	5,643,000
モバイルファクトリー	2,700	1,562.00	4,217,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,536.00	5,529,600

PCIホールディングス	1,700	2,257.00	3,836,900
オープンドア	3,900	3,125.00	12,187,500
マイネット	2,700	1,127.00	3,042,900
アカツキ	2,600	5,380.00	13,988,000
LINE	22,300	4,085.00	91,095,500
チェンジ	1,100	3,650.00	4,015,000
オークネット	5,200	989.00	5,142,800
AOI TYO Holdings	8,700	846.00	7,360,200
マクロミル	12,600	1,379.00	17,375,400
オロ	900	4,595.00	4,135,500
フェイス	5,300	747.00	3,959,100
野村総合研究所	46,300	4,445.00	205,803,500
サイバネットシステム	8,000	599.00	4,792,000
インテージホールディングス	10,700	859.00	9,191,300
ソースネクスト	28,800	480.00	13,824,000
インフォコム	3,100	3,910.00	12,121,000
アルテリア・ネットワークス	6,000	1,278.00	7,668,000
フォーカスシステムズ	6,000	1,017.00	6,102,000
クレスコ	2,500	3,505.00	8,762,500
フジ・メディア・ホールディングス	76,300	1,644.00	125,437,200
オービック	25,300	10,470.00	264,891,000
ジャストシステム	10,500	2,560.00	26,880,000
TDCソフト	7,400	884.00	6,541,600
ヤフー	476,700	312.00	148,730,400
トレンドマイクロ	38,900	5,260.00	204,614,000
日本オラクル	14,800	8,350.00	123,580,000
アルファシステムズ	2,900	2,661.00	7,716,900
フューチャー	10,300	1,727.00	17,788,100
CAC Holdings	7,700	1,213.00	9,340,100
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	2,146.00	7,296,400
オービックビジネスコンサルタント	7,400	4,415.00	32,671,000
伊藤忠テクノソリューションズ	33,200	2,660.00	88,312,000
アイティフォー	10,300	836.00	8,610,800
大塚商会	39,500	4,165.00	164,517,500
サイボウズ	10,600	641.00	6,794,600
電通国際情報サービス	4,700	3,605.00	16,943,500
デジタルガレージ	14,400	2,942.00	42,364,800
EMシステムズ	7,200	1,249.00	8,992,800
ウェザーニューズ	3,000	3,015.00	9,045,000
CIJ	9,000	815.00	7,335,000
WOWOW	3,600	2,932.00	10,555,200
スカラ	7,700	880.00	6,776,000

IMAGICA GROUP	7,400	513.00	3,796,200
ネットワンシステムズ	26,200	2,556.00	66,967,200
アルゴグラフィックス	3,200	4,835.00	15,472,000
マーベラス	12,200	908.00	11,077,600
エイベックス	12,800	1,419.00	18,163,200
日本ユニシス	22,600	2,861.00	64,658,600
兼松エレクトロニクス	4,000	3,355.00	13,420,000
東京放送ホールディングス	48,800	1,979.00	96,575,200
日本テレビホールディングス	67,400	1,765.00	118,961,000
朝日放送グループホールディングス	10,500	769.00	8,074,500
テレビ朝日ホールディングス	20,600	2,002.00	41,241,200
スカパーJ S A Tホールディングス	56,300	500.00	28,150,000
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,525.00	15,402,500
ビジョン	2,400	4,620.00	11,088,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,400	913.00	3,104,200
コネクシオ	6,000	1,437.00	8,622,000
日本電信電話	499,100	4,623.00	2,307,339,300
KDDI	643,000	2,680.00	1,723,240,000
ソフトバンク	579,000	1,329.50	769,780,500
光通信	8,600	20,000.00	172,000,000
NTTドコモ	523,700	2,588.00	1,355,335,600
エムティーアイ	10,200	626.00	6,385,200
GMOインターネット	26,700	1,753.00	46,805,100
カドカワ	21,500	1,107.00	23,800,500
学研ホールディングス	2,600	4,990.00	12,974,000
ゼンリン	14,500	3,080.00	44,660,000
アイネット	5,200	1,406.00	7,311,200
松竹	5,000	11,290.00	56,450,000
東宝	48,100	3,995.00	192,159,500
東映	3,100	13,350.00	41,385,000
エヌ・ティ・ティ・データ	193,400	1,195.00	231,113,000
D T S	8,000	4,180.00	33,440,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,100	3,215.00	109,631,500
シーイーシー	7,800	2,290.00	17,862,000
カブコン	31,700	2,287.00	72,497,900
アイ・エス・ビー	2,200	1,999.00	4,397,800
ジャステック	5,800	970.00	5,626,000
S C S K	19,300	4,845.00	93,508,500
日本システムウエア	2,800	1,980.00	5,544,000
アイネス	10,300	1,310.00	13,493,000
T K C	6,100	3,870.00	23,607,000
富士ソフト	10,900	4,645.00	50,630,500



N S D	11,900	2,450.00	29,155,000
コナミホールディングス	29,900	4,515.00	134,998,500
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,993.00	6,377,600
J B C Cホールディングス	6,600	1,690.00	11,154,000
ミロク情報サービス	7,300	2,755.00	20,111,500
ソフトバンクグループ	305,000	10,375.00	3,164,375,000
伊藤忠食品	2,100	4,870.00	10,227,000
エレマテック	3,900	1,884.00	7,347,600
J A L U X	2,400	2,570.00	6,168,000
あらた	4,100	4,390.00	17,999,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,864.00	7,083,200
フィールズ	7,800	735.00	5,733,000
双日	403,300	418.00	168,579,400
アルフレッサ ホールディングス	81,100	3,095.00	251,004,500
横浜冷凍	20,200	917.00	18,523,400
ラクーンホールディングス	5,800	688.00	3,990,400
アルコニックス	8,700	1,113.00	9,683,100
神戸物産	11,000	3,605.00	39,655,000
あい ホールディングス	11,900	1,946.00	23,157,400
ダイワボウホールディングス	6,700	6,480.00	43,416,000
マクニカ・富士エレホールディングス	20,000	1,556.00	31,120,000
ラクト・ジャパン	1,600	8,290.00	13,264,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,109.00	15,526,000
八洲電機	9,000	833.00	7,497,000
U K Cホールディングス	5,300	2,045.00	10,838,500
ジューテックホールディングス	2,900	1,020.00	2,958,000
T O K A Iホールディングス	38,100	921.00	35,090,100
三洋貿易	4,400	2,108.00	9,275,200
ウイン・パートナーズ	5,300	1,150.00	6,095,000
シップヘルスケアホールディングス	15,200	4,240.00	64,448,000
コメダホールディングス	17,300	2,118.00	36,641,400
小野建	7,100	1,599.00	11,352,900
佐島電機	7,300	977.00	7,132,100
伯東	5,900	1,227.00	7,239,300
コンドーテック	8,000	1,034.00	8,272,000
ナガイレーベン	10,800	2,358.00	25,466,400
三菱食品	7,700	2,912.00	22,422,400
松田産業	6,200	1,417.00	8,785,400
第一興商	11,100	5,540.00	61,494,000
メディバルホールディングス	78,900	2,615.00	206,323,500
S P K	2,800	2,273.00	6,364,400
萩原電気ホールディングス	3,200	2,991.00	9,571,200

アズワン	5,200	8,230.00	42,796,000
尾家産業	4,100	1,198.00	4,911,800
シモジマ	5,400	1,148.00	6,199,200
ドウシシャ	6,800	1,694.00	11,519,200
高速	6,500	1,160.00	7,540,000
丸文	9,000	732.00	6,588,000
ハピネット	6,700	1,476.00	9,889,200
日本ライフライン	22,900	1,704.00	39,021,600
エクセル	3,300	2,290.00	7,557,000
マルカキカイ	3,200	2,128.00	6,809,600
I D O M	25,900	377.00	9,764,300
日本エム・ディ・エム	5,100	1,092.00	5,569,200
進和	4,800	2,182.00	10,473,600
ダイトロン	4,100	1,638.00	6,715,800
シークス	9,400	1,566.00	14,720,400
オーハシテクニカ	5,900	1,429.00	8,431,100
白銅	3,500	1,661.00	5,813,500
伊藤忠商事	512,100	2,019.50	1,034,185,950
丸紅	722,400	806.10	582,326,640
長瀬産業	41,600	1,647.00	68,515,200
蝶理	5,400	1,619.00	8,742,600
豊田通商	81,100	3,570.00	289,527,000
三共生興	18,000	437.00	7,866,000
兼松	28,500	1,290.00	36,765,000
三井物産	603,300	1,777.50	1,072,365,750
日本紙パルプ商事	4,200	4,165.00	17,493,000
日立ハイテクノロジーズ	22,300	4,240.00	94,552,000
カメイ	9,900	1,210.00	11,979,000
スターゼン	3,000	4,050.00	12,150,000
山善	27,700	1,174.00	32,519,800
椿本興業	2,200	3,685.00	8,107,000
住友商事	432,900	1,627.50	704,544,750
内田洋行	3,900	2,320.00	9,048,000
三菱商事	513,700	3,191.00	1,639,216,700
第一実業	3,500	3,400.00	11,900,000
キャノンマーケティングジャパン	21,300	2,098.00	44,687,400
西華産業	4,800	1,511.00	7,252,800
佐藤商事	8,000	932.00	7,456,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,550.00	12,090,000
東京産業	10,100	542.00	5,474,200
ユアサ商事	7,300	3,405.00	24,856,500
神鋼商事	2,000	2,501.00	5,002,000

阪和興業	12,900	3,240.00	41,796,000
正栄食品工業	4,000	3,035.00	12,140,000
カナデン	8,200	1,305.00	10,701,000
菱電商事	6,900	1,455.00	10,039,500
フルサト工業	5,200	1,679.00	8,730,800
岩谷産業	16,600	3,645.00	60,507,000
極東貿易	3,400	1,729.00	5,878,600
イワキ	11,600	409.00	4,744,400
三愛石油	19,500	985.00	19,207,500
稲畑産業	16,900	1,554.00	26,262,600
ワキタ	16,400	1,214.00	19,909,600
東邦ホールディングス	21,900	2,707.00	59,283,300
サンゲツ	22,700	2,106.00	47,806,200
ミツウロコグループホールディングス	11,900	836.00	9,948,400
シナネンホールディングス	3,600	2,249.00	8,096,400
伊藤忠エネクス	15,400	949.00	14,614,600
サンリオ	23,100	2,340.00	54,054,000
サンワテクノス	5,700	969.00	5,523,300
リョーサン	8,200	3,090.00	25,338,000
新光商事	7,400	1,924.00	14,237,600
トーヨー	4,100	2,098.00	8,601,800
三信電気	6,200	1,894.00	11,742,800
東陽テクニカ	11,000	898.00	9,878,000
モスフードサービス	9,500	2,711.00	25,754,500
加賀電子	7,400	2,136.00	15,806,400
ソーダニッカ	11,200	558.00	6,249,600
立花エレテック	6,100	1,682.00	10,260,200
PALTAC	13,000	5,610.00	72,930,000
太平洋興発	7,800	773.00	6,029,400
西本Wismettacホールディングス	1,800	4,570.00	8,226,000
ヤマタネ	4,800	1,650.00	7,920,000
日鉄住金物産	4,900	4,760.00	23,324,000
泉州電業	3,000	2,632.00	7,896,000
トラスコ中山	15,000	3,095.00	46,425,000
オートバックスセブン	29,800	1,875.00	55,875,000
モリト	7,700	787.00	6,059,900
加藤産業	11,100	3,635.00	40,348,500
イノテック	5,800	1,065.00	6,177,000
イエローハット	6,900	2,954.00	20,382,600
JKホールディングス	10,000	591.00	5,910,000
日伝	6,800	1,514.00	10,295,200
杉本商事	4,800	1,798.00	8,630,400

因幡電機産業	10,100	4,610.00	46,561,000
バイテックホールディングス	3,100	2,026.00	6,280,600
東テク	3,000	2,230.00	6,690,000
ミスミグループ本社	91,600	2,758.00	252,632,800
タキヒヨー	4,000	1,784.00	7,136,000
スズケン	33,300	5,900.00	196,470,000
ジェコス	6,500	1,048.00	6,812,000
ローソン	18,600	6,820.00	126,852,000
サンエー	5,400	4,520.00	24,408,000
カワチ薬品	6,300	2,076.00	13,078,800
エービーシー・マート	11,500	6,370.00	73,255,000
アスクル	6,500	2,328.00	15,132,000
ゲオホールディングス	11,200	1,634.00	18,300,800
アダストリア	10,200	1,896.00	19,339,200
くらコーポレーション	4,300	5,550.00	23,865,000
キャンドウ	5,100	1,583.00	8,073,300
パルグループホールディングス	4,100	3,035.00	12,443,500
エディオン	30,800	978.00	30,122,400
サーラコーポレーション	16,600	580.00	9,628,000
ハローズ	3,100	2,157.00	6,686,700
あみやき亭	2,000	3,695.00	7,390,000
ひらまつ	20,500	345.00	7,072,500
大黒天物産	2,000	4,040.00	8,080,000
ハニーズホールディングス	9,500	968.00	9,196,000
アルペン	6,100	1,664.00	10,150,400
クオールホールディングス	10,900	1,433.00	15,619,700
ジンズ	5,100	5,420.00	27,642,000
ビックカメラ	38,800	1,260.00	48,888,000
D C Mホールディングス	38,800	1,126.00	43,688,800
ペッパーフードサービス	5,800	2,450.00	14,210,000
Monotaro	46,400	2,462.00	114,236,800
DDホールディングス	2,000	2,126.00	4,252,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	2,026.00	11,143,000
J.フロント リテイリング	93,800	1,263.00	118,469,400
ドトール・日レスホールディングス	12,700	2,175.00	27,622,500
マツモトキヨシホールディングス	30,300	3,885.00	117,715,500
ブロンコビリー	4,100	2,662.00	10,914,200
Z O Z O	79,400	1,783.00	141,570,200
物語コーポレーション	2,100	9,200.00	19,320,000
ココカラファイン	8,200	4,990.00	40,918,000
三越伊勢丹ホールディングス	136,900	1,099.00	150,453,100
Hamee	2,400	827.00	1,984,800

ウエルシアホールディングス	19,300	4,105.00	79,226,500
クリエイトSDホールディングス	10,400	2,901.00	30,170,400
チムニー	2,800	2,635.00	7,378,000
シュッピン	5,900	763.00	4,501,700
ネクステージ	11,400	986.00	11,240,400
ジョイフル本田	21,100	1,441.00	30,405,100
鳥貴族	3,000	1,798.00	5,394,000
キリン堂ホールディングス	3,600	1,534.00	5,522,400
ホットランド	5,100	1,360.00	6,936,000
すかいらーくホールディングス	68,600	1,665.00	114,219,000
綿半ホールディングス	3,100	2,265.00	7,021,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,100	1,187.00	23,858,700
あさひ	6,700	1,464.00	9,808,800
日本調剤	2,700	3,810.00	10,287,000
コスモス薬品	3,200	21,370.00	68,384,000
セブン&アイ・ホールディングス	306,900	4,956.00	1,520,996,400
薬王堂	3,300	2,604.00	8,593,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19,500	1,281.00	24,979,500
ツルハホールディングス	15,900	10,060.00	159,954,000
サンマルクホールディングス	5,800	2,570.00	14,906,000
トリドールホールディングス	9,200	2,219.00	20,414,800
TOKYO BASE	7,300	939.00	6,854,700
ジャパンミート	3,100	1,752.00	5,431,200
ダイユー・リックホールディングス	5,000	1,008.00	5,040,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	900.00	6,210,000
クスリのアオキホールディングス	7,200	7,560.00	54,432,000
スシローグローバルホールディングス	8,000	7,280.00	58,240,000
LIXILピバ	6,800	1,467.00	9,975,600
メディカルシステムネットワーク	10,700	440.00	4,708,000
ノジマ	12,900	2,006.00	25,877,400
カップ・クリエイト	11,200	1,382.00	15,478,400
ライトオン	8,000	798.00	6,384,000
良品計画	10,400	26,960.00	280,384,000
三城ホールディングス	15,500	388.00	6,014,000
アドヴァン	12,600	1,014.00	12,776,400
アルビス	3,200	2,375.00	7,600,000
コナカ	17,200	439.00	7,550,800
G-7ホールディングス	2,600	2,307.00	5,998,200
イオン北海道	10,100	786.00	7,938,600
コジマ	12,800	637.00	8,153,600
コーナン商事	9,700	2,861.00	27,751,700

エコス	3,100	1,701.00	5,273,100
ワタミ	10,300	1,529.00	15,748,700
パン・パシフィック・インターナショナルホ	43,700	6,910.00	301,967,000
西松屋チェーン	16,400	910.00	14,924,000
ゼンショーホールディングス	34,800	2,480.00	86,304,000
幸楽苑ホールディングス	6,200	2,295.00	14,229,000
サイゼリヤ	12,000	2,062.00	24,744,000
V Tホールディングス	27,000	422.00	11,394,000
ユナイテッドアローズ	8,400	3,690.00	30,996,000
ハイデイ日高	9,400	2,252.00	21,168,800
コロワイド	24,500	2,332.00	57,134,000
ピーシーデポコーポレーション	11,800	460.00	5,428,000
壱番屋	5,100	4,770.00	24,327,000
スギホールディングス	16,200	4,755.00	77,031,000
ヴィア・ホールディングス	13,300	663.00	8,817,900
スクロール	14,200	390.00	5,538,000
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,202.00	18,276,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	20,500	12,640.00	259,120,000
木曽路	9,100	2,530.00	23,023,000
S R Sホールディングス	11,200	1,014.00	11,356,800
ケーヨー	17,000	536.00	9,112,000
上新電機	8,600	2,345.00	20,167,000
日本瓦斯	11,900	4,115.00	48,968,500
ロイヤルホールディングス	12,500	2,650.00	33,125,000
いなげや	8,500	1,376.00	11,696,000
島忠	16,800	3,005.00	50,484,000
チヨダ	7,600	1,907.00	14,493,200
ライフコーポレーション	5,400	2,509.00	13,548,600
リンガーハット	9,200	2,377.00	21,868,400
Mr M a x H D	11,800	509.00	6,006,200
A O K Iホールディングス	14,500	1,279.00	18,545,500
オークワ	11,000	1,049.00	11,539,000
コメリ	11,300	2,842.00	32,114,600
青山商事	14,100	2,770.00	39,057,000
しまむら	8,600	9,260.00	79,636,000
高島屋	57,800	1,490.00	86,122,000
松屋	15,300	1,097.00	16,784,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,800	1,564.00	59,119,200
近鉄百貨店	3,000	3,450.00	10,350,000
パルコ	7,700	1,110.00	8,547,000
丸井グループ	62,100	2,017.00	125,255,700
アクシアル リテイリング	5,900	3,570.00	21,063,000

イオン	281,600	2,336.50	657,958,400
イズミ	14,900	5,340.00	79,566,000
平和堂	14,500	2,500.00	36,250,000
フジ	9,000	1,857.00	16,713,000
ヤオコー	8,100	5,960.00	48,276,000
ゼビオホールディングス	9,100	1,318.00	11,993,800
ケーズホールディングス	76,600	995.00	76,217,000
Olympicグループ	5,800	722.00	4,187,600
日産東京販売ホールディングス	17,800	328.00	5,838,400
Genky DrugStores	3,000	2,614.00	7,842,000
総合メディカルホールディングス	6,400	1,954.00	12,505,600
アインホールディングス	9,900	7,410.00	73,359,000
元気寿司	2,300	3,680.00	8,464,000
ヤマダ電機	224,400	537.00	120,502,800
アークランドサカモト	12,400	1,433.00	17,769,200
ニトリホールディングス	31,700	14,145.00	448,396,500
グルメ杵屋	8,200	1,179.00	9,667,800
吉野家ホールディングス	26,400	1,840.00	48,576,000
松屋フーズホールディングス	3,500	3,645.00	12,757,500
サガミホールディングス	10,800	1,368.00	14,774,400
関西スーパーマーケット	6,900	1,026.00	7,079,400
王将フードサービス	5,300	7,180.00	38,054,000
プレナス	8,000	1,823.00	14,584,000
ミニストップ	5,600	1,903.00	10,656,800
アークス	13,300	2,557.00	34,008,100
パローホールディングス	15,800	2,786.00	44,018,800
ベルク	3,500	5,010.00	17,535,000
大庄	5,500	1,578.00	8,679,000
ファーストリテイリング	9,800	50,620.00	496,076,000
サンドラッグ	27,600	3,555.00	98,118,000
サックスパー ホールディングス	7,300	1,126.00	8,219,800
ベルーナ	17,800	889.00	15,824,200
じもとホールディングス	60,300	123.00	7,416,900
めぶきフィナンシャルグループ	374,500	306.00	114,597,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,607.00	16,070,000
九州フィナンシャルグループ	118,600	463.00	54,911,800
ゆうちょ銀行	207,700	1,256.00	260,871,200
富山第一銀行	21,600	386.00	8,337,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	464,800	454.00	211,019,200
西日本フィナンシャルホールディングス	47,800	1,014.00	48,469,200
関西みらいフィナンシャルグループ	34,500	839.00	28,945,500
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,593.00	11,151,000

第四北越フィナンシャルグループ	12,800	3,460.00	44,288,000
新生銀行	53,000	1,516.00	80,348,000
あおぞら銀行	40,500	3,215.00	130,207,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,109,300	585.10	2,989,451,430
りそなホールディングス	805,200	515.40	415,000,080
三井住友トラスト・ホールディングス	144,400	4,178.00	603,303,200
三井住友フィナンシャルグループ	517,000	4,035.00	2,086,095,000
千葉銀行	257,300	687.00	176,765,100
群馬銀行	144,600	482.00	69,697,200
武蔵野銀行	11,000	2,418.00	26,598,000
千葉興業銀行	23,600	336.00	7,929,600
筑波銀行	36,800	211.00	7,764,800
七十七銀行	23,000	1,826.00	41,998,000
青森銀行	6,100	2,802.00	17,092,200
秋田銀行	5,300	2,192.00	11,617,600
山形銀行	8,600	1,900.00	16,340,000
岩手銀行	5,300	3,300.00	17,490,000
東邦銀行	67,200	311.00	20,899,200
東北銀行	5,500	1,090.00	5,995,000
みちのく銀行	5,500	1,608.00	8,844,000
ふくおかフィナンシャルグループ	58,800	2,471.00	145,294,800
静岡銀行	182,200	888.00	161,793,600
十六銀行	9,900	2,297.00	22,740,300
スルガ銀行	69,800	532.00	37,133,600
八十二銀行	130,200	467.00	60,803,400
山梨中央銀行	9,600	1,440.00	13,824,000
大垣共立銀行	11,600	2,268.00	26,308,800
福井銀行	6,900	1,613.00	11,129,700
北國銀行	8,000	3,405.00	27,240,000
清水銀行	3,900	1,692.00	6,598,800
富山銀行	1,700	3,120.00	5,304,000
滋賀銀行	14,600	2,587.00	37,770,200
南都銀行	8,600	2,233.00	19,203,800
百五銀行	65,400	384.00	25,113,600
京都銀行	26,000	4,695.00	122,070,000
紀陽銀行	25,800	1,576.00	40,660,800
ほくほくフィナンシャルグループ	48,500	1,243.00	60,285,500
広島銀行	105,900	648.00	68,623,200
山陰合同銀行	43,700	830.00	36,271,000
中国銀行	47,000	1,052.00	49,444,000
伊予銀行	95,500	621.00	59,305,500
百十四銀行	7,800	2,511.00	19,585,800



四国銀行	11,100	1,034.00	11,477,400
阿波銀行	11,500	3,080.00	35,420,000
大分銀行	4,700	3,425.00	16,097,500
宮崎銀行	5,200	2,659.00	13,826,800
佐賀銀行	4,700	1,781.00	8,370,700
十八銀行	4,600	2,736.00	12,585,600
沖縄銀行	6,900	3,360.00	23,184,000
琉球銀行	17,000	1,165.00	19,805,000
セブン銀行	246,600	338.00	83,350,800
みずほフィナンシャルグループ	9,970,000	175.10	1,745,747,000
山口フィナンシャルグループ	90,600	1,070.00	96,942,000
名古屋銀行	6,000	3,395.00	20,370,000
北洋銀行	112,300	307.00	34,476,100
愛知銀行	2,800	3,490.00	9,772,000
中京銀行	3,700	2,147.00	7,943,900
大光銀行	3,500	1,678.00	5,873,000
愛媛銀行	11,000	1,076.00	11,836,000
京葉銀行	32,300	703.00	22,706,900
栃木銀行	39,200	240.00	9,408,000
北日本銀行	3,000	2,087.00	6,261,000
東和銀行	13,800	719.00	9,922,200
福島銀行	10,000	382.00	3,820,000
トモニホールディングス	58,400	407.00	23,768,800
フィデアホールディングス	83,000	134.00	11,122,000
池田泉州ホールディングス	77,800	299.00	23,262,200
F P G	23,500	1,041.00	24,463,500
S B I ホールディングス	87,300	2,304.00	201,139,200
ジャフコ	12,300	3,890.00	47,847,000
大和証券グループ本社	588,700	567.40	334,028,380
野村ホールディングス	1,294,600	447.70	579,592,420
岡三証券グループ	63,600	485.00	30,846,000
丸三証券	23,000	813.00	18,699,000
東洋証券	32,000	164.00	5,248,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,200	499.00	44,011,800
水戸証券	24,000	268.00	6,432,000
いちよし証券	16,000	855.00	13,680,000
松井証券	35,900	1,175.00	42,182,500
マネックスグループ	69,900	404.00	28,239,600
カブドットコム証券	57,200	560.00	32,032,000
極東証券	10,000	1,203.00	12,030,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,243.00	9,944,000
藍澤証券	15,400	702.00	10,810,800

かんぽ生命保険	27,800	2,447.00	68,026,600
S O M P Oホールディングス	129,100	4,100.00	529,310,000
アニコム ホールディングス	6,200	3,015.00	18,693,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	191,200	3,325.00	635,740,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,000	2,080.00	124,800,000
第一生命ホールディングス	414,100	1,713.00	709,353,300
東京海上ホールディングス	265,900	5,484.00	1,458,195,600
T & Dホールディングス	225,700	1,378.50	311,127,450
アドバンスクリエイト	4,000	1,733.00	6,932,000
全国保証	21,000	4,055.00	85,155,000
アルヒ	7,200	2,150.00	15,480,000
クレディセゾン	51,700	1,562.00	80,755,400
芙蓉総合リース	8,500	5,540.00	47,090,000
興銀リース	14,300	2,695.00	38,538,500
東京センチュリー	14,700	5,140.00	75,558,000
日本証券金融	36,200	614.00	22,226,800
アイフル	116,300	305.00	35,471,500
リコーリース	6,100	3,425.00	20,892,500
イオンフィナンシャルサービス	46,500	2,213.00	102,904,500
アコム	147,500	386.00	56,935,000
ジャックス	9,100	1,900.00	17,290,000
オリエントコーポレーション	203,000	115.00	23,345,000
日立キャピタル	17,400	2,522.00	43,882,800
オリックス	489,000	1,639.50	801,715,500
三菱U F Jリース	164,300	579.00	95,129,700
日本取引所グループ	198,100	1,972.00	390,653,200
イー・ギャランティ	8,600	1,085.00	9,331,000
N E Cキャピタルソリューション	4,300	1,640.00	7,052,000
いちご	93,000	383.00	35,619,000
日本駐車場開発	90,400	158.00	14,283,200
ヒューリック	153,200	1,000.00	153,200,000
三栄建築設計	3,600	1,670.00	6,012,000
スター・マイカ	4,000	1,357.00	5,428,000
野村不動産ホールディングス	49,000	2,087.00	102,263,000
三重交通グループホールディングス	16,400	611.00	10,020,400
サムティ	10,600	1,517.00	16,080,200
ディア・ライフ	11,100	429.00	4,761,900
日本商業開発	5,500	1,517.00	8,343,500
プレサンスコーポレーション	11,700	1,346.00	15,748,200
ユニゾホールディングス	11,300	2,121.00	23,967,300
日本管理センター	5,800	772.00	4,477,600
フージャースホールディングス	17,800	656.00	11,676,800

オープンハウス	12,100	4,000.00	48,400,000
東急不動産ホールディングス	197,100	618.00	121,807,800
飯田グループホールディングス	60,800	1,984.00	120,627,200
ムゲンエステート	8,200	590.00	4,838,000
ハウズドゥ	3,200	1,454.00	4,652,800
パーク24	43,100	2,637.00	113,654,700
パラカ	2,800	1,818.00	5,090,400
三井不動産	389,100	2,680.00	1,042,788,000
三菱地所	514,000	1,861.50	956,811,000
平和不動産	14,100	2,014.00	28,397,400
東京建物	80,800	1,302.00	105,201,600
ダイビル	21,400	1,069.00	22,876,600
京阪神ビルディング	15,000	908.00	13,620,000
住友不動産	164,900	4,137.00	682,191,300
テーオーシー	17,500	787.00	13,772,500
東京楽天地	1,800	4,680.00	8,424,000
レオパレス21	92,900	201.00	18,672,900
スターツコーポレーション	10,000	2,381.00	23,810,000
フジ住宅	11,800	882.00	10,407,600
空港施設	13,300	548.00	7,288,400
ゴールドクレスト	6,200	1,591.00	9,864,200
日本エスリード	4,200	1,634.00	6,862,800
日神不動産	13,500	473.00	6,385,500
日本エスコン	14,100	761.00	10,730,100
タカラレーベン	36,800	355.00	13,064,000
サンヨーハウジング名古屋	7,000	936.00	6,552,000
イオンモール	37,100	1,866.00	69,228,600
カチタス	8,200	3,535.00	28,987,000
トーセイ	10,800	1,050.00	11,340,000
サンフロンティア不動産	10,500	1,208.00	12,684,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	891.00	7,306,200
ランドビジネス	6,500	779.00	5,063,500
日本空港ビルデング	23,500	4,385.00	103,047,500
日本工営	5,000	2,642.00	13,210,000
LIFULL	30,000	610.00	18,300,000
ジェイエシーリクルートメント	6,000	2,535.00	15,210,000
日本M&Aセンター	53,300	2,980.00	158,834,000
タケエイ	10,300	803.00	8,270,900
トラスト・テック	3,700	3,665.00	13,560,500
コシダカホールディングス	19,200	1,509.00	28,972,800
パソナグループ	8,200	1,454.00	11,922,800
リンクアンドモチベーション	13,400	920.00	12,328,000

G C A	8,500	876.00	7,446,000
エス・エム・エス	26,300	1,888.00	49,654,400
パーソルホールディングス	71,100	1,985.00	141,133,500
リニカル	4,400	1,727.00	7,598,800
クックパッド	24,700	290.00	7,163,000
学情	3,800	1,324.00	5,031,200
スタジオアリス	4,100	2,412.00	9,889,200
シミックホールディングス	4,500	1,565.00	7,042,500
総合警備保障	28,300	4,865.00	137,679,500
カカクコム	53,800	2,107.00	113,356,600
アイロムグループ	3,100	1,517.00	4,702,700
ルネサンス	4,500	1,974.00	8,883,000
ディップ	11,200	1,980.00	22,176,000
オプトホールディング	4,800	1,744.00	8,371,200
新日本科学	11,600	759.00	8,804,400
ツクイ	17,000	717.00	12,189,000
ベネフィット・ワン	9,800	4,120.00	40,376,000
エムスリー	149,800	1,661.00	248,817,800
アウトソーシング	37,500	1,394.00	52,275,000
ウェルネット	8,600	1,109.00	9,537,400
ワールドホールディングス	2,200	2,312.00	5,086,400
ディー・エヌ・エー	38,600	1,679.00	64,809,400
博報堂D Yホールディングス	98,500	1,773.00	174,640,500
ぐるなび	11,500	732.00	8,418,000
エスアールジータカミヤ	9,400	695.00	6,533,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,233.00	7,767,900
ファンコミュニケーションズ	21,000	545.00	11,445,000
ライク	3,500	982.00	3,437,000
W D Bホールディングス	3,600	2,770.00	9,972,000
バリューコマース	5,200	1,976.00	10,275,200
インフォマート	39,500	1,256.00	49,612,000
J Pホールディングス	25,400	291.00	7,391,400
E P Sホールディングス	10,700	1,806.00	19,324,200
プレステージ・インターナショナル	13,600	1,265.00	17,204,000
アミューズ	4,600	2,430.00	11,178,000
ドリームインキュベータ	3,200	1,500.00	4,800,000
クイック	5,000	1,597.00	7,985,000
ケネディクス	68,000	571.00	38,828,000
電通	86,500	4,855.00	419,957,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,000	1,837.00	5,511,000
ぴあ	2,100	4,055.00	8,515,500
イオンファンタジー	2,400	2,855.00	6,852,000

シーティーエス	9,200	713.00	6,559,600
ネクシィーズグループ	2,400	1,739.00	4,173,600
みらかホールディングス	20,400	3,130.00	63,852,000
アルプス技研	6,700	1,960.00	13,132,000
日本空調サービス	9,600	657.00	6,307,200
オリエンタルランド	83,900	12,130.00	1,017,707,000
ダスキン	19,500	2,665.00	51,967,500
明光ネットワークジャパン	10,600	952.00	10,091,200
ファルコホールディングス	5,200	1,456.00	7,571,200
ラウンドワン	22,400	1,402.00	31,404,800
リゾートトラスト	30,800	1,557.00	47,955,600
ビー・エム・エル	9,200	3,465.00	31,878,000
りらいあコミュニケーションズ	12,800	969.00	12,403,200
リソー教育	36,700	486.00	17,836,200
ユー・エス・エス	86,900	2,029.00	176,320,100
サイバーエージェント	43,900	3,350.00	147,065,000
楽天	331,400	799.00	264,788,600
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,165.00	5,708,500
テー・オー・ダブリュー	8,300	764.00	6,341,200
セントラルスポーツ	2,900	3,440.00	9,976,000
フルキャストホールディングス	6,800	2,201.00	14,966,800
エン・ジャパン	7,800	3,665.00	28,587,000
テクノプロ・ホールディングス	14,100	6,110.00	86,151,000
Gunosy	4,500	2,593.00	11,668,500
イー・ガーディアン	3,600	2,083.00	7,498,800
ジャパンマテリアル	19,600	1,494.00	29,282,400
ベクトル	8,900	1,323.00	11,774,700
I B J	5,600	927.00	5,191,200
アサンテ	3,500	2,231.00	7,808,500
N・フィールド	5,300	892.00	4,727,600
バリューHR	2,300	2,210.00	5,083,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	5,520.00	10,488,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,201.00	4,443,700
アビスト	1,500	3,265.00	4,897,500
シグマクシス	4,400	927.00	4,078,800
ウィルグループ	5,400	1,116.00	6,026,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	248.00	2,852,000
リクルートホールディングス	509,100	2,962.00	1,507,954,200
エラン	5,200	1,392.00	7,238,400
日本郵政	581,500	1,355.00	787,932,500
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,515.00	18,180,000
鎌倉新書	5,400	1,744.00	9,417,600

LITALICO	2,200	1,899.00	4,177,800
エポラブルアジア	2,500	2,515.00	6,287,500
アトラエ	1,600	2,912.00	4,659,200
ストライク	2,100	2,111.00	4,433,100
ソラスト	17,300	1,149.00	19,877,700
インソース	2,600	2,252.00	5,855,200
バイカレント・コンサルティング	4,000	3,220.00	12,880,000
キャリアインデックス	2,800	937.00	2,623,600
MS - J a p a n	3,200	1,795.00	5,744,000
グレイステクノロジー	2,200	2,365.00	5,203,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	1,984.00	8,928,000
日総工産	2,000	2,442.00	4,884,000
キュービーネットホールディングス	4,200	2,107.00	8,849,400
スプリックス	2,400	2,683.00	6,439,200
リログループ	38,900	2,978.00	115,844,200
東祥	4,500	3,480.00	15,660,000
エイチ・アイ・エス	12,700	4,260.00	54,102,000
共立メンテナンス	10,900	5,200.00	56,680,000
イチネンホールディングス	8,500	1,299.00	11,041,500
建設技術研究所	5,700	1,506.00	8,584,200
スペース	5,300	1,310.00	6,943,000
燦ホールディングス	2,500	2,505.00	6,262,500
東京テアトル	4,900	1,282.00	6,281,800
ナガワ	2,000	5,560.00	11,120,000
よみうりランド	2,300	4,155.00	9,556,500
東京都競馬	4,800	3,580.00	17,184,000
常磐興産	5,300	1,600.00	8,480,000
カナモト	10,700	2,931.00	31,361,700
東京ドーム	27,000	966.00	26,082,000
西尾レントオール	7,300	3,415.00	24,929,500
トランス・コスモス	7,800	2,176.00	16,972,800
乃村工藝社	16,600	3,210.00	53,286,000
藤田観光	3,300	2,698.00	8,903,400
KNT - CTホールディングス	4,300	1,291.00	5,551,300
日本管財	7,300	1,897.00	13,848,100
トーカイ	6,800	2,849.00	19,373,200
セコム	75,400	9,298.00	701,069,200
セントラル警備保障	3,500	4,090.00	14,315,000
丹青社	13,500	1,187.00	16,024,500
メイテック	9,200	4,965.00	45,678,000
応用地質	8,800	1,160.00	10,208,000
船井総研ホールディングス	14,700	2,454.00	36,073,800

オオバ	7,800	637.00	4,968,600
学究社	4,200	1,373.00	5,766,600
ベネッセホールディングス	26,200	2,940.00	77,028,000
イオンディライト	8,700	4,135.00	35,974,500
ナック	6,000	1,047.00	6,282,000
ニチイ学館	10,800	1,241.00	13,402,800
ダイセキ	12,000	2,622.00	31,464,000
合 計	85,086,300		170,172,936,360

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	322,046,441
コール・ローン	1,082,099,695	179,026,106
国債証券	152,749,085,120	133,138,175,610
地方債証券	19,316,624,612	14,924,506,675
特殊債券	25,660,169,148	22,855,001,513
社債券	7,932,157,000	7,696,933,000
未収入金	811,822,700	95,535,000
未収利息	676,631,920	544,108,689
前払費用	7,650,537	8,850,612
流動資産合計	208,236,240,732	179,764,183,646
資産合計	208,236,240,732	179,764,183,646
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,352,984,000	102,168,169
未払利息	3,042	521
その他未払費用	1,486	4,149
流動負債合計	1,352,988,528	102,172,839
負債合計	1,352,988,528	102,172,839
純資産の部		
元本等		
元本	164,465,810,821	140,556,463,902
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	42,417,441,383	39,105,546,905
元本等合計	206,883,252,204	179,662,010,807
純資産合計	206,883,252,204	179,662,010,807
負債純資産合計	208,236,240,732	179,764,183,646

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 2月19日現在）	（平成31年 2月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	164,465,810,821口	140,556,463,902口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2579円 (10,000口当たりの純資産額 12,579円)	1口当たり純資産額 1.2782円 (10,000口当たりの純資産額 12,782円)

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係る	(1) 金融商品の内容



<p>リスク</p>	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

<p>項目</p>	<p>（平成31年 2月18日現在）</p>
-----------	------------------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成30年 2月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	176,575,927,018円
同期中における追加設定元本額	21,143,135,795円
同期中における一部解約元本額	33,253,251,992円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	3,664,566,217円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	6,465,117,996円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,422,328,882円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	364,385,712円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	55,953,172円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	151,237,500円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	250,861,290円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	164,276,895円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	67,048,802円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	149,353,233円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	58,920,581円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,166,555,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,056,117円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,566,271円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,537,330円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	84,341円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	176,843円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	734,823円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	834,200円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	2,177,711円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,703,886円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,909,738,933円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	23,274,790,915円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,645,981,556円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,885,147,427円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	375,770,631円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	685,324,916円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,895,998円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	311,971,836円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	133,067,534円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,319,278,483円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,484,608,198円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,018,902,447円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,894,674,328円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	130,651,018円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	6,907,531,153円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	19,511,978,163円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	628,764,310円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	988,251,801円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,951,335,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,039,763,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	217,323,993円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	50,814,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,382,442,487円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,947,118,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,700,565,230円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,141,382,159円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	263,939,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,744,004円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	403,541,228円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,393,423,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	324,311,883円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,541,689円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,313,635,444円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	629,490,126円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,272,098,065円

S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	532,973円
合計	164,465,810,821円

(平成31年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	164,465,810,821円
同期中における追加設定元本額	21,365,190,241円
同期中における一部解約元本額	45,274,537,160円
平成31年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 年金バランス30 (債券重点型)	4,352,148,444円
三井住友 ・ D C 年金バランス50 (標準型)	7,502,108,232円
三井住友 ・ D C 年金バランス70 (株式重点型)	1,630,868,089円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	482,587,653円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	54,681,948円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ)	162,759,451円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	275,994,183円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	238,906,217円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	92,780,549円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	194,722,157円
三井住友 ・ D C 年金バランスゼロ (債券型)	85,042,474円
アセットアロケーション ・ ファンド (安定型)	1,208,340,138円
アセットアロケーション ・ ファンド (安定成長型)	280,118,124円
アセットアロケーション ・ ファンド (成長型)	252,211,358円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	9,849,119円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (1安定重視型)	25,543,276円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (2やや安定型)	10,340,058円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (3バランス型)	5,949,632円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (4やや成長型)	3,077,550円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (5成長重視型)	4,616,719円
三井住友 ・ D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	21,250,569円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド < 適格機関投資家限定 >	5,794,130,861円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	18,527,268,318円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	7,314,559,645円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	17,857,476,316円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	345,553,253円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	582,060,352円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	2,665,998円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	247,998,375円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	112,143,476円
S M A M ・ インデックス ・ バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,047,079,232円
S M A M ・ インデックス ・ バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,167,297,178円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,772,747,143円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	10,808,811,394円
S M A M ・ バランスV A 株40T < 適格機関投資家限定 >	3,063,620円

三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	3,726,942,552円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	12,751,361,841円
S M A M ・ グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	520,836,297円
S M A M ・ バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	544,630,081円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	14,264,345,915円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	927,922,952円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	191,775,939円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	43,342,038円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	2,006,588,161円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	2,523,671,562円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	2,433,561,093円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	1,048,367,392円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	242,464,366円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	18,191,493円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	358,205,168円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	6,358,160,188円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	299,186,872円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	170,781,640円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	1,544,380,261円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	740,019,068円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,822,232,047円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	505,574円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,542,240,301円
合計	140,556,463,902円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第395回利付国債(2年)	550,000,000	552,750,000	
	第396回利付国債(2年)	600,000,000	603,144,000	
	第397回利付国債(2年)	600,000,000	603,288,000	
	第128回利付国債(5年)	865,000,000	870,665,750	
	第129回利付国債(5年)	1,080,000,000	1,087,840,800	

第130回利付国債(5年)	930,000,000	937,412,100
第131回利付国債(5年)	140,000,000	141,213,800
第132回利付国債(5年)	235,000,000	237,204,300
第133回利付国債(5年)	408,000,000	412,194,240
第134回利付国債(5年)	540,000,000	545,940,000
第135回利付国債(5年)	870,000,000	880,005,000
第136回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,123,564,200
第137回利付国債(5年)	700,000,000	709,058,000
第1回利付国債(40年)	40,000,000	59,370,000
第2回利付国債(40年)	242,000,000	348,201,700
第3回利付国債(40年)	235,000,000	340,630,150
第4回利付国債(40年)	332,000,000	484,676,840
第5回利付国債(40年)	325,000,000	458,172,000
第6回利付国債(40年)	330,000,000	457,858,500
第7回利付国債(40年)	380,000,000	506,270,200
第8回利付国債(40年)	400,000,000	496,380,000
第9回利付国債(40年)	641,000,000	586,111,170
第10回利付国債(40年)	618,000,000	666,173,100
第11回利付国債(40年)	345,000,000	359,445,150
第313回利付国債(10年)	1,195,000,000	1,231,913,550
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,858,158,000
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,038,386,100
第318回利付国債(10年)	895,000,000	922,404,900
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,015,711,200
第320回利付国債(10年)	960,000,000	992,246,400
第321回利付国債(10年)	960,000,000	995,078,400
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,100,613,600
第323回利付国債(10年)	510,000,000	528,456,900
第324回利付国債(10年)	790,000,000	815,943,600
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,413,239,100
第326回利付国債(10年)	77,000,000	79,614,920
第327回利付国債(10年)	375,000,000	389,182,500
第328回利付国債(10年)	380,000,000	392,099,200
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,116,376,500
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,342,889,250
第332回利付国債(10年)	793,000,000	822,951,610
第333回利付国債(10年)	815,000,000	847,363,650
第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,317,750,500
第335回利付国債(10年)	350,000,000	363,321,000
第336回利付国債(10年)	470,000,000	488,691,900
第337回利付国債(10年)	120,000,000	123,358,800
第338回利付国債(10年)	805,000,000	833,183,050

第339回利付国債(10年)	1,105,000,000	1,145,310,400
第340回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,110,606,500
第341回利付国債(10年)	1,107,000,000	1,142,966,430
第342回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,376,109,000
第343回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,254,181,800
第344回利付国債(10年)	1,481,000,000	1,509,968,360
第345回利付国債(10年)	1,398,000,000	1,425,135,180
第346回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,059,957,600
第347回利付国債(10年)	1,030,000,000	1,049,065,300
第348回利付国債(10年)	1,095,000,000	1,114,436,250
第349回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,484,688,600
第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,930,381,000
第351回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,289,062,700
第352回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,216,152,000
第353回利付国債(10年)	155,000,000	156,909,600
第2回利付国債(30年)	510,000,000	642,900,900
第4回利付国債(30年)	300,000,000	399,648,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,559,000
第7回利付国債(30年)	474,000,000	608,734,500
第9回利付国債(30年)	100,000,000	116,939,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	660,716,550
第11回利付国債(30年)	430,000,000	522,407,000
第12回利付国債(30年)	590,000,000	752,043,500
第14回利付国債(30年)	742,000,000	983,105,480
第16回利付国債(30年)	465,000,000	625,680,750
第18回利付国債(30年)	500,000,000	660,485,000
第19回利付国債(30年)	490,000,000	648,627,700
第21回利付国債(30年)	345,000,000	458,501,550
第22回利付国債(30年)	315,000,000	430,034,850
第23回利付国債(30年)	329,000,000	450,098,320
第24回利付国債(30年)	310,000,000	425,329,300
第25回利付国債(30年)	300,000,000	401,901,000
第26回利付国債(30年)	363,000,000	493,727,190
第27回利付国債(30年)	440,000,000	608,247,200
第28回利付国債(30年)	386,000,000	535,864,500
第29回利付国債(30年)	177,000,000	243,277,650
第30回利付国債(30年)	492,000,000	669,479,160
第31回利付国債(30年)	395,000,000	531,729,250
第32回利付国債(30年)	575,000,000	788,146,750
第33回利付国債(30年)	613,000,000	806,260,510
第34回利付国債(30年)	637,000,000	866,976,110
第35回利付国債(30年)	535,000,000	707,895,950
第36回利付国債(30年)	260,000,000	345,339,800

第37回利付国債(30年)	600,000,000	786,324,000	
第38回利付国債(30年)	375,000,000	484,455,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	434,458,200	
第40回利付国債(30年)	390,000,000	505,420,500	
第41回利付国債(30年)	310,000,000	395,228,300	
第42回利付国債(30年)	445,000,000	567,797,750	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	402,702,300	
第44回利付国債(30年)	415,000,000	530,967,600	
第45回利付国債(30年)	415,000,000	511,699,150	
第46回利付国債(30年)	540,000,000	666,889,200	
第47回利付国債(30年)	550,000,000	693,187,000	
第48回利付国債(30年)	425,000,000	515,355,000	
第49回利付国債(30年)	395,000,000	479,103,400	
第50回利付国債(30年)	535,000,000	568,528,450	
第51回利付国債(30年)	520,000,000	486,220,800	
第52回利付国債(30年)	543,000,000	534,572,640	
第53回利付国債(30年)	397,000,000	400,823,110	
第54回利付国債(30年)	275,000,000	291,720,000	
第55回利付国債(30年)	425,000,000	450,491,500	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	455,425,900	
第57回利付国債(30年)	360,000,000	380,973,600	
第58回利付国債(30年)	730,000,000	771,880,100	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	412,032,000	
第60回利付国債(30年)	460,000,000	498,423,800	
第61回利付国債(30年)	200,000,000	205,580,000	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	957,951,360	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	762,652,800	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,030,388,400	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	877,763,080	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,560,269,250	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,273,648,050	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,123,010,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,122,877,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,138,626,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	887,850,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	849,353,880	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	752,796,720	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	558,154,100	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	667,950,800	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	713,465,000	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	976,837,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	749,373,900	



第88回利付国債(20年)	742,000,000	877,081,100
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,492,800
第90回利付国債(20年)	580,000,000	684,289,800
第92回利付国債(20年)	734,000,000	863,866,620
第93回利付国債(20年)	632,000,000	741,607,760
第95回利付国債(20年)	305,000,000	366,805,200
第97回利付国債(20年)	677,000,000	811,811,010
第99回利付国債(20年)	693,000,000	827,753,850
第100回利付国債(20年)	207,000,000	249,935,940
第101回利付国債(20年)	355,000,000	435,119,950
第102回利付国債(20年)	457,000,000	562,233,390
第105回利付国債(20年)	390,000,000	470,289,300
第106回利付国債(20年)	370,000,000	449,731,300
第107回利付国債(20年)	378,000,000	457,175,880
第108回利付国債(20年)	390,000,000	463,998,600
第109回利付国債(20年)	340,000,000	405,725,400
第111回利付国債(20年)	456,000,000	559,931,520
第113回利付国債(20年)	467,000,000	570,188,320
第114回利付国債(20年)	433,000,000	530,351,390
第116回利付国債(20年)	380,000,000	471,055,600
第118回利付国債(20年)	200,000,000	244,218,000
第119回利付国債(20年)	405,000,000	485,404,650
第120回利付国債(20年)	280,000,000	329,271,600
第121回利付国債(20年)	255,000,000	309,330,300
第122回利付国債(20年)	440,000,000	528,677,600
第123回利付国債(20年)	230,000,000	285,126,400
第124回利付国債(20年)	765,000,000	939,366,450
第125回利付国債(20年)	395,000,000	495,776,350
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,727,600
第127回利付国債(20年)	145,000,000	176,784,000
第128回利付国債(20年)	295,000,000	360,339,550
第129回利付国債(20年)	310,000,000	374,879,900
第130回利付国債(20年)	135,000,000	163,621,350
第131回利付国債(20年)	440,000,000	527,815,200
第132回利付国債(20年)	810,000,000	973,587,600
第133回利付国債(20年)	160,000,000	194,339,200
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,856,000
第135回利付国債(20年)	275,000,000	331,163,250
第136回利付国債(20年)	420,000,000	500,367,000
第137回利付国債(20年)	325,000,000	392,119,000
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,507,500
第139回利付国債(20年)	80,000,000	95,472,800
第140回利付国債(20年)	810,000,000	979,087,500

	第141回利付国債(20年)	460,000,000	557,000,200	
	第142回利付国債(20年)	230,000,000	281,618,900	
	第143回利付国債(20年)	310,000,000	371,721,000	
	第144回利付国債(20年)	180,000,000	213,357,600	
	第145回利付国債(20年)	245,000,000	297,650,500	
	第146回利付国債(20年)	275,000,000	334,636,500	
	第147回利付国債(20年)	960,000,000	1,156,099,200	
	第148回利付国債(20年)	394,000,000	469,317,040	
	第149回利付国債(20年)	715,000,000	852,630,350	
	第150回利付国債(20年)	631,000,000	743,185,490	
	第151回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,147,300,000	
	第152回利付国債(20年)	455,000,000	522,217,150	
	第153回利付国債(20年)	517,000,000	601,705,280	
	第154回利付国債(20年)	610,000,000	700,597,200	
	第155回利付国債(20年)	650,000,000	725,231,000	
	第156回利付国債(20年)	630,000,000	639,714,600	
	第157回利付国債(20年)	615,000,000	602,878,350	
	第158回利付国債(20年)	595,000,000	612,826,200	
	第159回利付国債(20年)	598,000,000	625,191,060	
	第160回利付国債(20年)	705,000,000	748,865,100	
	第161回利付国債(20年)	540,000,000	563,252,400	
	第162回利付国債(20年)	495,000,000	515,691,000	
	第163回利付国債(20年)	770,000,000	801,177,300	
	第164回利付国債(20年)	710,000,000	724,505,300	
	第165回利付国債(20年)	630,000,000	641,875,500	
	第166回利付国債(20年)	460,000,000	485,502,400	
	第167回利付国債(20年)	310,000,000	314,826,700	
国債証券合計		119,199,000,000	133,138,175,610	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,605,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,249,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,023,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,070,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,543,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	521,540,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	634,200,000	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	101,650,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	101,477,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	196,327,035	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	203,364,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	102,763,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	103,213,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	102,649,000	

平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,522,000	
平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,072,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,117,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,238,000	
平成26年度第10回北海道公募公債(5年)	200,000,000	200,178,000	
平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,435,000	
平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,844,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,517,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,222,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,699,000	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	100,879,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,196,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,782,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,002,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,822,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,301,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	112,516,800	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,817,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,370,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,303,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	332,865,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	90,000,000	90,363,600	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	101,652,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	128,904,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	228,404,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	302,643,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,574,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,840,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,946,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,905,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	201,270,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,968,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	400,072,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,796,000	
平成21年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,120,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,407,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,068,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,611,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	45,000,000	45,181,350	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,833,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,959,000	

平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	201,834,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,798,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,103,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,303,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,449,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,853,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,775,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,242,000	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,652,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,889,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	617,328,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,243,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,068,000	
第149回共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,492,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,525,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	302,406,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	219,084,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,716,000	
第1回京都市公募公債(7年)	300,000,000	300,855,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	136,002,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	121,424,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,102,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,558,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,205,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,058,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,125,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,098,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,803,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,156,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,938,000	
平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,694,000	
平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	151,537,890	
平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,303,000	
地方債証券合計	14,135,500,000	14,924,506,675	
特殊債券			
第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	220,816,000	
第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,648,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,832,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,871,000	
第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,318,000	
第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,513,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,707,000	

第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,302,000	
第7回道路債券	100,000,000	108,875,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,013,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,097,000	
第9回道路債券	100,000,000	133,301,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,687,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	443,910,000	
第42回道路債券	100,000,000	113,164,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,774,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,822,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,503,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	751,000,000	757,195,750	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	362,442,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,063,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	161,032,020	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,283,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,521,780,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,178,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,547,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,611,000	
第120回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,331,000	
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,029,560,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,831,000	
第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,870,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,686,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,465,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	102,075,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,138,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,227,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,018,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,762,000	

第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,825,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,450,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	130,595,730	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,582,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,718,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,648,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,112,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	301,000,000	305,960,480	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,998,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,704,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,290,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	801,336,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,611,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,573,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	239,628,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,310,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,218,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,849,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,799,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,996,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,561,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,160,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,067,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,896,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,006,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,307,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,026,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	102,058,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	107,846,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	107,605,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,786,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,458,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,626,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,316,000	13,760,354	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,144,000	17,042,413	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,834,000	14,277,656	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,072,000	21,285,670	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,559,000	18,591,118	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,596,000	10,685,854	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,888,000	31,352,213	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,666,000	18,757,582	

第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	46,452,000	48,893,517
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,233,000	18,135,836
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,527,000	19,666,410
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,974,000	12,218,509
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,072,000	17,461,412
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	39,558,000	40,804,868
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,880,000	24,491,667
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,280,000	51,162,633
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,058,000	79,790,829
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,464,000	28,497,758
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,454,000	31,680,722
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,517,000	14,988,221
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,018,000	34,478,583
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,541,000	33,934,961
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,587,000	17,196,074
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,276,000	66,612,900
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,069,000	17,769,682
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,275,000	36,584,449
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,662,000	36,867,196
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,383,000	15,971,707
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,871,000	17,738,675
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,054,000	33,861,204
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,040,000	47,935,621
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,393,000	40,000,039
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,392,000	75,279,316
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,513,000	36,725,628
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,008,000	15,759,450
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,932,000	80,701,288
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,849,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,971,000	16,785,680
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,728,000	104,562,824
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,043,000	49,854,760
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,730,000	52,656,113
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,978,000	102,838,380
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,582,000	159,091,388
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,673,000	51,225,412
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,412,000	56,869,790
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,890,000	117,008,910
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,812,000	103,894,889
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,062,000	58,139,415

	第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,165,000
	第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,835,000	81,858,322
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,109,000	95,341,827
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,330,000	95,317,635
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,663,000	95,650,335
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,467,000	96,296,608
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,431,000	96,408,213
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,109,000	97,390,132
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,552,000
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,751,000	100,157,214
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,598,000	32,001,836
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,950,000	34,697,668
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,302,000	17,234,800
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,654,000	16,381,911
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,796,000	35,582,456
	い第768号農林債	100,000,000	100,076,000
	い第810号農林債	300,000,000	300,507,000
	第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,005,000
	第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,041,000
	第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,190,000
	第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,546,000
	第197号商工債(3年)	200,000,000	199,998,000
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	102,883,000
	第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,189,000
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,292,000
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	200,980,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,038,000
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,173,000
	第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,515,000
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,941,000
特殊債券合計		21,720,434,000	22,855,001,513
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	200,000,000	196,734,000
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,450,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,797,000
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,110,000
	第9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	102,483,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,485,000
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,319,000
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,636,000
	第47回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,326,000



第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,597,000	
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,192,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,268,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,718,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,640,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,144,000	
第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,249,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,546,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,181,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	118,748,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	306,297,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,939,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,261,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	100,900,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,388,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	116,152,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,407,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,842,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,338,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	116,367,000	
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,669,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,961,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,629,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,186,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,125,000	
野村ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	99,901,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,927,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	130,837,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,584,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,997,000	

第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,107,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,235,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,996,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,532,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,560,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,638,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,381,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,417,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,138,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,922,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,598,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,536,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,827,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,689,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,780,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,693,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	210,870,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,231,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	103,679,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,795,000	
社債券合計	7,400,000,000	7,696,933,000	
合計		178,614,616,798	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,002,495,686	1,700,825,632
金銭信託	-	355,036,658
コール・ローン	325,047,162	197,365,418
株式	168,487,900,344	171,184,598,279
投資証券	3,697,373,584	4,315,934,641
派生商品評価勘定	119,615,357	148,585,275
未収入金	47,679	66,971,882
未収配当金	268,685,795	258,206,212
差入委託証拠金	2,233,969,543	1,470,491,510

	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
流動資産合計	178,135,135,150	179,698,015,507
資産合計	178,135,135,150	179,698,015,507
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	100,663,806	727,053
前受金	19,927,751	148,524,409
未払解約金	58,239,069	794,238,033
未払利息	913	575
その他未払費用	1,581	3,177
流動負債合計	178,833,120	943,493,247
負債合計	178,833,120	943,493,247
純資産の部		
元本等		
元本	53,426,368,221	51,684,573,164
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	124,529,933,809	127,069,949,096
元本等合計	177,956,302,030	178,754,522,260
純資産合計	177,956,302,030	178,754,522,260
負債純資産合計	178,135,135,150	179,698,015,507

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 2月20日 至平成31年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準

	受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	53,426,368,221口	51,684,573,164口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 3.3309円 33,309円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 3.4586円 34,586円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 2月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,755,889,225	-	5,775,816,976	19,927,751
	SPMINI 1803	3,946,756,893	-	3,997,544,375	50,787,482
	DJ EUR 1803	1,115,064,267	-	1,095,064,713	19,999,554
	FTSE 1803	419,557,411	-	411,776,937	7,780,474
	SPI200 1803	274,510,654	-	271,430,951	3,079,703
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	188,435,900	-	187,459,700	976,200
	米ドル	130,320,400	-	129,673,800	646,600
	カナダドル	9,399,500	-	9,333,500	66,000
	ユーロ	26,608,000	-	26,416,000	192,000
	英ポンド	13,463,100	-	13,434,300	28,800
	スイスフラン	4,601,200	-	4,584,000	17,200
	スウェーデンクローナ	537,200	-	534,400	2,800
	デンマーククローネ	1,428,800	-	1,418,400	10,400
	香港ドル	1,774,500	-	1,765,400	9,100
	イスラエルシェケル	303,200	-	299,900	3,300
	合計		5,944,325,125	-	5,963,276,676

（平成31年 2月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,848,518,831	-	2,997,043,240	148,524,409
	SPMINI 1903	2,023,625,382	-	2,133,515,406	109,890,024
	DJ EUR 1903	491,407,158	-	514,061,964	22,654,806
	FTSE 1903	185,445,319	-	195,023,469	9,578,150
	SPI200 1903	148,040,972	-	154,442,401	6,401,429

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	493,266,313	-	493,932,500	666,187
	米ドル	298,141,750	-	298,426,000	284,250
	カナダドル	22,490,713	-	22,545,000	54,287
	ユーロ	87,467,660	-	87,451,000	16,660
	英ポンド	41,060,913	-	41,371,400	310,487
	スイスフラン	18,698,112	-	18,720,400	22,288
	スウェーデンクローナ	5,954,961	-	5,965,000	10,039
	ノルウェークローネ	1,662,526	-	1,664,000	1,474
	デンマーククローネ	3,680,927	-	3,682,800	1,873
	ニュージーランドドル	760,482	-	760,400	82
	香港ドル	8,868,709	-	8,864,100	4,609
	シンガポールドル	3,258,680	-	3,260,800	2,120
	イスラエルシェケル	1,220,880	-	1,221,600	720
	合計	3,341,785,144	-	3,490,975,740	147,858,222

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

- 1) 原則として計算期間末日に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います。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います。
- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（平成30年 2月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	72,540,837,139円
同期中における追加設定元本額	6,255,320,431円
同期中における一部解約元本額	25,369,789,349円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	11,984,088,205円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	240,357,105円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,036,536,616円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	719,814,382円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	36,388,028円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	2,795,730円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	8,416,527円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	24,109,774円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	33,758,474円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	20,202,545円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	58,432,719円
外国株式指数ファンド	452,077,993円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,703,586,717円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	537,094,764円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	569,058,002円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	496,687,646円
イオン・バランス戦略ファンド	8,698,025円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,541,548円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	207,870円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	932,965円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	8,365,362円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	8,252,508円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	35,740,203円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,292,138円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,046,669,445円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	11,610,453円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	1,095,506,494円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,086,118,836円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,807,060,950円



S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	7,539,902,334円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	21,950,718円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	122,627,962円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	762,731円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	972,819,415円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	69,727,754円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	207,996,980円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	915,278,826円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	982,941,677円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,972,912,610円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T < 適格機関投資家限定 >	45,830,591円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	877,737,730円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,148,512,276円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	170,861,880円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	87,167,435円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,347,887,519円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	28,207,014円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	14,896,852円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	7,880,402円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	55,314,095円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	135,049,724円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	131,160,163円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,479,212,088円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	213,997,375円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	7,536,838,119円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	947,525,425円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	57,073,242円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	200,729円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	121,220,223円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	58,079,809円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	117,363,065円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	29,434円
合計	53,426,368,221円

(平成31年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	53,426,368,221円
同期中における追加設定元本額	12,383,378,335円
同期中における一部解約元本額	14,125,173,392円
平成31年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	14,294,963,986円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	301,486,997円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,220,412,888円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	819,335,496円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	78,089,843円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,801,776円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,735,358円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	24,212,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	44,880,486円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	29,977,900円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	76,326,245円
外国株式指数ファンド	524,857,848円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	3,009,447,295円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	376,578,994円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	371,997,772円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	333,712,412円
イオン・バランス戦略ファンド	6,430,032円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,859,772円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	11,687,544円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	13,615,858円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	47,624,899円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	30,222,568円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,904,038円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	10,687,154円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,975,049,162円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,701,163円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	119,211,609円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,724,561,838円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,607,695,839円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,835,629,479円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	22,670,800円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	114,401,526円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	421,485円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	786,338,219円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	64,798,117円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	192,420,422円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	848,947,417円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	721,002,661円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,747,955,017円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,175,998円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	559,969,113円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	799,835,633円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	150,631,765円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	51,121,242円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,180,157,280円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	26,604,429円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	14,526,973円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	7,399,828円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	52,066,697円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	125,784,372円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	128,790,890円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,252,975,939円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	177,194,569円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	6,598,091,306円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	314,574,192円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	1,526,288,842円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	7,312,415円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	67,464,942円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	32,300,625円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	79,608,081円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	12,261円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	63,030,886円
合計	51,684,573,164円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	21,404	45.23	968,102.92	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	9.61	88,729.13	
	APACHE CORPORATION	16,399	33.30	546,086.70	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,431	25.83	605,222.73	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	25.23	495,315.36	
	CHENIERE ENERGY INC	10,007	66.22	662,663.54	
	CHEVRON CORPORATION	84,420	119.35	10,075,527.00	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	75.99	310,039.20	
	CONCHO RESOURCES INC	9,223	122.97	1,134,152.31	
	CONOCOPHILLIPS	50,365	70.18	3,534,615.70	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	46.93	212,827.55	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	28.42	626,831.52	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,082	105.50	747,151.00	
	EOG RESOURCES INC	25,219	100.25	2,528,204.75	
	EXXON MOBIL CORPORATION	187,158	77.71	14,544,048.18	
	HALLIBURTON CO	40,309	31.85	1,283,841.65	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	57.40	234,192.00	
	HESS CORPORATION	11,053	57.58	636,431.74	
HOLLYFRONTIER CORP	7,365	57.89	426,359.85		

KINDER MORGAN INC	86,457	18.80	1,625,391.60
MARATHON OIL CORP	36,817	17.08	628,834.36
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	30,435	65.15	1,982,840.25
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	29.81	502,238.88
NOBLE ENERGY INC	20,924	22.64	473,719.36
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,362	67.19	2,241,592.78
ONEOK INC	18,835	67.71	1,275,317.85
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	18.73	172,465.84
PHILLIPS 66	19,641	95.99	1,885,339.59
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,846	145.35	1,140,416.10
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	24.22	189,061.32
SCHLUMBERGER LTD	60,249	44.95	2,708,192.55
TARGA RESOURCES CORP	8,672	45.51	394,662.72
TECHNIPFMC PLC	18,187	23.54	428,121.98
VALERO ENERGY CORP	19,389	84.40	1,636,431.60
WILLIAMS COS INC	55,076	27.27	1,501,922.52
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,939	174.08	1,730,181.12
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	81.37	374,546.11
AVERY DENNISON CORP	3,941	104.90	413,410.90
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	26.68	287,530.36
BALL CORPORATION	13,670	54.13	739,957.10
CELANESE CORPORATION	5,647	100.26	566,168.22
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	41.77	423,506.03
CHEMOURS CO	8,067	37.75	304,529.25
CROWN HOLDINGS INC	5,272	53.28	280,892.16
DOWDUPONT INC	101,656	54.24	5,513,821.44
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	82.71	492,620.76
ECOLAB INC	11,747	163.48	1,920,399.56
FMC CORPORATION	5,698	85.35	486,324.30
FREEMPORT-MCMORAN INC	60,238	12.28	739,722.64
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	47.15	807,726.65
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,770	132.01	497,677.70
LINDE PLC	24,467	168.54	4,123,668.18
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,642	87.64	1,283,224.88
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	190.06	489,784.62
MOSAIC CO/THE	15,550	32.11	499,310.50
NEWMONT MINING CORP	24,066	33.24	799,953.84
NUCOR CORP	13,218	59.50	786,471.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	98.47	398,409.62
PPG INDUSTRIES INC	11,108	109.11	1,211,993.88
SEALED AIR CORP	8,102	42.15	341,499.30
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,813	439.18	1,674,593.34

STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	37.09	377,984.19
VULCAN MATERIALS CO	5,483	113.14	620,346.62
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	80.88	119,298.00
WESTROCK CO	11,330	39.05	442,436.50
3M COMPANY	26,076	208.86	5,446,233.36
ACUITY BRANDS INC	1,884	131.09	246,973.56
AERCAP HOLDINGS NV	6,567	48.07	315,675.69
ALLEGION PLC	3,946	91.56	361,295.76
AMETEK INC	9,623	79.01	760,313.23
ARCONIC INC	19,024	17.55	333,871.20
BOEING CO	24,161	417.97	10,098,573.17
CATERPILLAR INC	25,747	136.20	3,506,741.40
CUMMINS INC	6,946	155.47	1,079,894.62
DEERE & CO	13,344	158.99	2,121,562.56
DOVER CORP	6,894	91.20	628,732.80
EATON CORP PLC	19,706	78.73	1,551,453.38
EMERSON ELECTRIC CO	28,385	68.31	1,938,979.35
FASTENAL COMPANY	11,953	62.97	752,680.41
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	47.78	231,685.22
FLUOR CORP	5,677	36.31	206,131.87
FORTIVE CORP	13,835	81.80	1,131,703.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	47.40	305,730.00
GENERAL DYNAMICS CORP	11,368	175.24	1,992,128.32
GENERAL ELECTRIC CO	387,549	10.09	3,910,369.41
HARRIS CORP	4,981	164.80	820,868.80
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	43.81	341,148.47
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,031	153.32	5,064,312.92
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	219.70	402,490.40
IDEX CORP	3,078	144.12	443,601.36
ILLINOIS TOOL WORKS	13,639	144.21	1,966,880.19
INGERSOLL-RAND PLC	10,304	104.73	1,079,137.92
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	68.72	338,239.84
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	70.51	662,794.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	38.63	351,533.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	35.10	1,388,310.30
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	212.24	713,338.64
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	246.71	380,426.82
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,119	307.23	3,416,090.37
MASCO CORP	14,833	37.46	555,644.18
MIDDLEBY CORP	2,315	126.27	292,315.05
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,244	286.98	2,078,883.12
OWENS CORNING	4,859	54.69	265,738.71

PACCAR INC	15,714	68.10	1,070,123.40
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,941	173.66	1,031,714.06
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	42.72	299,296.32
RAYTHEON COMPANY	12,830	184.61	2,368,546.30
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,701	177.39	1,011,300.39
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,708	311.96	1,468,707.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	49.27	350,112.62
SMITH(A.O.) CORP	5,944	51.64	306,948.16
SNAP-ON INC	2,448	157.78	386,245.44
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	95.71	491,662.27
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,882	136.39	938,635.98
TEXTRON INC	10,639	54.82	583,229.98
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	440.09	888,981.80
UNITED RENTALS INC	3,677	134.86	495,880.22
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,448	127.76	4,656,596.48
WABCO HOLDINGS INC	2,109	116.77	246,267.93
WABTEC CORP	3,452	74.92	258,623.84
WW GRAINGER INC	1,980	316.62	626,907.60
XYLEM INC	7,965	73.93	588,852.45
CINTAS CORP	4,216	203.79	859,178.64
COPART INC	8,553	54.03	462,118.59
COSTAR GROUP INC	1,507	411.03	619,422.21
EQUIFAX INC	5,740	109.31	627,439.40
IHS MARKIT LTD	16,261	53.42	868,662.62
MANPOWERGROUP	3,240	84.43	273,553.20
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	26.30	398,076.80
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	77.63	754,641.23
ROBERT HALF INTL INC	4,666	66.98	312,528.68
ROLLINS INC	6,451	40.11	258,749.61
TRANSUNION	7,559	63.13	477,199.67
VERISK ANALYTICS INC	7,079	125.38	887,565.02
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	82.82	907,127.46
WASTE MANAGEMENT INC	18,801	99.06	1,862,427.06
AMERCO	390	376.42	146,803.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	35.05	198,943.80
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	91.45	554,461.35
CSX CORPORATION	36,618	72.54	2,656,269.72
DELTA AIR LINES INC	7,251	51.08	370,381.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,336	73.64	613,863.04
FEDEX CORP	11,325	179.30	2,030,572.50
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	113.59	400,177.57
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	107.54	499,953.46

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,115	33.53	171,505.95
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,601	182.87	2,304,344.87
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	146.37	386,270.43
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	57.70	364,433.20
UNION PACIFIC CORP	32,863	170.24	5,594,597.12
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,880	88.31	254,332.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,088	110.87	3,335,856.56
XPO LOGISTICS INC	4,945	51.97	256,991.65
APTIV PLC	12,276	80.95	993,742.20
AUTOLIV INC	4,001	78.23	312,998.23
BORGWARNER INC	8,566	41.92	359,086.72
FORD MOTOR COMPANY	169,448	8.54	1,447,085.92
GENERAL MOTORS CO	55,540	39.09	2,171,058.60
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	18.79	194,157.07
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	37.30	274,043.10
LEAR CORP	2,531	156.99	397,341.69
TESLA INC	5,786	307.88	1,781,393.68
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	44.49	277,128.21
D.R.HORTON INC	15,658	39.97	625,850.26
GARMIN LTD	4,936	71.62	353,516.32
HANESBRANDS INC	13,181	18.77	247,407.37
HASBRO INC	5,156	86.40	445,478.40
LEGGETT & PLATT INC	5,036	44.95	226,368.20
LENNAR CORP-CL A	13,866	48.90	678,047.40
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	151.09	646,514.11
MATTEL INC	14,058	13.82	194,281.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	139.21	398,558.23
NEWELL BRANDS INC	18,477	17.16	317,065.32
NIKE INC -CL B	56,415	85.38	4,816,712.70
NVR INC	143	2,662.85	380,787.55
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	86.78	214,086.26
PULTE GROUP INC	13,052	27.12	353,970.24
PVH CORP	3,303	112.90	372,908.70
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	125.09	259,811.93
TAPESTRY INC	11,987	35.91	430,453.17
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	21.16	182,695.44
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	19.04	157,860.64
VF CORP	14,995	86.90	1,303,065.50
WHIRLPOOL CORP	2,604	139.36	362,893.44
ARAMARK	10,783	31.80	342,899.40
CARNIVAL CORP	17,764	57.25	1,016,989.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,101	605.89	667,084.89

DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	112.12	602,308.64
DOMINO'S PIZZA INC	1,661	281.65	467,820.65
H&R BLOCK INC	7,820	24.10	188,462.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	13,107	81.75	1,071,497.25
LAS VEGAS SANDS CORP	17,618	60.31	1,062,541.58
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	13,397	121.05	1,621,706.85
MCDONALD'S CORPORATION	34,179	179.97	6,151,194.63
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	21.74	242,401.00
MGM MIRAGE	22,498	28.21	634,668.58
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	53.03	484,429.05
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,767	117.97	916,272.99
STARBUCKS CORP	60,103	70.71	4,249,883.13
VAIL RESORTS INC	1,680	206.40	346,752.00
WYNN RESORTS LTD	4,252	124.51	529,416.52
YUM! BRANDS INC	13,431	94.12	1,264,125.72
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,851	44.60	1,420,554.60
ALPHABET INC-CL A	13,212	1,119.63	14,792,551.56
ALPHABET INC-CL C	13,916	1,113.65	15,497,553.40
CBS CORP-CL B	15,883	50.64	804,315.12
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,151	349.06	2,496,128.06
COMCAST CORP-CLASS A	202,710	37.77	7,656,356.70
DISCOVERY INC-A	7,075	29.30	207,297.50
DISCOVERY INC-C	12,731	27.65	352,012.15
DISH NETWORK CORP.	9,780	30.90	302,202.00
ELECTRONIC ARTS INC	13,909	106.84	1,486,037.56
FACEBOOK INC-A	106,533	162.50	17,311,612.50
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	220.02	710,884.62
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	23.38	363,418.72
LIBERTY BROADBAND-C	4,072	89.05	362,611.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	25.66	216,365.12
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	24.82	585,503.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	31.43	269,292.24
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	40.74	311,579.52
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	40.73	168,662.93
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	56.34	341,702.10
NETFLIX INC	19,320	356.87	6,894,728.40
NEWS CORP-CLASS A	16,662	12.75	212,440.50
OMNICOM GROUP	9,445	75.00	708,375.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.03	411,559.56
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	93.30	448,586.40
THE WALT DISNEY CO.	65,593	112.59	7,385,115.87
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	56.81	230,137.31



TWENTY-FIRST CE CL-A	46,438	50.40	2,340,475.20
TWENTY-FIRST CE CL-B	18,780	50.02	939,375.60
TWITTER INC	29,540	31.23	922,534.20
VIACOM INC-CLASS B	14,668	29.15	427,572.20
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	37.18	197,797.60
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	169.99	561,646.96
AMAZON.COM INC	18,294	1,607.95	29,415,837.30
AUTOZONE INC	1,182	919.75	1,087,144.50
BEST BUY COMPANY INC	10,543	60.18	634,477.74
BOOKING HOLDINGS INC	2,116	1,933.57	4,091,434.12
BURLINGTON STORES INC	3,144	162.81	511,874.64
CARMAX INC	7,453	62.06	462,533.18
DOLLAR GENERAL CORP	11,733	119.00	1,396,227.00
DOLLAR TREE INC	10,263	98.85	1,014,497.55
EBAY INC	42,726	36.58	1,562,917.08
EXPEDIA GROUP INC	5,168	127.09	656,801.12
GAP INC/THE	9,218	25.07	231,095.26
GENUINE PARTS CO	6,098	107.59	656,083.82
GRUBHUB INC	4,403	83.21	366,373.63
HOME DEPOT INC	50,407	192.39	9,697,802.73
KOHL'S CORP	6,991	65.93	460,916.63
L BRANDS INC	10,675	27.34	291,854.50
LKQ CORPORATION	13,945	27.15	378,606.75
LOWE'S COMPANIES INC	36,211	104.24	3,774,634.64
MACY'S INC	13,521	24.88	336,402.48
MERCADOLIBRE INC	1,842	363.10	668,830.20
NORDSTROM INC	4,756	44.44	211,356.64
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,676	388.00	1,426,288.00
QURATE RETAIL INC	18,982	21.86	414,946.52
ROSS STORES INC	17,084	94.01	1,606,066.84
TARGET CORP	22,694	72.84	1,653,030.96
TIFFANY & CO	4,643	90.83	421,723.69
TJX COMPANIES INC	54,698	50.23	2,747,480.54
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	97.58	515,027.24
ULTA BEAUTY INC	2,389	306.36	731,894.04
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	122.11	352,531.57
COSTCO WHOLESALE CORP	19,321	216.47	4,182,416.87
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	8.98	121,230.00
KROGER CO	36,791	29.50	1,085,334.50
SYSCO CORP	21,225	67.54	1,433,536.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,826	73.43	2,777,563.18
WALMART INC	65,003	99.99	6,499,649.97

ALTRIA GROUP INC	84,008	48.74	4,094,549.92
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,953	41.98	1,047,526.94
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	48.93	554,181.18
BUNGE LIMITED	5,968	52.31	312,186.08
CAMPBELL SOUP CO	7,879	34.79	274,110.41
COCA-COLA CO/THE	178,942	45.24	8,095,336.08
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	46.68	436,551.36
CONAGRA BRANDS INC	20,188	24.50	494,606.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,429	174.91	1,299,406.39
GENERAL MILLS INC	25,006	45.04	1,126,270.24
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	43.20	537,537.60
INGREDION INC	3,320	93.77	311,316.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	103.38	508,009.32
KELLOGG CO	11,216	56.79	636,956.64
KRAFT HEINZ COMPANY	27,010	47.62	1,286,216.20
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	69.51	423,315.90
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,040	128.47	647,488.80
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	60.91	478,996.24
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	63,749	48.16	3,070,151.84
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,060	58.72	1,119,203.20
PEPSICO INC	62,311	115.91	7,222,468.01
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,487	83.46	5,715,925.02
THE HERSHEY COMPANY	6,652	109.35	727,396.20
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	62.61	790,138.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,995	64.69	646,576.55
CLOROX COMPANY	5,583	156.28	872,511.24
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,318	66.48	2,414,420.64
COTY INC-CL A	22,574	11.04	249,216.96
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,584	155.01	1,485,615.84
KIMBERLY-CLARK CORP	15,599	118.44	1,847,545.56
PROCTER & GAMBLE CO	110,139	98.48	10,846,488.72
ABBOTT LABORATORIES	77,290	75.25	5,816,072.50
ABIOMED INC	1,839	362.06	665,828.34
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,164	254.96	806,693.44
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	86.66	611,646.28
ANTHEM INC	11,286	311.58	3,516,491.88
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,361	73.43	1,641,968.23
BECTON DICKINSON & CO	11,788	248.34	2,927,431.92
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,113	40.01	2,485,141.13
CARDINAL HEALTH INC	12,873	55.48	714,194.04
CENTENE CORP	18,086	64.97	1,175,047.42
CERNER CORP	12,409	57.91	718,605.19

CIGNA CORPORATION	16,487	197.87	3,262,282.69
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	279.07	573,488.85
CVS HEALTH CORPORATION	57,653	69.53	4,008,613.09
DANAHER CORP	27,746	111.24	3,086,465.04
DAVITA INC	5,801	59.10	342,839.10
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	43.58	433,359.52
DEXCOM INC	3,778	148.49	560,995.22
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,953	177.78	1,591,664.34
HCA HEALTHCARE INC	12,533	144.26	1,808,010.58
HENRY SCHEIN INC	6,050	62.39	377,459.50
HOLOGIC INC	12,110	46.29	560,571.90
HUMANA INC.	6,228	310.30	1,932,548.40
IDEXX LABORATORIES INC	3,602	210.26	757,356.52
INTUITIVE SURGICAL INC	5,099	548.50	2,796,801.50
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	150.17	661,498.85
MCKESSON CORP	8,396	135.56	1,138,161.76
MEDTRONIC PLC	59,499	92.27	5,489,972.73
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	87.81	518,957.10
RESMED INC	5,931	100.45	595,768.95
STRYKER CORP	15,083	186.83	2,817,956.89
TELEFLEX INC	1,951	285.89	557,771.39
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,585	271.13	11,546,071.05
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	135.53	509,592.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	132.74	546,888.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	120.81	608,278.35
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,377	279.15	663,539.55
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,965	123.65	1,108,522.25
ABBVIE INC	66,714	80.85	5,393,826.90
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,657	78.30	1,147,643.10
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,529	129.42	1,233,243.18
ALKERMES PLC	6,413	32.54	208,679.02
ALLERGAN PLC	15,301	139.07	2,127,910.07
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	83.53	326,435.24
AMGEN INC	28,517	188.34	5,370,891.78
BEIGENE LTD-ADR	1,790	132.22	236,673.80
BIOGEN INC	9,022	332.87	3,003,153.14
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	93.99	706,428.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,826	51.67	3,762,919.42
CELGENE CORP	31,507	90.69	2,857,369.83
ELI LILLY & CO	42,585	122.48	5,215,810.80
GILEAD SCIENCES INC	57,802	67.59	3,906,837.18
ILLUMINA INC	6,286	299.82	1,884,668.52

INCYTE CORP	7,576	84.15	637,520.40
IQVIA HOLDINGS INC	6,827	141.85	968,409.95
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	125.93	327,921.72
JOHNSON & JOHNSON	118,547	136.38	16,167,439.86
MERCK & CO. INC.	117,778	79.81	9,399,862.18
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	668.86	743,772.32
MYLAN NV	22,501	31.84	716,431.84
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	41.69	293,247.46
PERRIGO CO PLC	5,561	48.95	272,210.95
PFIZER INC	259,385	42.40	10,997,924.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	423.97	1,438,106.24
SEATTLE GENETICS INC	4,290	71.48	306,649.20
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	43,466	17.98	781,518.68
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,937	252.49	4,528,913.13
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,809	119.63	216,410.67
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,516	188.07	2,165,814.12
WATERS CORP	3,459	234.69	811,792.71
ZOETIS INC	21,768	95.37	2,076,014.16
BANK OF AMERICA CORP	419,690	29.11	12,217,175.90
BB & T CORPORATION	34,052	50.70	1,726,436.40
CIT GROUP INC	4,770	50.77	242,172.90
CITIGROUP INC	111,631	64.27	7,174,524.37
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	36.70	739,211.40
COMERICA INC	7,145	86.37	617,113.65
EAST WEST BANCORP INC	6,233	53.93	336,145.69
FIFTH THIRD BANCORP	28,485	27.17	773,937.45
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,722	101.63	683,156.86
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	14.01	642,036.27
JPMORGAN CHASE & CO	148,532	105.55	15,677,552.60
KEYCORP	45,615	17.51	798,718.65
M & T BANK CORP	6,295	172.27	1,084,439.65
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	17.34	243,366.90
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,839	124.15	2,587,161.85
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,311	16.00	756,976.00
SIGNATURE BANK	2,508	133.65	335,194.20
SUNTRUST BANKS INC	21,018	65.12	1,368,692.16
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	246.95	576,134.35
US BANCORP	69,104	51.31	3,545,726.24
WELLS FARGO & COMPANY	201,575	49.22	9,921,521.50
ZIONS BANCORPORATION	8,874	50.11	444,676.14
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	108.96	245,377.92
ALLY FINANCIAL INC	17,783	27.01	480,318.83

AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,731	107.38	3,407,274.78
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,450	130.68	842,886.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	7,749	19.34	149,865.66
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	44,951	52.99	2,381,953.49
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	57,396	205.29	11,782,824.84
BLACKROCK INC	5,227	431.95	2,257,802.65
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,675	81.57	1,768,029.75
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	93.54	460,497.42
CME GROUP INC.	15,517	175.40	2,721,681.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,482	71.29	1,032,421.78
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	47.46	520,493.82
EATON VANCE CORP	5,530	41.05	227,006.50
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	32.45	437,069.05
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,580	198.50	3,092,630.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,881	75.50	1,954,015.50
INVESCO LIMITED	18,328	18.86	345,666.08
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	21.02	270,842.70
MOODY'S CORP	7,897	169.26	1,336,646.22
MORGAN STANLEY	58,812	41.99	2,469,515.88
MSCI INC-A	3,805	175.17	666,521.85
NASDAQ INC	5,459	87.76	479,081.84
NORTHERN TRUST CORP	9,865	93.09	918,332.85
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	82.33	451,991.70
S&P GLOBAL INC	11,000	198.32	2,181,520.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,994	46.36	2,456,801.84
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	52.17	305,820.54
STATE STREET CORP	16,881	70.66	1,192,811.46
SYNCHRONY FINANCIAL	30,645	31.75	972,978.75
T ROWE PRICE GROUP INC	11,217	97.58	1,094,554.86
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	56.86	670,379.40
VOYA FINANCIAL INC	7,528	49.58	373,238.24
AFLAC INC	34,792	49.28	1,714,549.76
ALLEGHANY CORPORATION	635	648.84	412,013.40
ALLSTATE CORP	15,758	94.38	1,487,240.04
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	98.10	347,175.90
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,225	42.32	1,702,322.00
AON PLC	10,964	171.97	1,885,479.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	31.50	561,424.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	79.84	605,746.08
ASSURANT INC	2,198	98.21	215,865.58
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	44.33	269,659.39
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	41.95	178,623.10

CHUBB LTD	20,144	133.21	2,683,382.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	85.48	539,464.28
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	216.93	357,934.50
FNF GROUP	10,851	34.76	377,180.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	48.73	741,426.95
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	61.61	566,380.73
LOEWS CORPORATION	10,639	46.70	496,841.30
MARKEL CORP	577	1,009.80	582,654.60
MARSH & MCLENNAN COS	22,762	91.16	2,074,983.92
METLIFE INC	38,332	44.86	1,719,573.52
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	50.79	604,401.00
PROGRESSIVE CORP	25,645	71.26	1,827,462.70
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,334	94.15	1,726,146.10
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	144.36	436,255.92
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	142.17	213,823.68
TORCHMARK CORPORATION	4,615	83.36	384,706.40
TRAVELERS COS INC(THE)	12,165	128.74	1,566,122.10
UNUM GROUP	9,769	36.32	354,810.08
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	81.40	315,262.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	169.56	925,797.60
CBRE GROUP INC-A	13,193	50.04	660,177.72
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,132	120.13	2,178,197.16
EQUINIX INC	3,520	421.39	1,483,292.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	7.11	371,853.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	164.96	331,074.72
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	185.50	887,803.00
ACCENTURE PLC-CL A	28,529	159.23	4,542,672.67
ADOBE INC	21,573	259.45	5,597,114.85
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	70.09	518,245.46
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	173.21	384,872.62
ANSYS INC	3,662	174.49	638,982.38
AUTODESK INC	9,933	160.35	1,592,756.55
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,060	149.67	2,852,710.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	100.35	491,715.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	52.58	615,922.12
CDK GLOBAL INC	5,003	58.19	291,124.57
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,542	120.10	665,594.20
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	106.49	601,774.99
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,483	73.56	1,874,529.48
DELL TECHNOLOGIES INC-C	6,212	55.00	341,660.00
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	65.46	774,653.64
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,914	108.93	1,624,582.02

FIRST DATA CORP-CLASS A	25,471	25.58	651,548.18
FISERV INC	18,391	85.78	1,577,579.98
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	224.05	856,767.20
FORTINET INC	5,937	83.11	493,424.07
GARTNER INC	4,011	143.35	574,976.85
GLOBAL PAYMENTS INC	6,630	123.30	817,479.00
GODADDY INC - CLASS A	6,638	72.86	483,644.68
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,214	138.03	5,550,738.42
INTUIT INC	10,638	233.32	2,482,058.16
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	133.79	429,733.48
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	63.37	384,909.38
MASTERCARD INC-CL A	40,645	222.11	9,027,660.95
MICROSOFT CORP	321,390	108.22	34,780,825.80
ORACLE CORPORATION	131,548	51.72	6,803,662.56
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	226.77	888,258.09
PAYCHEX INC	14,864	75.78	1,126,393.92
PAYPAL HOLDINGS INC	50,044	94.91	4,749,676.04
PTC INC	5,462	91.93	502,121.66
RED HAT INC	8,075	180.98	1,461,413.50
SABRE CORP	9,850	22.53	221,920.50
SALESFORCE.COM, INC.	31,962	159.05	5,083,556.10
SERVICENOW INC	7,838	234.89	1,841,067.82
SPLUNK INC	6,247	136.25	851,153.75
SQUARE INC-A	13,915	75.64	1,052,530.60
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	59.86	541,254.12
SYMANTEC CORPORATION	27,227	23.15	630,305.05
SYNOPSYS INC	6,139	101.65	624,029.35
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	92.78	666,067.62
VERISIGN INC	5,108	175.40	895,943.20
VISA INC	78,605	144.91	11,390,650.55
VMWARE INC	3,055	169.68	518,372.40
WESTERN UNION COMPANY	19,054	17.80	339,161.20
WIX.COM LTD	2,198	121.40	266,837.20
WORKDAY INC-CLASS A	6,686	190.79	1,275,621.94
WORLDPAY INC-CL A	13,838	88.23	1,220,926.74
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,750	92.69	1,274,487.50
APPLE INC	213,067	170.42	36,310,878.14
ARISTA NETWORKS INC	2,260	263.95	596,527.00
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	81.19	335,314.70
CDW CORP/DE	6,306	94.84	598,061.04
CISCO SYSTEMS INC	207,195	49.43	10,241,648.85
COGNEX CORP	7,187	50.73	364,596.51

COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	22.68	199,652.04
CORNING INC	37,084	34.51	1,279,768.84
F5 NETWORKS INC	2,620	171.28	448,753.60
FLEX LTD	23,204	10.25	237,841.00
FLIR SYSTEMS INC	5,286	52.41	277,039.26
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	68,235	16.09	1,097,901.15
HP INC	69,703	23.28	1,622,685.84
IPG PHOTONICS CORP	1,776	154.88	275,066.88
JUNIPER NETWORKS INC	15,026	27.12	407,505.12
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,598	80.38	610,727.24
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,737	138.63	933,950.31
NETAPP INC	11,136	64.03	713,038.08
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	45.71	517,985.72
TE CONNECTIVITY LTD	15,934	82.14	1,308,818.76
TRIMBLE INC	10,356	39.21	406,058.76
WESTERN DIGITAL CORP	13,851	47.65	660,000.15
XEROX CORP	9,697	30.46	295,370.62
AT&T INC	319,942	30.47	9,748,632.74
CENTURYLINK INC	40,608	13.74	557,953.92
SPRINT CORP	36,740	6.30	231,462.00
T-MOBILE US INC	15,612	72.05	1,124,844.60
VERIZON COMMUNICATIONS INC	182,041	55.16	10,041,381.56
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	25.71	237,586.11
AES CORPORATION	27,194	16.92	460,122.48
ALLIANT ENERGY CORP	11,027	44.98	495,994.46
AMEREN CORPORATION	10,336	69.68	720,212.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,663	79.27	1,717,226.01
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,199	98.05	803,911.95
ATMOS ENERGY CORP	4,697	97.05	455,843.85
CENTERPOINT ENERGY INC	22,526	30.89	695,828.14
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	52.77	604,955.28
CONSOLIDATED EDISON INC	14,296	78.51	1,122,378.96
DOMINION ENERGY INC	32,632	73.26	2,390,620.32
DTE ENERGY COMPANY	8,162	119.81	977,889.22
DUKE ENERGY CORP	30,963	87.51	2,709,572.13
EDISON INTERNATIONAL	13,539	60.50	819,109.50
ENERGY CORP	8,240	89.86	740,446.40
EVERGY INC	11,852	58.77	696,542.04
EVERSOURCE ENERGY	13,730	70.20	963,846.00
EXELON CORP	42,258	48.26	2,039,371.08
FIRSTENERGY CORP	21,413	39.59	847,740.67
NEXTERA ENERGY INC	21,032	184.04	3,870,729.28



NISOURCE INC	15,794	27.08	427,701.52
NRG ENERGY INC	13,738	42.46	583,315.48
OGE ENERGY CORP	9,056	41.88	379,265.28
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	89.96	460,595.20
PPL CORPORATION	32,318	30.46	984,406.28
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	23,080	56.32	1,299,865.60
SEMPRA ENERGY	11,603	115.26	1,337,361.78
SOUTHERN CO	44,322	48.56	2,152,276.32
UGI CORPORATION	7,497	53.44	400,639.68
VISTRA ENERGY CORP	13,852	26.51	367,216.52
WEC ENERGY GROUP INC	14,523	74.47	1,081,527.81
XCEL ENERGY INC	22,653	53.46	1,211,029.38
ADVANCED MICRO DEVICES	39,452	23.68	934,223.36
ANALOG DEVICES INC	16,833	105.74	1,779,921.42
APPLIED MATERIALS INC	41,888	39.10	1,637,820.80
BROADCOM INC	19,188	281.93	5,409,672.84
INTEL CORP	203,147	51.66	10,494,574.02
KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	108.19	701,612.15
LAM RESEARCH CORP	7,045	181.09	1,275,779.05
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	18.83	506,093.91
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	55.85	649,088.70
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	91.10	921,658.70
MICRON TECHNOLOGY INC	50,850	41.99	2,135,191.50
NVIDIA CORP	25,766	157.34	4,054,022.44
NXP SEMICONDUCTORS NV	15,460	93.04	1,438,398.40
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	22.97	400,481.95
QORVO INC	4,855	65.16	316,351.80
QUALCOMM INC	60,895	51.98	3,165,322.10
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	83.38	661,870.44
TEXAS INSTRUMENTS INC	43,277	107.57	4,655,306.89
XILINX INC	11,291	119.31	1,347,129.21
米ドル 小計	13,387,742		1,056,400,715.63 (116,774,535,105)
カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	17,074	10.14	173,130.36
CAMECO CORP	16,384	16.32	267,386.88
CANADIAN NATURAL RESOURCES	55,596	36.87	2,049,824.52
CENOVUS ENERGY INC	41,433	11.48	475,650.84
ENBRIDGE INC	87,692	47.40	4,156,600.80
ENCANA CORP	41,829	9.14	382,317.06
HUSKY ENERGY INC	14,553	15.62	227,317.86
IMPERIAL OIL LTD	12,999	36.22	470,823.78
INTER PIPELINE LTD	18,081	21.32	385,486.92

KEYERA CORP	8,467	28.57	241,902.19
PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	48.66	1,055,970.66
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	18.58	167,926.04
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	8,534	10.65	90,887.10
SUNCOR ENERGY INC	72,641	44.88	3,260,128.08
TOURMALINE OIL CORP	12,887	20.34	262,121.58
TRANSCANADA CORP	39,882	56.74	2,262,904.68
VERMILION ENERGY INC	5,586	32.58	181,991.88
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	57.16	554,280.52
BARRICK GOLD CORP	74,120	17.12	1,268,934.40
CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	59.38	318,158.04
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	14.01	443,724.72
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	101.12	816,240.64
GOLDCORP INC	42,547	14.33	609,698.51
KINROSS GOLD CORP	57,099	4.59	262,084.41
LUNDIN MINING CORP	28,209	6.51	183,640.59
METHANEX CORPORATION	2,452	75.77	185,788.04
NUTRIEN LTD	26,986	70.76	1,909,529.36
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,552	28.66	703,660.32
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.25	101,490.75
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	71.38	205,074.74
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	28.24	552,882.72
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	2.50	189,630.00
CAE INC	13,932	27.83	387,727.56
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	26.38	161,313.70
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	33.88	279,510.00
WSP GLOBAL INC	4,524	70.08	317,041.92
THOMSON REUTERS CORP	9,879	70.13	692,814.27
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,885	111.38	3,551,351.30
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,426	270.72	1,739,646.72
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	68.81	1,007,447.21
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	45.66	413,953.56
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,929	85.68	936,396.72
STARS GROUP INC/THE	6,424	21.30	136,831.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.96	522,457.84
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	140.43	339,419.31
DOLLARAMA INC	15,367	35.69	548,448.23
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,945	72.99	1,455,785.55
EMPIRE CO LTD A	7,235	30.73	222,331.55
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	66.72	569,722.08
METRO INC	11,418	48.57	554,572.26
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	97.25	302,642.00

SAPUTO INC	9,854	41.63	410,222.02	
AURORA CANNABIS INC	28,563	9.30	265,635.90	
BAUSCH HEALTH COS INC	14,796	33.67	498,181.32	
CANOPY GROWTH CORP	8,388	62.81	526,850.28	
BANK OF MONTREAL	27,525	98.13	2,701,028.25	
BANK OF NOVA SCOTIA	55,112	74.77	4,120,724.24	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	20,109	113.05	2,273,322.45	
NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	62.19	915,125.85	
ROYAL BANK OF CANADA	64,055	101.41	6,495,817.55	
TORONTO-DOMINION BANK	81,292	75.36	6,126,165.12	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	36,043	58.29	2,100,946.47	
CI FINANCIAL CORP	11,041	19.33	213,422.53	
IGM FINANCIAL INC	3,023	34.12	103,144.76	
ONEX CORPORATION	4,217	76.92	324,371.64	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	651.14	750,764.42	
GREAT-WEST LIFE CO INC	14,200	29.47	418,474.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	50.01	242,598.51	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	109.21	684,091.44	
MANULIFE FINANCIAL CORP	84,843	21.47	1,821,579.21	
POWER CORP OF CANADA	14,595	27.11	395,670.45	
POWER FINANCIAL CORP	11,076	28.28	313,229.28	
SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	49.06	1,266,925.44	
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.82	142,833.72	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	11.50	298,919.50	
CGI INC-CL A	11,470	87.88	1,007,983.60	
CONSTELLATION SOFTWARE	848	1,095.31	928,822.88	
OPEN TEXT CORPORATION	11,689	49.70	580,943.30	
SHOPIFY INC-CLASS A	3,824	236.05	902,655.20	
BCE INC	6,928	57.33	397,182.24	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,795	72.59	1,219,149.05	
TELUS CORPORATION	7,611	47.10	358,478.10	
ALTAGAS LTD	9,753	15.76	153,707.28	
ATCO LTD-CLASS I	3,030	41.78	126,593.40	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	33.32	244,702.08	
EMERA INC	2,409	46.45	111,898.05	
FORTIS INC	17,933	46.58	835,319.14	
HYDRO ONE LTD	15,052	20.72	311,877.44	
カナダドル 小計	1,836,798		79,145,958.08 (6,609,478,959)	
ユーロ				
ENAGAS	10,471	24.74	259,052.54	
ENI SPA	111,408	15.12	1,684,488.96	
GALP ENERGIA SGPS S.A	25,110	14.38	361,207.35	

NESTE OYJ	5,632	87.38	492,124.16
OMV AG	6,314	46.29	292,275.06
REPSOL SA	63,434	15.17	962,293.78
SNAM SPA	103,665	4.18	433,838.02
TENARIS S.A.	18,477	11.80	218,028.60
TOTAL SA	105,643	49.69	5,249,928.88
VOPAK	3,130	43.58	136,405.40
AIR LIQUIDE SA	18,664	106.85	1,994,248.40
AKZO NOBEL	9,650	81.08	782,422.00
ARCELORMITTAL	31,425	20.15	633,213.75
ARKEMA	3,250	83.70	272,025.00
BASF SE	40,465	66.32	2,683,638.80
COVESTRO AG	8,053	51.08	411,347.24
CRH PLC	36,636	26.90	985,508.40
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	25.10	161,869.90
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	41.24	138,978.80
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	61.82	406,404.68
IMERYS SA	1,384	49.72	68,812.48
KONINKLIJKE DSM NV	8,310	94.40	784,464.00
LANXESS	3,160	48.71	153,923.60
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,196	26.58	271,009.68
SOLVAY SA	3,263	98.74	322,188.62
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	12.14	300,090.80
SYMRISE AG	5,581	77.44	432,192.64
THYSSENKRUPP AG	19,367	13.26	256,806.42
UMICORE	8,730	35.40	309,042.00
UPM-KYMMENE OYJ	24,675	26.81	661,536.75
VOESTALPINE AG	5,079	25.79	130,987.41
ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	11,553	0.47	5,468.03
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,553	37.21	429,887.13
AIRBUS SE	26,054	110.98	2,891,472.92
ALSTOM RGPT	6,452	37.56	242,337.12
ANDRITZ AG	3,392	44.06	149,451.52
BOUYGUES SA	11,049	31.00	342,519.00
BRENTAG AG	6,629	43.43	287,897.47
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.42	406,567.20
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	32.67	694,760.22
DASSAULT AVIATION SA	89	1,321.00	117,569.00
EIFFAGE SA	3,580	82.46	295,206.80
FERROVIAL SA	23,072	19.81	457,171.68
GEA GROUP AG	8,178	20.51	167,730.78
HOCHTIEF AG	825	133.60	110,220.00

KINGSPAN GROUP PLC	7,347	37.96	278,892.12
KION GROUP AG	3,179	54.14	172,111.06
KONE OYJ-B	15,370	44.55	684,733.50
LEGRAND SA	12,541	57.42	720,104.22
LEONARDO SPA	18,310	8.90	163,032.24
METSO OYJ	3,963	28.66	113,579.58
MTU AERO ENGINES AG	2,011	195.80	393,753.80
OSRAM LICHT AG	4,588	41.15	188,796.20
PRYSMIAN SPA	9,379	18.84	176,700.36
REXEL SA	12,854	10.90	140,172.87
SAFRAN SA	14,623	115.15	1,683,838.45
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,885	68.16	1,696,161.60
SIEMENS AG-REG	34,121	94.62	3,228,529.02
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	13.68	157,131.17
THALES SA	4,530	106.85	484,030.50
VINCI S.A.	22,212	80.52	1,788,510.24
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	14.23	269,084.20
BIC	1,337	83.95	112,241.15
BUREAU VERITAS SA	12,626	19.64	248,037.77
ELENRED	9,497	37.09	352,243.73
RANDSTAD NV	4,694	46.82	219,773.08
TELEPERFORMANCE	2,489	155.60	387,288.40
WOLTERS KLUWER-CVA	12,856	56.00	719,936.00
AENA SME SA	2,881	153.55	442,377.55
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	169.00	227,474.00
ATLANTIA SPA	22,160	20.96	464,473.60
BOLLORE	39,433	3.70	146,059.83
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	22.37	207,146.20
DEUTSCHE POST AG-REG	45,081	26.75	1,205,916.75
FRAPORT AG	1,856	70.44	130,736.64
GETLINK	16,953	12.63	214,116.39
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	7.57	176,277.27
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	11.84	19,109.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,180	70.77	1,074,288.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	61.85	155,119.80
CONTINENTAL AG	4,655	138.65	645,415.75
DAIMLER AG	40,918	50.61	2,070,859.98
FAURECIA	3,127	39.40	123,203.80
FERRARI NV	5,649	111.30	628,733.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,785	13.02	596,395.41
MICHELIN (CGDE)-B	7,374	101.40	747,723.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	30.12	165,870.84

PIRELLI & C SPA	17,484	6.07	106,197.81
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	6,624	56.04	371,208.96
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	21.29	556,116.09
RENAULT SA	8,830	59.63	526,532.90
VALEO SA	9,959	26.26	261,523.34
VOLKSWAGEN AG	1,256	147.50	185,260.00
VOLKSWAGEN AG PFD	8,203	144.40	1,184,513.20
ADIDAS AG	8,502	199.15	1,693,173.30
ESSILORLUXOTTICA	12,648	105.80	1,338,158.40
HERMES INTERNATIONAL	1,312	540.80	709,529.60
HUGO BOSS AG	2,203	62.22	137,070.66
KERING	3,429	473.50	1,623,631.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,380	294.20	3,642,196.00
MONCLER SPA	7,711	34.35	264,872.85
PUMA SE	383	442.50	169,477.50
SEB SA	1,032	139.00	143,448.00
ACCOR SA	7,551	39.65	299,397.15
PADDY POWER BETFAIR PLC	4,063	70.60	286,847.80
SODEXO	3,900	94.04	366,756.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	53.30	90,503.40
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	17.68	154,275.68
JC DECAUX SA	2,828	27.12	76,695.36
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	15.50	168,190.50
PUBLICIS GROUPE	9,116	47.67	434,559.72
RTL GROUP	1,615	46.96	75,840.40
SES	17,687	17.98	318,012.26
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	38.30	83,532.30
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	67.10	236,393.30
VIVENDI SA	43,372	24.01	1,041,361.72
DELIVERY HERO SE	3,417	35.80	122,328.60
INDITEX	47,526	25.59	1,216,190.34
ZALANDO SE	5,372	26.14	140,424.08
CARREFOUR SA	26,320	18.13	477,313.20
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	45.00	82,485.00
COLRUYT NV	3,100	62.50	193,750.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	8,915	12.74	113,621.67
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	53,314	22.97	1,224,622.58
METRO AG	8,344	15.25	127,246.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,699	68.45	2,306,696.55
DANONE	26,497	65.69	1,740,587.93
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	8.19	188,140.81
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	84.10	445,057.20

HEINEKEN NV	11,926	87.62	1,044,956.12
KERRY GROUP PLC-A	7,177	92.05	660,642.85
PERNOD-RICARD SA	9,080	150.55	1,366,994.00
REMY COINTREAU	1,273	112.60	143,339.80
BEIERSDORF AG	4,089	91.62	374,634.18
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	80.85	378,458.85
HENKEL AG & CO KGAA	7,849	86.90	682,078.10
L'OREAL	11,256	221.80	2,496,580.80
UNILEVER NV-CVA	68,559	48.93	3,354,934.66
BIOMERIEUX	1,779	69.70	123,996.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	68.50	628,898.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,038	47.26	899,735.88
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,641	35.09	1,426,092.69
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	148.40	194,107.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	35.65	234,719.60
BAYER AG	41,702	68.17	2,842,825.34
EUROFINS SCIENTIFIC	484	341.00	165,044.00
GRIFOLS S.A.	11,922	23.80	283,743.60
IPSEN	1,498	125.10	187,399.80
MERCK KGAA	5,705	96.92	552,928.60
ORION OYJ	4,259	29.20	124,362.80
QIAGEN N.V.	10,011	34.05	340,874.55
RECORDATI SPA	4,578	33.83	154,873.74
SANOFI	50,087	75.24	3,768,545.88
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	102.10	158,765.50
UCB SA	5,244	78.80	413,227.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	20.49	387,588.84
AIB GROUP PLC	36,918	3.88	143,537.18
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,783	5.19	1,520,714.90
BANCO DE SABADELL SA	235,029	0.95	223,888.62
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	726,938	4.10	2,980,445.80
BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	5.46	205,866.55
BANKIA SA	48,396	2.54	123,313.00
BANKINTER,S.A.	26,969	6.91	186,409.72
BNP PARIBAS	50,571	42.11	2,129,544.81
CAIXABANK	149,132	3.01	449,036.45
COMMERZBANK AG	46,644	6.66	310,928.90
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	10.19	505,497.28
ERSTE GROUP BANK AG	13,217	32.00	422,944.00
ING GROEP NV-CVA	175,231	11.04	1,934,900.70
INTESA SANPAOLO	666,967	2.04	1,365,281.44

KBC GROUPE SA	10,878	61.64	670,519.92
MEDIOBANCA SPA	26,782	8.30	222,451.29
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	22.51	150,299.27
SOCIETE GENERALE	35,517	24.54	871,764.76
UNICREDIT SPA	88,548	11.22	993,862.75
AMUNDI SA	2,379	54.42	129,465.18
DEUTSCHE BANK AG -REG	92,086	7.72	711,088.09
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	111.30	915,665.10
EURAZEO	2,123	63.85	135,553.55
EXOR NV	4,683	56.38	264,027.54
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	82.42	278,167.50
NATIXIS	45,362	4.41	200,273.23
WENDEL	1,082	106.00	114,692.00
AEGON NV	74,580	4.56	340,606.86
AGEAS	9,051	41.47	375,344.97
ALLIANZ SE-REG	19,085	190.14	3,628,821.90
ASSICURAZIONI GENERALI	51,717	15.23	787,649.91
AXA SA	82,899	20.74	1,719,739.75
CNP ASSURANCES	8,978	20.18	181,176.04
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,386	128.70	307,078.20
MAPFRE SA	46,367	2.45	113,599.15
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,592	204.20	1,346,086.40
NN GROUP NV	12,995	37.86	491,990.70
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.74	205,749.25
SAMPO OYJ-A SHS	19,253	42.40	816,327.20
SCOR SE	7,100	38.30	271,930.00
AROUNDTOWN SA	34,226	7.58	259,604.21
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,160	42.60	688,416.00
VONOVIA SE	22,168	44.20	979,825.60
AMADEUS IT GROUP SA	19,963	68.32	1,363,872.16
ATOS SE	4,547	82.82	376,582.54
CAPGEMINI SA	7,156	102.55	733,847.80
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	128.35	709,647.15
SAP SE	43,744	94.30	4,125,059.20
WIRECARD AG	4,828	99.90	482,317.20
INGENICO S.A.	2,691	54.92	147,789.72
NOKIA OYJ	248,108	5.56	1,381,465.34
1&1 DRILLISCH AG	2,188	34.14	74,698.32
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	149,746	14.26	2,135,377.96
ELISA OYJ	5,909	35.91	212,192.19
ILIAD SA	1,016	88.34	89,753.44
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.72	385,301.82



	ORANGE S.A.	90,986	13.42	1,221,487.05
	PROXIMUS SA	6,313	21.96	138,633.48
	TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.51	253,751.78
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.44	111,360.45
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.98	120,656.87
	TELEFONICA S.A.	204,679	7.50	1,535,092.50
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,179	32.87	137,363.73
	E.ON SE	94,119	9.64	907,307.16
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	108,125	3.24	351,190.00
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	13.99	400,645.62
	ENDESA S.A.	12,944	21.51	278,425.44
	ENEL SPA	361,804	5.23	1,894,405.74
	ENGIE	78,100	14.12	1,102,772.00
	FORTUM OYJ	19,573	19.66	384,903.04
	IBERDROLA SA	279,399	7.25	2,025,642.75
	INNOGY SE	5,851	40.55	237,258.05
	NATURGY ENERGY GROUP SA	16,170	23.64	382,258.80
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	16,549	19.37	320,554.13
	RWE AG	22,852	22.34	510,513.68
	SUEZ	17,725	11.09	196,658.87
	TERNA SPA	66,384	5.35	355,287.16
	UNIPER SE	8,953	25.72	230,271.16
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	19.09	412,095.83
	VERBUND AG	2,937	42.84	125,821.08
	ASML HOLDING NV	17,784	163.08	2,900,214.72
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	19.98	967,773.62
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	14.69	412,077.19
	ユーロ 小計	8,816,359		161,790,974.23 (20,212,546,410)
英bond	BP PLC	880,162	5.43	4,783,680.47
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	202,456	24.24	4,907,533.44
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	165,015	24.43	4,032,141.52
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.23	170,877.12
	ANGLO AMERICAN PLC	44,719	19.51	872,557.12
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.73	169,741.34
	BHP GROUP PLC	93,051	17.92	1,668,218.32
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,506	51.58	335,579.48
	FRESNILLO PLC	8,512	9.69	82,532.35
	GLENCORE PLC	499,559	3.03	1,516,910.90
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,294	30.95	225,749.30
	MONDI PLC	17,733	18.95	336,040.35
	RIO TINTO PLC	51,055	43.98	2,245,398.90

ASHTREAD GROUP PLC	19,216	20.33	390,661.28
BAE SYSTEMS PLC	147,630	5.27	778,010.10
BUNZL PLC	13,431	24.88	334,163.28
DCC PLC	4,734	67.95	321,675.30
FERGUSON PLC	9,945	54.73	544,289.85
MEGGITT PLC	36,960	5.55	205,128.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	1.70	361,386.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	9.71	696,289.80
SMITHS GROUP PLC	18,742	14.91	279,536.93
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	15.67	144,554.85
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	5.52	63,205.60
EXPERIAN PLC	42,116	20.27	853,691.32
G4S PLC	74,291	2.05	152,445.13
INTERTEK GROUP PLC	6,794	51.88	352,472.72
RELX PLC	86,570	17.20	1,489,004.00
EASYJET PLC	7,630	12.78	97,549.55
ROYAL MAIL PLC	36,064	2.79	100,690.68
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.63	223,952.09
BURBERRY GROUP PLC	17,470	19.53	341,189.10
PERSIMMON PLC	13,916	24.05	334,679.80
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.64	212,881.21
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	38.21	203,888.56
CARNIVAL PLC	8,091	43.38	350,987.58
COMPASS GROUP PLC	69,382	17.43	1,209,675.17
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.40	152,708.01
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,220	46.39	334,935.80
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.53	115,023.88
TUI AG-DI	17,636	8.09	142,675.24
WHITBREAD PLC	7,771	49.65	385,830.15
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	4.54	191,004.72
INFORMA PLC	54,642	7.04	385,007.53
ITV PLC	151,064	1.33	201,066.18
PEARSON PLC	38,226	9.20	351,908.55
WPP PLC	54,571	8.46	461,779.80
KINGFISHER PLC	109,678	2.25	247,323.89
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.85	203,704.25
NEXT PLC	6,856	47.24	323,877.44
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.86	183,557.23
TESCO PLC	426,993	2.24	957,318.30
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.37	239,622.99
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	22.66	380,030.86
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	101,055	28.59	2,889,162.45

	COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.62	222,996.48
	DIAGEO PLC	109,640	30.64	3,359,917.80
	IMPERIAL BRANDS PLC	43,416	26.51	1,151,175.24
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,280	60.17	1,761,777.60
	UNILEVER PLC	49,828	42.49	2,117,191.72
	CONVATEC GROUP PLC	61,239	1.18	72,598.83
	NMC HEALTH PLC	3,733	27.74	103,553.42
	SMITH & NEPHEW PLC	37,643	14.51	546,199.93
	ASTRAZENECA PLC	56,444	62.41	3,522,670.04
	GLAXOSMITHKLINE PLC	218,523	15.81	3,454,848.63
	BARCLAYS PLC	752,904	1.59	1,200,881.88
	HSBC HOLDINGS PLC	882,563	6.65	5,876,987.01
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,196,250	0.58	1,867,888.50
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.47	517,658.62
	STANDARD CHARTERED PLC	125,623	6.37	801,349.11
	3I GROUP PLC	46,773	9.47	442,940.31
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	16.65	183,782.70
	INVESTEC PLC	33,008	4.92	162,696.43
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	46.85	607,972.45
	SCHRODERS PLC	6,213	26.98	167,626.74
	ST JAMES' S PLACE PLC	21,830	9.49	207,210.36
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.33	239,532.97
	ADMIRAL GROUP PLC	7,842	21.44	168,132.48
	AVIVA PLC	181,146	4.23	766,791.01
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.50	221,638.07
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.66	663,970.03
	PRUDENTIAL PLC	113,202	15.32	1,734,820.65
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.36	217,122.88
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	16.80	306,012.00
	SAGE GROUP PLC/THE	51,945	6.59	342,317.55
	BT GROUP PLC	365,274	2.31	844,513.48
	VODAFONE GROUP PLC	1,195,988	1.41	1,688,735.05
	CENTRICA PLC	254,915	1.37	350,635.58
	NATIONAL GRID PLC	147,017	8.42	1,238,177.17
	SEVERN TRENT PLC	9,868	19.45	191,932.60
	SSE PLC	44,560	11.98	534,051.60
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.17	271,301.19
	英ポンド 小計	13,243,527		77,665,113.89 (11,080,481,798)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	20.66	208,686.66
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	554.50	177,994.50
	GIVAUDAN-REG	413	2,453.00	1,013,089.00

	LAFARGEHOLCIM LTD	22,384	47.92	1,072,641.28	
	SIKA AG	5,281	130.30	688,114.30	
	ABB LTD	81,000	19.77	1,601,775.00	
	GEBERIT AG-REG	1,593	394.80	628,916.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	700	217.40	152,180.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	223.60	380,343.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	52.90	371,305.10	
	SGS SA	255	2,483.00	633,165.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	138.40	326,900.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,686	72.26	1,711,550.36	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	284.50	378,385.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	55.15	138,757.40	
	DUFREY AG-REG	1,180	99.72	117,669.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,707.00	186,063.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,280.00	282,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	72,100.00	288,400.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	134,947	89.10	12,023,777.70	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	189.35	500,452.05	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	738.50	321,247.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	292.40	923,984.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	95,969	90.08	8,644,887.52	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	31,126	272.55	8,483,391.30	
	VIFOR PHARMA AG	1,781	128.00	227,968.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	113,020	11.75	1,327,985.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	40.81	390,061.98	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	78.95	147,399.65	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	679	704.00	478,016.00	
	UBS GROUP AG	168,121	12.99	2,184,732.39	
	BALOISE HOLDING AG	1,987	157.20	312,356.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	415.10	611,027.20	
	SWISS RE AG	13,910	97.12	1,350,939.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,815	322.10	2,195,111.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,252	84.60	275,119.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,416	140.90	340,414.40	
	SWISSCOM AG-REG	1,242	447.50	555,795.00	
	スイスフラン 小計	756,400		51,653,202.99 (5,688,050,713)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	298.40	2,039,265.60	
	BOLIDEN AB	13,931	238.90	3,328,115.90	
	ALFA LAVAL AB	12,041	198.90	2,394,954.90	
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	188.95	8,206,098.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,698	251.55	7,470,531.90	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,108	233.75	4,466,495.00	
	EPIROC AB-A	30,249	90.53	2,738,441.97	
	EPIROC AB-B	16,107	84.92	1,367,806.44	
	SANDVIK AB	51,127	151.15	7,727,846.05	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	162.60	2,554,608.60	
	SKF AB-B SHARES	16,642	156.30	2,601,144.60	
	VOLVO AB-B SHS	70,432	135.25	9,525,928.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	144.50	1,767,813.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	237.60	2,624,529.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	75.30	1,400,052.90	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	136.38	4,943,502.24	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	351.30	1,247,115.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	452.60	3,419,393.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,040	258.50	7,248,340.00	
	NORDEA BANK ABP	130,401	84.90	11,071,044.90	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	76,224	98.16	7,482,147.84	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,140	102.65	7,097,221.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	209.60	8,180,688.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	187.35	1,173,935.10	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	412.00	8,196,740.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	217.50	2,448,397.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	288.20	903,218.80	
	ERICSSON LM-B SHS	136,211	86.68	11,806,769.48	
	HEXAGON AB-B SHS	11,065	471.40	5,216,041.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	565.00	1,522,110.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,857	118.45	2,233,611.65	
	TELIA CO AB	126,963	39.73	5,044,239.99	
	スウェーデンクローナ 小計	1,093,713		149,448,148.46 (1,782,916,411)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,073	292.40	1,483,345.20	
	EQUINOR ASA	50,025	200.30	10,020,007.50	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	34.68	2,095,851.12	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	340.20	2,548,778.40	
	SCIBSTED ASA-B SHS	5,466	297.00	1,623,402.00	
	MOWI ASA	19,167	197.80	3,791,232.60	
	ORKLA ASA	33,915	67.68	2,295,367.20	
	DNB ASA	44,986	162.80	7,323,720.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,997	152.10	1,064,243.70	
	TELENOR ASA	31,196	162.70	5,075,589.20	
	ノルウェークローネ 小計	264,751		37,321,537.72 (478,088,898)	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	657.60	2,693,529.60	

デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	298.50	3,046,789.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	8,593	554.00	4,760,522.00
	ISS A/S	6,409	193.60	1,240,782.40
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,470.00	1,422,960.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	9,044.00	2,667,980.00
	DSV A/S	8,836	535.60	4,732,561.60
	PANDORA A/S	4,763	334.70	1,594,176.10
	CARLSBERG AS-B	4,678	797.40	3,730,237.20
	COLOPLAST-B	4,991	627.40	3,131,353.40
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	219.60	978,318.00
	GENMAB A/S	2,773	1,014.00	2,811,822.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	282.80	818,988.80
	NOVO NORDISK A/S-B	80,049	330.70	26,472,204.30
	DANSKE BANK A/S	29,784	124.40	3,705,129.60
	TRYG A/S	5,005	172.80	864,864.00
ORSTED A/S	8,941	474.30	4,240,716.30	
デンマーククローネ 小計		186,939		68,912,934.80 (1,153,602,528)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,863	28.06	388,995.78
	OIL SEARCH LTD	60,868	8.11	493,639.48
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	7.50	559,402.50
	SANTOS LTD	71,529	6.71	479,959.59
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	28.90	129,443.10
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,965	36.06	1,477,197.90
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	15.28	204,507.52
	ALUMINA LTD	106,977	2.62	280,279.74
	AMCOR LIMITED	50,321	14.74	741,731.54
	BHP GROUP LTD	131,611	36.47	4,799,853.17
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	12.12	279,838.68
	BORAL LIMITED	42,214	4.88	206,004.32
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	6.27	456,832.20
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.28	201,244.40
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	17.50	327,092.50
	NEWCREST MINING LIMITED	36,464	24.88	907,224.32
	ORICA LIMITED	17,981	18.20	327,254.20
	RIO TINTO LIMITED	15,921	91.30	1,453,587.30
	SOUTH32 LTD	223,474	3.81	851,435.94
	CIMIC GROUP LTD	4,062	49.81	202,328.22
BRAMBLES LIMITED	67,015	11.24	753,248.60	
SEEK LIMITED	12,504	17.14	214,318.56	
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.62	401,404.08	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,068	24.76	645,443.68	

CROWN RESORTS LTD	16,521	12.12	200,234.52		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,408	46.23	157,551.84		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	43.13	114,294.50		
TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.64	345,095.36		
REA GROUP LTD	3,067	78.02	239,287.34		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.56	73,133.08		
WESFARMERS LIMITED	49,461	33.30	1,647,051.30		
COLES GROUP LIMITED	46,407	12.60	584,728.20		
WOOLWORTHS GROUP LTD	60,049	30.03	1,803,271.47		
COCA-COLA AMATIL LIMITED	16,808	8.41	141,355.28		
TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	16.19	517,820.96		
COCHLEAR LIMITED	2,796	197.48	552,154.08		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	58.55	361,546.25		
SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	23.67	422,201.79		
CSL LIMITED	19,604	185.00	3,626,740.00		
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	128,479	26.81	3,444,521.99		
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	9.95	177,617.45		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	9.87	195,830.67		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	78,429	70.81	5,553,557.49		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	116,911	24.22	2,831,584.42		
WESTPAC BANKING CORPORATION	153,822	26.24	4,036,289.28		
AMP LIMITED	129,763	2.18	282,883.34		
ASX LTD	9,287	67.84	630,030.08		
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	7.29	167,830.38		
MACQUARIE GROUP LTD	14,246	124.22	1,769,638.12		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	7.48	755,494.96		
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.84	365,576.16		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	11.24	654,471.48		
SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.10	686,086.30		
COMPUTERSHARE LIMITED	22,639	18.25	413,161.75		
TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.18	539,744.58		
TPG TELECOM LTD	17,758	6.73	119,511.34		
AGL ENERGY LIMITED	28,043	22.05	618,348.15		
AUSNET SERVICES	85,220	1.74	148,282.80		
オーストラリアドル 小計	3,004,218		50,959,194.03 (4,027,305,104)		
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,032	5.22	161,987.04	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	7.50	318,802.50	
	A2 MILK CO LTD	36,279	12.70	460,743.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	13.51	296,936.29	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	11.23	222,578.60	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	4.06	324,419.52	

	MERIDIAN ENERGY LTD	58,184	3.75	218,190.00
	ニュージーランドドル 小計	289,609		2,003,657.25 (152,378,133)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	123,424	79.70	9,836,892.80
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	19.20	1,334,400.00
	MTR CORPORATION	67,000	43.80	2,934,600.00
	MINTH GROUP LTD	32,000	29.55	945,600.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	47.00	2,632,000.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	25.80	696,600.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	103,000	51.70	5,325,100.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	14.58	641,520.00
	SANDS CHINA LTD	110,800	36.00	3,988,800.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	10.30	659,200.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	8.06	644,800.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	17.88	1,265,904.00
	WH GROUP LIMITED	397,500	7.39	2,937,525.00
	BANK OF EAST ASIA	52,820	27.70	1,463,114.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	30.70	4,819,900.00
	HANG SENG BANK LTD	33,100	182.70	6,047,370.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	53,700	251.00	13,478,700.00
	AIA GROUP LTD	533,600	73.20	39,059,520.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	118,924	64.25	7,640,867.00
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	23.60	991,200.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.02	1,765,960.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,622	44.70	2,978,003.40
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	42.00	1,218,000.00
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	32.95	906,125.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	12.52	3,271,889.16
	SINO LAND CO	124,200	14.52	1,803,384.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	132.40	9,268,000.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,000	91.10	1,639,800.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	31.00	1,643,000.00
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	24.30	1,433,700.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	54.30	2,606,400.00
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	51.50	1,699,500.00
	PCCW LIMITED	194,000	4.76	923,440.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	63.35	1,900,500.00
	CLP HOLDINGS LTD	74,100	94.00	6,965,400.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	8.06	894,660.00
	HONG KONG & CHINA GAS	419,286	17.56	7,362,662.16
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	53.05	3,183,000.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	87.00	1,070,100.00



	香港ドル 小計	4,024,509		159,877,136.52 (2,251,070,082)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.08	356,288.00
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.57	112,360.40
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.71	253,393.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.40	126,000.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.40	280,080.00
	SATS LTD	26,800	5.06	135,608.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.76	244,644.16
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	1.08	303,156.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	86,650	2.48	214,892.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	36.10	169,670.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.26	91,936.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.30	230,670.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	24.79	1,906,351.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,700	11.52	1,551,744.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	60,500	25.68	1,553,640.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.79	277,324.00
	CAPITALAND LTD	104,500	3.36	351,120.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	9.41	151,501.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.60	143,220.00
	VENTURE CORP LTD	11,900	16.10	191,590.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	366,915	2.99	1,097,075.85	
	シンガポールドル 小計	2,053,551		9,742,263.41 (794,286,735)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	20.35	584,268.85
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	476.50	383,582.50
	BANK HAPOLIM BM	44,062	24.55	1,081,722.10
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	23.88	1,565,907.12
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	67.70	368,423.40
	AZRIELI GROUP	2,140	198.70	425,218.00
	NICE LTD	2,768	417.20	1,154,809.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	3.23	323,381.14
	イスラエルシュケル 小計	249,620		5,887,312.71 (179,857,403)
	合 計	49,207,736		171,184,598,279 (171,184,598,279)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 596銘柄	65.3%	68.2%
カナダドル	株式 88銘柄	3.7%	3.9%

ユーロ	株式	240銘柄	11.3%	11.8%
英ポンド	株式	92銘柄	6.2%	6.5%
スイスフラン	株式	38銘柄	3.2%	3.3%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	2.3%	2.4%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	1.3%	1.3%
シンガポールドル	株式	21銘柄	0.4%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	448,111.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	583,404.36	
		AMERICAN TOWER CORP	19,691	3,501,453.62	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	65,636	668,830.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,207,791.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,984	933,202.08	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	8,328	166,643.28	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	418,685.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,492	1,091,864.76	
		DUKE REALTY CORP	17,308	515,432.24	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,404	1,200,936.84	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,077	857,929.14	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	538,986.60	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	436,787.52	
		HCP, INC.	20,162	621,796.08	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	597,747.52	
		INVITATION HOMES INC	14,734	346,543.68	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	427,234.80	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	278,228.16	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	326,885.04	
		MACERICH COMPANY/THE	3,806	166,284.14	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	495,792.62			
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	337,289.12			
PROLOGIS INC	27,735	1,974,454.65			
PUBLIC STORAGE	6,909	1,435,275.66			

	REALTY INCOME CORPORATION	13,440	942,009.60
	REGENCY CENTERS CORP	6,080	403,225.60
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,474	2,470,592.64
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	361,362.00
	UDR INC	10,651	474,928.09
	VENTAS INC	16,435	1,071,726.35
	VEREIT INC	44,740	369,999.80
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	523,086.40
	WELLTOWER INC	16,526	1,282,582.86
	WEYERHAEUSER CO	35,206	899,161.24
	WP CAREY INC	6,694	503,388.80
	米ドル 小計	521,799	28,879,654.57 (3,192,357,016)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	85,947.75
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	186,992.33
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	120,563.55
	カナダドル 小計	14,851	393,503.63 (32,861,488)
ユーロ	COVIVIO	2,388	206,920.20
	GECINA SA	1,738	219,335.60
	ICADE	1,265	93,863.00
	KLEPIERRE	9,305	279,522.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	861,577.44
	ユーロ 小計	20,633	1,661,218.44 (207,536,019)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	263,657.16
	HAMMERSON PLC	34,414	130,876.44
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	290,533.45
	SEGRO PLC	40,873	261,587.20
	英ポンド 小計	152,952	946,654.25 (135,059,161)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	446,128.14
	DEXUS	43,102	519,810.12
	GOODMAN GROUP	75,399	968,123.16
	GPT GROUP	90,563	533,416.07
	LENDLEASE GROUP	25,262	342,300.10
	MIRVAC GROUP	140,993	362,352.01
	SCENTRE GROUP	234,290	932,474.20
	STOCKLAND	103,417	384,711.24
	SYDNEY AIRPORT	49,760	343,344.00

	TRANSURBAN GROUP	120,613	1,469,066.34
	VICINITY CENTRES	146,656	375,439.36
	オーストラリアドル 小計	1,078,442	6,677,164.74 (527,696,329)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	136,000	1,621,120.00
	LINK REIT	92,500	8,010,500.00
	香港ドル 小計	228,500	9,631,620.00 (135,613,209)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	326,508.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	243,848.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	245,692.00
	SUNTEC REIT	118,000	224,200.00
	シンガポールドル 小計	469,500	1,040,248.00 (84,811,419)
	合計		4,315,934,641 (4,315,934,641)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 36銘柄	1.8%	74.0%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	4.8%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	3.1%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.3%	12.2%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	3.1%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	438,229,262	657,437,070
金銭信託	-	215,951,090
コール・ローン	109,160,718	120,047,539
国債証券	181,786,932,094	162,644,383,881
派生商品評価勘定	2,129,768	-

	（平成30年 2月19日現在）	（平成31年 2月18日現在）
未収入金	536,414,266	-
未収利息	1,498,902,971	1,221,235,038
前払費用	32,867,925	31,978,274
流動資産合計	184,404,637,004	164,891,032,892
資産合計	184,404,637,004	164,891,032,892
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,051	-
未払解約金	209,915,063	123,892,792
未払利息	306	350
その他未払費用	1,961	1,338
流動負債合計	209,919,381	123,894,480
負債合計	209,919,381	123,894,480
純資産の部		
元本等		
元本	107,887,329,111	94,756,321,868
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	76,307,388,512	70,010,816,544
元本等合計	184,194,717,623	164,767,138,412
純資産合計	184,194,717,623	164,767,138,412
負債純資産合計	184,404,637,004	164,891,032,892

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成30年 2月19日現在)	(平成31年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	107,887,329,111口	94,756,321,868口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7073円 (10,000口当たりの純資産額 17,073円)	1口当たり純資産額 1.7389円 (10,000口当たりの純資産額 17,389円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 2月20日 至 平成31年 2月18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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成31年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 2月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	432,987	-	430,936	2,051
	米ドル	30,564	-	30,523	41
	ユーロ	292,806	-	290,980	1,826
	英ポンド	98,441	-	98,312	129
	オーストラリアドル	11,176	-	11,121	55
	売建	544,569,849	-	542,440,081	2,129,768
	米ドル	227,615,671	-	226,919,690	695,981
	ユーロ	251,961,267	-	250,610,309	1,350,958
	英ポンド	47,087,947	-	47,060,203	27,744
	オーストラリアドル	17,904,964	-	17,849,879	55,085
	合計		545,002,836	-	542,871,017

## （注）１．時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

## ２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（平成31年 2月18日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）



自 平成30年 2月20日

至 平成31年 2月18日

市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 2月19日現在)

(平成30年 2月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	130,285,580,252円
同期中における追加設定元本額	6,508,480,988円
同期中における一部解約元本額	28,906,732,129円
平成30年 2月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	9,505,326,385円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	482,033,249円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,356,533,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	680,716,519円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	200,617,669円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,208,930円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	32,156,213円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	80,908,758円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	73,213,085円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	37,204,501円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	97,792,755円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	11,259,132円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	152,612,684円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,704,491円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	392,288,596円
イオン・バランス戦略ファンド	10,515,823円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,053,006円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	728,193円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,092,772円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,997,336円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	6,653,417円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,409,160円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,459,793円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,829,683,107円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	994,362,360円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,694,956,379円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,654,452,542円
S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,041,192,959円
S M A M・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,495,798円
S M A M・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	117,271,531円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	989,325円

S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	929,198,288円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	140,411,944円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,418,831,340円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,748,624,082円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,929,871,193円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	7,898,142,389円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	93,275,672円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	12,591,554,333円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	1,134,143,770円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	2,276,903,513円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	227,593,463円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	702,294,439円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	2,660,961,718円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	170,058,697円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	47,031,545円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	15,695,353円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	168,163,991円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	620,414,441円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	191,711,885円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	185,168,652円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	54,863,227円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,975,325円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,573,385,690円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	23,478,678円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）V A < 適格機関投資家限定 >	4,637,499,307円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（債券重視型）V A < 適格機関投資家限定 >	2,210,250,875円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	7,274,876,655円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	2,166,022,742円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	51,673,877円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	602,639円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	350,447,977円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	167,862,823円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	339,385,086円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	63,930円
合計	107,887,329,111円

(平成31年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,887,329,111円
同期中における追加設定元本額	7,153,086,340円
同期中における一部解約元本額	20,284,093,583円
平成31年 2月18日現在における元本の内訳	

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	10,800,033,665円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	575,643,684円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,577,450,241円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	794,781,744円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	25,572,009円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,371,911円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	33,211,546円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	86,966,443円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	101,860,374円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	52,596,701円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	125,041,959円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	16,834,815円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	311,203,534円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	247,356,709円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	227,453,768円
イオン・バランス戦略ファンド	57,491,089円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,567,061円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	41,575,897円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,522,479円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	62,131,014円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	24,982,933円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,624,118円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	20,801,227円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,778,175,370円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	113,134,995円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	11,976,264,430円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,849,091,288円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	13,194,228,180円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	42,432,859円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	108,332,872円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	544,270円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	760,699,544円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	123,320,327円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,319,059,860円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,585,915,151円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,077,398,370円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	6,843,713,362円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	2,272,452円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	11,562,545,380円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	685,852,860円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,562,159,834円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	190,617,998円
S M A M・バランスファンドV A 2 0<適格機関投資家専用>	400,918,774円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	2,325,950,041円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	157,416,976円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	42,642,821円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	152,401,822円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	565,241,602円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	183,364,596円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	176,647,546円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	53,460,924円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,686,052円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,413,161,939円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	22,730,393円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）V A < 適格機関投資家限定 >	3,897,703,188円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（債券重視型）V A < 適格機関投資家限定 >	1,754,457,308円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	6,196,835,258円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	731,917,710円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	79,285,289円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	37,314,367円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	444,315,726円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	212,861,484円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	524,294,115円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	68,594円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	347,081,623円
合計	94,756,321,868円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 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	米ドル	US TREASURY N/B 1.125	500,000.00	493,984.37	
		US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,756,468.76	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,949,375.00	
		US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,694,312.50	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,906,250.00	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,352,343.75	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,608,453.12	
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,379,687.50	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,964,140.64	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,960,625.00	

US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,507,187.50
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,385,703.12
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,842,031.25
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,968,593.75
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,956,875.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,965,781.25
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,939,453.15
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,948,750.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,944,062.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,955,000.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,928,437.52
US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,240,445.32
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,943,750.00
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,627,445.33
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,933,437.50
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,341,312.51
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,899,062.52
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,337,031.25
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,379,687.50
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,853,281.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,959,687.50
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	986,171.88
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,970,468.76
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,914,921.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,884,453.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,882,812.50
US TREASURY N/B 1.5	4,800,000.00	4,441,500.00
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,968,437.52
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,980,468.76
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,456,250.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,959,687.50
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,443,671.87
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,911,875.00
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,881,875.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,390,078.12
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,894,765.64
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,892,890.64
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,883,046.89
US TREASURY N/B 1.625	5,300,000.00	4,975,375.00
US TREASURY N/B 1.625	5,300,000.00	4,960,882.83
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,269,093.75
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,971,406.26

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,939,531.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,934,609.39
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,422,070.33
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,931,093.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,930,156.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,929,218.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,928,750.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,921,953.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,915,156.25
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,526,328.12
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,972,812.50
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,356,875.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,963,125.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,942,812.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,941,406.25
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,664,671.87
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,915,625.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,933,203.14
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,740,375.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,975,625.00
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,279,695.32
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,249,070.33
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,969,765.64
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,968,359.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,966,250.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,962,500.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,960,859.39
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,243,898.45
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,452,148.45
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,055,921.87
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,950,312.50
US TREASURY N/B 2	500,000.00	491,054.69
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,945,156.25
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,392,148.46
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,949,531.26
US TREASURY N/B 2	4,200,000.00	4,091,718.75
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,434,179.70
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,427,625.00
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,153,195.33
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,936,500.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,979,843.75
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,678,484.37
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,684,992.19

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,962,187.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,970,937.50
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,968,828.14
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,964,609.39
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,945,312.52
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,046,476.57
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,963,125.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,924,687.52
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,428,632.83
US TREASURY N/B 2.125	4,400,000.00	4,306,156.27
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,759,921.88
US TREASURY N/B 2.125	3,400,000.00	3,313,406.25
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,977,812.52
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,982,656.25
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,988,125.00
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,782,718.76
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,964,609.39
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,975,781.26
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,477,148.44
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,201,070.34
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,050,351.57
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,918,437.52
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,060,656.27
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,047,656.27
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	6,008,187.50
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,613,640.64
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,993,906.26
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	2,991,093.75
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,993,437.50
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,194,000.00
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,554,937.52
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,892,187.50
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,998,437.50
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,693,320.34
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,587,781.25
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,649,367.21
US TREASURY N/B 2.5	4,400,000.00	3,997,125.00
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,446,750.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,003,437.52
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,504,296.87
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	501,054.69
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,010,312.52

US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,009,375.00
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,009,843.75
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,017,500.00
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,317,132.83
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	6,320,671.87
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,022,500.00
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,408,421.88
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000.00	6,056,718.78
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,020,312.50
US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,165,289.09
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,266,843.75
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,156,179.71
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,022,031.26
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,053,906.25
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	606,375.00
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	4,837,875.02
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,926,406.26
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	2,693,906.26
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,284,500.00
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,427,343.75
US TREASURY N/B 2.875	7,200,000.00	7,268,062.53
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,033,750.00
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,239,531.25
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,120,023.44
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,546,093.75
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,578,046.87
US TREASURY N/B 2.875	7,300,000.00	7,426,039.09
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,946,562.50
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,919,687.52
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,520,968.76
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,103,750.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,180,406.25
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,811,812.50
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,013,437.52
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,012,812.52
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,917,226.58
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,507,226.57
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,203,781.25
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,099,031.25
US TREASURY N/B 3	1,500,000.00	1,499,882.82
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,039,375.00
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	5,920,429.70
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,058,593.76



	US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,056,562.50	
	US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,435,656.25	
	US TREASURY N/B 3.125	5,100,000.00	5,231,484.37	
	US TREASURY N/B 3.125	1,200,000.00	1,229,250.00	
	US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,279,375.00	
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,333,710.93	
	US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,549,921.87	
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	879,250.00	
	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,061,875.00	
	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,106,250.00	
	US TREASURY N/B 3.625	3,800,000.00	4,227,796.89	
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,009,500.00	
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,700,273.44	
	US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,541,562.52	
	US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,730,156.25	
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,212,812.50	
	US TREASURY N/B 4.25	1,800,000.00	2,185,031.25	
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	615,312.50	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,849,101.57	
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,726,375.00	
	US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,225,390.63	
	US TREASURY N/B 4.5	900,000.00	1,112,484.37	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,250,390.63	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,252,421.88	
	US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,673,890.62	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,944,843.75	
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	658,671.87	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	609,609.37	
	US TREASURY N/B 5.375	720,000.00	914,962.50	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	617,421.87	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,216,796.88	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,268,828.13	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	926,062.50	
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	670,546.87	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	635,976.56	
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,487,484.37	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,089,687.50	
	米ドル 小計	684,520,000.00	682,572,369.99 (75,451,549,778)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,924,280.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,279,187.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,959,700.00	

	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,947,900.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	933,060.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,492,350.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,994,240.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,975,260.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,169,760.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	999,860.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,097,888.00
	CANADA-GOV'T 2	1,100,000.00	1,109,790.00
	CANADA-GOV'T 2.25	400,000.00	408,580.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,433,992.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,379,327.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,030,900.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	2,034,000.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	591,490.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,032,660.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,043,140.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,902,795.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,514,250.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,983,450.00
	CANADA-GOV'T 5	1,200,000.00	1,721,148.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	812,670.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,000,000.00	1,460,630.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	733,685.00
	カナダドル 小計	37,400,000.00	39,965,992.00 (3,337,559,991)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	36,000,000.00	38,967,120.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,328,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	5,000,000.00	4,761,300.00
	MEXICAN BONOS 7.5	21,000,000.00	19,943,700.00
	MEXICAN BONOS 8	47,000,000.00	46,889,550.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	19,851,200.00
	MEXICAN BONOS 8.5	36,000,000.00	36,146,520.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	38,958,800.00
	メキシコペソ 小計	225,000,000.00	222,846,790.00 (1,281,369,042)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	968,625.00
	BELGIAN 0.8	1,800,000.00	1,878,084.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	721,630.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	511,305.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,893,180.00
	BELGIAN 0304 5	1,800,000.00	2,823,444.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,706,055.00

BELGIAN 0318 3.75	1,600,000.00	1,709,760.00
BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,612,322.00
BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,460,056.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,302,920.00
BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,983,747.00
BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,663,620.00
BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	570,715.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	634,420.00
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,027,180.00
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	554,270.00
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	409,944.00
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,475,222.00
BELGIAN 1	1,300,000.00	1,320,345.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	412,520.00
BELGIAN 1.6	500,000.00	498,885.00
BELGIAN 1.9	700,000.00	765,520.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	533,425.00
BELGIAN 3.75	900,000.00	1,332,000.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	986,520.00
BTPS 0.2	2,000,000.00	1,992,720.00
BTPS 0.35	500,000.00	500,390.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,477,050.00
BTPS 0.45	1,500,000.00	1,491,315.00
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,605,136.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,911,640.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,009,700.00
BTPS 0.9	800,000.00	788,800.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,954,980.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,000,800.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,849,520.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,009,420.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,006,900.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	959,600.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,599,263.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,909,100.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,720,580.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	997,780.00
BTPS 2	2,300,000.00	2,269,755.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,525,264.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,443,720.00
BTPS 2.15	500,000.00	515,515.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	976,200.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,048,224.00

BTPS 2.3	600,000.00	620,130.00
BTPS 2.45	600,000.00	554,058.00
BTPS 2.5	600,000.00	615,510.00
BTPS 2.7	1,700,000.00	1,467,984.00
BTPS 2.8	300,000.00	300,591.00
BTPS 2.8	900,000.00	739,836.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	933,680.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,428,405.00
BTPS 3.35	300,000.00	302,892.00
BTPS 3.45	1,100,000.00	1,066,439.00
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,420,037.00
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,656,375.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,130,040.00
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,418,912.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,179,860.00
BTPS 4	2,500,000.00	2,636,050.00
BTPS 4	2,700,000.00	2,943,891.00
BTPS 4.25	500,000.00	520,795.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,811,213.00
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,568,962.00
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,372,840.00
BTPS 4.5	1,700,000.00	1,940,805.00
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,845,102.00
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,830,825.00
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,462,460.00
BTPS 4.75	1,600,000.00	1,894,064.00
BTPS 5	2,000,000.00	2,226,420.00
BTPS 5	1,000,000.00	1,161,830.00
BTPS 5	2,070,000.00	2,509,274.70
BTPS 5	2,000,000.00	2,430,060.00
BTPS 5	1,900,000.00	2,300,140.00
BTPS 5.25	1,900,000.00	2,307,778.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,282,940.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,288,140.00
BTPS 5.75	2,200,000.00	2,829,244.00
BTPS 6	2,900,000.00	3,771,682.00
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,367,025.60
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,337,570.00
BTPS 9	1,000,000.00	1,327,230.00
BUNDESUBL-171 0	2,000,000.00	2,013,180.00
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,026,880.00
BUNDESUBL-173 0	2,500,000.00	2,530,325.00

BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,043,230.00
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,316,081.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,800,000.00	2,882,656.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,850,000.00	3,924,459.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,600,000.00	3,773,484.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	945,117.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,572,000.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,300,000.00	2,405,961.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,396,551.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,650,000.00	2,868,969.50
DEUTSCHLAND REP 1.25	400,000.00	456,448.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,679,575.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,698,975.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,167,500.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,197,440.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,369,598.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,215,900.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,665,765.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,565,475.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,500,422.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,587,870.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,149,124.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,052,476.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,147,570.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	1,896,840.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,500,000.00	4,026,000.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,582,790.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,100,000.00	1,590,534.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,155,102.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,152,208.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	300,000.00	489,177.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,380,728.20
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,592,052.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	700,000.00	1,167,446.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,555,900.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	404,732.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	405,448.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	509,865.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	210,954.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,074,780.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,071,120.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,112,440.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	683,715.00

FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	735,966.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	731,591.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,085,840.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,259,450.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,019,650.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,242,294.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,011,350.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,019,280.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,330,291.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,998,380.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	2,982,621.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,068,280.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,384,315.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,734,714.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,649,950.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,636,275.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	2,038,540.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,200,000.00	3,470,272.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,340,880.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,100,000.00	3,419,114.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,524,474.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	995,240.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,216,320.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,900,000.00	3,174,253.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000.00	4,834,963.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,677,450.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,300,000.00	3,952,476.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,800,000.00	4,581,698.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,539,800.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,738,130.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	3,494,900.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,190,240.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,000,000.00	2,481,880.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,259,853.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,447,194.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,921,631.40	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,525,070.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000.00	4,596,860.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000.00	5,357,847.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,300,000.00	3,597,683.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,479,240.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,585,448.00	

FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,185,420.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	821,064.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	402,116.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	722,617.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	712,278.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,042,160.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	314,136.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,086,330.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	693,108.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,168,320.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	581,915.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,047,697.20
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,090,870.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,964,280.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,500,000.00	1,521,120.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,740,409.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,557,510.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,475,418.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	420,240.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,749,104.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,121,260.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,639,395.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,300,000.00	1,652,417.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	1,942,213.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	873,568.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,586,100.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,165,060.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,476,305.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,210,852.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,035,496.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,112,628.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,044,420.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,463,238.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	207,454.00
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	431,900.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	197,482.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	535,180.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,500,000.00	1,651,560.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,094,690.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	735,072.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	725,645.00
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	685,338.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,103,120.00

REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,128,510.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	900,855.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,592,610.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,004,535.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,338,720.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,504,640.00	
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,104,862.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,029,000.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,044,420.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,041,380.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,058,700.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,032,440.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,224,072.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,217,448.00	
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,030,120.00	
SPANISH GOV'T 1.45	800,000.00	807,648.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,555,845.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,335,454.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,371,424.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,100,520.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,187,260.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,400,000.00	1,499,386.00	
SPANISH GOV'T 2.7	100,000.00	105,089.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,364,705.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,800,000.00	1,984,860.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,303,610.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,230,847.00	
SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,628,100.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,210,125.50	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,384,040.00	
SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,253,366.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,900,000.00	2,742,954.00	
SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,436,520.00	
SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,174,060.00	
SPANISH GOV'T 4.9	1,600,000.00	2,357,952.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,034,375.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,857,144.00	
SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,022,825.00	
SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,035,880.00	
SPANISH GOV'T 5.75	1,900,000.00	2,846,371.00	
SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,584,670.00	
SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,404,975.00	



	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,174,072.00
	ユーロ 小計	438,020,000.00	503,899,637.10 (62,952,181,662)
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,190,160.00
	UK TSY GILT 0.75	300,000.00	299,238.00
	UK TSY GILT 1.25	1,700,000.00	1,725,177.00
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,943,007.00
	UK TSY GILT 1.5	2,250,000.00	2,335,882.50
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,631,626.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	460,957.50
	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,459,584.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,103,890.00
	UK TSY GILT 1.75	1,300,000.00	1,330,186.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	305,091.00
	UK TSY GILT 2	3,000,000.00	3,054,450.00
	UK TSY GILT 2	1,800,000.00	1,926,036.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,874,258.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,089,120.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,874,148.00
	UK TSY GILT 3.25	2,100,000.00	2,767,254.00
	UK TSY GILT 3.5	1,800,000.00	2,483,010.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,317,780.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,093,120.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	538,190.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,476,816.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,647,660.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,939,810.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,393,920.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,887,004.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,390,625.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,606,011.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,366,672.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,666,314.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,272,690.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,949,109.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	1,916,001.00
UK TSY GILT 4.5	1,700,000.00	2,650,351.00	
UK TSY GILT 4.75	1,250,000.00	1,725,112.50	
UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,998,685.00	
UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,987,104.00	
UK TSY GILT 6	700,000.00	1,014,468.00	
UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,889,940.60	

英債券 小計		61,720,000.00	77,580,458.10 (11,068,403,957)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	10,100,000.00	10,696,809.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,526,820.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,755,450.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,985,760.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	5,000,000.00	7,199,400.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	8,600,000.00	9,431,620.00
スウェーデンクローナ 小計		43,700,000.00	49,595,859.00 (591,678,597)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	5,005,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,102,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,500,000.00	6,698,250.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	2,000,000.00	2,066,200.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,329,200.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,351,000.00
ノルウェークローネ 小計		28,500,000.00	29,552,150.00 (378,563,041)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,550,050.00
	DENMARK - BULLET 0.5	1,900,000.00	1,978,850.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,444,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	9,500,000.00	10,742,600.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,681,100.00
	DENMARK - BULLET 4.5	12,000,000.00	21,314,400.00
デンマーククローネ 小計		38,900,000.00	50,711,000.00 (848,902,140)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,000,000.00	1,999,000.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,011,100.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,017,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,492,350.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	2,955,900.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,900,000.00	6,153,700.00
	POLAND GOVT BOND 4	1,500,000.00	1,623,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,122,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,424,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,763,052.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,260,000.00
ポーランドズロチ 小計		33,100,000.00	34,821,102.00 (1,004,588,792)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,997,540.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,008,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	408,080.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,300,000.00	2,324,150.00

	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	400,000.00	413,440.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,623,225.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,630,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,902,754.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,585,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	839,680.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,175,922.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,054,090.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,094,180.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,110,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,430,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,800,940.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,100,000.00	1,134,066.12
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,775,620.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,600,000.00	3,125,460.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,200,000.00	2,534,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,044,160.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,400,650.00
	オーストラリアドル 小計	39,700,000.00	43,414,027.92 (3,431,010,626)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,108,250.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,033,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	416,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	724,794.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	426,200.00
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	315,900.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,040,800.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	815,816.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	562,447.50
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,200,000.00	1,325,400.00
	シンガポールドル 小計	7,400,000.00	7,768,607.50 (633,374,569)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	5,000,000.00	4,956,326.45
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,100,000.00	8,859,829.61
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,500,000.00	5,540,630.70
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,212,872.50
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,002,635.80
	マレーシアリングgit 小計	27,600,000.00	27,572,295.06 (748,036,364)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	63,000,000.00	43,822,800.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	15,870,400.00
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	49,302,000.00

	REP SOUTH AFRICA 8	8,500,000.00	7,692,500.00
	南アフリカランド 小計	147,500,000.00	116,687,700.00 (917,165,322)
	合計		162,644,383,881 (162,644,383,881)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 217銘柄	45.8%	46.4%
カナダドル	国債証券 27銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 263銘柄	38.2%	38.7%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.7%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.6%	0.6%

#### 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。

**【中間財務諸表】**

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(平成31年2月19日から令和1年8月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第15期中間計算期間  
(令和1年8月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	471,361,352
コール・ローン	98,485,586
親投資信託受益証券	10,420,223,191
流動資産合計	10,990,070,129
資産合計	10,990,070,129
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,049,859
未払受託者報酬	1,712,043
未払委託者報酬	10,842,866
未払利息	777
その他未払費用	296,047
流動負債合計	19,901,592
負債合計	19,901,592
純資産の部	
元本等	
元本	7,484,951,189
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,485,217,348
元本等合計	10,970,168,537
純資産合計	10,970,168,537
負債純資産合計	10,990,070,129

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	44,939,505
営業収益合計	44,939,505
営業費用	
支払利息	144,525
受託者報酬	1,712,043
委託者報酬	10,842,866
その他費用	395,691
営業費用合計	13,095,125
営業利益又は営業損失( )	31,844,380
経常利益又は経常損失( )	31,844,380
中間純利益又は中間純損失( )	31,844,380
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	5,443,756
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,206,170,173
剰余金増加額又は欠損金減少額	470,155,644
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	470,155,644
剰余金減少額又は欠損金増加額	217,509,093
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	217,509,093
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,485,217,348

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第15期中間計算期間 ( 令和 1年 8月18日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	7,484,951,189口
2. 1単位当たり純資産の額	1.4656円
	(10,000口当たりの純資産額 14,656円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項



項目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)
期首元本額	6,956,439,833円
期中追加設定元本額	999,838,727円
期中一部解約元本額	471,327,371円

## 【三井住友・DC年金バランス50(標準型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第15期中間計算期間 (令和1年8月18日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	1,162,325,210
コール・ローン	242,259,968
親投資信託受益証券	27,602,730,096
未収入金	120,000,000
流動資産合計	29,127,315,274
資産合計	29,127,315,274
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	14,508,005
未払受託者報酬	4,623,736
未払委託者報酬	30,824,874
未払利息	1,911
その他未払費用	799,348
流動負債合計	50,757,874
負債合計	50,757,874
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,051,314,363
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,025,243,037
元本等合計	29,076,557,400
純資産合計	29,076,557,400
負債純資産合計	29,127,315,274

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	334,190,462
営業収益合計	334,190,462
営業費用	
支払利息	389,005
受託者報酬	4,623,736
委託者報酬	30,824,874
その他費用	1,070,177
営業費用合計	36,907,792
営業利益又は営業損失（ ）	371,098,254
経常利益又は経常損失（ ）	371,098,254
中間純利益又は中間純損失（ ）	371,098,254
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	6,981,194
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,771,498,471
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,048,194,252
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,048,194,252
剰余金減少額又は欠損金増加額	416,370,238
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	416,370,238
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,025,243,037

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		19,051,314,363口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5262円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,262円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)
期首元本額	17,921,973,465円
期中追加設定元本額	1,892,385,167円
期中一部解約元本額	763,044,269円

## 【三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第15期中間計算期間 (令和1年8月18日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	575,821,472
コール・ローン	119,996,841
親投資信託受益証券	13,595,169,757
未収入金	70,000,000
流動資産合計	14,360,988,070
資産合計	14,360,988,070
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	24,946,505
未払受託者報酬	2,318,616
未払委託者報酬	16,230,258
未払利息	946
その他未払費用	400,690
流動負債合計	43,897,015
負債合計	43,897,015
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,209,235,391
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,107,855,664
元本等合計	14,317,091,055
純資産合計	14,317,091,055
負債純資産合計	14,360,988,070

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	392,048,574
営業収益合計	392,048,574
営業費用	
支払利息	195,568
受託者報酬	2,318,616
委託者報酬	16,230,258
その他費用	537,520
営業費用合計	19,281,962
営業利益又は営業損失（ ）	411,330,536
経常利益又は経常損失（ ）	411,330,536
中間純利益又は中間純損失（ ）	411,330,536
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,244,127
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,253,999,474
剰余金増加額又は欠損金減少額	574,596,945
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	574,596,945
剰余金減少額又は欠損金増加額	306,166,092
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	306,166,092
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,107,855,664

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項 目	第15期中間計算期間 自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第15期中間計算期間 (令和 1年 8月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	9,209,235,391口
2. 1単位当たり純資産の額	1.5546円
	(10,000口当たりの純資産額 15,546円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項



項目	第15期中間計算期間 (令和1年8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第15期中間計算期間 (令和1年8月18日現在)
期首元本額	8,769,321,012円
期中追加設定元本額	950,559,435円
期中一部解約元本額	510,645,056円

## (参考)

「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」および「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・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「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和1年8月18日現在)

## 資産の部

## 流動資産

金銭信託	2,135,152,233
コール・ローン	452,163,424
株式	154,779,040,590
派生商品評価勘定	1,293,160

（令和 1年 8月18日現在）

未収入金	129,198
未収配当金	254,384,342
前払金	88,930,000
差入委託証拠金	135,000
流動資産合計	157,711,227,947
資産合計	157,711,227,947
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	90,421,880
未払解約金	126,577,487
未払利息	1,189
その他未払費用	37,423
流動負債合計	217,037,979
負債合計	217,037,979
純資産の部	
元本等	
元本	67,138,841,830
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	90,355,348,138
元本等合計	157,494,189,968
純資産合計	157,494,189,968
負債純資産合計	157,711,227,947

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年 8月18日現在）	
1. 担保資産	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。	
	株式	2,716,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		67,138,841,830口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.3458円
	(10,000口当たりの純資産額)	23,458円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（令和 1年 8月18日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（令和 1年 8月18日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,816,928,720	-	2,727,800,000	89,128,720
	東証株価指数先物	2,816,928,720	-	2,727,800,000	89,128,720
合計		2,816,928,720	-	2,727,800,000	89,128,720

（注）1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

- 1) 原則として計算期間末日に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います。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います。
- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(令和 1年 8月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,410,111,137円
同期中における追加設定元本額	6,243,906,155円
同期中における一部解約元本額	8,515,175,462円
令和 1年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,250,585,014円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	920,821,811円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,288,269,504円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,041,872,401円
S M A M ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	77,855,227円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	7,223,318円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	25,338,138円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	66,652,968円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	110,430,562円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	69,629,085円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	156,260,368円
国内株式指数ファンド（T O P I X）	1,897,813,349円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	10,583,333,013円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	714,643,723円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	709,340,229円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	663,177,797円
イオン・バランス戦略ファンド	26,739,584円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,933,631円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	47,327,194円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	40,880,159円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	112,601,421円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	63,335,746円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	94,278,355円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	11,587,151円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）	81,477円
三井住友D S ・年金バランス50（標準型）	142,584円
三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）	203,691円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	4,353,538,292円
バランスファンドV A（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	25,901,097円

S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	225,151,325円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	3,419,283,445円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,478,628,566円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	9,114,813,234円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	59,944,639円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	226,776,172円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	798,365円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	948,529,137円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	58,426,213円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	383,289,354円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,117,775,166円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	946,532,566円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,069,470,019円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,153,095円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	513,254,928円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	64,850,126円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	224,893,982円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	106,907,713円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	48,923,196円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	23,097,649円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	208,963,079円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	389,259,305円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	122,347,600円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	120,159,600円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	62,637,257円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,525,643円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	77,475,462円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	942,454,924円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A ( 適格機関投資家専用 )	203,968,482円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	21,266,288円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,408,581,188円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	216,497,008円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	133,073,322円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	15,906,752円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	72,506,666円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	72,176,302円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	83,433,172円
合計	67,138,841,830円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年 8月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,101,153,228
コール・ローン	444,963,419
国債証券	113,849,269,400
地方債証券	11,079,242,055
特殊債券	18,542,389,225
社債券	7,219,922,000
未収利息	446,847,087
前払費用	4,638,501
流動資産合計	153,688,424,915
資産合計	153,688,424,915
負債の部	
流動負債	
未払金	31,276,200
未払解約金	1,081,672,000
未払利息	1,170
その他未払費用	53,771
流動負債合計	1,113,003,141
負債合計	1,113,003,141
純資産の部	
元本等	
元本	116,176,873,864
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	36,398,547,910
元本等合計	152,575,421,774
純資産合計	152,575,421,774
負債純資産合計	153,688,424,915

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年 8月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		116,176,873,864口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3133円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,133円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（令和 1年 8月18日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（令和 1年 8月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	140,556,463,902円
同期中における追加設定元本額	12,117,785,035円
同期中における一部解約元本額	36,497,375,073円
令和 1年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	4,639,330,264円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,878,159,080円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,652,472,258円

(令和1年8月18日現在)	
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	782,343,701円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	49,223,099円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	172,040,264円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	326,027,450円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	310,726,015円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	117,198,768円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	223,074,438円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	92,005,800円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,932,491,864円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,190,814,691円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	524,992,211円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,607,074円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	619,721,849円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	208,852,814円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	259,171,212円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	51,435,129円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,513,818円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,956,104円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	424,350円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	270,041円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	115,732円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,793,124,662円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,337,676,993円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,057,709,903円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,237,710,355円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	346,485,770円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	578,749,942円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,693,922円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	249,144,592円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	112,648,590円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,962,263,301円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,072,118,528円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,653,181,323円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,188,824,891円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,233,431円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,469,208,745円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	5,566,950,174円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	494,946,879円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,826,519,453円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	876,341,455円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	186,847,552円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,707,508円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,919,759,794円



(令和1年8月18日現在)	
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,431,282,021円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	1,614,881,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,004,292,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	234,605,464円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,303,717円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	345,511,994円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,037,037,010円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	287,982,728円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	139,288,437円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	690,840,302円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	697,474,167円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,618,559,014円
合計	116,176,873,864円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和1年8月18日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	2,252,470,233
金銭信託	239,449,448
コール・ローン	50,708,460
株式	159,075,333,832
投資証券	4,328,240,431
派生商品評価勘定	359,428
未収入金	21,299
未収配当金	348,627,637
前払金	120,776,190
差入委託証拠金	635,812,549
流動資産合計	167,051,799,507

## 資産合計

167,051,799,507

## 負債の部

## 流動負債

派生商品評価勘定	121,195,898
未払解約金	108,299,000
未払利息	133
その他未払費用	8,215
流動負債合計	229,503,246

## 負債合計

229,503,246

## 純資産の部

## 元本等

元本	49,128,960,596
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	117,693,335,665
元本等合計	166,822,296,261

## 純資産合計

166,822,296,261

## 負債純資産合計

167,051,799,507

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	49,128,960,596口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3956円
	(10,000口当たりの純資産額 33,956円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 8月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(令和 1年 8月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,543,319,840	-	3,422,543,650	120,776,190
	SPMINI 1909	2,578,801,466	-	2,494,625,842	84,175,624
	DJ EUR 1909	603,835,116	-	579,998,775	23,836,341
	FTSE 1909	207,109,343	-	198,891,726	8,217,617
	SPI200 1909	153,573,915	-	149,027,307	4,546,608
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	79,059,580	-	78,999,300	60,280
	米ドル	15,903,000	-	15,918,000	15,000
	カナダドル	10,355,800	-	10,357,100	1,300
	ユーロ	25,986,400	-	25,927,000	59,400
	スイスフラン	9,799,200	-	9,770,400	28,800
	スウェーデンクローナ	2,533,680	-	2,530,000	3,680
	ノルウェークローネ	590,450	-	587,500	2,950
	デンマーククローネ	2,058,420	-	2,054,000	4,420
	オーストラリアドル	6,450,300	-	6,473,700	23,400
	ニュージーランドドル	682,790	-	683,100	310
	香港ドル	2,570,320	-	2,570,700	380

シンガポールドル	1,526,220	-	1,528,400	2,180
イスラエルシケル	603,000	-	599,400	3,600
合計	3,622,379,420	-	3,501,542,950	120,836,470

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に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います。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います。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(令和 1年 8月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,684,573,164円
同期中における追加設定元本額	7,617,210,186円
同期中における一部解約元本額	10,172,822,754円
令和 1年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	15,625,556,317円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	311,027,218円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,234,584,996円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	827,256,316円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	79,274,347円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,133,991円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,514,805円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	22,932,457円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,359,722円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	33,585,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	79,887,710円
外国株式指数ファンド	519,080,238円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	4,058,415,628円

(令和1年8月18日現在)	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	422,935,603円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	416,958,986円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	393,178,840円
イオン・バランス戦略ファンド	30,622,298円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,747,400円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	32,234,142円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	28,119,916円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	76,570,796円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	43,234,945円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	64,208,493円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,923,892円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	28,001円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	42,001円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,001円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,606,087,391円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,821,862円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	76,749,837円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,526,410,907円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,460,709,925円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,139,461,309円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	20,213,639円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	103,737,458円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	403,044円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	740,848,911円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	60,411,931円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	171,173,908円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	770,537,138円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	636,532,209円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,546,331,643円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	793,347円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	298,820,648円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	350,664,780円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	131,931,365円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	154,234,455円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	23,547,826円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	13,163,561円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	6,722,410円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	45,905,122円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	110,966,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	82,987,289円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	952,434,244円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	148,739,209円

（令和 1年 8月18日現在）	
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	5,934,125,566円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	282,287,006円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA <適格機関投資家限定>	1,116,346,988円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	12,080,713円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	57,790,137円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン <適格機関投資家限定>	57,690,476円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	99,546,999円
合計	49,128,960,596円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（令和 1年 8月18日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	694,666,935
金銭信託	499,376,691
コール・ローン	105,753,525
国債証券	152,921,691,546
未収利息	953,905,294
前払費用	26,091,142
流動資産合計	155,201,485,133

##### 資産合計

155,201,485,133

#### 負債の部

##### 流動負債

未払解約金	348,011,000
未払利息	278
その他未払費用	16,667
流動負債合計	348,027,945

##### 負債合計

348,027,945

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	86,579,028,020
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,274,429,168
元本等合計	154,853,457,188

##### 純資産合計

154,853,457,188

##### 負債純資産合計

155,201,485,133

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成31年 2月19日 至 令和 1年 8月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 8月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		86,579,028,020口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7886円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,886円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 8月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(令和 1年 8月18日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(令和 1年 8月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	94,756,321,868円
同期中における追加設定元本額	4,586,031,157円
同期中における一部解約元本額	12,763,325,005円
令和 1年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	11,633,431,735円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	621,269,670円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,679,953,239円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	827,642,915円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,860,776円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,303,518円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	87,658,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	122,169,780円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	64,339,106円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	140,267,099円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	18,171,359円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,853,732円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	195,601,327円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	189,353,081円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,482,729円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,253,420円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,648,811円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	68,683,227円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,172,115円



(令和1年8月18日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,888,475円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,516,099円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,364円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,738,644,329円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,147,951,245円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,624,340,247円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,653,544,623円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,186,441円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	550,315円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	736,523,984円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,249,804,938円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,538,130,778円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,965,588,908円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,433,277,386円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,624,200円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,739,140,570円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	395,520,558円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	683,610,533円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	181,442,998円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	299,575,559円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	148,648,147円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,608,212円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,631,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	144,122,010円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	541,009,537円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	122,474,452円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,962,548円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,587,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,611,476円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,326,287,455円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	3,091,167,882円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,485,794,470円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,021,742,837円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	684,846,209円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	8,879,303円

(令和1年8月18日現在)	
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	36,221,321円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	202,531,923円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	203,237,067円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	506,071,933円
合計	86,579,028,020円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

2019年 8月30日現在

資産総額	11,180,947,683円
負債総額	8,977,532円
純資産総額（ - ）	11,171,970,151円
発行済口数	7,559,193,459口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4779円
（1万口当たり純資産額）	（14,779円）

## 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

2019年 8月30日現在

資産総額	29,762,878,547円
負債総額	8,587,567円
純資産総額（ - ）	29,754,290,980円
発行済口数	19,265,871,695口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5444円
（1万口当たり純資産額）	（15,444円）

## 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

2019年 8月30日現在

資産総額	14,690,944,040円
負債総額	2,914,902円
純資産総額（ - ）	14,688,029,138円
発行済口数	9,303,388,325口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5788円
（1万口当たり純資産額）	（15,788円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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は発行されません。

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

- a. 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かかる振替機関等に振替の申請をするものとしします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかか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します。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとしします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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また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。

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

## ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

## ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還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に支払います。

## ト 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金およ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】

###### イ 資本金の額および株式数

	2019年8月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

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の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2019年8月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	764	8,176,418
単体型株式投資信託	115	635,603
追加型公社債投資信託	1	28,308
単体型公社債投資信託	188	532,167
合計	1,068	9,372,497

## 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（平成30年4月1日から平成31年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の監査を受けております。

### (1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		

有形固定資産	1		
建物		185,371	173,517
器具備品		300,694	751,471
有形固定資産合計		486,065	924,988
無形固定資産			
ソフトウェア		409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定		5,755	183,528
電話加入権		56	44
商標権		-	60
無形固定資産合計		415,576	663,501
投資その他の資産			
投資有価証券		10,616,594	10,829,628
関係会社株式		10,412,523	10,252,067
長期差入保証金		658,505	2,004,451
長期前払費用		69,423	97,107
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計		23,159,314	24,617,457
固定資産合計		24,060,956	26,205,946
資産合計		53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		

資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成29年4月1日	(自	平成30年4月1日
	至	平成30年3月31日)	至	平成31年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		36,538,981		39,156,499
運用受託報酬		8,362,118		6,277,217
投資助言報酬		1,440,233		1,332,888
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		-
サービス支援手数料		128,324		182,502
その他		55,820		49,507
営業収益計		46,530,479		46,998,614
営業費用				
支払手数料		16,961,384		18,499,433
広告宣伝費		353,971		361,696
公告費		1,140		125
調査費				
調査費		1,654,233		1,752,905
委託調査費		5,972,473		6,050,441
営業雑経費				
通信費		40,066		46,551
印刷費		339,048		338,465
協会費		-		24,700
諸会費		45,465		23,756
情報機器関連費		2,582,734		2,872,416
販売促進費		34,333		49,118
その他		136,669		148,307
営業費用合計		28,121,520		30,167,918
一般管理費				



給料		
役員報酬	196,529	190,951
給料・手当	6,190,716	6,308,066
賞与	601,375	514,259
賞与引当金繰入額	1,566,810	1,235,936
交際費	25,709	27,802
寄付金	-	82
事務委託費	256,413	286,905
旅費交通費	220,569	228,538
租税公課	282,036	285,369
不動産賃借料	654,286	612,410
退職給付費用	419,884	463,553
固定資産減価償却費	329,756	378,530
諸経費	285,490	290,243
一般管理費合計	11,029,580	10,822,651
営業利益	7,379,378	6,008,044

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	51,335	-
受取利息	520	623
時効成立分配金・償還金	2,622	72
原稿・講演料	894	1,951
雑収入	10,669	36,408
営業外収益合計	66,042	39,055
営業外費用		
為替差損	5,125	15,760
雑損失	913	7,027
営業外費用合計	6,038	22,787
経常利益	7,439,383	6,024,312
特別利益		
投資有価証券償還益	61,842	289,451
投資有価証券売却益	30,980	7,247
過去勤務費用償却益	1	79,850
特別利益合計	92,822	376,549
特別損失		
固定資産除却損	2	1,462
投資有価証券償還損		13,668
投資有価証券売却損		14,605
関係会社株式評価損	3	160,455
合併関連費用	4	187,140
特別損失合計	505,996	377,331
税引前当期純利益	7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税	2,350,891	1,750,031
法人税等調整額	280,166	90,084
法人税等合計	2,070,725	1,840,116
当期純利益	4,955,483	4,183,413

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074
当期変動額							
剰余金の配当							1,887,480
当期純利益							4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額					
剰余金の配当	1,887,480	1,887,480			1,887,480
当期純利益	4,955,483	4,955,483			4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（自 平成30年 4 月 1 日 至 平成31年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------

	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(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)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 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。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 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

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正(企業会計基準第28号平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、

繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

#### (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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

##### 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

##### 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

#### (損益計算書関係)

##### 1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

##### 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

##### 3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

##### 4 合併関連費用

合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用であります。

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

##### 1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

##### 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000.00	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成30年6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	17,622,360株	-	17,640,000株

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
令和1年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

## (リース取引関係)

## オペレーティング・リース取引

## (借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っております。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っております。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬

は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

#### 信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

#### 市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

### (4)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、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

当事業年度（平成31年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-

(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(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	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
其他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

其他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)其他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

区分	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	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位：千円)

区分	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	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

当事業年度(平成31年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 298千円)については、市場価格がなく、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、記載しておりません。

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 298千円)については、市場価格がなく、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、記載しておりません。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30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
532,099	30,980	9,634

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31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
728,127	7,247	14,605

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、有価証券について160,455千円(関係会社株式160,455千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

(退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

### 2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)



	前事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

(注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。

2.その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
割引率	0.000%	0.000%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

## (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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798

繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額（注）	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

（注）評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

（セグメント情報等）

前事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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。

4. 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。

5. 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)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15円

(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. 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 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29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

取得による企業結合

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

(3)企業結合日

平成31年4月1日

(4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「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)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1)合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当て交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

(3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

(参考)大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DS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 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄 裕 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31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。

## 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

(注2) 四半データは監査の対象には含まれていません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	21,360,895	20,475,527

前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-

長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540
協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994



その他		122,930	63,596
営業費用計		17,381,079	16,727,567
一般管理費			
給料			
役員報酬		218,127	217,030
給料・手当		2,809,008	3,002,836
賞与		86,028	48,878
退職金		9,864	2,855
福利厚生費		647,269	638,399
交際費		29,121	38,883
旅費交通費		159,224	153,694
租税公課		199,255	160,817
不動産賃借料		622,807	639,392
退職給付費用		219,724	324,082
固定資産減価償却費		71,624	141,154
賞与引当金繰入額		1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額		36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額		85,500	72,900
諸経費		901,001	1,011,941
一般管理費計		7,357,787	7,562,768
営業利益		6,839,032	4,444,730
営業外収益			
受取配当金		23,350	35,946
受取利息		199	178
投資有価証券売却益		6,350	45,345
その他		2,831	10,431
営業外収益計		32,732	91,902
営業外費用			
投資有価証券売却損		5,000	4,735
解約違約金		-	982
為替差損		1,784	828
その他		0	410
営業外費用計		6,784	6,956
経常利益		6,864,980	4,529,676
特別損失			
合併関連費用	2	-	179,376
固定資産除却損		-	4,121
特別損失計		-	183,498
税引前当期純利益		6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税		2,242,775	1,339,010
法人税等調整額		78,014	73,635
法人税等合計		2,164,761	1,412,646
当期純利益		4,700,218	2,933,531

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	株主資本合計	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	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	株主資本合計	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	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605

当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650
-------	------------	------------	--------	--------	------------

## 注記事項

## (重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 2～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の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。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p> <p>これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>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。</p>

## (表示方法の変更)

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

（追加情報）

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

（貸借対照表関係）

第46期 (平成30年3月31日)		第47期 (平成31年3月31日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	465,964千円	建物	556,889千円
器具備品	266,621千円	器具備品	297,262千円
リース資産	8,719千円	リース資産	12,584千円

（損益計算書関係）

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

(2) 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)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
-------	---------	----	----	--------

普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

## (2) 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)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用(*)	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4) 未収入金	4,542	4,542	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2) 未払費用(*)	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

(6) 長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

## 負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(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

区分	第46期(平成30年3月31日)	第47期(平成31年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、市場価格がなく、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時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期(平成30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・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期(平成31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・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

第47期(平成31年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

## 2. 其他有価証券

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
----	----------	------	----

貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 51,135千円)については、市場価格がなく、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。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 45,071千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

(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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)



	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965
繰延税金負債		
建物	-	54,715

その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

## 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

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

## (セグメント情報等)

セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の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90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の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90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 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)
----	--------	----	-------------	-------------------	-------------------	---------------	-------	------------------	----	------------------

その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	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)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

(注)潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たりの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。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

#### 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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

- a. 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2019年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2019年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
静岡東海証券株式会社	600百万円	
十六T T証券株式会社	3,000百万円	
損保ジャパン日本興亜D C証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

資本金の額は、2019年3月末現在。ただし、十六T T証券株式会社の資本金の額は、2019年6月3日現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

## 第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

(2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。
  - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
  - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきであることを記載することがあります。
  - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
  - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
  - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
  - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31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。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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



**独立監査人の監査報告書**

平成31年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成30年2月20日から平成31年2月18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、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成31年2月18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**

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成31年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成30年2月20日から平成31年2月18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、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成31年2月18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**

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

以上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成31年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成30年2月20日から平成31年2月18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、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成31年2月18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**

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年10月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成31年2月19日から令和1年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の令和1年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年2月19日から令和1年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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



## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年10月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成31年2月19日から令和1年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の令和1年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年2月19日から令和1年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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



## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年10月1日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成31年2月19日から令和1年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の令和1年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年2月19日から令和1年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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



