

【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2年1月23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】	イオン・バランス戦略ファンド
【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】	2,500億円を上限とします。
【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】

イオン・バランス戦略ファンド

（愛称として「みらいパレット」という名称を用いることがあります。）

以下「当ファンド」といいます。

（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】

2,500億円を上限とします。

（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、「みらいパレ」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	https://www.smd-am.co.jp

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。

（５）【申込手数料】

原則として、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）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2020年1月24日から2020年7月21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。

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)に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、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。

ハ お申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨーク、ロンドンの取引所または銀行の休業日のいずれ

かに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません(また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。)

ニ 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。

ホ 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、主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金500億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。
- ハ 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
単位型・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実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款において、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。

(ロ) 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、不動産投信）資産配分変更型））	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、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの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	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単字型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	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
株式	年1回	グローバル		
一般		(日本を含む)		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米	ファミリーファンド	あり
債券	年6回(隔月)	欧州		(部分ヘッジ)
一般	年12回(毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		
社債	その他	中南米	ファンド・オブ・ファン	
その他債券	()	アフリカ	ズ	なし
クレジット属性 ()				
不動産投信		中近東(中東)		
その他資産		エマージング		
(投資信託証券(資				
産複合(株式、債				
券、不動産投信)				
資産配分変更型)				
資産複合 ()				
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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せん。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】

2016年10月12日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年 5月29日	信託期間の変更(無期限化)実施。

(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DS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。

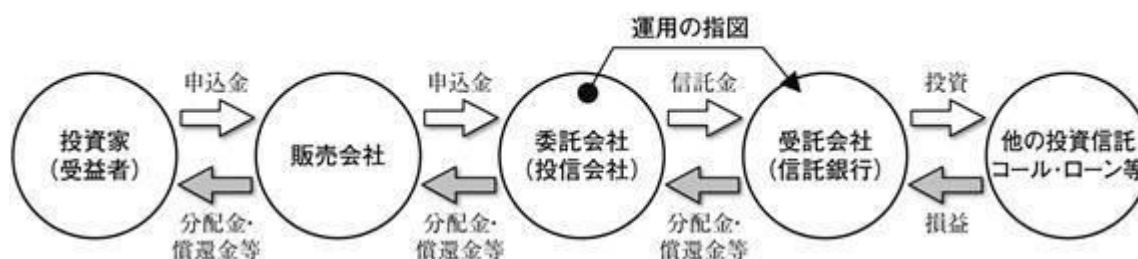
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2019年11月29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

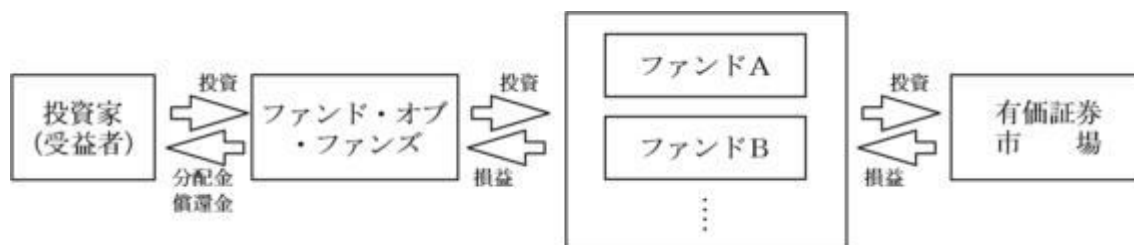
(2019年11月29日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

(ロ) 運用にあたっては、安定資産ポートフォリオへの投資を基本とし、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、リスク資産ポートフォリオの組入配分を機動的に調整します。リスク資産ポートフォリオへの投資割合の上限は40%程度とします。

(ハ) 安定資産ポートフォリオ内の資産配分は均等配分を基本としますが、市況の見通しに応じて一

定の範囲で調整を行う場合があります。

- (ニ) リスク資産ポートフォリオ内の資産配分はモメンタム・フォロー戦略 を活用します。
モメンタム・フォロー戦略とは、「過去に良好な運用成績の資産は、一定期間良好な運用成績が継続する」という仮定を基に、過去の運用成績が良い資産の投資割合を上げる戦略です。
- (ホ) 実質組入外貨建資産については、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドを除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ヘ) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ト) 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。
- (チ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

■投資対象とする投資信託の投資方針等

安定資産を構成する投資信託証券

日本国債

ファンド名	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●主として日本の国債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。 ●長期金利の低下（あるいは横ばい）が予想される局面では積極的に金利リスクを取得し、長期金利の上昇が予想される局面では機動的に金利リスクの圧縮を図ります。 ●長期金利の局面判定には、運用会社独自のクオンツ手法を用います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.06%

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）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。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

リスク資産を構成する投資信託証券

●すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶ 株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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、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ます。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●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ます。 ●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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●新興国の株式、新興国の株式指数を対象とした先物取引および上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

ファンド名	バンガード・FTSE・エマージング・マーケットETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●FTSEエマージング・マーケット・オールキャップ(含む中国A株)インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の株式を主要投資対象とします。 ●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等*1	年0.12%程度
購入の可否	日本において一般投資者の購入が可能です。*2

*1 管理報酬等とは各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目録見書等で開示されているものです(以下同じ。)

*2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接購入することができる場合があります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります(以下同じ)。

▶リート

国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 東証REIT指数（配当込み）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。 ● 日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）している不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、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。 ● 日本を除く世界各国の不動産投資信託（REIT）などを主要投資対象とします。 ● 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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

▶債券

先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 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。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

新興国債券…為替ヘッジなし

ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● ブルームバーグ・パークレイズ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ● ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等	年0.30%程度
購入の可否	日本において一般投資者の購入が可能です。

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ● ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等	年0.39%程度
購入の可否	日本において一般投資者の購入が可能です。

ファンドの特色

1 日本を含む世界のさまざまな資産に投資し、
値下がりするリスクを抑えつつ、安定的なリターンを目指します。

2 各資産の組入比率は柔軟に調整します。

■ 当ファンドでは、日本を含む世界のさまざまな資産を、安定資産とリスク資産に区別します。



安定資産・リスク資産とは？

安定資産 ……資産が目減りする可能性が低い資産のことをいいます。

リスク資産 ……安定資産と比べ値動きが大きく、より高い収益が期待できる反面、大きな損失を被る可能性のある資産のことをいいます。

■ リスク資産への投資は40%程度までとします。

■ 安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)」の組入比率がほぼ半分ずつになるようにします。

※市況の見通しに応じて一定の範囲で調整を行う場合があります。

3 先進国の債券は、部分的に対円での為替ヘッジを行います。

■ 為替ヘッジを行う場合でも、完全に為替変動リスクを回避することはできません。

■ 為替ヘッジを行う場合と行わない場合で、為替の変動が当ファンドに与える影響は以下のように考えると考えられます。

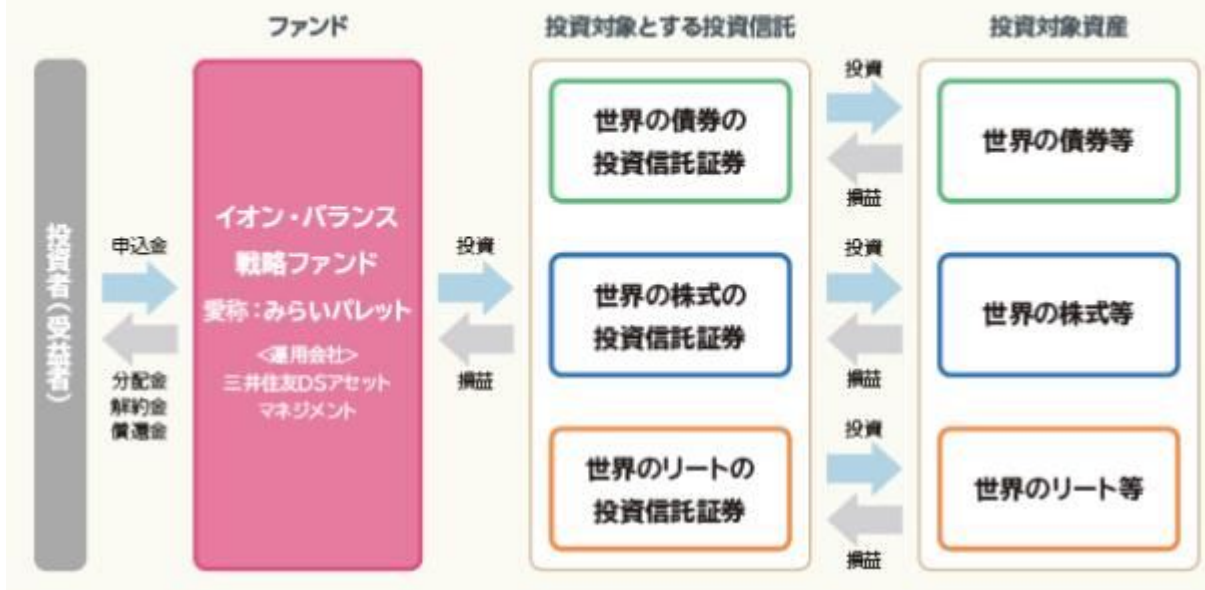
		円高となった場合	円安となった場合
日本の資産		基準価額に影響はありません。	基準価額に影響はありません。
外国の資産	為替ヘッジを行う資産	組入通貨に対し円高となった場合でも、為替差損は発生せず、基準価額へのマイナスは限定的となります。	組入通貨に対し円安となった場合でも、為替差益は発生せず、基準価額にプラスとなりません。
	為替ヘッジを行わない資産	組入通貨に対して円高となった場合、為替差損が発生し、基準価額にマイナスとなります。	組入通貨に対し円安となった場合、為替差益が発生し、基準価額にプラスとなります。

※上記は、為替ヘッジの一般的な説明であり、市況動向等によっては、上記の通りにならない場合があります。

※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

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象資産と資産配分

- 安定資産と言われる債券への投資と現預金での保有を基本とします。このうち債券は、日本国債と米国国債などの為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）に投資します。
- 安定資産のほか、株式やリート（不動産投資信託）など7つのリスク資産を組み入れることがあります。

▶投資対象資産と各資産のインデックス

【安定資産】

日本国債	NOMURA-BPI(国債)
為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)
現預金	-



日本国債と現預金

日本の長期金利の方向性(低下・横ばい、上昇)を予想し、日本国債(長期・超長期国債)と現預金への資産配分比率を機動的に変更します。

為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)

日本国債よりも利回りが相対的に高い先進国債券に投資する一方、投資先通貨(米国国債が投資先であれば米ドル)の下落リスクの低減を図ります(為替ヘッジを行います)。為替ヘッジでは、具体的には、投資先通貨を売って日本円を買います。

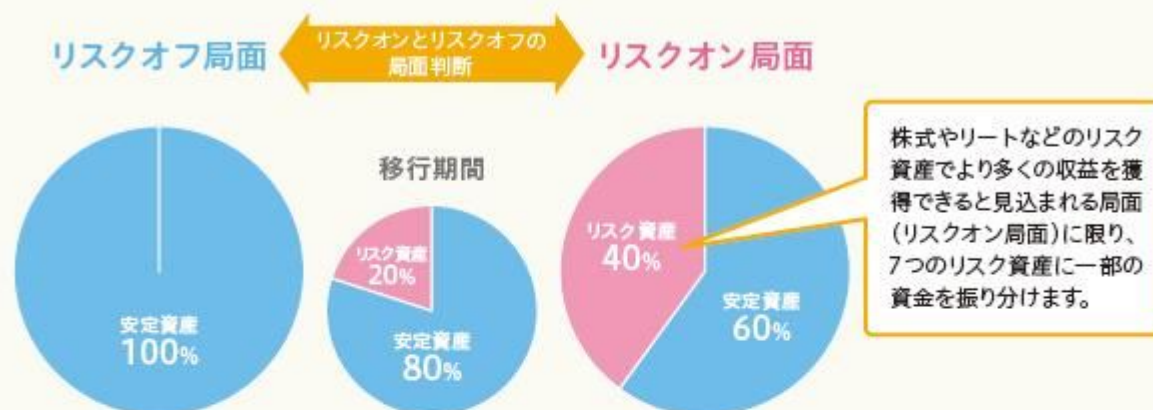
【リスク資産】

日本株式	TOPIX(配当込み)
先進国株式(除く日本)	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債券	J.P.モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス(円ベース)
日本リート	東証REIT指数(配当込み)
外国リート	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)

(注)ただし、すべてのリスク資産に投資するとは限りません。

▶ リスクオン・オフ局面での資産配分

- 「リスクオン局面」、「リスクオフ局面」の判断は、委託会社が独自の手法で算出する「リスク態度指数」で行います。



リスクオン局面（リスク選好的な局面）

投資家がより高い収益の獲得を目指し、リスクの高い資産に積極的に資金を投入する市場環境のこと。景気や企業業績の改善、金融緩和（利下げ）、金融不安の解消（国家財政や銀行経営の改善）、地政学的リスク（戦争、テロ）の低下などが見込まれる場合、多くはリスクオン局面と判断されます。

リスクオフ局面（リスク回避的な局面）

投資家がリスクを回避するようになり、より安全な資産に資金が向かいやすい市場環境のこと。景気や企業業績の悪化、金融引締め（利上げ）、金融不安の高まり（国家財政や銀行経営の悪化）、地政学的リスク（戦争、テロ）の高まりなどが見込まれる場合、多くはリスクオフ局面と判断されます。

リスク態度指数

市場のリスク選好度合いを計るための指数です。リスクオン局面とリスクオフ局面を判断します。

（注1）リスク資産への投資は40%程度までとします。

（注2）局面判断の有効性を高めるため、資産配分の切替えを行う際に一定の移行期間を設けます。

（注3）安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）」の組入比率がほぼ半半ずつになるようにします。

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※日本銀行によるマイナス金利政策が導入されたため、日本国債の一部がマイナス利回りとなることや、現預金に口座管理手数料が課されることがあります。このため、上図のリスクオフ局面の場合でも、日本国債および現預金の保有による損失が発生する場合があります。

（2）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

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．約束手形
- 3．金銭債権

（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、投資信託証券（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。））ならびに投資証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。））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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第3号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

八 投資対象とする金融商品

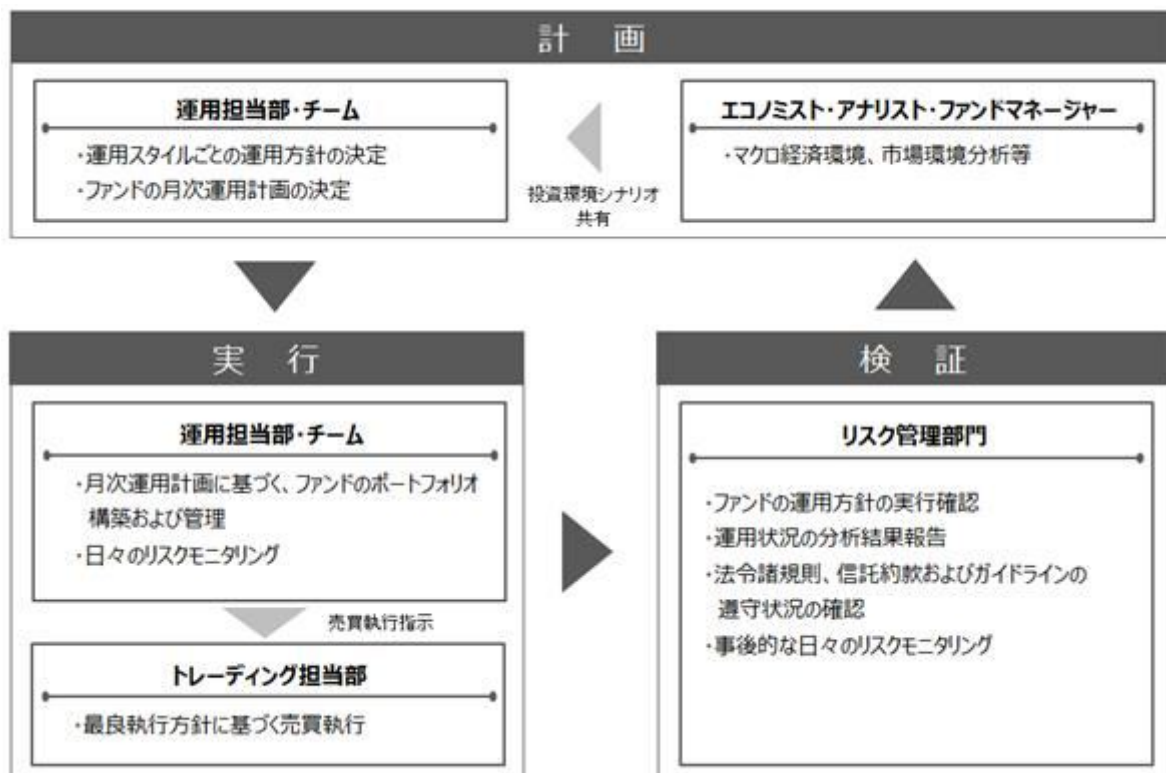
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 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

主要投資対象となる投資信託証券の名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（1）投資方針」の記載をご覧ください。

（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。

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、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、選定しています。ま

た、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

- 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】

年1回(原則として毎年4月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日)決算を行い、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 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、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。ただし、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。
- 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、元本部分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投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- 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 公社債の借入れの指図
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
 - (ロ) 公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債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、借入れにかかる公社債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公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。
- ト 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産(投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)について、当該外貨建資産の対円で為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

チ 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性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図を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) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、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%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

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ます。

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、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投

資本金を割り込むことがあります。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(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) 不動産投資信託（リート）に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度（税制、建築規制、会計制度等）の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 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。

(ホ) 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。為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）は、実質外貨建資産に対し原則として対円で為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。

(ヘ) 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。特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ト) 市場流動性リスク

ファンドの資金流出に伴い、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。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、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。

ロ 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。



※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】

原則として、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）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(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】

ファンド	純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）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。信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分（税抜き） >		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.45%	ファンドの運用等の対価
	販売会社	年0.40%	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	年0.03%	ファンドの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
	上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。		
投資対象とする投資信託	リスク資産配分の変動幅（0%～40%）を加味した場合の管理報酬等の概算値は以下の通りとなります。 年0.0%～年0.156%程度* 管理報酬等のうち最大のもの（年0.39%程度）を用いて計算しています。なお、管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.968%（税抜き0.88%）～年1.124%（税抜き1.036%）程度* 実質的な負担は、実際の組入状況等により変動します。		

* 投資対象とする投資信託の信託報酬等は、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の料率を上回ることがあります。

(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0.0066%（税抜き0.006%）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）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担す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金額を認識するものがあったりすることから、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。

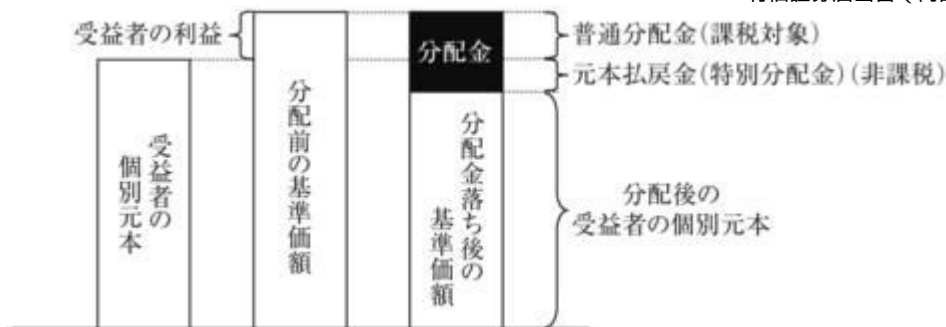
ハ 収益分配金の課税について

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（課税対象）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。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISA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。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各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。

	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	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 5年間 （投資期間は2023年まで）	
利用できる限度額	120万円/年 （最大 600万円 ）	80万円/年 （最大 400万円 ）

当ファンドの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には制限を設けません。
非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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11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】

イオン・バランス戦略ファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
投資信託受益証券	アメリカ	2,832,345	0.12
親投資信託受益証券	日本	2,431,019,498	98.84
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		25,646,782	1.04
合計（純資産総額）		2,459,498,625	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。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イオン・バランス戦略ファンド

イ 主要投資銘柄

2019年11月29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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	494,092,003	1.4349	708,972,616	1.4687	725,672,924	29.50
日本	親投資信託受 益証券	日本国債ダイナミック・アローケー ション・マザーファンド	603,168,309	1.1994	723,440,070	1.2014	724,646,406	29.46
日本	親投資信託受 益証券	Jリート・インデックス・マザー ファンド	129,703,834	2.5794	334,563,254	2.6934	349,344,306	14.20
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）	102,533,812	2.6371	270,400,000	2.7116	278,030,684	11.30
日本	親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	151,186,383	1.3751	207,900,000	1.3483	203,844,600	8.29
日本	親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	42,801,801	2.2427	95,994,881	2.3249	99,509,907	4.05
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	12,835,702	3.6689	47,092,908	3.8931	49,970,671	2.03
アメリカ	投資信託受益 証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ド ル建てエマージング・マーケット債 券ETF	230	12,467.92	2,867,623	12,314.54	2,832,345	0.12

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	0.12
親投資信託受益証券	98.84
合計	98.96

【投資不動産物件】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

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1期 (2017年 4月26日)	941,887,543	941,887,543	10,191	10,191
第2期 (2018年 4月26日)	2,135,712,788	2,135,712,788	9,962	9,962
第3期 (2019年 4月26日)	2,327,681,035	2,327,681,035	10,073	10,073
2018年11月末日	2,247,048,646		9,818	
12月末日	2,289,099,167		9,919	
2019年 1月末日	2,295,582,893		9,951	
2月末日	2,305,751,367		9,971	
3月末日	2,329,144,219		10,084	
4月末日	2,327,681,035		10,073	
5月末日	2,338,821,101		10,013	
6月末日	2,380,421,028		10,151	
7月末日	2,417,305,639		10,264	
8月末日	2,445,591,857		10,375	
9月末日	2,413,339,551		10,318	
10月末日	2,456,793,196		10,319	
11月末日	2,459,498,625		10,302	

【分配の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2016年10月12日～2017年 4月26日	0
第2期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第3期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0

【収益率の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	収益率(%)
第1期	1.9
第2期	2.2
第3期	1.1
第4期(中間期)	2.5

(注) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配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】

イオン・バランス戦略ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	941,628,680	17,412,426
第2期	1,491,997,945	272,427,188
第3期	510,495,142	343,373,820
第4期(中間期)	282,207,883	212,605,505

(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

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

2019年11月29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	8,712,284,624	70.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,677,581,383	29.68
合計(純資産総額)		12,389,866,007	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年11月29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	9,834,884,251	48.52
	フランス	1,979,178,010	9.76
	イタリア	1,902,261,123	9.39
	イギリス	1,285,015,651	6.34
	スペイン	1,200,036,925	5.92
	ドイツ	989,903,860	4.88
	ベルギー	418,771,989	2.07
	オーストラリア	401,036,605	1.98
	カナダ	379,488,987	1.87
	オランダ	370,313,257	1.83
	オーストリア	327,575,742	1.62
	シンガポール	179,550,478	0.89
	アイルランド	176,579,937	0.87
	メキシコ	168,298,276	0.83
	フィンランド	151,654,828	0.75
	南アフリカ	118,298,231	0.58
	ポーランド	117,902,530	0.58
	デンマーク	106,899,690	0.53
	スウェーデン	70,485,245	0.35
ノルウェー	48,225,540	0.24	
	小計	20,226,361,155	99.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		42,384,032	0.21
合計(純資産総額)		20,268,745,187	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 (%)
為替予約取引	売建		20,466,679,000	100.97

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	168,902,980,880	97.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,092,095,066	2.37
合計(純資産総額)		172,995,075,946	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	3,954,010,000	2.28
合計	買建	-	3,954,010,000	2.28

外国株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29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	146,400,779,043	62.78
	イギリス	13,086,058,884	5.61
	カナダ	8,505,748,862	3.65
	フランス	8,434,098,776	3.62
	スイス	8,285,990,832	3.55
	ドイツ	7,137,267,594	3.06
	オーストラリア	4,925,709,668	2.11
	オランダ	4,365,492,373	1.87
	アイルランド	4,239,242,884	1.82
	スペイン	2,311,335,429	0.99
	スウェーデン	2,019,635,441	0.87
	香港	1,975,323,784	0.85
	イタリア	1,566,958,737	0.67
	デンマーク	1,498,485,974	0.64
	シンガポール	971,445,461	0.42
	バミューダ	899,987,657	0.39
	フィンランド	897,539,577	0.38
	ベルギー	813,810,858	0.35
	ジャージー	806,718,565	0.35
	ケイマン諸島	529,463,181	0.23
ノルウェー	499,979,307	0.21	
イスラエル	486,108,902	0.21	
キュラソー	296,797,271	0.13	

	ルクセンブルグ	220,724,276	0.09
	ニュージーランド	220,272,851	0.09
	オーストリア	183,782,598	0.08
	ポルトガル	125,593,296	0.05
	リベリア	120,085,079	0.05
	パプアニューギニア	38,614,243	0.02
	マン島	28,672,577	0.01
	英ヴァージン諸島	25,591,846	0.01
	小計	221,917,315,826	95.17
投資証券	アメリカ	4,731,071,587	2.03
	オーストラリア	691,310,351	0.30
	フランス	255,144,092	0.11
	イギリス	159,091,775	0.07
	香港	155,183,000	0.07
	シンガポール	118,642,732	0.05
	カナダ	66,271,079	0.03
	小計	6,176,714,616	2.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,084,743,906	2.18
合計(純資産総額)		233,178,774,348	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	3,679,897,993	1.57
	買建	ドイツ	838,824,040	0.35
	買建	イギリス	293,678,490	0.12
	買建	オーストラリア	216,533,284	0.09
合計	買建	-	5,028,933,807	2.13

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		102,797,800	0.04
	売建		114,312,200	0.04

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	820,266,206	9.66
	韓国	543,128,042	6.40
	台湾	537,808,340	6.34
	インド	427,147,342	5.03
	中国	380,497,503	4.48
	ブラジル	322,137,480	3.80
	南アフリカ	200,472,954	2.36
	香港	175,673,156	2.07
	タイ	126,681,842	1.49
	メキシコ	104,609,452	1.23
	インドネシア	88,277,958	1.04
	マレーシア	86,172,100	1.02
	フィリピン	46,229,558	0.54
	ポーランド	42,615,884	0.50
	バミューダ	35,784,146	0.42
	チリ	32,393,871	0.38
	トルコ	23,201,408	0.27
	コロンビア	16,175,962	0.19
	アメリカ	15,383,052	0.18
	ギリシャ	13,607,620	0.16
	ハンガリー	13,597,658	0.16
	エジプト	6,492,378	0.08
	チェコ	6,265,497	0.07
	ルクセンブルグ	5,353,417	0.06
	アルゼンチン	3,842,779	0.05
	マン島	2,770,381	0.03
	ペルー	2,563,424	0.03
シンガポール	1,346,800	0.02	
ベルギー	748,348	0.01	
小計		4,081,244,558	48.09

投資信託受益証券	アメリカ	256,110,317	3.02
	香港	185,495,635	2.19
	小計	441,605,952	5.20
投資証券	アメリカ	112,789,031	1.33
	ブラジル	8,392,072	0.10
	南アフリカ	7,482,080	0.09
	メキシコ	3,884,139	0.05
	小計	132,547,322	1.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,831,800,982	45.15
合計(純資産総額)		8,487,198,814	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	3,838,539,777	45.22
合計	買建	-	3,838,539,777	45.22

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		4,129,445,511	48.65
	売建		1,071,400,041	12.62

Jリート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	8,189,938,400	98.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		95,911,498	1.16
合計(純資産総額)		8,285,849,898	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 (%)
REIT指数先物取引	買建	日本	66,585,000	0.80
合計	買建	-	66,585,000	0.80

外国リート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	4,977,732,232	73.15
	オーストラリア	440,447,405	6.47
	イギリス	355,341,862	5.22
	シンガポール	264,949,906	3.89
	フランス	235,279,858	3.46
	カナダ	129,476,019	1.90
	香港	126,461,020	1.86
	ベルギー	70,521,478	1.04
	スペイン	41,479,694	0.61
	ニュージーランド	27,097,244	0.40
	オランダ	20,523,200	0.30
	ドイツ	16,421,436	0.24
	アイルランド	6,517,117	0.10
	イスラエル	5,594,400	0.08
	イタリア	2,621,993	0.04
	ガーンジー	1,908,160	0.03
マン島	1,445,263	0.02	
	小計	6,723,818,287	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		80,908,026	1.19
合計(純資産総額)		6,804,726,313	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 (%)
為替予約取引	買建		17,320,537	0.25

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年11月29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356回利付国債(10年)	790,000,000	101.77	804,009,500	101.82	804,441,200	0.100	2029/9/20	6.49
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	710,000,000	102.26	726,107,200	102.13	725,179,800	0.100	2028/9/20	5.85
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	630,000,000	102.05	642,948,000	101.92	642,140,100	0.100	2029/6/20	5.18
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	520,000,000	102.73	534,231,700	102.27	531,809,200	0.100	2028/3/20	4.29
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	510,000,000	102.47	522,620,500	102.02	520,302,000	0.100	2029/3/20	4.20
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	470,000,000	102.69	482,657,500	102.25	480,617,300	0.100	2027/6/20	3.88
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	410,000,000	102.47	420,145,000	102.29	419,413,600	0.100	2027/9/20	3.39
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	400,000,000	102.09	408,392,000	102.22	408,884,000	0.100	2027/3/20	3.30
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	400,000,000	103.26	413,061,400	102.20	408,832,000	0.100	2028/6/20	3.30
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	350,000,000	102.29	358,038,000	102.10	357,371,000	0.100	2028/12/20	2.88
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	200,000,000	133.30	266,600,000	136.95	273,914,000	2.000	2042/3/20	2.21
日本	国債証券	第57回利付国債(30年)	220,000,000	106.42	234,124,000	111.20	244,659,800	0.800	2047/12/20	1.97
日本	国債証券	第64回利付国債(30年)	230,000,000	99.20	228,171,200	99.86	229,694,100	0.400	2049/9/20	1.85
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	185,000,000	122.46	226,562,000	121.37	224,534,500	1.600	2033/12/20	1.81
日本	国債証券	第155回利付国債(20年)	190,000,000	113.04	214,791,000	113.58	215,817,200	1.000	2035/12/20	1.74
日本	国債証券	第157回利付国債(20年)	200,000,000	98.35	196,700,000	100.64	201,288,000	0.200	2036/6/20	1.62
日本	国債証券	第163回利付国債(20年)	180,000,000	107.05	192,703,000	107.06	192,709,800	0.600	2037/12/20	1.56
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	160,000,000	116.74	186,784,000	116.65	186,649,600	1.200	2035/9/20	1.51
日本	国債証券	第168回利付国債(20年)	180,000,000	103.38	186,084,000	102.95	185,310,000	0.400	2039/3/20	1.50
日本	国債証券	第58回利付国債(30年)	160,000,000	107.59	172,156,000	111.15	177,849,600	0.800	2048/3/20	1.44
日本	国債証券	第62回利付国債(30年)	170,000,000	103.86	176,564,000	102.89	174,916,400	0.500	2049/3/20	1.41
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	150,000,000	117.25	175,889,000	116.30	174,462,000	1.200	2034/12/20	1.41
日本	国債証券	第142回利付国債(20年)	132,000,000	124.27	164,049,000	122.92	162,263,640	1.800	2032/12/20	1.31
日本	国債証券	第12回利付国債(40年)	150,000,000	101.37	152,068,800	101.83	152,758,500	0.500	2059/3/20	1.23
日本	国債証券	第159回利付国債(20年)	140,000,000	107.69	150,772,300	107.12	149,973,600	0.600	2036/12/20	1.21
日本	国債証券	第63回利付国債(30年)	100,000,000	102.03	102,033,000	100.00	100,000,000	0.400	2049/6/20	0.81

日本	国債証券	第5 2 回利付国債 (3 0 年)	80,000,000	98.80	79,040,000	103.54	82,838,400	0.500	2046/9/20	0.67
日本	国債証券	第1 6 0 回利付国債 (2 0 年)	70,000,000	106.85	74,795,000	108.81	76,169,100	0.700	2037/3/20	0.61
日本	国債証券	第6 回利付国債 (4 0 年)	50,000,000	139.08	69,544,000	146.00	73,002,000	1.900	2053/3/20	0.59
日本	国債証券	第5 回利付国債 (4 0 年)	48,100,000	141.31	67,970,110	147.87	71,128,356	2.000	2052/3/20	0.57

ロ 種類別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	70.32
合計	70.32

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年11月29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 2.125	1,700,000	11,277.01	191,709,184	11,173.40	189,947,938	2.125	2024/2/29	0.94
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	1,300,000	13,108.34	170,408,502	12,743.71	165,668,230	0.500	2029/5/25	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,450,000	10,901.89	158,077,441	10,808.77	156,727,290	1.500	2026/8/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,400,000	11,166.68	156,333,561	11,085.67	155,199,443	2.000	2023/2/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,400,000	11,053.50	154,749,117	11,028.75	154,402,566	2.250	2021/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	1,400,000	10,874.44	152,242,180	10,878.10	152,293,536	1.125	2021/2/28	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,200,000	11,038.17	132,458,040	10,958.13	131,497,678	1.625	2023/10/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,100,000	12,009.65	132,106,249	11,755.44	129,309,901	2.625	2029/2/15	0.64
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	600,000	21,635.37	129,812,240	20,867.73	125,206,426	5.750	2032/10/25	0.62
イタリア	国債証券	BTPS 1.65	1,000,000	12,229.03	122,290,319	12,285.70	122,857,092	1.650	2032/3/1	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,100,000	11,077.54	121,852,974	11,003.07	121,033,842	1.750	2023/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,100,000	10,926.89	120,195,879	10,864.41	119,508,562	1.375	2023/6/30	0.59
イタリア	国債証券	BTPS 6.5	700,000	17,154.28	120,080,025	17,030.80	119,215,636	6.500	2027/11/1	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	900,000	13,189.99	118,709,972	12,725.22	114,527,006	3.000	2045/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	900,000	13,124.08	118,116,807	12,665.30	113,987,764	3.000	2044/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,000,000	11,488.39	114,883,931	11,358.29	113,582,906	2.500	2024/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,000,000	11,448.16	114,481,641	11,316.77	113,167,777	2.375	2024/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	900,000	12,936.63	116,429,754	12,485.56	112,370,043	2.875	2046/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,000,000	11,335.07	113,350,777	11,226.47	112,264,763	2.250	2024/1/31	0.55

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,000,000	11,329.18	113,291,888	11,224.76	112,247,644	2.250	2023/12/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,235.03	112,350,356	11,124.19	111,241,917	2.000	2024/4/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	11,242.73	112,427,391	11,067.27	110,672,719	1.875	2026/6/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,000,000	11,079.25	110,792,550	11,038.59	110,385,979	2.125	2021/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	11,090.38	110,903,822	11,031.32	110,313,225	1.875	2022/8/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,080.11	110,801,110	11,030.46	110,304,666	2.000	2021/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	11,070.69	110,706,956	11,019.76	110,197,673	1.875	2022/4/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	11,052.72	110,527,210	10,997.08	109,970,850	1.750	2022/9/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	11,025.33	110,253,310	10,958.56	109,585,679	1.625	2023/5/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	11,024.47	110,244,750	10,957.28	109,572,839	1.625	2023/4/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,000,000	10,911.49	109,114,912	10,917.05	109,170,548	1.375	2021/1/31	0.54

□ 種類別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.79
合計	99.79

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11月29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	784,800	6,802.22	5,338,382,256	7,638.00	5,994,302,400	3.47
日本	株式	ソニー	電気機器	444,900	5,908.12	2,628,522,588	6,904.00	3,071,589,600	1.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,780,600	620.93	2,968,417,958	578.10	2,763,664,860	1.60
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	586,000	4,375.58	2,564,089,880	4,455.00	2,610,630,000	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	461,800	4,674.36	2,158,619,448	5,527.00	2,552,368,600	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	63,800	30,735.14	1,960,901,932	37,440.00	2,388,672,000	1.38
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	548,100	4,732.97	2,594,140,857	4,253.00	2,331,069,300	1.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	480,300	4,165.83	2,000,848,149	3,989.00	1,915,916,700	1.11
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	481,700	3,116.98	1,501,449,266	3,962.00	1,908,495,400	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	43,200	34,682.81	1,498,297,392	42,350.00	1,829,520,000	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	554,300	3,191.16	1,768,859,988	3,067.00	1,700,038,100	0.98

日本	株式	KDDI	情報・通信業	514,800	2,661.02	1,369,893,096	3,139.00	1,615,957,200	0.93
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,433,600	187.38	1,767,667,968	169.20	1,596,165,120	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	510,100	2,668.06	1,360,977,406	3,003.00	1,531,830,300	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	248,300	5,593.56	1,388,880,948	5,952.00	1,477,881,600	0.85
日本	株式	日立製作所	電気機器	338,300	3,353.76	1,134,577,008	4,300.00	1,454,690,000	0.84
日本	株式	花王	化学	168,500	8,356.43	1,408,058,455	8,612.00	1,451,122,000	0.84
日本	株式	HOYA	精密機器	141,800	6,929.43	982,593,174	9,990.00	1,416,582,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	89,700	12,578.07	1,128,252,879	15,745.00	1,412,326,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	66,900	19,318.26	1,292,391,594	20,905.00	1,398,544,500	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	486,700	3,058.86	1,488,747,162	2,866.00	1,394,882,200	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	118,400	10,107.12	1,196,683,008	11,710.00	1,386,464,000	0.80
日本	株式	第一三共	医薬品	201,400	4,188.68	843,600,152	6,862.00	1,382,006,800	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	84,700	15,034.80	1,273,447,560	16,190.00	1,371,293,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	206,800	5,745.85	1,188,241,780	6,344.00	1,311,939,200	0.76
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	58,500	23,330.78	1,364,850,630	22,095.00	1,292,557,500	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	124,000	10,303.61	1,277,647,640	10,070.00	1,248,680,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	609,200	1,775.70	1,081,756,440	1,939.50	1,181,543,400	0.68
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	484,900	2,016.77	977,931,773	2,388.00	1,157,941,200	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	619,500	1,735.78	1,075,315,710	1,867.50	1,156,916,250	0.67

□ 種別・業種別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.71
		食料品	3.82
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.98
		医薬品	5.88
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.57
		機械	4.99
		電気機器	13.88
輸送用機器	7.64		
精密機器	2.29		

	その他製品	2.28
	電気・ガス業	1.51
	陸運業	4.45
	海運業	0.17
	空運業	0.50
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.35
	卸売業	4.84
	小売業	4.56
	銀行業	5.72
	証券、商品先物取引業	0.82
	保険業	2.24
	その他金融業	1.14
	不動産業	2.35
	サービス業	5.02
合計		97.63

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11月29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	APPLE INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	235,469	20,424.17	4,809,260,110	29,344.55	6,909,731,938	2.96
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	377,980	12,731.16	4,812,125,526	16,688.17	6,307,797,974	2.71
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,921	186,070.97	4,078,861,920	199,235.95	4,367,451,383	1.87
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・ 娯楽	125,223	16,390.92	2,052,520,682	22,131.12	2,771,325,240	1.19
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	166,908	12,150.20	2,027,966,249	14,468.49	2,414,907,330	1.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	16,320	122,435.61	1,998,149,294	143,851.18	2,347,651,329	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	15,639	123,075.84	1,924,783,120	143,756.96	2,248,215,141	0.96
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	137,822	15,563.91	2,145,050,394	15,091.89	2,079,994,464	0.89
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェ ア・サービ ス	90,236	16,120.44	1,454,644,829	20,199.57	1,822,729,048	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	155,168	9,854.74	1,529,141,538	11,439.62	1,775,063,577	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	130,780	10,904.10	1,426,038,755	13,340.02	1,744,608,548	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	462,152	3,089.59	1,427,861,122	3,661.49	1,692,167,330	0.73

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	68,836	23,487.45	1,616,782,726	24,157.97	1,662,938,711	0.71
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	220,825	8,432.11	1,862,022,883	7,526.77	1,662,099,427	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	381,980	3,501.42	1,337,474,516	4,126.02	1,576,060,787	0.68
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	94,182	13,059.63	1,229,982,565	16,596.14	1,563,058,486	0.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,121	29,436.45	1,445,948,304	30,750.20	1,510,480,830	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	46,953	23,412.57	1,099,290,465	31,958.65	1,500,554,587	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	231,361	5,296.86	1,225,486,897	6,410.35	1,483,106,282	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	216,321	6,506.29	1,407,447,304	6,584.55	1,424,377,738	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	57,288	20,508.28	1,174,878,457	24,431.87	1,399,653,541	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	219,017	5,759.56	1,261,443,568	5,953.49	1,303,915,607	0.56
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	132,835	8,661.66	1,150,572,208	9,598.55	1,275,023,602	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	98,472	13,028.34	1,282,927,132	12,935.74	1,273,809,095	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	212,612	5,482.91	1,165,733,364	5,910.76	1,256,698,930	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,331	28,623.93	1,039,936,064	33,891.12	1,231,298,281	0.53
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	287,130	4,773.12	1,370,507,432	4,232.30	1,215,221,103	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	237,462	4,438.47	1,053,969,813	4,866.65	1,155,645,677	0.50
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	112,401	8,902.95	1,000,700,567	10,127.85	1,138,380,603	0.49
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	27,992	38,597.32	1,080,416,205	40,318.07	1,128,583,695	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.09
		素材	4.18
		資本財	7.02
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.10
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.75

	メディア・娯楽	5.97
	小売	4.66
	食品・生活必需品小売り	1.51
	食品・飲料・タバコ	4.66
	家庭用品・パーソナル用品	2.04
	ヘルスケア機器・サービス	4.91
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.02
	銀行	7.63
	各種金融	4.35
	保険	3.74
	不動産	0.68
	ソフトウェア・サービス	9.58
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.47
	電気通信サービス	2.32
	公益事業	3.44
	半導体・半導体製造装置	3.20
投資証券		2.65
合計		97.82

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年11月29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 (%)
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	12,270	18,855.12	231,352,443	22,001.83	269,962,567	3.18
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	179,000	873.48	156,354,071	1,111.10	198,887,795	2.34
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	41,600	4,517.13	187,912,826	4,732.00	196,851,200	2.32
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		301,800	598.66	180,675,759	614.63	185,495,635	2.19
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		39,708	3,855.49	153,093,805	4,582.89	181,977,586	2.14
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	34,674	4,155.30	144,080,908	4,776.02	165,604,064	1.95
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		34,756	3,441.24	119,603,837	3,245.16	112,789,031	1.33
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	700,000	91.49	64,048,490	89.60	62,720,000	0.74
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	40,500	1,145.35	46,386,794	1,264.90	51,228,450	0.60
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	20,779	1,915.35	39,799,185	2,433.66	50,569,063	0.60
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	3,194	14,895.82	47,577,259	15,733.99	50,254,367	0.59
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		22,394	2,027.16	45,396,312	1,943.59	43,524,853	0.51

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	11,886	3,098.74	36,831,684	3,557.01	42,278,680	0.50
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	475,000	77.59	36,856,668	80.36	38,171,000	0.45
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	45,000	1,039.57	46,780,949	844.20	37,989,000	0.45
ブラジル	株式	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	銀行	35,400	921.88	32,634,898	899.60	31,845,840	0.38
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	3,989	6,759.58	26,963,975	7,708.68	30,749,925	0.36
ブラジル	株式	VALE SA	素材	23,200	1,281.92	29,740,762	1,309.62	30,383,184	0.36
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	91,800	266.32	24,448,593	322.38	29,594,668	0.35
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI UAE ETF		19,639	1,570.93	30,851,513	1,493.18	29,324,606	0.35
インド	株式	ICICI BANK LIMITED	銀行	34,946	684.64	23,925,577	799.49	27,939,012	0.33
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	24,916	1,087.75	27,102,597	1,080.84	26,930,434	0.32
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,023	17,222.98	34,842,092	13,093.51	26,488,182	0.31
中国	株式	BANK OF CHINA LTD	銀行	581,000	47.23	27,440,761	44.94	26,110,140	0.31
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO S.A. -PREF	銀行	29,484	865.18	25,509,015	863.46	25,458,255	0.30
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO SA- PETROBRAS-PR	エネルギー	30,800	674.42	20,772,407	767.78	23,647,624	0.28
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,025	3,352.95	20,201,573	3,882.27	23,390,677	0.28
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	131,000	175.46	22,986,007	164.36	21,531,160	0.25
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	6,602	3,144.90	20,762,665	3,199.11	21,120,584	0.25
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	電気通信サービス	244,700	78.88	19,304,172	84.63	20,710,723	0.24

□ 種別・業種別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.72
		素材	3.10
		資本財	1.52
		商業・専門サービス	0.12
		運輸	0.93
		自動車・自動車部品	1.20
		耐久消費財・アパレル	0.70
		消費者サービス	0.75
		メディア・娯楽	3.70
		小売	5.04
		食品・生活必需品小売り	0.78
		食品・飲料・タバコ	1.73

	家庭用品・パーソナル用品	0.62
	ヘルスケア機器・サービス	0.40
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.98
	銀行	7.76
	各種金融	1.25
	保険	2.06
	不動産	1.27
	ソフトウェア・サービス	0.92
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.91
	電気通信サービス	2.02
	公益事業	1.29
	半導体・半導体製造装置	3.33
投資信託受益証券		5.20
投資証券		1.56
合計		54.85

Jリート・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11月29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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	702	779,224.05	547,015,289	822,000	577,044,000	6.96
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	725	709,694.79	514,528,723	745,000	540,125,000	6.52
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	2,261	189,704.26	428,921,348	199,800	451,747,800	5.45
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,446	228,494.09	330,402,461	240,700	348,052,200	4.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,627	203,070.65	330,395,960	213,000	346,551,000	4.18
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	1,371	221,617.31	303,837,337	249,300	341,790,300	4.12
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,041	287,156.81	298,930,245	293,700	305,741,700	3.69
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	977	285,420.18	278,855,522	299,400	292,513,800	3.53
日本	投資証券	G L P 投資法人	1,807	136,456.36	246,576,649	145,600	263,099,200	3.18
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	687	341,050.32	234,301,573	353,500	242,854,500	2.93
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	459	494,495.35	226,973,367	498,500	228,811,500	2.76
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,339	84,698.74	198,110,360	89,700	209,808,300	2.53
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,181	62,726.75	199,533,795	65,100	207,083,100	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,119	90,717.82	192,231,065	96,800	205,119,200	2.48
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	363	529,675.65	192,272,262	565,000	205,095,000	2.48
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	224	813,011.67	182,114,616	829,000	185,696,000	2.24
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	241	670,178.83	161,513,099	688,000	165,808,000	2.00
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	892	149,990.49	133,791,524	171,200	152,710,400	1.84
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	835	166,557.56	139,075,566	177,400	148,129,000	1.79
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	168	838,558.2	140,877,779	822,000	138,096,000	1.67
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	473	267,033.22	126,306,714	280,200	132,534,600	1.60

日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	616	194,409.42	119,756,205	202,000	124,432,000	1.50
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	257	456,654.84	117,360,295	476,000	122,332,000	1.48
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	651	171,348.63	111,547,959	185,000	120,435,000	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人	780	138,026.12	107,660,380	152,400	118,872,000	1.43
日本	投資証券	日本リート投資法人	235	449,128.74	105,545,255	484,500	113,857,500	1.37
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	673	149,101.84	100,345,539	167,200	112,525,600	1.36
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	930	113,423.59	105,483,941	118,300	110,019,000	1.33
日本	投資証券	プレミアム投資法人	657	150,393.55	98,808,563	163,400	107,353,800	1.30
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	303	332,029.19	100,604,845	350,000	106,050,000	1.28

ロ 種類別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.84
合計	98.84

外国リート・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11月29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(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	28,829	9,070.62	261,497,016	10,123.34	291,845,884	4.29
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,866	63,460.48	245,338,234	61,922.21	239,391,289	3.52
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,122	16,102.69	227,402,327	16,567.66	233,968,540	3.44
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	18,722	9,635.00	180,386,554	9,402.43	176,032,467	2.59
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,971	27,759.81	193,513,696	23,239.86	162,005,114	2.38
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,191	22,719.31	140,655,305	23,617.84	146,218,104	2.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	15,414	9,140.59	140,893,067	9,381.62	144,608,334	2.13
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,721	13,356.20	129,835,641	13,278.67	129,081,970	1.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	14,203	8,058.14	114,449,854	8,511.71	120,891,908	1.78
香港	投資証券	LINK REIT	98,600	1,272.17	125,436,713	1,134.00	111,812,400	1.64
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	6,447	15,005.33	96,739,410	17,093.63	110,202,649	1.62
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	16,229	7,904.92	128,289,084	6,432.26	104,389,271	1.53
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	6,746	14,039.64	94,711,476	15,229.93	102,741,146	1.51
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,932	34,747.52	101,879,757	34,287.89	100,532,116	1.48
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	5,366	16,265.96	87,283,180	17,782.68	95,421,880	1.40
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,419	3,777.26	84,682,492	3,845.55	86,213,520	1.27
アメリカ	投資証券	WIP CAREY INC	8,165	9,641.77	78,725,066	9,273.15	75,715,338	1.11
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	69,039	1,141.96	78,840,246	1,092.82	75,447,448	1.11
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,163	16,308.00	67,890,225	18,109.17	75,388,485	1.11
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	254,330	293.32	74,601,513	291.37	74,104,183	1.09

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,919	13,730.30	67,539,353	15,021.77	73,892,094	1.09
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	20,922	3,141.76	65,732,043	3,325.14	69,568,705	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	12,995	5,222.72	67,869,314	5,262.16	68,381,858	1.00
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,661	13,204.41	74,750,191	11,636.36	65,873,477	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,094	7,402.23	59,913,678	8,086.62	65,453,131	0.96
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,878	1,732.23	56,952,473	1,944.69	63,937,518	0.94
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	50,582	1,100.12	55,646,381	1,263.43	63,906,886	0.94
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	21,940	2,382.87	52,280,299	2,726.94	59,829,248	0.88
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	15,371	3,597.11	55,291,321	3,865.27	59,413,170	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,680	11,808.95	55,265,912	12,294.82	57,539,773	0.85

□ 種類別の投資比率

2019年11月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.81
合計	98.81

投資不動産物件

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・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

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年11月29日現在

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	売建	90,500,000.00	9,750,968,655	9,907,035,000	48.87
	カナダドル	売建	4,600,000.00	376,661,340	378,994,000	1.86
	メキシコペソ	売建	31,400,000.00	175,020,742	175,840,000	0.86
	ユーロ	売建	63,500,000.00	7,651,781,115	7,656,830,000	37.77
	英ポンド	売建	9,200,000.00	1,285,850,144	1,300,788,000	6.41
	スウェーデンクローナ	売建	6,300,000.00	70,481,880	72,198,000	0.35
	ノルウェークローネ	売建	4,100,000.00	48,086,030	48,913,000	0.24
	デンマーククローネ	売建	6,700,000.00	108,103,830	108,138,000	0.53
	ポーランドズロチ	売建	4,300,000.00	121,248,003	119,927,000	0.59
	オーストラリアドル	売建	5,400,000.00	401,813,838	400,140,000	1.97
	シンガポールドル	売建	2,200,000.00	174,424,140	176,352,000	0.87
	南アフリカランド	売建	16,400,000.00	116,525,034	121,524,000	0.59

(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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年11月29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	233	日本円	3,926,388,600	3,954,010,000	2.28

(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。

外国株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29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 1912	買建	213	米ドル	32,924,339	3,607,190,581	33,587,970	3,679,897,993	1.57
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1912	買建	188	ユーロ	6,912,136	833,534,480	6,956,000	838,824,040	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1912	買建	17	オーストラリアドル	2,863,601.5	212,307,415	2,920,600	216,533,284	0.09

イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1912	買建	28	英ポンド	2,059,741	291,350,364	2,076,200	293,678,490	0.12
------	--------------------	-----------	----	----	------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(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。

2019年11月29日現在

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	670,000.00	73,298,000	73,385,100	0.03
	カナダドル	買建	50,000.00	4,116,000	4,121,500	0.00
	ユーロ	買建	100,000.00	12,041,000	12,058,000	0.00
	英ポンド	買建	30,000.00	4,240,500	4,242,900	0.00
	スイスフラン	買建	40,000.00	4,381,200	4,387,200	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	90,000.00	1,027,800	1,031,400	0.00
	ノルウェークローネ	買建	10,000.00	119,400	119,300	0.00
	デンマーククローネ	買建	60,000.00	967,200	968,400	0.00
	ニュージーランドドル	買建	10,000.00	702,800	702,700	0.00
	香港ドル	買建	70,000.00	977,900	979,300	0.00
	シンガポールドドル	買建	10,000.00	801,000	802,000	0.00
	米ドル	売建	750,000.00	82,140,000	82,140,000	0.03
	カナダドル	売建	20,000.00	1,648,800	1,648,400	0.00
	ユーロ	売建	120,000.00	14,472,000	14,469,600	0.00
	英ポンド	売建	40,000.00	5,655,600	5,656,800	0.00
	スイスフラン	売建	20,000.00	2,193,400	2,193,600	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	50,000.00	573,000	573,000	0.00
	ノルウェークローネ	売建	10,000.00	119,400	119,300	0.00
	デンマーククローネ	売建	20,000.00	322,800	322,800	0.00
	オーストラリアドル	売建	80,000.00	5,931,200	5,929,600	0.00
香港ドル	売建	90,000.00	1,259,100	1,259,100	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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29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	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 1912	買建	664	米ドル	34,492,459	3,778,993,807	35,035,960	3,838,539,777	45.22

(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。

2019年11月29日現在

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	37,753,204.58	4,071,700,000	4,129,445,511	48.65
	米ドル	売建	9,795,209.74	1,057,000,000	1,071,400,041	12.62

(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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29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 (%)
REIT指数 先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	30	日本円	67,352,100	66,585,000	0.80

(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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

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	127,970.75	14,000,000	14,016,636	0.20
	ユーロ	買建	9,135.45	1,100,000	1,101,552	0.01
	英ポンド	買建	7,074.64	1,000,000	1,000,566	0.01
	オーストラリアドル	買建	16,214.03	1,200,000	1,201,783	0.01

(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。

参考情報

基準日:2019年11月29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



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4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。

主要な資産の状況

■イオン・バランス戦略ファンド

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	98.84
投資信託受益証券	アメリカ	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.04
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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	29.50
日本	親投資信託受益証券	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	29.46
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	14.20
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)	11.30
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	8.29
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	4.05
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	2.03
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	0.12

※比率は、ファンド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)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

▶投資対象とする投資信託の現況

■日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

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356回利付国債(10年)	0.100	2029/09/20	6.49
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	0.100	2028/09/20	5.85
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	0.100	2029/06/20	5.18
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	0.100	2028/03/20	4.29
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	0.100	2029/03/20	4.20
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	0.100	2027/06/20	3.88
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	0.100	2027/09/20	3.39
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	0.100	2027/03/20	3.30
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	0.100	2028/06/20	3.30
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	0.100	2028/12/20	2.88

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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 2.125	2.125	2024/02/29	0.94
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	0.500	2029/05/25	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2026/08/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2023/02/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2021/02/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	1.125	2021/02/28	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2023/10/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.64
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	5.750	2032/10/25	0.62
イタリア	国債証券	BTPS 1.65	1.650	2032/03/01	0.61

※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。

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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	3.47
日本	株式	ソニー	電気機器	1.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.60
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.38
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.11
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	1.06

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、株価指数先物取引の買建て(2.28%)を行っています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.96
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.71
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.87
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.19
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	0.96
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	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.76

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(2.13%)を行っています。

※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。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	3.18
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	2.34
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	2.32
香港	投資信託 受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	2.19
アメリカ	投資信託 受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.14
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェア および機器	1.95
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	1.33
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	0.74
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	0.60
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	0.60

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(45.22%)を行っています。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.96
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.52
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.45
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.18
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4.12
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3.69
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.53
日本	投資証券	GLP投資法人	3.18
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2.93

※上記のほか、Jリート・インデックス・マザーファンドにおいて、リート指数先物取引の買建て(0.80%)を行っています。

※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。

■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	4.29
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3.52
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.44
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.59
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.38
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.13
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	1.78
香港	投資証券	LINK REIT	1.64

※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。

■iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)

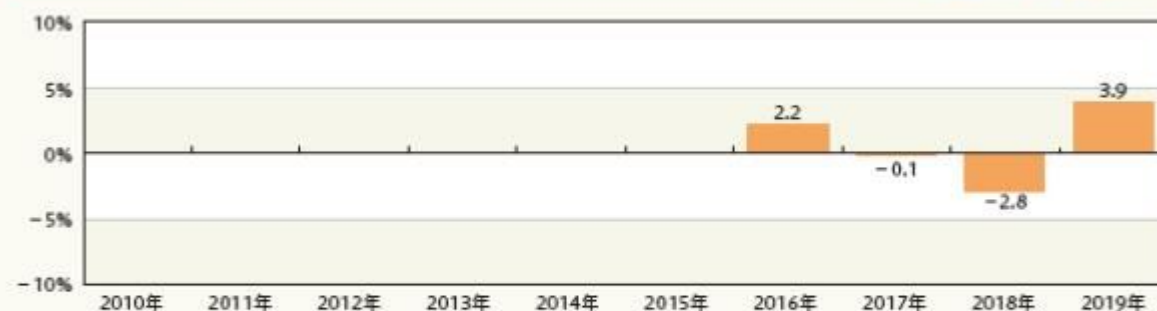
国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
クウェート	国債証券	KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) MTN RegS 3.5 03/20/27	3.500	2027/03/20	0.86
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1 06/18/50	5.100	2050/06/18	0.84
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25 06/23/47	5.250	2047/06/23	0.76
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 5.1 04/23/48	5.100	2048/04/23	0.72
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 4.817 03/14/49	4.817	2049/03/14	0.68
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.625 11/18/50	5.625	2050/11/18	0.66
コロンビア	国債証券	COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5 06/15/45	5.000	2045/06/15	0.66
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 8.75 11/21/33	8.750	2033/11/21	0.63
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI (EMIRATE OF) RegS 3.125 10/11/27	3.125	2027/10/11	0.58
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 4.975 04/20/55	4.975	2055/04/20	0.54

※国・地域は発行国基準です。

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」の公開情報およびホームページの情報を基に委託会社作成

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2016年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2016年10月12日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年11月29日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

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。

（二）申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨーク、ロンドンの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

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

原則として、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）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売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D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

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）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、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、委託会社の指定する口座を経由して、追加設定が行われる日に、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。

ご購入の販売会社にお申し出ください。

ただし、ニューヨーク、ロンドンの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までには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6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付を中止すること、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（借入れ公社債を除きます。）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、「みらいパレ」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	https://www.smd-am.co.jp

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】

2016年10月12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4月27日から翌年4月26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、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、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、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(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。

(二) 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違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- 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。

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無手数料で再投資され、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 信託約款の変更等

(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、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- (二) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(二)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

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。

ヘ 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無手数料で再投資され、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。

ニ 書面決議における議決権

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等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

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3期(平成30年4月27日から平成31年4月26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】

【イオン・バランス戦略ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (平成30年 4月26日現在)	第3期 (平成31年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	611,024
金銭信託	28,773,320	33,011,641
コール・ローン	4,379,986	10,664,655
投資信託受益証券	-	176,771,319
親投資信託受益証券	2,113,627,475	2,121,420,558
流動資産合計	2,146,780,781	2,342,479,197
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,164,804	3,893,898
未払受託者報酬	335,252	369,157
未払委託者報酬	9,498,682	10,459,435
未払利息	12	31
その他未払費用	69,243	75,641
流動負債合計	11,067,993	14,798,162
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	2,143,787,011	2,310,908,333
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	8,074,223	16,772,702
元本等合計	2,135,712,788	2,327,681,035
純資産合計		
	2,135,712,788	2,327,681,035
負債純資産合計		
	2,146,780,781	2,342,479,197

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26日	自	平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26日
営業収益				
受取配当金		258,494		1,707,659
受取利息		-		399
有価証券売買等損益		35,973,335		45,368,843
為替差損益		703,104		892,079
営業収益合計		35,011,737		47,968,980
営業費用				
支払利息		22,289		18,569
受託者報酬		576,366		724,871
委託者報酬		16,330,105		20,537,834
その他費用		146,252		199,612
営業費用合計		17,075,012		21,480,886
営業利益又は営業損失()		52,086,749		26,488,094
経常利益又は経常損失()		52,086,749		26,488,094
当期純利益又は当期純損失()		52,086,749		26,488,094
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()		994,791		165,729
期首剰余金又は期首欠損金()		17,671,289		8,074,223
剰余金増加額又は欠損金減少額		31,051,272		1,443,868
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,443,868
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		31,051,272		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,704,826		3,250,766
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,704,826		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,250,766
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		8,074,223		16,772,702

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第3期	
	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、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。 (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。 (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。 (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。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、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。	
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	第2期		第3期	
	（平成30年 4月26日現在）		（平成31年 4月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,143,787,011口		2,310,908,333口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	8,074,223円	元本の欠損	
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9962円	1口当たり純資産額	1.0073円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,962円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,073円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26日	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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（8,907,767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（15,967,910円）、および分配準備積立金（7,170,797円）より、分配対象収益は32,046,474円（1万口当たり149.47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（22,172,920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（21,303,147円）、および分配準備積立金（13,811,829円）より、分配対象収益は57,287,896円（1万口当たり247.88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3期
	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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、投資信託受益証券、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。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>

項目	第3期 自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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3期 (平成31年 4月26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（投資信託受益証券、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2期（自 平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26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	4,325,833円
合計	4,325,833円

第3期（自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,709,650円
親投資信託受益証券	42,238,490円
合計	43,948,140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3期 自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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2期 （平成30年 4月26日現在）	第3期 （平成31年 4月26日現在）
期首元本額	924,216,254円	2,143,787,011円
期中追加設定元本額	1,491,997,945円	510,495,142円
期中一部解約元本額	272,427,188円	343,373,820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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	14,420	1,580,432.00	
		米ドル 小計	14,420	1,580,432.00 (176,771,319)	
投資信託受益証券合計				176,771,319 (176,771,319)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	72,532,788	184,973,115	
		外国株式インデックス・マザーファンド	31,169,212	114,970,755	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	484,931,670	681,280,503	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	51,896,581	91,706,448	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	119,998,945	269,913,626	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	21,338,148	46,636,656	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	34,214,964	47,397,989	
		日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	575,099,947	684,541,466	
親投資信託受益証券合計			1,391,182,255	2,121,420,558	
合計				2,298,191,877 (176,771,319)	

(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	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	7.6%	100.0%

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

該当事項はありません。

(参考)

イオン・バランス戦略ファンドは、「日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・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」および「iシェアーズ」J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。ただし、前計算期間末時点において、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・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」および「iシェアーズ」J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」受益証券への投資は行っておりません。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,811,868,740	5,172,395,825
コール・ローン	732,481,267	1,670,980,804
国債証券	15,585,028,821	6,861,008,271
未収入金	10,087,400	152,458,500
未収利息	13,948,235	5,945,662
前払費用	4,392,337	3,337,142
流動資産合計	21,157,806,800	13,866,126,204
資産合計	21,157,806,800	13,866,126,204
負債の部		
流動負債		
未払金	402,409,000	123,622,800
未払利息	2,147	4,898
その他未払費用	484,449	328,687
流動負債合計	402,895,596	123,956,385
負債合計	402,895,596	123,956,385
純資産の部		
元本等		
元本	17,752,254,102	11,545,167,174
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,002,657,102	2,197,002,645
元本等合計	20,754,911,204	13,742,169,819
純資産合計	20,754,911,204	13,742,169,819
負債純資産合計	21,157,806,800	13,866,126,204

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 4月27日 至平成31年 4月26日
----	------------------------------

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>
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,752,254,102口	11,545,167,174口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1691円 (10,000口当たりの純資産額 11,691円)	1口当たり純資産額 1.1903円 (10,000口当たりの純資産額 11,903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 4月27日 至 平成31年 4月26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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

	<p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>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)

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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	25,280,140,338円
同期中における追加設定元本額	2,037,503,938円
同期中における一部解約元本額	9,565,390,174円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	908,442,463円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	10,815,591,075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>	1,700,068,966円
S M A M・日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家転売制限付少数人私募投信>	4,328,151,598円
合計	17,752,254,102円

(平成31年 4月26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	17,752,254,102円
同期中における追加設定元本額	1,861,949,897円
同期中における一部解約元本額	8,069,036,825円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	575,099,947円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	10,468,658,138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>	501,409,089円
合計	11,545,167,174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5回利付国債(40年)	48,100,000	68,564,145	
	第6回利付国債(40年)	50,000,000	70,172,500	
	第10回利付国債(40年)	20,000,000	21,953,000	
	第343回利付国債(10年)	60,000,000	61,123,200	
	第344回利付国債(10年)	110,000,000	112,049,300	
	第345回利付国債(10年)	170,000,000	173,209,600	
	第346回利付国債(10年)	50,000,000	50,954,500	
	第347回利付国債(10年)	70,000,000	71,320,900	
	第348回利付国債(10年)	110,000,000	112,046,000	
	第350回利付国債(10年)	260,000,000	264,651,400	
	第351回利付国債(10年)	130,000,000	132,271,100	
	第352回利付国債(10年)	380,000,000	386,273,800	
	第353回利付国債(10年)	400,000,000	406,388,000	
	第34回利付国債(30年)	5,000,000	6,865,050	
	第36回利付国債(30年)	200,000,000	268,168,000	
	第46回利付国債(30年)	20,000,000	24,923,600	
	第52回利付国債(30年)	80,000,000	79,807,200	
	第57回利付国債(30年)	320,000,000	342,748,800	
	第58回利付国債(30年)	410,000,000	438,814,800	
	第130回利付国債(20年)	40,000,000	48,577,600	
	第140回利付国債(20年)	6,200,000	7,513,966	
	第142回利付国債(20年)	172,000,000	211,152,360	
	第147回利付国債(20年)	205,000,000	247,707,650	
	第151回利付国債(20年)	350,000,000	403,935,000	
	第154回利付国債(20年)	460,000,000	531,658,800	
	第155回利付国債(20年)	90,000,000	101,094,300	
	第157回利付国債(20年)	200,000,000	197,870,000	

第159回利付国債(20年)	340,000,000	358,268,200	
第160回利付国債(20年)	820,000,000	877,859,200	
第163回利付国債(20年)	90,000,000	94,428,000	
第164回利付国債(20年)	320,000,000	329,660,800	
第167回利付国債(20年)	350,000,000	358,977,500	
合計	6,336,300,000	6,861,008,271	

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	(平成30年 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	259,230,603	50,359,494
金銭信託	289,835,875	415,258,078
コール・ローン	44,119,938	134,152,199
国債証券	51,785,032,676	29,078,480,015
派生商品評価勘定	7,988,825	41,355,593
未収入金	42,108,460	-
未収利息	405,046,658	230,974,541
前払費用	42,818,395	16,985,596
流動資産合計	52,876,181,430	29,967,565,516
資産合計		
	52,876,181,430	29,967,565,516
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,197,670,271	127,368,030
未払金	21,022,205	7,120,428
未払解約金	228,352,000	373,800,000
未払利息	129	393
その他未払費用	28,777	10,280
流動負債合計	1,447,073,382	508,299,131
負債合計		
	1,447,073,382	508,299,131
純資産の部		
元本等		
元本	37,484,650,129	20,968,888,985
剰余金		
剰余金又は欠損金()	13,944,457,919	8,490,377,400
元本等合計	51,429,108,048	29,459,266,385
純資産合計		
	51,429,108,048	29,459,266,385
負債純資産合計		
	52,876,181,430	29,967,565,516

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	37,484,650,129口	20,968,888,985口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3720円 (10,000口当たりの純資産額 13,720円)	1口当たり純資産額 1.4049円 (10,000口当たりの純資産額 14,049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 4月27日 至 平成31年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
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

リスク	<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 (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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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) 「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)

(平成30年 4月26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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	51,737,759,554	-	52,927,441,000	1,189,681,446
	米ドル	21,648,332,645	-	22,321,135,000	672,802,355
	カナダドル	1,069,728,530	-	1,107,600,000	37,871,470
	メキシコペソ	436,047,691	-	435,234,000	813,691
	ユーロ	21,840,931,906	-	22,194,447,000	353,515,094
	英ポンド	3,706,427,997	-	3,797,997,000	91,569,003
	スイスフラン	100,183,221	-	100,242,000	58,779
	スウェーデンクローナ	204,721,482	-	205,919,000	1,197,518
	ノルウェークローネ	159,931,772	-	162,014,000	2,082,228
	デンマーククローネ	312,419,014	-	318,264,000	5,844,986
	ポーランドズロチ	363,128,688	-	368,316,000	5,187,312
	オーストラリアドル	1,082,357,724	-	1,101,506,000	19,148,276
	シンガポールドル	461,229,750	-	469,623,000	8,393,250
	南アフリカランド	352,319,134	-	345,144,000	7,175,134
合計		51,737,759,554	-	52,927,441,000	1,189,681,446

(平成31年 4月26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
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437
	米ドル	13,705,195,380	-	13,824,746,000	119,550,620
	カナダドル	564,236,800	-	563,312,000	924,800
	メキシコペソ	245,669,510	-	252,439,000	6,769,490
	ユーロ	11,360,099,278	-	11,331,018,000	29,081,278
	英ポンド	1,977,945,825	-	1,973,759,000	4,186,825
	スウェーデンク ローナ	106,512,530	-	104,219,000	2,293,530
	ノルウェークロー ネ	73,408,590	-	73,302,000	106,590
	デンマーククロー ネ	152,034,610	-	151,606,000	428,610
	ポーランドズロチ	190,955,820	-	191,004,000	48,180
	オーストラリアド ル	622,982,500	-	618,649,000	4,333,500
	シンガポールドル	253,660,600	-	253,952,000	291,400
	南アフリカランド	165,396,120	-	166,104,000	707,880
合計	29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437	

（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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	43,677,470,657円
同期中における追加設定元本額	11,173,000,491円
同期中における一部解約元本額	17,365,821,019円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	11,612,319,177円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	5,981,900,100円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,690,389,470円
イオン・バランス戦略ファンド	766,448,537円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	6,850,648円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	9,701,314円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	26,352,404円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,648,237円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,366,728円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,171,544円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,344,760,836円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	111,614,838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)	5,043,404,425円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,597,379,498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>	92,798,295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>	866,441,504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>	415,238,172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>	901,864,402円
合計	37,484,650,129円

(平成31年 4月26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	37,484,650,129円
同期中における追加設定元本額	4,051,374,366円
同期中における一部解約元本額	20,567,135,510円

平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,528,795,593円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,212,263,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	30,628,517円
イオン・バランス戦略ファンド	484,931,670円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	405,127,343円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	119,950,191円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	175,969,660円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,277,400円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,715,362円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,505,272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>	5,306,637,177円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	2,816,640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)	2,862,382,122円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,845,668,421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>	80,321,679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>	699,835,651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>	335,294,032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>	825,768,924円
合計	20,968,888,985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	494,101.56	
		US TREASURY N/B 1.125	600,000.00	592,265.62	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	977,968.75	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	682,554.69	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	973,750.00	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	972,734.38	
		US TREASURY N/B 1.125	400,000.00	388,968.75	
		US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	489,765.62	
		US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	973,984.38	
		US TREASURY N/B 1.375	700,000.00	693,000.00	
		US TREASURY N/B 1.375	900,000.00	889,593.75	

US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,479,843.75
US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,084,531.25
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	985,078.13
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	982,890.63
US TREASURY N/B 1.375	400,000.00	392,375.00
US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,058,406.25
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	960,625.00
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	960,156.25
US TREASURY N/B 1.5	1,700,000.00	1,683,132.82
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	586,921.87
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	484,765.62
US TREASURY N/B 1.5	1,400,000.00	1,311,625.00
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	792,500.00
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,485,234.37
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,185,937.50
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	782,687.50
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	973,515.63
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	972,812.50
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,163,812.49
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,710,000.00
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	568,453.12
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	693,601.56
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	196,921.87
US TREASURY N/B 1.75	400,000.00	393,468.75
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	590,203.12
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	688,242.19
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	981,562.50
US TREASURY N/B 1.75	1,100,000.00	1,075,593.75
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	496,875.00
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	593,531.25
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	691,796.87
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	988,046.88
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	988,281.25
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	987,343.75
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	986,015.63
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	292,804.68
US TREASURY N/B 2	500,000.00	497,382.81
US TREASURY N/B 2	500,000.00	497,304.69
US TREASURY N/B 2	400,000.00	397,750.00
US TREASURY N/B 2	600,000.00	596,062.50
US TREASURY N/B 2	800,000.00	794,187.50
US TREASURY N/B 2	900,000.00	893,179.68

US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	992,656.25
US TREASURY N/B 2	600,000.00	595,265.62
US TREASURY N/B 2	700,000.00	693,218.75
US TREASURY N/B 2	1,300,000.00	1,286,390.62
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,186,218.75
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	983,828.13
US TREASURY N/B 2	800,000.00	787,000.00
US TREASURY N/B 2	600,000.00	589,828.12
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	498,203.12
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	497,890.62
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	796,687.50
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	995,781.25
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	398,187.50
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	695,953.12
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	993,359.38
US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,475,390.62
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	984,296.88
US TREASURY N/B 2.25	400,000.00	399,187.50
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	598,875.00
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	499,140.62
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	996,328.13
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	996,093.75
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	795,375.00
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	893,882.81
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	496,757.81
US TREASURY N/B 2.25	1,100,000.00	1,088,742.19
US TREASURY N/B 2.25	1,200,000.00	1,181,437.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	883,476.56
US TREASURY N/B 2.25	1,200,000.00	1,176,468.75
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	695,625.00
US TREASURY N/B 2.375	2,100,000.00	2,100,328.12
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,000,390.63
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	500,234.37
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	400,937.50
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,000,937.50
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,191,375.00
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	906,328.12
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,007,656.25
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,006,484.38
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	903,937.50
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	918,046.88
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	825,398.44
US TREASURY N/B 2.625	1,400,000.00	1,403,609.38

US TREASURY N/B 2.625	700,000.00	704,484.37
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	504,140.62
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	506,445.31
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	404,875.00
US TREASURY N/B 2.625	950,000.00	957,347.65
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	915,539.06
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,526,953.12
US TREASURY N/B 2.75	1,100,000.00	1,121,914.06
US TREASURY N/B 2.75	800,000.00	815,812.50
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	713,781.25
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	509,453.12
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	584,671.87
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	389,187.50
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	673,203.12
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	864,843.75
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	709,570.31
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	921,585.94
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	821,437.50
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	616,031.25
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,440,359.38
US TREASURY N/B 2.875	1,700,000.00	1,749,007.82
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	992,890.63
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	197,843.75
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	889,312.50
US TREASURY N/B 3	400,000.00	413,812.50
US TREASURY N/B 3	400,000.00	407,062.50
US TREASURY N/B 3	900,000.00	911,742.19
US TREASURY N/B 3	900,000.00	911,742.19
US TREASURY N/B 3	700,000.00	708,804.69
US TREASURY N/B 3	800,000.00	809,062.50
US TREASURY N/B 3	800,000.00	807,562.50
US TREASURY N/B 3	400,000.00	403,812.50
US TREASURY N/B 3	250,000.00	252,558.59
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	812,562.50
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	315,023.43
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	312,164.06
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	311,742.18
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	414,843.75
US TREASURY N/B 3.125	500,000.00	517,578.12
US TREASURY N/B 3.375	1,300,000.00	1,411,007.81
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	808,875.00
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	333,140.62

	US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,226,625.00
	US TREASURY N/B 3.625	900,000.00	1,012,148.44
	US TREASURY N/B 3.75	250,000.00	286,367.18
	US TREASURY N/B 3.75	100,000.00	114,671.87
	US TREASURY N/B 3.875	400,000.00	466,656.25
	US TREASURY N/B 4.25	100,000.00	122,593.75
	US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	491,218.75
	US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	248,312.50
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	373,921.87
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	374,718.75
	US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	124,398.43
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	252,296.87
	US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	379,734.37
	US TREASURY N/B 4.625	300,000.00	386,039.06
	US TREASURY N/B 5	200,000.00	265,437.50
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	245,859.37
	US TREASURY N/B 5.25	100,000.00	123,437.50
	US TREASURY N/B 5.375	200,000.00	256,703.12
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	579,882.81
	US TREASURY N/B 6.25	200,000.00	270,656.25
	US TREASURY N/B 6.5	300,000.00	382,945.31
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	341,859.37
	米ドル 小計	121,750,000.00	122,091,632.66 (13,655,949,113)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	700,000.00	679,630.00
	CANADA-GOV'T 0.75	200,000.00	197,572.00
	CANADA-GOV'T 0.75	600,000.00	591,509.40
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	294,390.00
	CANADA-GOV'T 1	300,000.00	284,754.00
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	399,268.00
	CANADA-GOV'T 1.5	200,000.00	198,200.00
	CANADA-GOV'T 2	100,000.00	102,626.00
	CANADA-GOV'T 2.25	150,000.00	155,713.50
	CANADA-GOV'T 2.25	100,000.00	105,040.00
	CANADA-GOV'T 2.5	400,000.00	418,568.00
	CANADA-GOV'T 2.75	800,000.00	829,680.00
	CANADA-GOV'T 2.75	250,000.00	292,000.00
	CANADA-GOV'T 3.25	300,000.00	310,422.00
	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	305,859.00
	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	391,980.00
	CANADA-GOV'T 4	300,000.00	406,812.00
	CANADA-GOV'T 5	300,000.00	439,293.00
	CANADA-GOV'T 5.75	100,000.00	137,093.00

	CANADA-GOV'T 5.75	100,000.00	148,443.00
カナダドル 小計		6,200,000.00	6,688,852.90 (554,840,348)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	4,500,000.00	4,914,360.00
	MEXICAN BONOS 5.75	2,000,000.00	1,759,060.00
	MEXICAN BONOS 6.5	6,000,000.00	5,829,780.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,839,360.00
	MEXICAN BONOS 7.5	1,500,000.00	1,445,175.00
	MEXICAN BONOS 7.75	2,000,000.00	1,916,000.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	942,050.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	5,515,980.00
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,003,100.00
	MEXICAN BONOS 8	5,500,000.00	5,509,185.00
	MEXICAN BONOS 8.5	1,000,000.00	1,022,120.00
	MEXICAN BONOS 8.5	4,000,000.00	3,990,160.00
	メキシコペソ 小計		42,500,000.00
ユーロ	BELGIAN 0.8	400,000.00	421,036.00
	BELGIAN 0.8	300,000.00	313,857.00
	BELGIAN 0.8	200,000.00	208,088.00
	BELGIAN 0304 5	250,000.00	399,290.00
	BELGIAN 0308 4	300,000.00	339,447.00
	BELGIAN 0318 3.75	300,000.00	318,330.00
	BELGIAN 0320 4.25	400,000.00	628,536.00
	BELGIAN 0321 4.25	200,000.00	223,238.00
	BELGIAN 0324 4.5	300,000.00	392,805.00
	BELGIAN 0328 2.25	500,000.00	554,765.00
	BELGIAN 0332 2.6	400,000.00	458,048.00
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	103,543.00
	BELGIAN 1	400,000.00	426,176.00
	BELGIAN 1.9	100,000.00	112,529.00
	BELGIAN 2.15	200,000.00	221,320.00
	BELGIAN 3.75	400,000.00	608,096.00
	BTPS 0.35	400,000.00	395,192.00
	BTPS 0.45	500,000.00	497,995.00
	BTPS 0.65	200,000.00	200,828.00
	BTPS 0.65	300,000.00	289,008.00
	BTPS 0.95	600,000.00	590,286.00
	BTPS 1.25	500,000.00	469,415.00
	BTPS 1.35	600,000.00	604,182.00
BTPS 1.45	200,000.00	201,492.00	
BTPS 1.45	300,000.00	293,424.00	

BTPS 1.5	800,000.00	778,000.00
BTPS 1.6	400,000.00	386,560.00
BTPS 1.65	600,000.00	526,236.00
BTPS 1.85	300,000.00	301,512.00
BTPS 2.05	600,000.00	587,208.00
BTPS 2.2	400,000.00	396,936.00
BTPS 2.3	300,000.00	310,275.00
BTPS 2.45	300,000.00	282,876.00
BTPS 2.5	600,000.00	619,428.00
BTPS 2.7	200,000.00	176,288.00
BTPS 2.8	200,000.00	167,648.00
BTPS 3.45	300,000.00	298,677.00
BTPS 3.75	700,000.00	740,936.00
BTPS 3.75	400,000.00	424,604.00
BTPS 3.75	800,000.00	852,888.00
BTPS 3.75	400,000.00	438,004.00
BTPS 4	700,000.00	734,482.00
BTPS 4	900,000.00	999,405.00
BTPS 4.5	200,000.00	229,974.00
BTPS 4.75	300,000.00	327,048.00
BTPS 4.75	700,000.00	793,205.00
BTPS 4.75	500,000.00	595,940.00
BTPS 4.75	200,000.00	241,422.00
BTPS 5	200,000.00	221,960.00
BTPS 5	400,000.00	492,740.00
BTPS 5	400,000.00	495,304.00
BTPS 5	200,000.00	246,378.00
BTPS 5.25	700,000.00	863,723.00
BTPS 5.5	600,000.00	685,962.00
BTPS 5.75	400,000.00	522,844.00
BTPS 6	400,000.00	527,876.00
BTPS 6.5	800,000.00	1,051,480.00
BTPS 9	550,000.00	726,940.50
BUNDESÖBL-171 0	300,000.00	301,683.00
BUNDESÖBL-174 0	200,000.00	202,942.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	100,000.00	103,673.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	600,000.00	617,478.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	400,000.00	420,812.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	200,000.00	211,212.00
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	322,911.00
DEUTSCHLAND REP 1	700,000.00	760,116.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	100,000.00	116,236.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	428,076.00

DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	647,076.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	300,000.00	324,843.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	659,586.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	400,000.00	429,996.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	110,775.00	
DEUTSCHLAND REP 2	700,000.00	749,322.00	
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	221,816.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	400,000.00	415,504.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	200,000.00	213,510.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	526,915.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	726,150.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	737,990.00	
DEUTSCHLAND REP 3	500,000.00	521,375.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	100,000.00	108,466.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	640,272.00	
DEUTSCHLAND REP 4	300,000.00	487,737.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	400,000.00	748,116.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	600,000.00	982,872.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	617,943.80	
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	263,650.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	334,742.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	500,000.00	776,905.00	
FINNISH GOV'T 0.75	100,000.00	103,544.00	
FINNISH GOV'T 0.875	300,000.00	319,551.00	
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	107,502.00	
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	322,785.00	
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	107,087.00	
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	222,972.00	
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	139,078.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	123,554.00	
FRANCE O.A.T. 0	800,000.00	804,744.00	
FRANCE O.A.T. 0	500,000.00	505,015.00	
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	707,819.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	202,814.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	500,000.00	506,400.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	200,000.00	202,898.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	500,000.00	518,905.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	400,000.00	414,252.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	800,000.00	835,784.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	300,000.00	312,441.00	
FRANCE O.A.T. 1	300,000.00	321,168.00	
FRANCE O.A.T. 1	800,000.00	856,024.00	

FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	319,611.00
FRANCE O.A.T. 1.25	600,000.00	630,930.00
FRANCE O.A.T. 1.5	900,000.00	999,171.00
FRANCE O.A.T. 1.75	1,600,000.00	1,738,736.00
FRANCE O.A.T. 1.75	400,000.00	449,876.00
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	207,024.00
FRANCE O.A.T. 2.25	700,000.00	765,688.00
FRANCE O.A.T. 2.25	800,000.00	902,112.00
FRANCE O.A.T. 2.5	500,000.00	522,920.00
FRANCE O.A.T. 2.5	800,000.00	976,528.00
FRANCE O.A.T. 2.75	800,000.00	976,752.00
FRANCE O.A.T. 3	600,000.00	662,598.00
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	437,952.00
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	576,208.00
FRANCE O.A.T. 3.5	500,000.00	520,130.00
FRANCE O.A.T. 3.5	400,000.00	499,832.00
FRANCE O.A.T. 3.75	200,000.00	217,200.00
FRANCE O.A.T. 4	200,000.00	339,308.00
FRANCE O.A.T. 4	400,000.00	696,608.00
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	724,758.00
FRANCE O.A.T. 4.5	400,000.00	667,140.00
FRANCE O.A.T. 4.75	600,000.00	957,846.00
FRANCE O.A.T. 5.5	200,000.00	302,452.00
FRANCE O.A.T. 5.75	700,000.00	1,165,864.00
FRANCE O.A.T. 6	600,000.00	837,552.00
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	271,502.00
IRISH GOVT 0.8	100,000.00	103,404.00
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	108,606.00
IRISH GOVT 2	300,000.00	339,957.00
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	234,866.00
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	232,960.00
IRISH GOVT 4.5	300,000.00	314,610.00
IRISH GOVT 5	600,000.00	648,918.00
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	395,043.00
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	304,443.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	412,140.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	600,000.00	628,002.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	300,000.00	319,083.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	106,250.00
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	448,968.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	100,000.00	109,017.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	200,000.00	304,418.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	400,000.00	434,372.00

NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	231,996.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	334,136.00	
NETHERLANDS GOVT 4	300,000.00	479,187.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	592,900.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	100,000.00	103,412.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	400,000.00	420,080.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	434,956.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	220,364.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	300,000.00	331,332.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	300,000.00	328,686.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	200,000.00	296,968.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	227,618.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	219,406.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	186,135.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	300,000.00	316,200.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	200,000.00	313,728.00	
SPANISH GOV'T 0.05	400,000.00	402,300.00	
SPANISH GOV'T 0.4	100,000.00	101,720.00	
SPANISH GOV'T 0.45	700,000.00	713,741.00	
SPANISH GOV'T 0.75	500,000.00	511,515.00	
SPANISH GOV'T 1.15	200,000.00	203,778.00	
SPANISH GOV'T 1.3	400,000.00	418,488.00	
SPANISH GOV'T 1.4	200,000.00	207,496.00	
SPANISH GOV'T 1.45	400,000.00	419,908.00	
SPANISH GOV'T 1.5	300,000.00	316,707.00	
SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	321,888.00	
SPANISH GOV'T 2.35	400,000.00	440,924.00	
SPANISH GOV'T 2.7	100,000.00	109,828.00	
SPANISH GOV'T 2.75	800,000.00	908,360.00	
SPANISH GOV'T 2.9	300,000.00	344,922.00	
SPANISH GOV'T 3.45	100,000.00	124,087.00	
SPANISH GOV'T 3.8	200,000.00	236,008.00	
SPANISH GOV'T 4	100,000.00	104,403.00	
SPANISH GOV'T 4.2	370,000.00	510,185.60	
SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	315,177.50	
SPANISH GOV'T 4.7	200,000.00	298,442.00	
SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	610,690.00	
SPANISH GOV'T 4.85	200,000.00	215,686.00	
SPANISH GOV'T 4.9	400,000.00	608,220.00	
SPANISH GOV'T 5.15	700,000.00	964,152.00	
SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	320,488.00	
SPANISH GOV'T 5.4	500,000.00	602,650.00	

	SPANISH GOV'T 5.5	200,000.00	223,168.00
	SPANISH GOV'T 5.75	800,000.00	1,223,312.00
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	700,302.00
	SPANISH GOV'T 6	500,000.00	732,730.00
	ユーロ 小計	76,830,000.00	89,740,458.40 (11,161,918,215)
英bond	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	495,925.00
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	199,410.00
	UK TSY GILT 1.25	300,000.00	304,680.00
	UK TSY GILT 1.5	650,000.00	658,580.00
	UK TSY GILT 1.5	400,000.00	415,052.00
	UK TSY GILT 1.5	350,000.00	335,912.50
	UK TSY GILT 1.625	350,000.00	364,766.50
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	309,750.00
	UK TSY GILT 1.75	200,000.00	204,384.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	313,578.00
	UK TSY GILT 2	250,000.00	266,992.50
	UK TSY GILT 2.25	500,000.00	530,695.00
	UK TSY GILT 2.5	300,000.00	392,052.00
	UK TSY GILT 2.75	400,000.00	439,508.00
	UK TSY GILT 3.25	300,000.00	394,632.00
	UK TSY GILT 3.5	150,000.00	206,637.00
	UK TSY GILT 3.5	400,000.00	664,848.00
	UK TSY GILT 3.75	400,000.00	416,376.00
	UK TSY GILT 3.75	250,000.00	267,752.50
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	773,040.00
	UK TSY GILT 4	300,000.00	517,770.00
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	379,404.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	268,986.00
	UK TSY GILT 4.25	800,000.00	1,122,272.00
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	442,572.00
	UK TSY GILT 4.25	100,000.00	156,528.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	324,178.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	346,534.00
	UK TSY GILT 4.5	150,000.00	212,232.00
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	310,976.00
	UK TSY GILT 4.75	300,000.00	413,025.00
	UK TSY GILT 4.75	200,000.00	306,500.00
	UK TSY GILT 5	150,000.00	185,133.00
	UK TSY GILT 8	300,000.00	346,017.00
	英bond 小計	10,700,000.00	13,286,698.00 (1,915,410,383)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRMNT 0.75	1,100,000.00	1,158,179.00

	SWEDISH GOVRNMNT 1	700,000.00	750,883.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	900,000.00	974,151.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	400,000.00	463,552.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	2,000,000.00	2,243,660.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	900,000.00	1,348,947.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	1,700,000.00	1,850,620.00
スウェーデンクローナ 小計		7,700,000.00	8,789,992.00 (102,930,806)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,300,000.00	1,291,420.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,011,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	1,300,000.00	1,328,535.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	300,000.00	307,350.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	600,000.00	642,480.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	1,000,000.00	1,048,700.00
ノルウェークローネ 小計		5,500,000.00	5,630,085.00 (72,515,494)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	100,000.00	105,200.00
	DENMARK - BULLET 1.5	800,000.00	871,440.00
	DENMARK - BULLET 1.75	800,000.00	907,680.00
	DENMARK - BULLET 3	1,900,000.00	2,075,940.00
	DENMARK - BULLET 4.5	2,100,000.00	3,785,670.00
	DENMARK - BULLET 7	820,000.00	1,159,480.00
デンマーククローネ 小計		6,520,000.00	8,905,410.00 (148,364,130)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	700,000.00	701,540.00
	POLAND GOVT BOND 2	700,000.00	703,850.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	900,000.00	891,990.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	600,000.00	589,200.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	900,000.00	936,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	500,000.00	533,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	800,000.00	878,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	900,000.00	1,013,499.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	100,000.00	125,292.00
ポーランドズロチ 小計		6,100,000.00	6,372,871.00 (184,685,801)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	600,000.00	603,318.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	400,000.00	407,280.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	500,000.00	520,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	426,354.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	600,000.00	648,900.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	600,000.00	650,844.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	100,000.00	109,370.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	223,154.00

	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	400,000.00	440,160.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	500,000.00	566,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	232,420.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	371,691.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	400,000.00	470,120.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	300,000.00	393,480.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	600,000.00	697,140.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	600,000.00	653,130.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	400,000.00	455,900.00	
	オーストラリアドル 小計	7,100,000.00	7,870,211.80 (617,103,307)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	400,000.00	393,960.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.125	300,000.00	301,080.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.25	300,000.00	302,250.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	309,570.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	103,950.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	207,442.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	425,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	400,000.00	420,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	300,000.00	311,640.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	200,000.00	225,492.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	100,000.00	110,150.00	
	シンガポールドル 小計	3,000,000.00	3,110,934.00 (255,221,025)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	12,500,000.00	8,793,750.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	9,000,000.00	7,530,300.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.75	5,000,000.00	5,001,000.00	
	南アフリカランド 小計	26,500,000.00	21,325,050.00 (164,842,636)	
	合計		29,078,480,015 (29,078,480,015)	

(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 160銘柄	46.4%	47.0%
カナダドル	国債証券 20銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 199銘柄	37.9%	38.4%
英ポンド	国債証券 34銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.3%	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	9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	17銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	11銘柄	0.9%	0.9%
南アフリカランド	国債証券	3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

「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 4月26日現在）	（平成31年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,454,346,918	1,409,744,393
コール・ローン	221,386,312	455,428,374
株式	179,158,324,620	172,267,269,170
派生商品評価勘定	106,239,600	17,550,320
未収入金	2,416,189,377	263,476,160
未収配当金	1,671,275,900	1,934,662,457
流動資産合計	185,027,762,727	176,348,130,874
資産合計		
185,027,762,727		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	714,840
前受金	106,380,000	17,045,000
未払金	392,589,700	442,124,980
未払解約金	438,216,960	412,800,909
未払利息	648	1,335
その他未払費用	216,792	110,085
流動負債合計	937,404,100	872,797,149
負債合計		
937,404,100		
純資産の部		
元本等		
元本	67,579,087,442	68,808,381,443
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	116,511,271,185	106,666,952,282
元本等合計	184,090,358,627	175,475,333,725
純資産合計		
184,090,358,627		
負債純資産合計		
185,027,762,727		

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,867,600,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,762,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,579,087,442口	68,808,381,443口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.7241円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,241円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.5502円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 25,502円)</p>

(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 4月27日 至 平成31年 4月26日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
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

リスク	<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 (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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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)

(平成30年 4月26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	4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600
	東証株価指数先物	4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600
合計		4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600

(平成31年 4月26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	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
	東証株価指数先物	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
合計		3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480

(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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	88,558,263,766円
同期中における追加設定元本額	9,688,625,992円
同期中における一部解約元本額	30,667,802,316円
平成30年 4月26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	10,000,363,906円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	656,170,114円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,169,289,242円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,344,599,102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）	98,967,258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）	6,694,581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）	22,118,808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）	54,658,747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）	66,139,864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）	37,344,477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）	102,465,695円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,621,512,742円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	4,934,985,885円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	496,212,971円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	726,003,004円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	720,204,682円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,154,910円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	312,825円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	1,613,667円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	11,322,900円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	11,768,701円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	44,737,280円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,302,624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）	6,957,446,229円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	30,109,855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＞	1,987,099,738円
S M A M ・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,897,902,109円
S M A M ・バランスファンドVA37.5＜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 >	9,494,460,725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 >	57,836,559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 >	229,663,802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 >	1,265,342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 >	1,036,963,093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 >	56,979,338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 >	390,180,737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 >	1,122,612,897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 >	1,151,955,345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 >	3,286,550,963円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	57,101,087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)	1,486,536,936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 >	70,337,724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 >	113,704,142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 >	111,559,736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 >	47,156,820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 >	22,080,403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 >	228,097,979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 >	409,768,676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 >	168,669,491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 >	122,157,944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 >	59,438,718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 >	11,086,429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 >	78,683,152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 >	1,016,895,360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)	198,971,078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 >	21,028,969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 >	1,787,366,166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 >	1,738,315,243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 >	293,505,531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 >	7,252,033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 >	70,808,588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 >	33,953,240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 >	72,401,416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 >	8,189円
合計	67,579,087,442円

(平成31年 4月26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	67,579,087,442円
--------------------------------	-----------------

同期中における追加設定元本額	14,060,784,008円
同期中における一部解約元本額	12,831,490,007円
平成31年 4月26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	10,172,824,380円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	830,155,477円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,969,466,510円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,853,749,898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)	120,162,198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)	6,965,080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)	23,612,948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)	60,915,863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)	92,315,517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)	58,012,897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)	140,545,819円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,825,003,426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	9,109,742,427円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,115,979,600円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,063,599,557円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,001,707,943円
イオン・バランス戦略ファンド	72,532,788円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,361,956円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	20,652,117円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	23,010,329円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,832,051円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	47,010,703円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,649,500円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	8,358,236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)	5,361,347,730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>	26,386,178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>	3,414,383,364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>	2,479,883,434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>	9,233,009,781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>	59,588,186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>	223,472,980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>	796,449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>	942,907,444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>	57,187,516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>	382,097,522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>	1,109,499,058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>	964,779,994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>	3,101,038,753円
S M A M・バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	1,573,523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)	880,282,695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>	65,177,660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>	41,425,659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)	1,045,609,939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>	107,829,530円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	48,426,618円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,746,684円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	208,991,050円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	391,095,028円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	162,209,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	119,503,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	62,251,723円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,591,895円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	77,314,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	945,660,284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）	204,123,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,958,549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>	1,618,468,794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>	224,746,577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
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	133,073,322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>	11,331,622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>	118,884,555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>	56,899,955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>	140,273,790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>	148,327,141円
合計	68,808,381,443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	2,761.00	9,663,500	
日本水産	100,400	777.00	78,010,800	
マルハニチロ	14,400	3,520.00	50,688,000	
カネコ種苗	4,000	1,352.00	5,408,000	
サカタのタネ	12,100	3,535.00	42,773,500	
ホクト	8,100	1,914.00	15,503,400	
日鉄鉱業	2,400	4,270.00	10,248,000	
三井松島ホールディングス	5,300	1,270.00	6,731,000	
国際石油開発帝石	404,500	1,081.00	437,264,500	
石油資源開発	14,200	2,417.00	34,321,400	
K&Oエナジーグループ	5,100	1,612.00	8,221,200	

ヒノキヤグループ	2,700	2,268.00	6,123,600
ショーボンドホールディングス	7,200	7,640.00	55,008,000
ミライト・ホールディングス	28,400	1,631.00	46,320,400
タマホーム	7,200	1,095.00	7,884,000
ベステラ	2,700	1,338.00	3,612,600
T A T E R U	14,000	265.00	3,710,000
スペースバリューホールディングス	13,800	605.00	8,349,000
安藤・間	64,300	747.00	48,032,100
東急建設	29,100	799.00	23,250,900
コムシスホールディングス	35,600	2,917.00	103,845,200
ミサワホーム	9,700	779.00	7,556,300
ビーアールホールディングス	11,500	319.00	3,668,500
高松コンストラクショングループ	6,300	2,392.00	15,069,600
東建コーポレーション	3,100	6,780.00	21,018,000
大成建設	82,800	4,875.00	403,650,000
大林組	249,800	1,089.00	272,032,200
清水建設	253,800	949.00	240,856,200
飛鳥建設	8,200	1,419.00	11,635,800
長谷工コーポレーション	103,600	1,341.00	138,927,600
松井建設	11,200	704.00	7,884,800
銭高組	1,300	5,330.00	6,929,000
鹿島建設	194,600	1,645.00	320,117,000
不動テトラ	7,000	1,525.00	10,675,000
大末建設	5,400	927.00	5,005,800
鉄建建設	5,400	2,902.00	15,670,800
西松建設	18,600	2,405.00	44,733,000
三井住友建設	61,500	724.00	44,526,000
大豊建設	5,800	2,980.00	17,284,000
前田建設工業	60,300	1,102.00	66,450,600
奥村組	14,300	3,590.00	51,337,000
東鉄工業	10,000	3,255.00	32,550,000
浅沼組	3,300	2,464.00	8,131,200
戸田建設	97,100	685.00	66,513,500
熊谷組	11,800	3,255.00	38,409,000
北野建設	2,300	3,015.00	6,934,500
矢作建設工業	13,900	779.00	10,828,100
ピーエス三菱	11,100	654.00	7,259,400
日本ハウスホールディングス	20,000	454.00	9,080,000
大東建託	29,700	14,865.00	441,490,500
新日本建設	10,800	953.00	10,292,400
N I P P O	22,200	2,256.00	50,083,200
東亜道路工業	2,300	2,848.00	6,550,400

前田道路	26,100	2,200.00	57,420,000
日本道路	2,400	6,400.00	15,360,000
東亜建設工業	8,300	1,602.00	13,296,600
日本国土開発	13,000	751.00	9,763,000
若築建設	5,800	1,427.00	8,276,600
東洋建設	32,900	408.00	13,423,200
五洋建設	100,700	509.00	51,256,300
世紀東急工業	15,400	567.00	8,731,800
福田組	3,100	4,390.00	13,609,000
住友林業	58,600	1,527.00	89,482,200
巴コーポレーション	16,600	358.00	5,942,800
大和ハウス工業	230,100	3,111.00	715,841,100
ライト工業	16,300	1,431.00	23,325,300
積水ハウス	254,200	1,792.00	455,526,400
日特建設	9,500	568.00	5,396,000
ユアテック	14,300	783.00	11,196,900
中電工	10,800	2,271.00	24,526,800
関電工	37,800	935.00	35,343,000
きんでん	55,200	1,783.00	98,421,600
東京エネシス	9,400	959.00	9,014,600
トーエネック	2,900	3,080.00	8,932,000
住友電設	6,200	1,903.00	11,798,600
日本電設工業	14,100	2,394.00	33,755,400
協和エクシオ	32,500	3,030.00	98,475,000
新日本空調	7,500	1,788.00	13,410,000
九電工	16,300	3,160.00	51,508,000
三機工業	18,800	1,214.00	22,823,200
日揮	72,100	1,588.00	114,494,800
中外炉工業	3,200	1,857.00	5,942,400
ヤマト	10,600	520.00	5,512,000
太平電業	5,800	2,451.00	14,215,800
高砂熱学工業	21,100	1,758.00	37,093,800
朝日工業社	2,300	3,025.00	6,957,500
明星工業	16,600	745.00	12,367,000
大気社	11,400	3,355.00	38,247,000
ダイダン	5,900	2,467.00	14,555,300
日比谷総合設備	8,200	1,857.00	15,227,400
東芝プラントシステム	17,800	1,992.00	35,457,600
O S J Bホールディングス	41,700	265.00	11,050,500
新興プランテック	15,500	1,161.00	17,995,500
日本製粉	24,400	1,875.00	45,750,000
日清製粉グループ本社	83,400	2,584.00	215,505,600

日東富士製粉	800	6,190.00	4,952,000
昭和産業	6,800	3,010.00	20,468,000
鳥越製粉	9,100	767.00	6,979,700
中部飼料	9,200	1,229.00	11,306,800
フィード・ワン	52,400	171.00	8,960,400
日本甜菜製糖	5,300	1,869.00	9,905,700
三井製糖	5,500	2,682.00	14,751,000
日新製糖	3,800	1,972.00	7,493,600
森永製菓	18,600	4,625.00	86,025,000
中村屋	2,500	4,380.00	10,950,000
江崎グリコ	22,400	5,860.00	131,264,000
名糖産業	3,400	1,449.00	4,926,600
井村屋グループ	3,600	2,444.00	8,798,400
不二家	4,500	2,067.00	9,301,500
山崎製パン	60,900	1,652.00	100,606,800
モロゾフ	1,600	5,100.00	8,160,000
亀田製菓	4,500	5,220.00	23,490,000
寿スピリッツ	7,800	4,985.00	38,883,000
カルビー	33,900	3,060.00	103,734,000
森永乳業	15,000	3,665.00	54,975,000
六甲バター	5,700	2,156.00	12,289,200
ヤクルト本社	55,100	7,550.00	416,005,000
明治ホールディングス	52,700	8,750.00	461,125,000
雪印メグミルク	17,900	2,453.00	43,908,700
プリマハム	10,000	2,034.00	20,340,000
日本ハム	31,200	4,470.00	139,464,000
丸大食品	8,000	1,943.00	15,544,000
S Foods	6,700	3,830.00	25,661,000
伊藤ハム米久ホールディングス	46,800	693.00	32,432,400
サッポロホールディングス	27,300	2,272.00	62,025,600
アサヒグループホールディングス	155,900	4,829.00	752,841,100
キリンホールディングス	336,800	2,519.50	848,567,600
宝ホールディングス	56,200	1,294.00	72,722,800
オエノンホールディングス	24,800	399.00	9,895,200
養命酒製造	3,200	2,126.00	6,803,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	57,100	2,737.00	156,282,700
サントリー食品インターナショナル	49,700	4,900.00	243,530,000
ダイトーグループホールディングス	4,000	4,960.00	19,840,000
伊藤園	22,600	5,530.00	124,978,000
キーコーヒー	7,200	2,094.00	15,076,800
日清オイリオグループ	9,300	3,175.00	29,527,500
不二製油グループ本社	18,100	3,565.00	64,526,500

かどや製油	1,000	5,000.00	5,000,000	
J - オイルミルズ	3,700	3,980.00	14,726,000	
キッコーマン	49,000	5,160.00	252,840,000	
味の素	164,500	1,792.50	294,866,250	
キューピー	41,400	2,566.00	106,232,400	
ハウス食品グループ本社	28,300	4,470.00	126,501,000	
カゴメ	29,600	3,025.00	89,540,000	
焼津水産化学工業	5,700	1,113.00	6,344,100	
アリアケジャパン	6,800	6,460.00	43,928,000	
ニチレイ	38,600	2,562.00	98,893,200	
東洋水産	38,200	4,235.00	161,777,000	
イトアンド	3,800	1,639.00	6,228,200	
日清食品ホールディングス	31,600	7,330.00	231,628,000	
永谷園ホールディングス	4,600	2,242.00	10,313,200	
一正蒲鉾	3,900	1,163.00	4,535,700	
フジッコ	8,000	2,194.00	17,552,000	
ロック・フィールド	8,000	1,591.00	12,728,000	
日本たばこ産業	430,100	2,576.00	1,107,937,600	
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,268.00	10,659,600	
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,784.00	9,098,400	
なとり	5,500	1,676.00	9,218,000	
ピクルスコーポレーション	2,300	2,065.00	4,749,500	
北の達人コーポレーション	30,000	530.00	15,900,000	
ユーグレナ	31,100	761.00	23,667,100	
ミヨシ油脂	4,300	1,175.00	5,052,500	
理研ビタミン	3,600	3,650.00	13,140,000	
片倉工業	10,000	1,281.00	12,810,000	
ゲンゼ	5,000	4,730.00	23,650,000	
東洋紡	31,700	1,451.00	45,996,700	
ユニチカ	25,300	441.00	11,157,300	
富士紡ホールディングス	4,300	2,768.00	11,902,400	
倉敷紡績	6,900	2,091.00	14,427,900	
シキボウ	6,300	1,016.00	6,400,800	
日本毛織	23,800	897.00	21,348,600	
ダイドーリミテッド	15,000	323.00	4,845,000	
帝国繊維	8,400	2,480.00	20,832,000	
帝人	58,900	1,907.00	112,322,300	
東レ	563,700	758.00	427,284,600	
住江織物	2,600	3,000.00	7,800,000	
アツギ	8,700	938.00	8,160,600	
ダイニック	6,200	736.00	4,563,200	
セーレン	17,900	1,662.00	29,749,800	

小松マテール	15,100	867.00	13,091,700
ワコールホールディングス	21,400	2,746.00	58,764,400
ホギメディカル	9,200	3,640.00	33,488,000
T S Iホールディングス	27,000	692.00	18,684,000
マツオカコーポレーション	3,000	3,475.00	10,425,000
ワールド	7,400	2,149.00	15,902,600
三陽商会	5,100	1,877.00	9,572,700
オンワードホールディングス	45,400	611.00	27,739,400
ゴールドウイン	6,600	17,720.00	116,952,000
デサント	17,600	2,359.00	41,518,400
特種東海製紙	4,400	4,100.00	18,040,000
王子ホールディングス	325,700	666.00	216,916,200
日本製紙	34,300	2,204.00	75,597,200
三菱製紙	14,800	563.00	8,332,400
北越コーポレーション	46,900	606.00	28,421,400
中越パルプ工業	4,000	1,402.00	5,608,000
巴川製紙所	3,700	1,021.00	3,777,700
大王製紙	35,500	1,284.00	45,582,000
レンゴー	74,100	977.00	72,395,700
トモク	5,200	1,769.00	9,198,800
ザ・パック	5,400	3,580.00	19,332,000
クラレ	122,100	1,487.00	181,562,700
旭化成	516,800	1,143.00	590,702,400
昭和電工	48,200	3,765.00	181,473,000
住友化学	571,500	552.00	315,468,000
住友精化	3,500	4,305.00	15,067,500
日産化学	44,500	4,930.00	219,385,000
ラサ工業	3,600	1,554.00	5,594,400
クレハ	6,600	6,640.00	43,824,000
多木化学	2,200	5,300.00	11,660,000
テイカ	6,200	2,506.00	15,537,200
石原産業	14,300	1,238.00	17,703,400
日本曹達	11,500	3,065.00	35,247,500
東ソー	111,900	1,785.00	199,741,500
トクヤマ	21,000	2,750.00	57,750,000
セントラル硝子	16,300	2,587.00	42,168,100
東亜合成	46,100	1,211.00	55,827,100
大阪ソーダ	7,800	2,683.00	20,927,400
関東電化工業	17,700	828.00	14,655,600
デンカ	28,400	3,340.00	94,856,000
信越化学工業	128,100	10,430.00	1,336,083,000
日本カーバイド工業	3,200	1,515.00	4,848,000

堺化学工業	5,200	2,746.00	14,279,200
第一稀元素化学工業	7,100	854.00	6,063,400
エア・ウォーター	59,700	1,692.00	101,012,400
大陽日酸	59,900	1,849.00	110,755,100
日本化学工業	2,900	2,114.00	6,130,600
日本パーカラライジング	40,100	1,447.00	58,024,700
高压ガス工業	12,800	830.00	10,624,000
四国化成工業	12,300	1,200.00	14,760,000
戸田工業	2,200	2,226.00	4,897,200
ステラ ケミファ	4,600	3,075.00	14,145,000
保土谷化学工業	3,100	3,040.00	9,424,000
日本触媒	12,200	7,700.00	93,940,000
大日精化工業	6,000	3,230.00	19,380,000
カネカ	19,200	4,280.00	82,176,000
三菱瓦斯化学	74,600	1,660.00	123,836,000
三井化学	65,600	2,718.00	178,300,800
J S R	72,900	1,688.00	123,055,200
東京応化工業	12,700	3,540.00	44,958,000
大阪有機化学工業	8,500	1,129.00	9,596,500
三菱ケミカルホールディングス	484,900	789.10	382,634,590
K Hネオケム	11,100	3,225.00	35,797,500
ダイセル	106,700	1,242.00	132,521,400
住友ベークライト	12,600	4,330.00	54,558,000
積水化学工業	159,000	1,781.00	283,179,000
日本ゼオン	65,200	1,083.00	70,611,600
アイカ工業	21,800	3,840.00	83,712,000
宇部興産	36,500	2,370.00	86,505,000
積水樹脂	12,100	2,148.00	25,990,800
タキロンシーアイ	18,900	671.00	12,681,900
旭有機材	5,700	1,794.00	10,225,800
日立化成	33,600	2,950.00	99,120,000
ニチバン	4,300	2,314.00	9,950,200
リケンテクノス	21,800	518.00	11,292,400
大倉工業	4,400	1,841.00	8,100,400
積水化成成品工業	12,000	828.00	9,936,000
群栄化学工業	2,500	2,733.00	6,832,500
ダイキョーニシカワ	15,400	1,117.00	17,201,800
森六ホールディングス	4,400	2,607.00	11,470,800
日本化薬	46,000	1,304.00	59,984,000
カーリットホールディングス	9,500	847.00	8,046,500
日本精化	7,300	1,319.00	9,628,700
扶桑化学工業	7,300	1,980.00	14,454,000

トリケミカル研究所	1,800	5,840.00	10,512,000
A D E K A	35,900	1,665.00	59,773,500
日油	27,400	3,955.00	108,367,000
ハリマ化成グループ	7,300	1,094.00	7,986,200
花王	180,100	8,557.00	1,541,115,700
第一工業製薬	3,000	3,620.00	10,860,000
石原ケミカル	2,800	1,734.00	4,855,200
三洋化成工業	4,800	5,610.00	26,928,000
大日本塗料	9,300	1,048.00	9,746,400
日本ペイントホールディングス	59,900	4,215.00	252,478,500
関西ペイント	81,700	2,115.00	172,795,500
中国塗料	24,000	1,050.00	25,200,000
日本特殊塗料	7,100	1,199.00	8,512,900
藤倉化成	12,600	608.00	7,660,800
太陽ホールディングス	5,900	3,905.00	23,039,500
D I C	32,700	3,255.00	106,438,500
サカタインクス	16,000	1,009.00	16,144,000
東洋インキS Cホールディングス	15,200	2,659.00	40,416,800
T & K T O K A	6,600	979.00	6,461,400
富士フィルムホールディングス	154,100	5,184.00	798,854,400
資生堂	147,500	8,718.00	1,285,905,000
ライオン	103,400	2,288.00	236,579,200
高砂香料工業	5,200	3,370.00	17,524,000
マンダム	16,700	2,869.00	47,912,300
ミルボン	9,200	5,680.00	52,256,000
ファンケル	33,000	3,300.00	108,900,000
コーセー	12,500	20,850.00	260,625,000
コタ	4,800	1,250.00	6,000,000
ポーラ・オルビスホールディングス	31,700	3,500.00	110,950,000
ノエビアホールディングス	7,000	5,850.00	40,950,000
エステー	5,800	1,917.00	11,118,600
アグロ カネショウ	3,800	2,265.00	8,607,000
コニシ	13,100	1,709.00	22,387,900
長谷川香料	9,100	1,792.00	16,307,200
星光P M C	8,000	792.00	6,336,000
小林製薬	20,800	8,860.00	184,288,000
荒川化学工業	6,300	1,498.00	9,437,400
メック	6,900	1,184.00	8,169,600
日本高純度化学	2,200	2,225.00	4,895,000
タカラバイオ	19,500	2,432.00	47,424,000
J C U	9,800	1,884.00	18,463,200
デクセリアルズ	19,400	702.00	13,618,800

アース製薬	5,500	5,100.00	28,050,000
北興化学工業	10,500	523.00	5,491,500
大成ラミック	2,600	2,821.00	7,334,600
クミアイ化学工業	30,500	814.00	24,827,000
日本農薬	12,700	472.00	5,994,400
アキレス	5,900	1,969.00	11,617,100
有沢製作所	13,100	849.00	11,121,900
日東電工	51,200	5,990.00	306,688,000
レック	8,100	1,449.00	11,736,900
藤森工業	6,600	3,260.00	21,516,000
前澤化成工業	5,700	1,038.00	5,916,600
未来工業	4,700	2,320.00	10,904,000
J S P	4,800	2,326.00	11,164,800
エフピコ	8,200	6,750.00	55,350,000
天馬	5,600	2,062.00	11,547,200
信越ポリマー	14,000	845.00	11,830,000
東リ	24,400	260.00	6,344,000
ニフコ	29,500	3,130.00	92,335,000
バルカー	6,200	2,377.00	14,737,400
ユニ・チャーム	157,400	3,649.00	574,352,600
協和発酵キリン	86,800	2,156.00	187,140,800
武田薬品工業	647,800	4,112.00	2,663,753,600
アステラス製薬	684,400	1,509.00	1,032,759,600
大日本住友製薬	55,200	2,450.00	135,240,000
塩野義製薬	94,900	6,476.00	614,572,400
田辺三菱製薬	77,500	1,398.00	108,345,000
あすか製薬	9,900	1,160.00	11,484,000
日本新薬	19,400	7,660.00	148,604,000
中外製薬	77,300	7,040.00	544,192,000
科研製薬	13,400	4,745.00	63,583,000
エーザイ	88,800	6,454.00	573,115,200
ロート製薬	38,100	3,115.00	118,681,500
小野薬品工業	175,400	2,079.50	364,744,300
久光製薬	22,000	4,710.00	103,620,000
持田製薬	11,200	5,160.00	57,792,000
参天製薬	140,800	1,694.00	238,515,200
扶桑薬品工業	3,800	2,463.00	9,359,400
日本ケミファ	1,700	2,899.00	4,928,300
ツムラ	23,100	3,415.00	78,886,500
日医工	18,700	1,331.00	24,889,700
キッセイ薬品工業	13,400	2,750.00	36,850,000
生化学工業	14,600	1,222.00	17,841,200

栄研化学	13,100	2,000.00	26,200,000
鳥居薬品	4,200	2,207.00	9,269,400
J C Rファーマ	5,200	6,250.00	32,500,000
東和薬品	10,500	2,731.00	28,675,500
富士製薬工業	5,300	1,684.00	8,925,200
沢井製薬	15,300	5,960.00	91,188,000
ゼリア新薬工業	14,700	1,965.00	28,885,500
第一三共	212,400	5,481.00	1,164,164,400
キョーリン製薬ホールディングス	16,700	2,086.00	34,836,200
大幸薬品	4,100	1,816.00	7,445,600
ダイト	4,200	3,585.00	15,057,000
大塚ホールディングス	141,400	3,969.00	561,216,600
大正製薬ホールディングス	16,600	10,280.00	170,648,000
ペプチドリーム	37,100	5,990.00	222,229,000
日本コークス工業	75,000	100.00	7,500,000
ニチレキ	10,100	1,057.00	10,675,700
ユシロ化学工業	4,800	1,329.00	6,379,200
富士石油	23,300	278.00	6,477,400
MORESCO	3,400	1,499.00	5,096,600
出光興産	85,700	3,605.00	308,948,500
J X T Gホールディングス	1,248,200	540.70	674,901,740
コスモエネルギーホールディングス	21,300	2,297.00	48,926,100
横浜ゴム	43,800	2,093.00	91,673,400
TOYO TIRE	38,900	1,299.00	50,531,100
ブリヂストン	228,000	4,406.00	1,004,568,000
住友ゴム工業	66,700	1,367.00	91,178,900
オカモト	5,200	5,750.00	29,900,000
ニッタ	8,400	3,660.00	30,744,000
住友理工	14,600	975.00	14,235,000
三ツ星ベルト	10,100	2,106.00	21,270,600
バンドー化学	15,200	1,083.00	16,461,600
日東紡績	11,000	2,312.00	25,432,000
A G C	73,200	3,785.00	277,062,000
日本板硝子	26,500	915.00	24,247,500
日本山村硝子	4,500	1,468.00	6,606,000
日本電気硝子	32,100	3,050.00	97,905,000
オハラ	3,100	1,390.00	4,309,000
住友大阪セメント	15,200	4,520.00	68,704,000
太平洋セメント	46,900	3,570.00	167,433,000
日本ヒューム	8,900	774.00	6,888,600
日本コンクリート工業	20,500	282.00	5,781,000
三谷セキサン	3,700	3,035.00	11,229,500

アジアパイルホールディングス	11,700	603.00	7,055,100
東海カーボン	67,300	1,279.00	86,076,700
日本カーボン	3,600	4,880.00	17,568,000
東洋炭素	4,600	2,196.00	10,101,600
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	5,390.00	23,716,000
TOTO	57,000	4,690.00	267,330,000
日本碍子	90,200	1,644.00	148,288,800
日本特殊陶業	62,600	2,157.00	135,028,200
MARUWA	2,600	6,010.00	15,626,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,300.00	7,260,000
黒崎播磨	1,600	5,850.00	9,360,000
ヨータイ	8,700	521.00	4,532,700
東京窯業	12,600	368.00	4,636,800
ニッカトー	4,800	902.00	4,329,600
フジミインコーポレーテッド	6,700	2,571.00	17,225,700
ニチアス	20,300	2,142.00	43,482,600
ニチハ	10,200	3,055.00	31,161,000
日本製鉄	341,300	1,980.50	675,944,650
神戸製鋼所	134,900	849.00	114,530,100
中山製鋼所	13,000	516.00	6,708,000
合同製鐵	4,300	1,728.00	7,430,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,000	1,905.00	377,190,000
東京製鐵	38,800	950.00	36,860,000
共英製鋼	8,400	1,843.00	15,481,200
大和工業	15,700	3,075.00	48,277,500
東京鐵鋼	4,700	1,227.00	5,766,900
大阪製鐵	5,700	1,905.00	10,858,500
淀川製鋼所	10,000	2,116.00	21,160,000
丸一鋼管	26,100	3,070.00	80,127,000
モリ工業	2,700	2,547.00	6,876,900
大同特殊鋼	12,000	4,510.00	54,120,000
日本冶金工業	62,700	253.00	15,863,100
山陽特殊製鋼	9,400	2,224.00	20,905,600
愛知製鋼	4,000	3,405.00	13,620,000
日立金属	79,100	1,281.00	101,327,100
大平洋金属	5,200	2,431.00	12,641,200
新日本電工	50,200	232.00	11,646,400
栗本鐵工所	4,600	1,451.00	6,674,600
三菱製鋼	6,300	1,610.00	10,143,000
シンニッタン	14,700	365.00	5,365,500
大紀アルミニウム工業所	14,100	647.00	9,122,700
日本輕金属ホールディングス	199,600	245.00	48,902,000

三井金属鉱業	20,100	2,876.00	57,807,600
東邦亜鉛	4,100	2,901.00	11,894,100
三菱マテリアル	48,600	2,884.00	140,162,400
住友金属鉱山	100,600	3,479.00	349,987,400
D O W Aホールディングス	17,200	3,615.00	62,178,000
古河機械金属	12,300	1,380.00	16,974,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,700	1,537.00	13,371,900
東邦チタニウム	13,400	930.00	12,462,000
U A C J	11,000	2,243.00	24,673,000
C Kサンエツ	1,800	2,893.00	5,207,400
古河電気工業	21,300	2,928.00	62,366,400
住友電気工業	275,000	1,474.50	405,487,500
フジクラ	90,900	458.00	41,632,200
タツタ電線	16,300	486.00	7,921,800
平河ヒューテック	4,000	1,382.00	5,528,000
リョービ	9,000	2,529.00	22,761,000
アーレスティ	11,000	636.00	6,996,000
アサヒホールディングス	13,900	2,160.00	30,024,000
稲葉製作所	5,700	1,418.00	8,082,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,881.00	6,207,300
トーカロ	18,800	911.00	17,126,800
アルファC o	4,300	1,263.00	5,430,900
S U M C O	81,300	1,460.00	118,698,000
川田テクノロジーズ	1,700	6,930.00	11,781,000
R S Technologies	2,200	3,265.00	7,183,000
東洋製罐グループホールディングス	46,700	2,219.00	103,627,300
ホッカンホールディングス	4,800	1,844.00	8,851,200
コロナ	5,900	1,051.00	6,200,900
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,801.00	24,853,800
三和ホールディングス	75,400	1,334.00	100,583,600
文化シャッター	22,000	818.00	17,996,000
三協立山	10,500	1,235.00	12,967,500
アルインコ	8,900	972.00	8,650,800
L I X I Lグループ	108,600	1,447.00	157,144,200
ノーリツ	16,300	1,722.00	28,068,600
長府製作所	7,200	2,347.00	16,898,400
リンナイ	13,100	7,480.00	97,988,000
日東精工	14,000	655.00	9,170,000
岡部	15,200	1,016.00	15,443,200
ジーテクト	8,200	1,579.00	12,947,800
東プレ	13,500	2,076.00	28,026,000
高周波熱錬	14,600	954.00	13,928,400

東京製綱	7,000	1,090.00	7,630,000
パイオラックス	11,700	2,085.00	24,394,500
エイチワン	9,300	953.00	8,862,900
日本発條	73,000	1,000.00	73,000,000
三益半導体工業	7,400	1,655.00	12,247,000
日本製鋼所	22,500	2,136.00	48,060,000
三浦工業	31,600	2,823.00	89,206,800
タクマ	26,800	1,339.00	35,885,200
ツガミ	18,800	997.00	18,743,600
オークマ	9,300	6,510.00	60,543,000
東芝機械	8,200	2,526.00	20,713,200
アマダホールディングス	112,800	1,236.00	139,420,800
アイダエンジニアリング	20,100	872.00	17,527,200
F U J I	28,800	1,669.00	48,067,200
牧野フライス製作所	8,600	4,690.00	40,334,000
オーエスジー	36,200	2,229.00	80,689,800
旭ダイヤモンド工業	19,600	787.00	15,425,200
D M G 森精機	46,100	1,590.00	73,299,000
ソディック	16,100	998.00	16,067,800
ディスコ	9,900	19,080.00	188,892,000
日東工器	4,400	2,291.00	10,080,400
日進工具	2,400	2,539.00	6,093,600
豊和工業	5,300	969.00	5,135,700
津田駒工業	2,200	1,895.00	4,169,000
島精機製作所	10,100	3,725.00	37,622,500
オプトラン	7,200	2,917.00	21,002,400
フリュー	7,600	1,004.00	7,630,400
ヤマシンフィルタ	13,200	719.00	9,490,800
日阪製作所	10,500	986.00	10,353,000
やまびこ	14,400	1,096.00	15,782,400
平田機工	3,500	7,600.00	26,600,000
ペガサスミシン製造	8,600	642.00	5,521,200
ナプテスコ	40,400	3,390.00	136,956,000
三井海洋開発	7,900	3,405.00	26,899,500
レオン自動機	7,500	1,673.00	12,547,500
S M C	21,700	46,060.00	999,502,000
ホソカワミクロン	2,600	5,220.00	13,572,000
ユニオンツール	3,300	3,060.00	10,098,000
オイレス工業	10,000	1,855.00	18,550,000
日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,105.00	9,441,500
サトーホールディングス	8,900	2,697.00	24,003,300
技研製作所	5,200	3,485.00	18,122,000

日精樹脂工業	7,300	990.00	7,227,000
オカダアイヨン	3,200	1,306.00	4,179,200
小松製作所	336,000	2,852.00	958,272,000
住友重機械工業	42,200	3,925.00	165,635,000
日立建機	29,500	2,950.00	87,025,000
日工	2,800	2,450.00	6,860,000
巴工業	3,700	2,448.00	9,057,600
井関農機	7,900	1,735.00	13,706,500
TOWA	7,800	921.00	7,183,800
北川鉄工所	3,800	2,319.00	8,812,200
ローツェ	3,600	2,602.00	9,367,200
クボタ	397,400	1,683.00	668,824,200
荏原実業	3,500	2,085.00	7,297,500
三菱化工機	3,900	1,564.00	6,099,600
月島機械	15,000	1,458.00	21,870,000
帝国電機製作所	6,000	1,129.00	6,774,000
新東工業	17,600	1,043.00	18,356,800
澁谷工業	6,500	3,450.00	22,425,000
アイチ コーポレーション	14,200	758.00	10,763,600
小森コーポレーション	20,200	1,284.00	25,936,800
鶴見製作所	6,000	1,997.00	11,982,000
住友精密工業	2,000	3,100.00	6,200,000
酒井重工業	2,000	3,165.00	6,330,000
荏原製作所	33,000	3,405.00	112,365,000
西島製作所	9,800	1,008.00	9,878,400
北越工業	8,100	1,205.00	9,760,500
ダイキン工業	101,300	14,100.00	1,428,330,000
オルガノ	3,100	3,305.00	10,245,500
トーヨーカネツ	3,300	2,115.00	6,979,500
栗田工業	40,000	2,886.00	115,440,000
椿本チエイン	9,600	4,125.00	39,600,000
大同工業	5,700	867.00	4,941,900
アネスト岩田	12,800	972.00	12,441,600
ダイフク	40,800	6,780.00	276,624,000
加藤製作所	4,200	2,793.00	11,730,600
タダノ	36,300	1,168.00	42,398,400
フジテック	27,100	1,357.00	36,774,700
C K D	20,600	1,281.00	26,388,600
キトー	6,100	1,756.00	10,711,600
平和	20,400	2,212.00	45,124,800
理想科学工業	6,600	1,843.00	12,163,800
SANKYO	18,700	4,385.00	81,999,500

日本金銭機械	9,400	1,181.00	11,101,400
マースグループホールディングス	5,200	2,181.00	11,341,200
福島工業	4,600	3,850.00	17,710,000
ダイコク電機	4,300	1,517.00	6,523,100
竹内製作所	12,400	2,094.00	25,965,600
アマノ	21,200	2,890.00	61,268,000
J U K I	10,600	1,274.00	13,504,400
サンデンホールディングス	9,700	798.00	7,740,600
蛇の目ミシン工業	10,400	465.00	4,836,000
マックス	11,400	1,699.00	19,368,600
グローリー	20,700	2,800.00	57,960,000
新晃工業	7,400	1,600.00	11,840,000
大和冷機工業	10,800	1,297.00	14,007,600
セガサミーホールディングス	74,200	1,404.00	104,176,800
日本ピストンリング	3,500	1,606.00	5,621,000
リケン	3,400	5,320.00	18,088,000
T P R	9,800	2,179.00	21,354,200
ツバキ・ナカシマ	11,400	2,060.00	23,484,000
ホシザキ	21,800	7,200.00	156,960,000
大豊工業	6,900	876.00	6,044,400
日本精工	150,900	1,150.00	173,535,000
N T N	157,600	365.00	57,524,000
ジェイテクト	70,300	1,429.00	100,458,700
不二越	7,000	5,480.00	38,360,000
日本トムソン	23,600	573.00	13,522,800
T H K	46,300	2,906.00	134,547,800
ユーシン精機	6,300	1,206.00	7,597,800
前澤給装工業	4,100	1,944.00	7,970,400
イーグル工業	10,300	1,271.00	13,091,300
日本ピラー工業	8,300	1,306.00	10,839,800
キッツ	30,000	848.00	25,440,000
マキタ	90,300	4,050.00	365,715,000
日立造船	57,100	344.00	19,642,400
三菱重工業	124,400	4,621.00	574,852,400
I H I	57,100	2,637.00	150,572,700
スター精密	12,400	1,808.00	22,419,200
日清紡ホールディングス	41,900	985.00	41,271,500
イビデン	45,700	1,989.00	90,897,300
コニカミノルタ	161,900	1,114.00	180,356,600
ブラザー工業	96,400	2,183.00	210,441,200
ミネベアミツミ	137,600	1,970.00	271,072,000
日立製作所	334,200	3,689.00	1,232,863,800

三菱電機	741,600	1,582.00	1,173,211,200
富士電機	48,100	3,925.00	188,792,500
東洋電機製造	4,400	1,517.00	6,674,800
安川電機	86,100	4,095.00	352,579,500
シンフォニアテクノロジー	10,500	1,576.00	16,548,000
明電舎	14,700	1,582.00	23,255,400
オリジン	3,200	2,058.00	6,585,600
山洋電気	3,600	5,190.00	18,684,000
デンヨー	7,700	1,412.00	10,872,400
東芝テック	9,100	3,070.00	27,937,000
芝浦メカトロニクス	1,700	3,810.00	6,477,000
マブチモーター	20,400	4,110.00	83,844,000
日本電産	89,300	15,785.00	1,409,600,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	1,439.00	6,043,800
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,302.00	4,426,800
東光高岳	4,600	1,284.00	5,906,400
ダブル・スコープ	11,200	1,743.00	19,521,600
ダイヘン	8,200	3,110.00	25,502,000
ヤーマン	10,800	1,065.00	11,502,000
JVCケンウッド	57,500	294.00	16,905,000
ミマキエンジニアリング	7,700	610.00	4,697,000
第一精工	3,900	1,135.00	4,426,500
日新電機	17,500	1,053.00	18,427,500
大崎電気工業	16,200	737.00	11,939,400
オムロン	78,900	5,950.00	469,455,000
日東工業	12,100	2,172.00	26,281,200
I D E C	10,200	2,255.00	23,001,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,900	2,227.00	59,906,300
サクサホールディングス	2,700	1,756.00	4,741,200
メルコホールディングス	3,200	3,530.00	11,296,000
日本電気	96,200	3,745.00	360,269,000
富士通	71,600	8,135.00	582,466,000
沖電気工業	32,800	1,301.00	42,672,800
電気興業	4,100	3,260.00	13,366,000
サンケン電気	8,900	2,385.00	21,226,500
アイホン	5,400	1,753.00	9,466,200
ルネサスエレクトロニクス	75,300	593.00	44,652,900
セイコーエプソン	91,800	1,779.00	163,312,200
ワコム	55,300	447.00	24,719,100
アルバック	14,900	3,720.00	55,428,000
E I Z O	6,800	4,260.00	28,968,000
日本信号	18,800	1,031.00	19,382,800

京三製作所	18,500	434.00	8,029,000
能美防災	9,900	2,000.00	19,800,000
ホーチキ	5,500	1,265.00	6,957,500
エレコム	6,900	3,720.00	25,668,000
パナソニック	847,400	1,021.00	865,195,400
シャープ	73,900	1,236.00	91,340,400
アンリツ	48,000	1,926.00	92,448,000
富士通ゼネラル	23,300	1,621.00	37,769,300
ソニー	497,600	5,212.00	2,593,491,200
T D K	38,800	9,690.00	375,972,000
帝国通信工業	5,400	1,218.00	6,577,200
タムラ製作所	28,600	686.00	19,619,600
アルプスアルパイン	77,200	2,347.00	181,188,400
日本トリム	1,600	5,600.00	8,960,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,405.00	10,341,500
フォスター電機	9,000	1,731.00	15,579,000
S M K	2,600	2,566.00	6,671,600
ヨコオ	5,700	1,767.00	10,071,900
ホシデン	21,900	1,054.00	23,082,600
ヒロセ電機	10,600	12,860.00	136,316,000
日本航空電子工業	16,800	1,794.00	30,139,200
T O A	8,600	1,220.00	10,492,000
マクセルホールディングス	16,100	1,691.00	27,225,100
古野電気	10,100	934.00	9,433,400
ユニデンホールディングス	2,900	2,445.00	7,090,500
スミダコーポレーション	7,000	1,652.00	11,564,000
アイコム	4,700	2,085.00	9,799,500
リオン	4,000	1,993.00	7,972,000
本多通信工業	8,300	555.00	4,606,500
船井電機	10,700	802.00	8,581,400
横河電機	74,300	2,318.00	172,227,400
新電元工業	2,800	4,565.00	12,782,000
アズビル	47,900	2,667.00	127,749,300
東亜ディーケーケー	4,600	814.00	3,744,400
日本光電工業	32,800	3,235.00	106,108,000
チノー	4,500	1,304.00	5,868,000
共和電業	15,800	419.00	6,620,200
堀場製作所	14,800	6,700.00	99,160,000
アドバンテスト	50,700	3,140.00	159,198,000
エスペック	6,700	2,186.00	14,646,200
キーエンス	36,400	69,120.00	2,515,968,000
日置電機	4,000	4,005.00	16,020,000

シスメックス	57,800	6,352.00	367,145,600
日本マイクロニクス	13,400	858.00	11,497,200
メガチップス	6,300	1,488.00	9,374,400
O B A R A G R O U P	4,300	4,225.00	18,167,500
コーセル	11,400	1,191.00	13,577,400
イリソ電子工業	6,800	5,760.00	39,168,000
オブテックスグループ	13,200	1,858.00	24,525,600
千代田インテグレ	3,600	2,077.00	7,477,200
アイ・オー・データ機器	4,300	1,186.00	5,099,800
レーザーテック	15,200	5,030.00	76,456,000
スタンレー電気	52,300	3,010.00	157,423,000
岩崎電気	4,700	1,361.00	6,396,700
ウシオ電機	45,600	1,348.00	61,468,800
ヘリオス テクノ ホールディング	8,800	655.00	5,764,000
日本セラミック	7,700	3,155.00	24,293,500
古河電池	6,800	664.00	4,515,200
山一電機	5,800	1,255.00	7,279,000
図研	5,400	1,525.00	8,235,000
日本電子	14,700	2,245.00	33,001,500
カシオ計算機	65,700	1,401.00	92,045,700
ファナック	70,500	20,775.00	1,464,637,500
日本シイエムケイ	19,400	768.00	14,899,200
エンプラス	3,700	3,150.00	11,655,000
ローム	35,900	8,150.00	292,585,000
浜松ホトニクス	53,200	4,505.00	239,666,000
三井ハイテック	8,700	1,286.00	11,188,200
新光電気工業	24,300	979.00	23,789,700
京セラ	113,100	7,190.00	813,189,000
太陽誘電	33,200	2,687.00	89,208,400
村田製作所	233,400	5,960.00	1,391,064,000
ユーシン	3,900	982.00	3,829,800
双葉電子工業	12,100	1,804.00	21,828,400
ニチコン	23,800	1,081.00	25,727,800
日本ケミコン	1,400	2,267.00	3,173,800
K O A	11,500	1,528.00	17,572,000
市光工業	11,700	691.00	8,084,700
小糸製作所	44,300	6,620.00	293,266,000
ミツバ	14,300	716.00	10,238,800
S C R E E Nホールディングス	13,000	5,340.00	69,420,000
キャノン電子	6,900	1,833.00	12,647,700
キャノン	399,100	3,089.00	1,232,819,900
リコー	223,500	1,123.00	250,990,500

象印マホービン	14,200	1,144.00	16,244,800	
東京エレクトロン	49,500	17,645.00	873,427,500	
トヨタ紡織	25,700	1,644.00	42,250,800	
ユニプレス	14,100	1,715.00	24,181,500	
豊田自動織機	59,900	6,300.00	377,370,000	
モリタホールディングス	12,900	1,879.00	24,239,100	
三櫻工業	11,900	527.00	6,271,300	
デンソー	163,100	4,853.00	791,524,300	
東海理化電機製作所	19,600	1,929.00	37,808,400	
三井E & Sホールディングス	27,700	1,093.00	30,276,100	
川崎重工業	57,800	2,586.00	149,470,800	
名村造船所	25,400	374.00	9,499,600	
日本車輛製造	3,300	2,440.00	8,052,000	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,247.00	11,472,400	
日産自動車	874,800	893.30	781,458,840	
いすゞ自動車	234,200	1,595.50	373,666,100	
トヨタ自動車	826,500	6,905.00	5,706,982,500	代用有価証券 400,000株
日野自動車	92,600	1,048.00	97,044,800	
三菱自動車工業	275,000	623.00	171,325,000	
エフテック	6,700	883.00	5,916,100	
武蔵精密工業	17,900	1,733.00	31,020,700	
日産車体	14,200	1,020.00	14,484,000	
新明和工業	33,200	1,371.00	45,517,200	
極東開発工業	14,900	1,562.00	23,273,800	
日信工業	13,200	1,479.00	19,522,800	
トピー工業	6,300	2,562.00	16,140,600	
ティラド	3,500	2,380.00	8,330,000	
タチエス	13,000	1,711.00	22,243,000	
N O K	39,800	1,781.00	70,883,800	
フタバ産業	21,300	698.00	14,867,400	
K Y B	7,900	3,010.00	23,779,000	
大同メタル工業	13,900	699.00	9,716,100	
プレス工業	37,100	599.00	22,222,900	
ミクニ	11,800	473.00	5,581,400	
太平洋工業	15,500	1,816.00	28,148,000	
ケーヒン	16,600	1,828.00	30,344,800	
河西工業	9,900	919.00	9,098,100	
アイシン精機	60,900	4,305.00	262,174,500	
マツダ	232,800	1,315.50	306,248,400	
今仙電機製作所	8,800	1,044.00	9,187,200	
本田技研工業	626,100	3,101.00	1,941,536,100	
スズキ	135,800	5,065.00	687,827,000	

S U B A R U	230,400	2,720.50	626,803,200
安永	4,100	1,750.00	7,175,000
ヤマハ発動機	104,500	2,288.00	239,096,000
ショーワ	17,600	1,628.00	28,652,800
T B K	16,500	406.00	6,699,000
エクセディ	9,700	2,538.00	24,618,600
豊田合成	24,000	2,310.00	55,440,000
愛三工業	12,900	751.00	9,687,900
日本プラスト	7,800	779.00	6,076,200
ヨロズ	7,900	1,615.00	12,758,500
エフ・シー・シー	13,400	2,291.00	30,699,400
シマノ	29,900	16,290.00	487,071,000
テイ・エス テック	17,300	3,325.00	57,522,500
ジャムコ	4,000	2,232.00	8,928,000
テルモ	209,800	3,347.00	702,200,600
日機装	23,500	1,373.00	32,265,500
島津製作所	95,300	2,974.00	283,422,200
J M S	10,000	668.00	6,680,000
長野計器	7,400	803.00	5,942,200
ブイ・テクノロジー	1,700	14,890.00	25,313,000
東京計器	6,000	1,116.00	6,696,000
インターアクション	4,300	1,911.00	8,217,300
東京精密	13,200	3,220.00	42,504,000
マニー	9,000	6,410.00	57,690,000
ニコン	129,400	1,550.00	200,570,000
トプコン	39,700	1,345.00	53,396,500
オリンパス	442,800	1,244.00	550,843,200
理研計器	6,400	2,103.00	13,459,200
タムロン	6,500	2,168.00	14,092,000
H O Y A	149,500	7,815.00	1,168,342,500
シード	3,500	1,138.00	3,983,000
ノーリツ鋼機	6,100	2,130.00	12,993,000
エー・アンド・デイ	7,900	906.00	7,157,400
朝日インテック	31,500	5,610.00	176,715,000
シチズン時計	81,400	624.00	50,793,600
リズム時計工業	3,500	1,269.00	4,441,500
大研医器	8,500	570.00	4,845,000
メニコン	10,200	3,200.00	32,640,000
松風	5,100	1,264.00	6,446,400
セイコーホールディングス	11,100	2,517.00	27,938,700
ニプロ	51,700	1,377.00	71,190,900
スノーピーク	3,600	1,578.00	5,680,800

パラマウントベッドホールディングス	8,300	5,220.00	43,326,000
トランザクション	5,100	808.00	4,120,800
ニホンフラッシュ	3,600	2,236.00	8,049,600
前田工織	8,200	2,117.00	17,359,400
永大産業	14,700	411.00	6,041,700
アートネイチャー	10,700	627.00	6,708,900
バンダイナムコホールディングス	76,800	5,300.00	407,040,000
S H O E I	3,700	4,845.00	17,926,500
フランスベッドホールディングス	12,800	916.00	11,724,800
パイロットコーポレーション	13,000	4,600.00	59,800,000
萩原工業	4,700	1,453.00	6,829,100
トッパン・フォームズ	15,700	1,015.00	15,935,500
フジシールインターナショナル	16,700	3,880.00	64,796,000
タカラトミー	31,000	1,188.00	36,828,000
廣済堂	10,100	763.00	7,706,300
プロネクサス	7,900	1,323.00	10,451,700
大建工業	5,800	2,098.00	12,168,400
凸版印刷	105,200	1,801.00	189,465,200
大日本印刷	104,500	2,633.00	275,148,500
図書印刷	8,800	970.00	8,536,000
共同印刷	3,000	2,499.00	7,497,000
N I S S H A	15,400	1,289.00	19,850,600
宝印刷	5,100	1,719.00	8,766,900
アシックス	74,100	1,365.00	101,146,500
ヤマハ	44,100	5,750.00	253,575,000
河合楽器製作所	2,600	2,930.00	7,618,000
クリナップ	9,500	620.00	5,890,000
ピジョン	44,900	4,715.00	211,703,500
キングジム	8,800	881.00	7,752,800
リンテック	17,900	2,399.00	42,942,100
イトーキ	15,800	547.00	8,642,600
任天堂	42,500	38,000.00	1,615,000,000
三菱鉛筆	12,000	2,283.00	27,396,000
タカラスタANDARD	14,600	1,693.00	24,717,800
コクヨ	35,600	1,412.00	50,267,200
ナカバヤシ	10,000	510.00	5,100,000
グローブライド	3,900	3,210.00	12,519,000
オカムラ	25,400	1,120.00	28,448,000
美津濃	7,400	2,558.00	18,929,200
東京電力ホールディングス	592,500	628.00	372,090,000
中部電力	226,500	1,616.00	366,024,000
関西電力	302,600	1,345.50	407,148,300

中国電力	102,800	1,327.00	136,415,600
北陸電力	73,400	826.00	60,628,400
東北電力	172,900	1,272.00	219,928,800
四国電力	67,000	1,122.00	75,174,000
九州電力	152,300	1,077.00	164,027,100
北海道電力	70,100	623.00	43,672,300
沖縄電力	13,300	1,839.00	24,458,700
電源開発	58,900	2,580.00	151,962,000
エフオン	5,800	834.00	4,837,200
イーレックス	12,400	1,011.00	12,536,400
レノバ	9,400	962.00	9,042,800
東京瓦斯	145,300	2,827.00	410,763,100
大阪瓦斯	143,600	2,055.00	295,098,000
東邦瓦斯	36,700	4,580.00	168,086,000
北海道瓦斯	5,400	1,426.00	7,700,400
広島ガス	21,900	355.00	7,774,500
西部瓦斯	8,000	2,340.00	18,720,000
静岡ガス	22,600	901.00	20,362,600
メタウォーター	3,900	3,335.00	13,006,500
SBSホールディングス	7,700	1,876.00	14,445,200
東武鉄道	78,000	3,140.00	244,920,000
相鉄ホールディングス	25,300	3,075.00	77,797,500
東京急行電鉄	201,100	1,812.00	364,393,200
京浜急行電鉄	101,700	1,896.00	192,823,200
小田急電鉄	118,600	2,614.00	310,020,400
京王電鉄	41,400	6,700.00	277,380,000
京成電鉄	55,300	3,890.00	215,117,000
富士急行	10,200	4,205.00	42,891,000
新京成電鉄	3,600	2,071.00	7,455,600
東日本旅客鉄道	131,900	10,465.00	1,380,333,500
西日本旅客鉄道	66,400	8,262.00	548,596,800
東海旅客鉄道	66,400	23,895.00	1,586,628,000
西武ホールディングス	94,800	1,807.00	171,303,600
鴻池運輸	11,800	1,797.00	21,204,600
西日本鉄道	20,900	2,613.00	54,611,700
ハマキョウレックス	5,700	4,105.00	23,398,500
サカイ引越センター	3,900	6,540.00	25,506,000
近鉄グループホールディングス	70,100	4,935.00	345,943,500
阪急阪神ホールディングス	93,500	4,150.00	388,025,000
南海電気鉄道	31,400	3,030.00	95,142,000
京阪ホールディングス	31,200	4,725.00	147,420,000
神戸電鉄	2,700	4,000.00	10,800,000

名古屋鉄道	56,100	3,010.00	168,861,000
山陽電気鉄道	6,000	2,218.00	13,308,000
日本通運	27,600	6,100.00	168,360,000
ヤマトホールディングス	123,000	2,412.50	296,737,500
山九	19,500	5,320.00	103,740,000
丸全昭和運輸	5,900	2,939.00	17,340,100
センコーグループホールディングス	38,600	892.00	34,431,200
トナミホールディングス	1,800	6,090.00	10,962,000
ニッコンホールディングス	26,600	2,617.00	69,612,200
福山通運	8,900	4,270.00	38,003,000
セイノーホールディングス	52,800	1,509.00	79,675,200
神奈川中央交通	2,500	3,830.00	9,575,000
日立物流	15,500	3,080.00	47,740,000
丸和運輸機関	3,800	3,915.00	14,877,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,246.00	10,715,600
九州旅客鉄道	58,800	3,620.00	212,856,000
S Gホールディングス	66,500	2,975.00	197,837,500
日本郵船	58,700	1,896.00	111,295,200
商船三井	41,600	2,820.00	117,312,000
川崎汽船	16,100	1,610.00	25,921,000
N S ユナイテッド海運	4,200	2,432.00	10,214,400
飯野海運	35,500	387.00	13,738,500
乾汽船	8,400	874.00	7,341,600
日本航空	128,800	3,729.00	480,295,200
A N Aホールディングス	128,600	3,888.00	499,996,800
トランコム	2,000	6,450.00	12,900,000
日新	6,600	1,907.00	12,586,200
三菱倉庫	24,400	2,968.00	72,419,200
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,762.00	15,153,200
住友倉庫	26,500	1,420.00	37,630,000
澁澤倉庫	5,500	1,748.00	9,614,000
東陽倉庫	25,300	317.00	8,020,100
日本トランスシティ	19,500	443.00	8,638,500
川西倉庫	2,800	1,257.00	3,519,600
安田倉庫	8,700	861.00	7,490,700
東洋埠頭	3,800	1,491.00	5,665,800
上組	42,800	2,652.00	113,505,600
キューソー流通システム	2,300	2,033.00	4,675,900
近鉄エクスプレス	13,300	1,678.00	22,317,400
エーアイティー	5,700	1,082.00	6,167,400
N E C ネットズエスアイ	7,900	2,677.00	21,148,300
システナ	26,100	1,330.00	34,713,000

デジタルアーツ	3,900	9,570.00	37,323,000
日鉄ソリューションズ	10,900	2,986.00	32,547,400
キューブシステム	6,800	785.00	5,338,000
コア	4,400	1,334.00	5,869,600
ソリトンシステムズ	5,700	1,030.00	5,871,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,400	1,575.00	6,930,000
T I S	24,200	5,060.00	122,452,000
ネオス	3,200	838.00	2,681,600
電算システム	3,600	3,205.00	11,538,000
グリー	49,700	432.00	21,470,400
コーエーテクモホールディングス	14,800	2,022.00	29,925,600
三菱総合研究所	3,300	3,080.00	10,164,000
ファインデックス	8,100	836.00	6,771,600
ブレインパッド	1,700	6,200.00	10,540,000
K L a b	13,400	824.00	11,041,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,300	1,005.00	10,351,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,680.00	2,856,000
ネクソン	185,700	1,596.00	296,377,200
アイスタイル	18,900	792.00	14,968,800
エムアップ	2,700	2,493.00	6,731,100
エイチーム	5,100	1,659.00	8,460,900
テクノスジャパン	6,900	668.00	4,609,200
コロプラ	24,600	675.00	16,605,000
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	1,249.00	5,370,700
メディアドゥホールディングス	2,700	2,965.00	8,005,500
じげん	9,300	577.00	5,366,100
フィックスターズ	7,500	1,463.00	10,972,500
C A R T A H O L D I N G S	4,800	1,191.00	5,716,800
オブティム	3,600	2,099.00	7,556,400
セレス	2,800	2,110.00	5,908,000
ティーガイア	7,300	1,806.00	13,183,800
セック	1,400	3,550.00	4,970,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,096.00	7,781,600
テクマトリックス	5,500	1,978.00	10,879,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	177,000	347.00	61,419,000
G M O ペイメントゲートウェイ	12,100	8,770.00	106,117,000
システムリサーチ	1,400	2,625.00	3,675,000
インターネットイニシアティブ	12,000	2,243.00	26,916,000
さくらインターネット	11,000	538.00	5,918,000
ヴィンクス	3,000	1,101.00	3,303,000
G M O クラウド	2,000	4,170.00	8,340,000

S R Aホールディングス	4,300	2,407.00	10,350,100
e B A S E	5,800	1,080.00	6,264,000
アドソル日進	3,000	1,667.00	5,001,000
フリービット	5,800	1,121.00	6,501,800
コムチュア	4,400	3,815.00	16,786,000
アステリア	4,800	798.00	3,830,400
マークラインズ	3,600	1,574.00	5,666,400
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,010.00	7,070,000
g u m i	10,200	623.00	6,354,600
モバイルファクトリー	2,700	1,531.00	4,133,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,519.00	5,468,400
P C Iホールディングス	1,700	2,381.00	4,047,700
オープンドア	3,900	3,195.00	12,460,500
マイネット	2,700	945.00	2,551,500
アカツキ	2,600	5,100.00	13,260,000
L I N E	22,400	3,735.00	83,664,000
チェンジ	1,100	3,770.00	4,147,000
オークネット	5,200	1,262.00	6,562,400
A O I T Y O H o l d i n g s	8,700	762.00	6,629,400
マクロミル	12,600	1,271.00	16,014,600
オロ	900	6,840.00	6,156,000
フェイス	5,300	853.00	4,520,900
プロトコーポレーション	3,000	2,079.00	6,237,000
野村総合研究所	46,300	5,430.00	251,409,000
サイバネットシステム	8,000	547.00	4,376,000
インテージホールディングス	10,700	935.00	10,004,500
ソースネクスト	28,800	511.00	14,716,800
インフォコム	8,200	2,130.00	17,466,000
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,071.00	9,103,500
フォーカスシステムズ	6,000	955.00	5,730,000
クレスコ	2,500	3,380.00	8,450,000
フジ・メディア・ホールディングス	76,100	1,494.00	113,693,400
オービック	25,300	12,860.00	325,358,000
ジャストシステム	10,400	3,190.00	33,176,000
T D C ソフト	7,400	857.00	6,341,800
ヤフー	476,700	296.00	141,103,200
トレンドマイクロ	38,900	5,560.00	216,284,000
日本オラクル	14,700	7,610.00	111,867,000
アルファシステムズ	2,900	2,739.00	7,943,100
フューチャー	10,300	1,854.00	19,096,200
C A C H o l d i n g s	7,200	1,586.00	11,419,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	2,475.00	8,415,000

オービックビジネスコンサルタント	7,300	4,455.00	32,521,500
伊藤忠テクノソリューションズ	33,100	2,721.00	90,065,100
アイティフォー	10,300	929.00	9,568,700
大塚商会	39,400	4,370.00	172,178,000
サイボウズ	10,600	1,054.00	11,172,400
電通国際情報サービス	4,600	3,805.00	17,503,000
デジタルガレージ	14,300	3,230.00	46,189,000
E Mシステムズ	7,200	1,497.00	10,778,400
ウェザーニューズ	3,000	3,370.00	10,110,000
C I J	9,000	913.00	8,217,000
WOWOW	3,600	2,876.00	10,353,600
スカラ	7,700	902.00	6,945,400
I M A G I C A G R O U P	7,400	573.00	4,240,200
ネットワンシステムズ	25,800	2,868.00	73,994,400
アルゴグラフィックス	6,400	2,275.00	14,560,000
マーベラス	12,200	855.00	10,431,000
エイベックス	12,800	1,409.00	18,035,200
日本ユニシス	23,300	2,843.00	66,241,900
兼松エレクトロニクス	4,000	3,290.00	13,160,000
東京放送ホールディングス	48,400	2,111.00	102,172,400
日本テレビホールディングス	67,100	1,624.00	108,970,400
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	1,956.00	40,293,600
スカパーJ S A Tホールディングス	55,600	444.00	24,686,400
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,335.00	14,243,500
ビジョン	2,400	5,100.00	12,240,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	3,400	832.00	2,828,800
コネクシオ	6,000	1,377.00	8,262,000
日本電信電話	498,300	4,616.00	2,300,152,800
K D D I	642,000	2,540.50	1,631,001,000
ソフトバンク	772,300	1,312.00	1,013,257,600
光通信	8,600	20,540.00	176,644,000
N T T ドコモ	460,800	2,410.50	1,110,758,400
エムティーアイ	10,200	647.00	6,599,400
G M O インターネット	26,500	1,719.00	45,553,500
カドカワ	21,500	1,400.00	30,100,000
学研ホールディングス	2,600	5,200.00	13,520,000
ゼンリン	14,500	2,420.00	35,090,000
アイネット	5,200	1,327.00	6,900,400
松竹	4,900	13,350.00	65,415,000
東宝	48,000	4,655.00	223,440,000
東映	3,200	14,410.00	46,112,000

エヌ・ティ・ティ・データ	193,600	1,294.00	250,518,400
D T S	8,100	3,925.00	31,792,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,000	3,830.00	130,220,000
シーイーシー	7,800	2,194.00	17,113,200
カブコン	31,600	2,505.00	79,158,000
アイ・エス・ピー	2,200	1,864.00	4,100,800
ジャステック	5,800	945.00	5,481,000
S C S K	19,200	5,270.00	101,184,000
日本システムウエア	2,800	2,176.00	6,092,800
アイネス	10,300	1,390.00	14,317,000
T K C	6,200	4,345.00	26,939,000
富士ソフト	10,800	4,390.00	47,412,000
N S D	11,900	2,757.00	32,808,300
コナミホールディングス	29,800	5,060.00	150,788,000
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,230.00	7,136,000
J B C Cホールディングス	6,600	1,509.00	9,959,400
ミロク情報サービス	7,300	2,988.00	21,812,400
ソフトバンクグループ	304,400	11,555.00	3,517,342,000
伊藤忠食品	2,100	4,685.00	9,838,500
エレマテック	3,900	2,043.00	7,967,700
J A L U X	2,400	2,526.00	6,062,400
あらた	4,100	3,975.00	16,297,500
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,928.00	7,326,400
フィールズ	7,800	784.00	6,115,200
双日	402,100	383.00	154,004,300
アルフレッサ ホールディングス	81,000	3,095.00	250,695,000
横浜冷凍	20,200	879.00	17,755,800
ラクーンホールディングス	5,800	695.00	4,031,000
アルコニックス	8,700	1,313.00	11,423,100
神戸物産	11,000	4,415.00	48,565,000
あい ホールディングス	10,700	1,810.00	19,367,000
ダイワボウホールディングス	6,600	5,670.00	37,422,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,800	1,603.00	31,739,400
ラクト・ジャパン	3,200	4,620.00	14,784,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,060.00	14,840,000
八洲電機	9,000	880.00	7,920,000
レスターホールディングス	8,400	1,799.00	15,111,600
ジュテックホールディングス	2,900	990.00	2,871,000
T O K A Iホールディングス	38,500	926.00	35,651,000
三洋貿易	4,400	2,250.00	9,900,000
ウイン・パートナーズ	5,300	1,216.00	6,444,800
シップヘルスケアホールディングス	15,100	4,565.00	68,931,500

コメダホールディングス	17,300	2,040.00	35,292,000
小野建	7,100	1,583.00	11,239,300
佐島電機	7,300	996.00	7,270,800
伯東	5,900	1,203.00	7,097,700
コンドーテック	8,000	976.00	7,808,000
ナガイレーベン	10,800	2,499.00	26,989,200
三菱食品	8,100	2,880.00	23,328,000
松田産業	6,200	1,406.00	8,717,200
第一興商	11,000	5,440.00	59,840,000
メディカルホールディングス	78,800	2,495.00	196,606,000
S P K	2,800	2,417.00	6,767,600
萩原電気ホールディングス	3,200	3,080.00	9,856,000
アズワン	5,200	8,890.00	46,228,000
尾家産業	4,100	1,319.00	5,407,900
シモジマ	5,400	1,192.00	6,436,800
ドウシシャ	7,000	1,776.00	12,432,000
高速	6,500	1,181.00	7,676,500
丸文	9,000	647.00	5,823,000
ハピネット	6,700	1,318.00	8,830,600
日本ライフライン	22,800	1,752.00	39,945,600
エクセル	3,300	1,972.00	6,507,600
マルカ	3,200	2,128.00	6,809,600
I D O M	25,900	270.00	6,993,000
日本エム・ディ・エム	5,100	1,232.00	6,283,200
進和	4,800	2,257.00	10,833,600
ダイترون	4,100	1,656.00	6,789,600
シークス	9,400	1,776.00	16,694,400
オーハシテクニカ	5,900	1,437.00	8,478,300
白銅	3,500	1,545.00	5,407,500
伊藤忠商事	510,800	2,000.00	1,021,600,000
丸紅	719,600	795.10	572,153,960
長瀬産業	41,100	1,691.00	69,500,100
蝶理	5,400	1,658.00	8,953,200
豊田通商	81,100	3,680.00	298,448,000
三共生興	18,000	507.00	9,126,000
兼松	29,000	1,231.00	35,699,000
三井物産	601,800	1,794.00	1,079,629,200
日本紙パルプ商事	4,200	4,255.00	17,871,000
日立ハイテクノロジーズ	22,200	4,950.00	109,890,000
カメイ	9,900	1,110.00	10,989,000
スターゼン	3,000	4,015.00	12,045,000
山善	28,100	1,165.00	32,736,500

椿本興業	2,200	3,640.00	8,008,000
住友商事	431,300	1,589.50	685,551,350
内田洋行	3,900	3,550.00	13,845,000
三菱商事	512,600	3,056.00	1,566,505,600
第一実業	3,500	3,425.00	11,987,500
キヤノンマーケティングジャパン	21,300	2,402.00	51,162,600
西華産業	4,800	1,366.00	6,556,800
佐藤商事	8,000	940.00	7,520,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,710.00	13,338,000
東京産業	10,100	511.00	5,161,100
ユアサ商事	7,400	3,165.00	23,421,000
神鋼商事	2,000	2,654.00	5,308,000
阪和興業	12,800	3,195.00	40,896,000
正栄食品工業	4,000	3,115.00	12,460,000
カナデン	8,200	1,262.00	10,348,400
菱電商事	6,900	1,524.00	10,515,600
フルサト工業	5,200	1,630.00	8,476,000
岩谷産業	16,400	3,480.00	57,072,000
極東貿易	3,400	1,614.00	5,487,600
イワキ	11,600	457.00	5,301,200
三愛石油	19,800	938.00	18,572,400
稲畑産業	17,400	1,524.00	26,517,600
ワキタ	16,400	1,163.00	19,073,200
東邦ホールディングス	21,900	2,600.00	56,940,000
サンゲツ	22,700	2,084.00	47,306,800
ミツウロコグループホールディングス	11,900	896.00	10,662,400
シナネンホールディングス	3,600	2,088.00	7,516,800
伊藤忠エネクス	16,300	908.00	14,800,400
サンリオ	23,100	2,535.00	58,558,500
サンワテクノス	5,700	883.00	5,033,100
リョーサン	8,000	2,995.00	23,960,000
新光商事	7,400	1,871.00	13,845,400
トーヨー	4,100	2,193.00	8,991,300
三信電気	6,200	1,871.00	11,600,200
東陽テクニカ	11,000	906.00	9,966,000
モスフードサービス	9,500	2,607.00	24,766,500
加賀電子	7,400	2,048.00	15,155,200
ソーダニッカ	11,200	573.00	6,417,600
立花エレテック	6,100	1,734.00	10,577,400
PALTAC	13,100	6,110.00	80,041,000
太平洋興発	7,800	738.00	5,756,400
西本Wismettacホールディングス	1,800	4,010.00	7,218,000

ヤマタネ	4,800	1,615.00	7,752,000
日鉄物産	5,100	4,645.00	23,689,500
泉州電業	3,000	2,584.00	7,752,000
トラスコ中山	14,900	2,805.00	41,794,500
オートバックスセブン	29,200	1,940.00	56,648,000
モリト	7,700	840.00	6,468,000
加藤産業	11,400	3,620.00	41,268,000
イノテック	5,800	994.00	5,765,200
イエローハット	13,600	1,404.00	19,094,400
J Kホールディングス	10,000	582.00	5,820,000
日伝	6,800	1,663.00	11,308,400
杉本商事	4,800	1,988.00	9,542,400
因幡電機産業	10,400	4,525.00	47,060,000
東テク	3,000	2,187.00	6,561,000
ミスミグループ本社	91,500	2,878.00	263,337,000
タキヒヨー	4,000	1,825.00	7,300,000
スズケン	33,300	6,400.00	213,120,000
ジェコス	6,500	998.00	6,487,000
ローソン	18,500	5,190.00	96,015,000
サンエー	5,500	4,360.00	23,980,000
カワチ薬品	6,300	1,964.00	12,373,200
エービーシー・マート	11,400	6,920.00	78,888,000
アスクル	7,500	2,990.00	22,425,000
ゲオホールディングス	11,100	1,513.00	16,794,300
アダストリア	10,200	2,730.00	27,846,000
くらコーポレーション	4,300	4,805.00	20,661,500
キャンドウ	5,100	1,707.00	8,705,700
パルグループホールディングス	4,100	3,405.00	13,960,500
エディオン	30,500	942.00	28,731,000
サーラコーポレーション	16,600	611.00	10,142,600
ハローズ	3,100	2,200.00	6,820,000
フジオフードシステム	3,300	2,910.00	9,603,000
あみやき亭	2,000	3,465.00	6,930,000
ひらまつ	20,500	341.00	6,990,500
大黒天物産	2,000	3,815.00	7,630,000
ハニーズホールディングス	8,700	1,027.00	8,934,900
アルペン	6,100	1,726.00	10,528,600
クオールホールディングス	10,900	1,684.00	18,355,600
ジンズ	4,100	5,950.00	24,395,000
ビックカメラ	43,200	1,192.00	51,494,400
D C Mホールディングス	38,200	1,101.00	42,058,200
ペッパーフードサービス	5,800	2,243.00	13,009,400

MonotaRO	46,200	2,562.00	118,364,400
DDホールディングス	2,000	1,865.00	3,730,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	1,979.00	10,884,500
J.フロント リテイリング	93,400	1,355.00	126,557,000
ドトール・日レスホールディングス	12,800	2,121.00	27,148,800
マツモトキヨシホールディングス	30,100	3,655.00	110,015,500
ブロンコビリー	4,100	2,312.00	9,479,200
ZOZO	79,200	1,965.00	155,628,000
物語コーポレーション	1,900	8,900.00	16,910,000
ココカラファイン	8,200	4,420.00	36,244,000
三越伊勢丹ホールディングス	136,800	1,059.00	144,871,200
Hamee	3,000	773.00	2,319,000
ウエルシアホールディングス	19,200	4,375.00	84,000,000
クリエイティブSDホールディングス	10,600	2,564.00	27,178,400
チムニー	2,800	2,706.00	7,576,800
シュッピン	5,900	739.00	4,360,100
ネクステージ	11,400	1,190.00	13,566,000
ジョイフル本田	21,400	1,290.00	27,606,000
鳥貴族	3,000	1,893.00	5,679,000
キリン堂ホールディングス	3,600	1,722.00	6,199,200
ホットランド	5,100	1,528.00	7,792,800
すかいらーくホールディングス	68,200	1,833.00	125,010,600
綿半ホールディングス	3,100	2,371.00	7,350,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,300	1,004.00	21,385,200
あさひ	6,700	1,351.00	9,051,700
日本調剤	2,700	4,040.00	10,908,000
コスモス薬品	3,200	17,740.00	56,768,000
セブン&アイ・ホールディングス	306,400	3,859.00	1,182,397,600
薬王堂	3,300	2,719.00	8,972,700
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	19,500	1,332.00	25,974,000
ツルハホールディングス	15,900	9,470.00	150,573,000
サンマルクホールディングス	5,800	2,495.00	14,471,000
トリドールホールディングス	9,200	2,486.00	22,871,200
TOKYO BASE	7,300	1,062.00	7,752,600
ジャパンミート	3,100	1,708.00	5,294,800
アレンザホールディングス	5,000	855.00	4,275,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	960.00	6,624,000
クスリのアオキホールディングス	7,100	7,820.00	55,522,000
スシローグローバルホールディングス	8,000	7,270.00	58,160,000
LIXILピバ	6,800	1,309.00	8,901,200
メディカルシステムネットワーク	10,700	496.00	5,307,200

ノジマ	12,900	1,909.00	24,626,100
カップ・クリエイト	11,200	1,453.00	16,273,600
ライトオン	8,000	778.00	6,224,000
良品計画	10,400	21,140.00	219,856,000
三城ホールディングス	15,500	391.00	6,060,500
アドヴァン	12,600	1,035.00	13,041,000
アルビス	3,200	2,271.00	7,267,200
コナカ	17,200	458.00	7,877,600
G - 7ホールディングス	2,600	2,509.00	6,523,400
イオン北海道	10,100	736.00	7,433,600
コジマ	12,800	544.00	6,963,200
コーナン商事	9,600	2,459.00	23,606,400
エコス	3,100	1,473.00	4,566,300
ワタミ	10,300	1,554.00	16,006,200
パン・パシフィック・インターナショナルホ	43,800	7,170.00	314,046,000
西松屋チェーン	16,400	886.00	14,530,400
ゼンショーホールディングス	34,600	2,504.00	86,638,400
幸楽苑ホールディングス	5,700	3,205.00	18,268,500
サイゼリヤ	12,100	2,499.00	30,237,900
V Tホールディングス	32,000	448.00	14,336,000
ユナイテッドアローズ	8,400	3,515.00	29,526,000
ハイデイ日高	10,400	2,021.00	21,018,400
コロワイド	24,500	2,232.00	54,684,000
ピーシーデポコーポレーション	11,800	408.00	4,814,400
壱番屋	5,000	4,555.00	22,775,000
スギホールディングス	16,000	5,610.00	89,760,000
ヴィア・ホールディングス	13,300	650.00	8,645,000
スクロール	14,200	368.00	5,225,600
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,447.00	20,310,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	81,800	2,968.00	242,782,400
木曽路	8,900	2,595.00	23,095,500
S R Sホールディングス	11,200	1,007.00	11,278,400
ケーヨー	17,000	482.00	8,194,000
上新電機	8,600	2,384.00	20,502,400
日本瓦斯	11,900	2,922.00	34,771,800
ロイヤルホールディングス	12,700	2,719.00	34,531,300
いなげや	8,500	1,329.00	11,296,500
島忠	16,700	2,681.00	44,772,700
チヨダ	7,600	1,760.00	13,376,000
ライフコーポレーション	5,600	2,160.00	12,096,000
リンガーハット	9,100	2,353.00	21,412,300
Mr Max HD	11,800	460.00	5,428,000

AOKIホールディングス	14,500	1,161.00	16,834,500
オークワ	11,000	1,123.00	12,353,000
コメリ	11,100	2,343.00	26,007,300
青山商事	13,100	2,439.00	31,950,900
しまむら	8,500	8,290.00	70,465,000
高島屋	57,800	1,249.00	72,192,200
松屋	15,300	992.00	15,177,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,600	1,413.00	53,128,800
近鉄百貨店	3,000	3,265.00	9,795,000
パルコ	7,700	1,065.00	8,200,500
丸井グループ	61,900	2,257.00	139,708,300
アクシアル リテイリング	5,900	3,310.00	19,529,000
イオン	280,900	2,054.50	577,109,050
イズミ	14,800	4,850.00	71,780,000
平和堂	14,800	2,050.00	30,340,000
フジ	9,000	1,851.00	16,659,000
ヤオコー	8,200	5,280.00	43,296,000
ゼビオホールディングス	9,100	1,169.00	10,637,900
ケーズホールディングス	76,400	993.00	75,865,200
Olympicグループ	5,800	771.00	4,471,800
日産東京販売ホールディングス	17,800	292.00	5,197,600
Genky DrugStores	3,600	2,606.00	9,381,600
総合メディカルホールディングス	6,400	2,065.00	13,216,000
アインホールディングス	9,800	8,840.00	86,632,000
元気寿司	2,300	4,320.00	9,936,000
ヤマダ電機	224,400	527.00	118,258,800
アークランドサカモト	12,400	1,443.00	17,893,200
ニトリホールディングス	31,600	13,250.00	418,700,000
グルメ杵屋	8,200	1,170.00	9,594,000
吉野家ホールディングス	26,400	1,686.00	44,510,400
松屋フーズホールディングス	3,500	3,665.00	12,827,500
サガミホールディングス	10,800	1,324.00	14,299,200
関西スーパーマーケット	6,900	1,052.00	7,258,800
王将フードサービス	5,300	7,230.00	38,319,000
プレナス	8,000	1,836.00	14,688,000
ミニストップ	5,900	1,752.00	10,336,800
アークス	13,500	2,250.00	30,375,000
バローホールディングス	15,800	2,706.00	42,754,800
ベルク	3,500	4,975.00	17,412,500
大庄	5,500	1,561.00	8,585,500
ファーストリテイリング	9,800	64,260.00	629,748,000
サンドラッグ	27,400	2,976.00	81,542,400

サックスパー ホールディングス	7,300	1,108.00	8,088,400
ペルーナ	17,800	836.00	14,880,800
じもとホールディングス	59,100	102.00	6,028,200
めぶきフィナンシャルグループ	375,600	283.00	106,294,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,300	1,604.00	16,521,200
九州フィナンシャルグループ	120,000	447.00	53,640,000
ゆうちょ銀行	207,300	1,223.00	253,527,900
富山第一銀行	19,600	380.00	7,448,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	466,200	432.00	201,398,400
西日本フィナンシャルホールディングス	47,600	916.00	43,601,600
関西みらいフィナンシャルグループ	34,500	776.00	26,772,000
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,503.00	10,521,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	3,265.00	41,792,000
新生銀行	53,400	1,542.00	82,342,800
あおぞら銀行	40,600	2,709.00	109,985,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,039,200	549.90	2,771,056,080
りそなホールディングス	801,300	469.70	376,370,610
三井住友トラスト・ホールディングス	143,600	3,864.00	554,870,400
三井住友フィナンシャルグループ	516,100	4,021.00	2,075,238,100
千葉銀行	258,200	581.00	150,014,200
群馬銀行	144,600	439.00	63,479,400
武蔵野銀行	11,100	2,153.00	23,898,300
千葉興業銀行	23,600	286.00	6,749,600
筑波銀行	32,800	196.00	6,428,800
七十七銀行	23,200	1,587.00	36,818,400
青森銀行	6,000	2,903.00	17,418,000
秋田銀行	5,100	2,193.00	11,184,300
山形銀行	8,600	1,789.00	15,385,400
岩手銀行	5,300	3,195.00	16,933,500
東邦銀行	67,200	288.00	19,353,600
東北銀行	4,000	1,082.00	4,328,000
みちのく銀行	5,000	1,624.00	8,120,000
ふくおかフィナンシャルグループ	63,700	2,576.00	164,091,200
静岡銀行	184,200	850.00	156,570,000
十六銀行	9,900	2,266.00	22,433,400
スルガ銀行	58,800	490.00	28,812,000
八十二銀行	176,500	446.00	78,719,000
山梨中央銀行	9,600	1,302.00	12,499,200
大垣共立銀行	15,700	2,508.00	39,375,600
福井銀行	6,900	1,625.00	11,212,500
北國銀行	8,000	3,420.00	27,360,000
清水銀行	3,500	1,761.00	6,163,500

富山銀行	1,700	3,165.00	5,380,500
滋賀銀行	14,700	2,652.00	38,984,400
南都銀行	8,900	2,080.00	18,512,000
百五銀行	65,400	359.00	23,478,600
京都銀行	26,200	4,800.00	125,760,000
紀陽銀行	25,800	1,512.00	39,009,600
ほくほくフィナンシャルグループ	48,500	1,221.00	59,218,500
広島銀行	106,600	598.00	63,746,800
山陰合同銀行	43,700	735.00	32,119,500
中国銀行	62,200	1,073.00	66,740,600
伊予銀行	96,500	616.00	59,444,000
百十四銀行	8,100	2,314.00	18,743,400
四国銀行	11,100	1,015.00	11,266,500
阿波銀行	11,600	2,788.00	32,340,800
大分銀行	4,700	3,345.00	15,721,500
宮崎銀行	5,200	2,673.00	13,899,600
佐賀銀行	4,700	1,761.00	8,276,700
沖縄銀行	6,900	3,455.00	23,839,500
琉球銀行	17,000	1,201.00	20,417,000
セブン銀行	247,900	302.00	74,865,800
みずほフィナンシャルグループ	9,947,300	173.50	1,725,856,550
山口フィナンシャルグループ	91,200	820.00	74,784,000
名古屋銀行	6,000	3,600.00	21,600,000
北洋銀行	112,300	272.00	30,545,600
愛知銀行	2,900	3,625.00	10,512,500
中京銀行	3,000	2,195.00	6,585,000
大光銀行	2,500	1,660.00	4,150,000
愛媛銀行	11,200	1,058.00	11,849,600
京葉銀行	32,300	687.00	22,190,100
栃木銀行	42,500	225.00	9,562,500
北日本銀行	2,000	1,903.00	3,806,000
東和銀行	13,800	711.00	9,811,800
トモニホールディングス	58,400	404.00	23,593,600
フィデアホールディングス	73,000	131.00	9,563,000
池田泉州ホールディングス	81,200	276.00	22,411,200
F P G	23,500	951.00	22,348,500
S B I ホールディングス	87,200	2,373.00	206,925,600
ジャフコ	12,100	4,185.00	50,638,500
大和証券グループ本社	585,900	515.10	301,797,090
野村ホールディングス	1,287,200	417.80	537,792,160
岡三証券グループ	63,600	406.00	25,821,600
丸三証券	22,500	630.00	14,175,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,900	368.00	32,715,200
水戸証券	26,500	221.00	5,856,500
いちよし証券	16,600	807.00	13,396,200
松井証券	35,900	990.00	35,541,000
マネックスグループ	69,900	338.00	23,626,200
カブドットコム証券	54,200	557.00	30,189,400
極東証券	11,100	988.00	10,966,800
岩井コスモホールディングス	8,000	1,194.00	9,552,000
藍澤証券	15,600	668.00	10,420,800
スパークス・グループ	30,000	239.00	7,170,000
かんぽ生命保険	27,800	2,245.00	62,411,000
S O M P Oホールディングス	128,800	4,161.00	535,936,800
アニコム ホールディングス	6,200	3,440.00	21,328,000
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	3,438.00	657,345,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	59,800	2,267.00	135,566,600
第一生命ホールディングス	413,600	1,595.00	659,692,000
東京海上ホールディングス	261,600	5,602.00	1,465,483,200
T & Dホールディングス	225,500	1,196.50	269,810,750
アドバンスクリエイト	4,000	1,835.00	7,340,000
全国保証	21,000	3,890.00	81,690,000
アルヒ	7,200	1,982.00	14,270,400
プレミアグループ	3,000	1,919.00	5,757,000
クレディセゾン	51,700	1,416.00	73,207,200
芙蓉総合リース	8,400	5,530.00	46,452,000
興銀リース	14,300	2,607.00	37,280,100
東京センチュリー	14,600	5,120.00	74,752,000
日本証券金融	32,200	576.00	18,547,200
アイフル	116,300	260.00	30,238,000
リコーリース	6,100	3,240.00	19,764,000
イオンフィナンシャルサービス	46,600	2,299.00	107,133,400
アコム	146,800	390.00	57,252,000
ジャックス	9,100	1,927.00	17,535,700
オリエントコーポレーション	203,000	117.00	23,751,000
日立キャピタル	17,200	2,575.00	44,290,000
オリックス	488,100	1,571.50	767,049,150
三菱U F Jリース	164,100	564.00	92,552,400
日本取引所グループ	197,900	1,808.00	357,803,200
イー・ギャランティ	8,600	1,183.00	10,173,800
N E Cキャピタルソリューション	4,300	1,728.00	7,430,400
いちご	95,000	358.00	34,010,000
日本駐車場開発	90,400	174.00	15,729,600
ヒューリック	154,300	958.00	147,819,400

三栄建築設計	3,600	1,574.00	5,666,400
スター・マイカ	4,000	1,325.00	5,300,000
野村不動産ホールディングス	49,500	2,355.00	116,572,500
三重交通グループホールディングス	16,400	590.00	9,676,000
サムティ	10,600	1,440.00	15,264,000
ディア・ライフ	11,100	421.00	4,673,100
日本商業開発	5,500	1,483.00	8,156,500
プレサンスコーポレーション	12,100	1,360.00	16,456,000
ユニゾホールディングス	11,300	1,966.00	22,215,800
日本管理センター	5,800	903.00	5,237,400
フージャースホールディングス	17,800	659.00	11,730,200
オープンハウス	12,100	4,065.00	49,186,500
東急不動産ホールディングス	200,300	626.00	125,387,800
飯田グループホールディングス	62,200	1,879.00	116,873,800
ムゲンエステート	8,200	590.00	4,838,000
ハウスドゥ	4,800	1,386.00	6,652,800
パーク24	43,100	2,333.00	100,552,300
パラカ	2,800	1,995.00	5,586,000
三井不動産	389,000	2,567.00	998,563,000
三菱地所	514,100	1,875.50	964,194,550
平和不動産	14,100	2,138.00	30,145,800
東京建物	80,800	1,251.00	101,080,800
ダイビル	22,800	983.00	22,412,400
京阪神ビルディング	15,000	1,017.00	15,255,000
住友不動産	165,000	4,103.00	676,995,000
テーオーシー	17,500	694.00	12,145,000
東京楽天地	1,800	5,040.00	9,072,000
スターツコーポレーション	10,200	2,471.00	25,204,200
フジ住宅	11,800	840.00	9,912,000
空港施設	13,300	550.00	7,315,000
ゴールドクレスト	6,700	1,461.00	9,788,700
日本エスリード	4,200	1,555.00	6,531,000
日神不動産	13,500	453.00	6,115,500
日本エスコン	14,100	789.00	11,124,900
タカラレーベン	36,800	345.00	12,696,000
サンヨーハウジング名古屋	7,000	947.00	6,629,000
イオンモール	37,100	1,704.00	63,218,400
カチタス	8,300	3,665.00	30,419,500
トーセイ	10,800	922.00	9,957,600
サンフロンティア不動産	10,500	1,134.00	11,907,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	890.00	7,298,000
ランドビジネス	6,500	783.00	5,089,500

日本空港ビルデング	23,500	4,685.00	110,097,500
日本工営	5,100	2,546.00	12,984,600
L I F U L L	26,800	600.00	16,080,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,718.00	15,764,400
日本M & Aセンター	52,900	3,150.00	166,635,000
タケエイ	10,300	783.00	8,064,900
トラスト・テック	3,700	3,765.00	13,930,500
コシダカホールディングス	19,200	1,550.00	29,760,000
パソナグループ	8,200	1,759.00	14,423,800
リンクアンドモチベーション	13,400	844.00	11,309,600
G C A	8,500	819.00	6,961,500
エス・エム・エス	26,200	2,132.00	55,858,400
パーソルホールディングス	71,000	2,084.00	147,964,000
リニカル	4,400	1,261.00	5,548,400
クックパッド	24,700	270.00	6,669,000
学情	3,800	1,140.00	4,332,000
スタジオアリス	4,100	2,050.00	8,405,000
シミックホールディングス	4,500	1,634.00	7,353,000
総合警備保障	28,300	4,955.00	140,226,500
カカクコム	53,400	2,280.00	121,752,000
アイロムグループ	3,100	1,850.00	5,735,000
ルネサンス	4,500	2,051.00	9,229,500
ディップ	11,400	1,690.00	19,266,000
オプトホールディング	4,800	1,819.00	8,731,200
新日本科学	11,600	764.00	8,862,400
ツクイ	17,000	693.00	11,781,000
ベネフィット・ワン	19,700	2,311.00	45,526,700
エムスリー	149,600	1,969.00	294,562,400
アウトソーシング	37,500	1,453.00	54,487,500
ウェルネット	8,600	1,062.00	9,133,200
ワールドホールディングス	2,200	1,886.00	4,149,200
ディー・エヌ・エー	38,600	1,735.00	66,971,000
博報堂D Yホールディングス	99,400	1,873.00	186,176,200
ぐるなび	11,500	619.00	7,118,500
タカミヤ	9,400	673.00	6,326,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,631.00	10,275,300
ファンコミュニケーションズ	21,000	680.00	14,280,000
ライク	3,500	1,241.00	4,343,500
W D Bホールディングス	3,600	3,290.00	11,844,000
バリューコマース	5,200	2,800.00	14,560,000
インフォマート	39,000	1,617.00	63,063,000
J Pホールディングス	25,400	287.00	7,289,800

E P S ホールディングス	10,700	1,985.00	21,239,500
プレステージ・インターナショナル	13,600	1,589.00	21,610,400
アミューズ	4,600	2,636.00	12,125,600
ドリームインキュベータ	3,200	1,580.00	5,056,000
クイック	5,000	1,723.00	8,615,000
ケネディクス	63,400	528.00	33,475,200
電通	86,500	4,535.00	392,277,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,200	1,456.00	4,659,200
ぴあ	2,100	4,695.00	9,859,500
イオンファンタジー	2,400	2,652.00	6,364,800
シーティーエス	9,200	677.00	6,228,400
ネクシィーズグループ	2,400	2,456.00	5,894,400
みらかホールディングス	20,100	2,843.00	57,144,300
アルプス技研	6,400	1,932.00	12,364,800
日本空調サービス	9,600	699.00	6,710,400
オリエンタルランド	83,800	12,270.00	1,028,226,000
ダスキン	19,400	2,738.00	53,117,200
明光ネットワークジャパン	10,600	1,105.00	11,713,000
ファルコホールディングス	5,200	1,424.00	7,404,800
ラウンドワン	22,200	1,494.00	33,166,800
リゾートトラスト	30,800	1,550.00	47,740,000
ビー・エム・エル	9,100	3,135.00	28,528,500
りらいあコミュニケーションズ	12,800	1,173.00	15,014,400
リソー教育	36,700	425.00	15,597,500
ユー・エス・エス	86,600	2,126.00	184,111,600
サイバーエージェント	40,900	4,430.00	181,187,000
楽天	331,300	1,235.00	409,155,500
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,226.00	6,007,400
テー・オー・ダブリュー	8,300	725.00	6,017,500
山田コンサルティンググループ	3,500	2,413.00	8,445,500
セントラルスポーツ	2,900	3,145.00	9,120,500
フルキャストホールディングス	6,900	2,435.00	16,801,500
エン・ジャパン	10,800	3,600.00	38,880,000
テクノプロ・ホールディングス	14,300	6,650.00	95,095,000
アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	1,907.00	4,767,500
G u n o s y	5,400	1,657.00	8,947,800
イー・ガーディアン	3,600	2,107.00	7,585,200
ジャパンマテリアル	19,600	1,649.00	32,320,400
ベクトル	8,900	1,317.00	11,721,300
I B J	5,600	899.00	5,034,400
アサンテ	3,500	2,170.00	7,595,000
N・フィールド	5,300	721.00	3,821,300

バリューHR	2,300	2,571.00	5,913,300
M&Aキャピタルパートナーズ	2,400	4,725.00	11,340,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,200.00	4,440,000
アビスト	1,500	3,155.00	4,732,500
シグマクシス	4,400	1,079.00	4,747,600
ウィルグループ	5,400	1,130.00	6,102,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	300.00	3,450,000
リクルートホールディングス	508,300	3,329.00	1,692,130,700
エラン	5,200	1,687.00	8,772,400
日本郵政	581,700	1,243.00	723,053,100
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,623.00	19,476,000
鎌倉新書	5,400	1,448.00	7,819,200
LITALICO	2,200	1,794.00	3,946,800
エボラブルアジア	3,500	2,091.00	7,318,500
アトラエ	1,600	3,390.00	5,424,000
ストライク	3,100	2,014.00	6,243,400
ソラスト	17,300	1,108.00	19,168,400
インソース	2,600	2,324.00	6,042,400
ベikalレント・コンサルティング	5,000	4,020.00	20,100,000
キャリアインデックス	2,800	792.00	2,217,600
MS - Japan	3,200	1,712.00	5,478,400
グレイステクノロジー	2,200	1,911.00	4,204,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,500	2,253.00	12,391,500
日総工産	4,000	1,269.00	5,076,000
キュービーネットホールディングス	4,200	2,596.00	10,903,200
RPAホールディングス	1,500	5,460.00	8,190,000
スプリックス	2,400	2,508.00	6,019,200
リログループ	39,000	3,030.00	118,170,000
東祥	4,500	2,855.00	12,847,500
エイチ・アイ・エス	12,400	3,540.00	43,896,000
共立メンテナンス	10,800	5,700.00	61,560,000
イチネンホールディングス	8,500	1,209.00	10,276,500
建設技術研究所	5,700	1,525.00	8,692,500
スペース	5,300	1,290.00	6,837,000
燦ホールディングス	2,500	2,489.00	6,222,500
東京テアトル	4,900	1,330.00	6,517,000
ナガワ	2,100	6,140.00	12,894,000
よみうりランド	2,300	4,385.00	10,085,500
東京都競馬	4,700	3,250.00	15,275,000
常磐興産	5,300	1,654.00	8,766,200
カナモト	10,700	2,632.00	28,162,400
東京ドーム	27,000	1,103.00	29,781,000

西尾レントオール	7,200	3,080.00	22,176,000
トランス・コスモス	7,800	2,426.00	18,922,800
乃村工藝社	16,500	3,100.00	51,150,000
藤田観光	3,300	2,749.00	9,071,700
KNT - CTホールディングス	4,300	1,389.00	5,972,700
日本管財	8,000	2,016.00	16,128,000
トーカイ	6,800	2,567.00	17,455,600
セコム	75,200	9,338.00	702,217,600
セントラル警備保障	3,500	5,260.00	18,410,000
丹青社	13,500	1,237.00	16,699,500
メイテック	9,100	5,160.00	46,956,000
応用地質	8,800	1,170.00	10,296,000
船井総研ホールディングス	14,600	2,873.00	41,945,800
オオバ	7,800	688.00	5,366,400
学究社	4,200	1,281.00	5,380,200
ベネッセホールディングス	26,200	3,065.00	80,303,000
イオンディライト	8,800	3,745.00	32,956,000
ナック	6,000	997.00	5,982,000
ニチイ学館	10,800	1,363.00	14,720,400
ダイセキ	11,900	3,045.00	36,235,500
合 計	85,769,300		172,267,269,170

(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。

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 4月26日現在）	（平成31年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,452,065,233	504,936,832
金銭信託	250,821,542	827,792,557
コール・ローン	38,181,025	267,424,520
株式	170,304,759,182	178,606,464,111
投資証券	3,800,076,025	4,394,088,058
派生商品評価勘定	50,433,327	27,245,209
未収入金	58,878,268	48,846,591
未収配当金	264,940,937	267,879,105

	（平成30年 4月26日現在）	（平成31年 4月26日現在）
前払金	5,446,384	-
差入委託証拠金	2,148,510,347	1,096,617,753
流動資産合計	178,374,112,270	186,041,294,736
資産合計	178,374,112,270	186,041,294,736
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	56,072,971	4,286,862
前受金	-	22,998,847
未払金	72,330,014	11,682,025
未払解約金	266,432,845	992,052,101
未払利息	111	783
その他未払費用	29,313	23,083
流動負債合計	394,865,254	1,031,043,701
負債合計	394,865,254	1,031,043,701
純資産の部		
元本等		
元本	53,208,560,898	50,156,918,145
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	124,770,686,118	134,853,332,890
元本等合計	177,979,247,016	185,010,251,035
純資産合計	177,979,247,016	185,010,251,035
負債純資産合計	178,374,112,270	186,041,294,736

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年 4月27日 至平成31年 4月26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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	53,208,560,898口	50,156,918,145口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3449円 (10,000口当たりの純資産額 33,449円)	1口当たり純資産額 3.6886円 (10,000口当たりの純資産額 36,886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 4月27日 至 平成31年 4月26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、投資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、先物取引、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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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 4月26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	3,583,051,456	-	3,577,605,072	5,446,384
	SPMINI 1806	2,502,814,566	-	2,459,794,897	43,019,669
	DJ EUR 1806	651,709,944	-	678,216,069	26,506,125
	FTSE 1806	246,297,808	-	257,128,646	10,830,838
	SPI200 1806	182,229,138	-	182,465,460	236,322
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	385,357,540	-	385,550,800	193,260
	米ドル	317,065,700	-	317,231,000	165,300
	カナダドル	17,043,400	-	17,048,000	4,600
	ユーロ	13,316,000	-	13,321,000	5,000
	英ポンド	3,049,540	-	3,051,400	1,860
	スイスフラン	15,580,600	-	15,590,400	9,800
	スウェーデンクローナ	5,367,600	-	5,371,800	4,200
	ノルウェークローネ	1,373,000	-	1,374,000	1,000
	デンマーククローネ	1,787,100	-	1,788,000	900
	香港ドル	7,388,200	-	7,388,200	-
	シンガポールドル	2,472,300	-	2,472,900	600
	イスラエルシェケル	914,100	-	914,100	-
	合計		3,968,408,996	-	3,963,155,872

（平成31年 4月26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	1,847,197,992	-	1,870,196,839	22,998,847
	SPMINI 1906	1,326,815,033	-	1,341,957,285	15,142,252

市場取引以外の取引	DJ EUR 1906	317,818,264	-	323,761,140	5,942,876
	FTSE 1906	116,233,325	-	117,084,589	851,264
	SPI200 1906	86,331,370	-	87,393,825	1,062,455
	為替予約取引				
	売建	122,280,500	-	122,321,000	40,500
	米ドル	89,360,000	-	89,384,000	24,000
	カナダドル	4,142,000	-	4,144,000	2,000
	ユーロ	24,864,000	-	24,876,000	12,000
	オーストラリアドル	3,914,500	-	3,917,000	2,500
合計	1,969,478,492	-	1,992,517,839	22,958,347	

(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 4月27日

至 平成31年 4月26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 4月26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	67,999,201,436円
同期中における追加設定元本額	6,479,607,105円
同期中における一部解約元本額	21,270,247,643円
平成30年 4月26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	12,314,303,411円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	265,807,738円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,097,241,211円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	768,789,110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)	99,268,143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)	2,657,747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)	7,967,224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)	21,829,082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)	33,957,710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)	21,980,577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)	61,426,602円
外国株式指数ファンド	478,323,794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	1,846,490,389円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	464,151,919円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	509,991,846円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	447,374,259円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,814,247円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	258,118円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,299,824円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,140,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,485,296円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	36,120,520円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	3,714,765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)	2,861,016,759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 >	11,989,163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 >	761,175,839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 >	2,087,096,531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 >	1,831,931,763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 >	7,621,846,055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 >	23,184,564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 >	123,614,027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 >	772,703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 >	953,214,100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 >	69,063,912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 >	210,826,290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 >	903,886,602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 >	928,182,271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 >	1,984,404,007円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	45,952,710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)	880,224,993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)	1,195,139,569円
S M A M・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	173,816,287円
S M A M・バランスファンドV A 20 <適格機関投資家専用>	89,537,244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)	1,378,857,819円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	29,139,560円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	14,944,131円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	7,525,974円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	58,355,726円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	136,603,968円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T <適格機関投資家専用>	135,776,870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>	1,427,941,057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>	210,986,415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>	7,498,908,615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>	743,105,133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>	87,684,238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>	8,596,819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>	84,319,064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>	40,344,880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>	84,186,466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>	14,545円
合計	53,208,560,898円

(平成31年 4月26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	53,208,560,898円
同期中における追加設定元本額	12,569,281,751円
同期中における一部解約元本額	15,620,924,504円
平成31年 4月26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	14,530,943,449円
三井住友・D C年金バランス30(債券重点型)	281,447,230円
三井住友・D C年金バランス50(標準型)	1,173,444,908円
三井住友・D C年金バランス70(株式重点型)	786,537,850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)	73,260,890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)	1,988,128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)	7,899,545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)	21,142,487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)	39,734,004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)	28,557,819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)	72,267,318円
外国株式指数ファンド	515,978,365円
三井住友・D CつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	3,283,561,242円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	509,858,594円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,067,966円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	492,485,334円
イオン・バランス戦略ファンド	31,169,212円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,505,740円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	14,280,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,985,108円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	56,285,291円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,652,516円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,909,723円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,770,492円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,742,054,495円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,619,538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 >	1,554,318,707円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,493,601,415円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,319,455,272円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	20,379,742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 >	423,742円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	758,296,083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 >	60,125,135円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	175,645,387円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	775,699,406円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	658,649,408円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,587,648,005円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,104,987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)	409,339,094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)	601,436,192円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	135,732,381円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	28,425,171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)	720,253,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	23,722,444円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	12,876,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	6,622,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	44,693,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	111,349,288円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	111,277,275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 >	1,090,156,776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 >	152,693,007円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	6,115,998,283円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	278,956,079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 >	2,012,443,704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 >	7,865,987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 >	101,802,107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 >	48,744,796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 >	120,134,876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>	147,153,141円
合計	50,156,918,145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	71.77	1,536,165.08	
	APACHE CORPORATION	16,399	34.06	558,549.94	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,431	25.57	599,130.67	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	26.01	510,628.32	
	CHENIERE ENERGY INC	10,007	64.92	649,654.44	
	CHEVRON CORPORATION	82,665	117.90	9,746,203.50	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	69.67	284,253.60	
	CONCHO RESOURCES INC	9,223	121.01	1,116,075.23	
	CONOCOPHILLIPS	50,365	63.97	3,221,849.05	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	48.90	221,761.50	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	33.54	739,758.24	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,082	109.61	776,258.02	
	EOG RESOURCES INC	25,219	102.08	2,574,355.52	
	EXXON MOBIL CORPORATION	183,467	82.22	15,084,656.74	
	HALLIBURTON CO	37,453	29.22	1,094,376.66	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	61.44	250,675.20	
	HESS CORPORATION	11,053	64.18	709,381.54	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,365	49.49	364,493.85	
	KINDER MORGAN INC	86,457	19.97	1,726,546.29	
	MARATHON OIL CORP	36,817	17.93	660,128.81	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	30,435	60.65	1,845,882.75	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	26.44	445,461.12	
	NOBLE ENERGY INC	20,924	27.25	570,179.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,362	61.84	2,063,106.08	
	ONEOK INC	17,884	69.76	1,247,587.84	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	20.77	191,250.16	
	PHILLIPS 66	19,641	95.22	1,870,216.02	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,229	168.01	1,214,544.29	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	23.87	186,329.22		
SCHLUMBERGER LTD	60,249	43.30	2,608,781.70		
TARGA RESOURCES CORP	8,672	40.23	348,874.56		

TECHNIPFMC PLC	18,187	24.27	441,398.49
VALERO ENERGY CORP	18,039	90.83	1,638,482.37
WILLIAMS COS INC	52,630	28.47	1,498,376.10
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,545	199.60	1,905,182.00
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	74.87	344,626.61
AVERY DENNISON CORP	3,941	108.46	427,440.86
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	26.75	288,284.75
BALL CORPORATION	13,670	58.96	805,983.20
CELANESE CORPORATION	5,647	108.70	613,828.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	44.07	446,825.73
CHEMOURS CO	8,067	38.09	307,272.03
CROWN HOLDINGS INC	5,272	57.61	303,719.92
DOW INC	33,348	55.33	1,845,144.84
DOWDUPONT INC	100,044	37.60	3,761,654.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	80.71	480,708.76
ECOLAB INC	11,211	183.39	2,055,985.29
FMC CORPORATION	5,698	78.99	450,085.02
FREEMPORT-MCMORAN INC	60,238	12.21	735,505.98
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	45.53	779,974.43
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,770	136.43	514,341.10
LINDE PLC	23,768	176.28	4,189,823.04
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,642	88.66	1,298,159.72
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	212.35	547,225.95
MOSAIC CO/THE	15,550	26.05	405,077.50
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	21,603	31.63	683,302.89
NUCOR CORP	13,218	57.40	758,713.20
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	97.94	396,265.24
PPG INDUSTRIES INC	10,300	115.53	1,189,959.00
SEALED AIR CORP	8,102	45.70	370,261.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,663	451.30	1,653,111.90
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	31.59	321,933.69
VULCAN MATERIALS CO	5,483	121.75	667,555.25
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	71.78	105,875.50
WESTROCK CO	11,330	36.61	414,791.30
3M COMPANY	25,316	190.72	4,828,267.52
ACUITY BRANDS INC	1,884	145.41	273,952.44
AERCAP HOLDINGS NV	4,629	48.67	225,293.43
ALLEGION PLC	3,946	96.56	381,025.76
AMETEK INC	9,623	85.91	826,711.93
ARCONIC INC	19,024	20.64	392,655.36
BOEING CO	23,455	382.80	8,978,574.00
CATERPILLAR INC	25,747	136.13	3,504,939.11

CUMMINS INC	6,946	162.14	1,126,224.44
DEERE & CO	13,344	161.81	2,159,192.64
DOVER CORP	6,894	96.22	663,340.68
EATON CORP PLC	18,843	83.80	1,579,043.40
EMERSON ELECTRIC CO	26,867	71.28	1,915,079.76
FASTENAL COMPANY	11,953	70.96	848,184.88
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	48.50	235,176.50
FLUOR CORP	5,677	39.87	226,341.99
FORTIVE CORP	13,068	87.79	1,147,239.72
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	52.05	335,722.50
GENERAL DYNAMICS CORP	10,944	176.88	1,935,774.72
GENERAL ELECTRIC CO	379,099	9.12	3,457,382.88
HARRIS CORP	4,981	164.75	820,619.75
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	45.10	351,193.70
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,446	170.42	5,529,447.32
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	223.32	409,122.24
IDEX CORP	3,078	153.32	471,918.96
ILLINOIS TOOL WORKS	13,015	151.21	1,967,998.15
INGERSOLL-RAND PLC	10,304	111.85	1,152,502.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	78.37	385,737.14
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	63.75	599,250.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	36.68	333,788.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	36.65	1,449,617.45
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	213.51	717,607.11
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	268.95	414,720.90
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,119	328.87	3,656,705.53
MASCO CORP	13,282	37.50	498,075.00
MIDDLEBY CORP	2,315	131.93	305,417.95
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,244	279.19	2,022,452.36
OWENS CORNING	4,859	50.25	244,164.75
PACCAR INC	15,714	70.16	1,102,494.24
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,941	182.02	1,081,380.82
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	37.51	262,795.06
RAYTHEON COMPANY	12,344	177.37	2,189,455.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,199	176.22	916,167.78
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,497	347.15	1,561,133.55
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	50.38	358,000.28
SMITH(A.O.) CORP	5,944	55.34	328,940.96
SNAP-ON INC	2,448	168.16	411,655.68
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	87.12	447,535.44
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,882	143.49	987,498.18
TEXTRON INC	10,639	53.34	567,484.26

TRANSDIGM GROUP INC	2,020	476.81	963,156.20
UNITED RENTALS INC	3,677	137.53	505,697.81
UNITED TECHNOLOGIES CORP	35,740	139.73	4,993,950.20
WABCO HOLDINGS INC	2,109	133.22	280,960.98
WABTEC CORP	5,533	71.46	395,388.18
WW GRAINGER INC	1,980	295.00	584,100.00
XYLEM INC	7,965	82.18	654,563.70
CINTAS CORP	4,216	214.80	905,596.80
COPART INC	8,553	65.76	562,445.28
COSTAR GROUP INC	1,507	486.10	732,552.70
EQUIFAX INC	5,242	124.52	652,733.84
IHS MARKIT LTD	17,968	56.30	1,011,598.40
MANPOWERGROUP	3,240	94.56	306,374.40
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	25.34	383,546.24
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	79.47	772,527.87
ROBERT HALF INTL INC	4,666	62.10	289,758.60
ROLLINS INC	6,451	39.11	252,298.61
TRANSUNION	7,559	68.51	517,867.09
VERISK ANALYTICS INC	7,079	138.79	982,494.41
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	91.10	997,818.30
WASTE MANAGEMENT INC	18,801	105.52	1,983,881.52
AMERCO	390	372.93	145,442.70
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	33.41	189,635.16
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	88.58	537,060.54
CSX CORPORATION	35,380	78.54	2,778,745.20
DELTA AIR LINES INC	7,251	56.71	411,204.21
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,504	78.73	590,789.92
FEDEX CORP	10,884	188.87	2,055,661.08
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	96.85	341,202.55
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	123.31	573,268.19
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	5,115	34.72	177,592.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,102	202.81	2,454,406.62
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	152.25	401,787.75
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	53.35	336,958.60
UNION PACIFIC CORP	32,334	175.49	5,674,293.66
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,880	86.86	250,156.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,088	105.13	3,163,151.44
XPO LOGISTICS INC	4,945	66.52	328,941.40
APTIV PLC	11,455	85.45	978,829.75
AUTOLIV INC	4,001	79.71	318,919.71
BORGWARNER INC	8,566	41.57	356,088.62
FORD MOTOR COMPANY	161,371	9.40	1,516,887.40

GENERAL MOTORS CO	55,540	39.11	2,172,169.40
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	19.57	202,216.81
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	36.49	268,092.03
LEAR CORP	2,531	146.67	371,221.77
TESLA INC	5,786	247.63	1,432,787.18
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	44.52	277,315.08
D.R.HORTON INC	15,658	44.45	695,998.10
GARMIN LTD	4,936	85.71	423,064.56
HANESBRANDS INC	13,181	18.74	247,011.94
HASBRO INC	5,156	101.48	523,230.88
LEGGETT & PLATT INC	5,036	41.69	209,950.84
LENNAR CORP-CL A	13,866	51.56	714,930.96
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	177.29	758,623.91
MATTEL INC	14,058	12.28	172,632.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	130.71	374,222.73
NEWELL BRANDS INC	18,477	13.63	251,841.51
NIKE INC -CL B	55,349	87.56	4,846,358.44
NVR INC	143	3,145.78	449,846.54
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	94.79	233,846.93
PULTE GROUP INC	13,052	31.67	413,356.84
PVH CORP	3,303	130.03	429,489.09
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	129.73	269,449.21
TAPESTRY INC	11,987	30.80	369,199.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	22.47	194,005.98
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	20.10	166,649.10
VF CORP	14,995	94.01	1,409,679.95
WHIRLPOOL CORP	2,604	135.04	351,644.16
ARAMARK	10,783	30.80	332,116.40
CARNIVAL CORP	17,764	53.83	956,236.12
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,101	678.07	746,555.07
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	119.15	640,073.80
DOMINO'S PIZZA INC	1,661	276.45	459,183.45
H&R BLOCK INC	7,820	26.04	203,632.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,688	87.63	1,024,219.44
LAS VEGAS SANDS CORP	17,618	67.14	1,182,872.52
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,696	135.68	1,722,593.28
MCDONALD'S CORPORATION	33,687	197.93	6,667,667.91
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	9,499	26.20	248,873.80
MGM MIRAGE	22,498	27.75	624,319.50
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	56.80	518,868.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,767	120.76	937,942.92
STARBUCKS CORP	54,394	77.11	4,194,321.34

VAIL RESORTS INC	1,680	216.81	364,240.80
WYNN RESORTS LTD	4,252	147.00	625,044.00
YUM! BRANDS INC	13,431	103.45	1,389,436.95
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,851	47.41	1,510,055.91
ALPHABET INC-CL A	12,998	1,267.34	16,472,885.32
ALPHABET INC-CL C	13,680	1,263.45	17,283,996.00
ALTICE USA INC-A	16,558	23.29	385,635.82
CBS CORP-CL B	14,639	50.66	741,611.74
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	6,967	366.76	2,555,216.92
COMCAST CORP-CLASS A	198,218	42.93	8,509,498.74
DISCOVERY INC-A	7,075	30.37	214,867.75
DISCOVERY INC-C	12,731	28.56	363,597.36
DISH NETWORK CORP.	9,780	33.86	331,150.80
ELECTRONIC ARTS INC	12,994	92.98	1,208,182.12
FACEBOOK INC-A	104,451	193.26	20,186,200.26
FOX CORPORATION-CLASS A	15,479	38.15	590,523.85
FOX CORPORATION-CLASS B	6,260	37.64	235,626.40
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	229.85	742,645.35
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	22.28	346,320.32
LIBERTY BROADBAND-C	4,072	97.35	396,409.20
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	26.65	224,712.80
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	25.79	608,386.10
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	37.29	319,500.72
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	39.13	299,266.24
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	39.09	161,871.69
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	65.82	399,198.30
NETFLIX INC	19,073	368.33	7,025,158.09
NEWS CORP-CLASS A	16,662	12.35	205,775.70
OMNICOM GROUP	9,445	79.50	750,877.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	5.73	391,083.96
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	92.90	446,663.20
THE WALT DISNEY CO.	78,170	137.24	10,728,050.80
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	52.86	214,135.86
TWITTER INC	29,540	38.48	1,136,699.20
VIACOM INC-CLASS B	14,668	29.20	428,305.60
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	34.11	181,465.20
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	170.64	563,794.56
AMAZON.COM INC	18,070	1,902.25	34,373,657.50
AUTOZONE INC	1,086	1,042.35	1,131,992.10
BEST BUY COMPANY INC	10,543	73.79	777,967.97
BOOKING HOLDINGS INC	2,014	1,866.26	3,758,647.64
BURLINGTON STORES INC	3,144	175.77	552,620.88

CARMAX INC	7,453	76.33	568,887.49
DOLLAR GENERAL CORP	11,733	126.38	1,482,816.54
DOLLAR TREE INC	10,263	110.76	1,136,729.88
EBAY INC	40,316	38.11	1,536,442.76
EXPEDIA GROUP INC	5,168	125.22	647,136.96
GAP INC/THE	9,218	26.03	239,944.54
GENUINE PARTS CO	6,098	103.57	631,569.86
GRUBHUB INC	4,403	69.78	307,241.34
HOME DEPOT INC	48,899	206.50	10,097,643.50
KOHL'S CORP	6,991	71.62	500,695.42
L BRANDS INC	10,675	25.90	276,482.50
LKQ CORPORATION	13,945	29.66	413,608.70
LOWE'S COMPANIES INC	35,353	113.60	4,016,100.80
MACY'S INC	13,521	24.13	326,261.73
MERCADOLIBRE INC	1,842	487.57	898,103.94
NORDSTROM INC	4,756	41.05	195,233.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,483	380.00	1,323,540.00
QURATE RETAIL INC	18,982	17.14	325,351.48
ROSS STORES INC	16,129	98.02	1,580,964.58
TARGET CORP	21,448	81.74	1,753,159.52
TIFFANY & CO	4,643	104.82	486,679.26
TJX COMPANIES INC	54,698	55.08	3,012,765.84
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	105.06	554,506.68
ULTA BEAUTY INC	2,389	353.70	844,989.30
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	153.75	443,876.25
COSTCO WHOLESALE CORP	18,852	245.60	4,630,051.20
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	7.85	105,975.00
KROGER CO	36,791	25.77	948,104.07
SYSCO CORP	21,225	69.37	1,472,378.25
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,877	52.68	1,837,320.36
WALMART INC	63,691	103.52	6,593,292.32
ALTRIA GROUP INC	81,472	51.41	4,188,475.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,953	41.72	1,041,039.16
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	52.67	596,540.42
BUNGE LIMITED	5,968	48.60	290,044.80
CAMPBELL SOUP CO	7,879	38.18	300,820.22
COCA-COLA CO/THE	176,926	47.84	8,464,139.84
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	52.43	490,325.36
CONAGRA BRANDS INC	20,188	30.95	624,818.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,429	212.16	1,576,136.64
GENERAL MILLS INC	25,006	50.22	1,255,801.32
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	39.66	493,489.38

INGREDION INC	3,320	90.52	300,526.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	121.22	595,675.08
KELLOGG CO	11,216	57.94	649,855.04
KRAFT HEINZ COMPANY	27,010	32.52	878,365.20
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	69.20	421,428.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,040	150.97	760,888.80
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	62.80	493,859.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	63,749	50.01	3,188,087.49
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,060	57.90	1,103,574.00
PEPSICO INC	61,370	126.13	7,740,598.10
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	67,209	83.59	5,618,000.31
THE HERSHEY COMPANY	6,652	122.44	814,470.88
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	73.62	929,084.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,995	73.40	733,633.00
CLOROX COMPANY	5,583	155.09	865,867.47
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,318	68.69	2,494,683.42
COTY INC-CL A	22,574	11.10	250,571.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,584	170.39	1,633,017.76
KIMBERLY-CLARK CORP	14,659	124.01	1,817,862.59
PROCTER & GAMBLE CO	107,856	103.28	11,139,367.68
ABBOTT LABORATORIES	76,359	78.11	5,964,401.49
ABIOMED INC	1,839	268.13	493,091.07
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,164	296.74	938,885.36
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	73.72	520,315.76
ANTHEM INC	11,286	255.91	2,888,200.26
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,361	76.25	1,705,026.25
BECTON DICKINSON & CO	11,788	237.43	2,798,824.84
BOSTON SCIENTIFIC CORP	60,163	36.93	2,221,819.59
CARDINAL HEALTH INC	12,873	46.85	603,100.05
CENTENE CORP	18,086	50.23	908,459.78
CERNER CORP	12,409	64.60	801,621.40
CIGNA CORPORATION	16,487	156.81	2,585,326.47
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	281.50	578,482.50
CVS HEALTH CORPORATION	56,224	53.23	2,992,803.52
DANAHER CORP	27,746	130.39	3,617,800.94
DAVITA INC	5,801	53.89	312,615.89
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	50.18	498,989.92
DEXCOM INC	3,778	118.12	446,257.36
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,953	177.22	1,586,650.66
HCA HEALTHCARE INC	11,901	124.56	1,482,388.56
HENRY SCHEIN INC	6,050	63.82	386,111.00
HOLOGIC INC	12,110	45.20	547,372.00

HUMANA INC.	5,930	251.86	1,493,529.80
IDEXX LABORATORIES INC	3,602	227.67	820,067.34
INTUITIVE SURGICAL INC	4,965	517.78	2,570,777.70
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	154.72	681,541.60
MCKESSON CORP	8,396	115.21	967,303.16
MEDTRONIC PLC	58,391	86.86	5,071,842.26
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	94.24	556,958.40
RESMED INC	5,931	102.25	606,444.75
STRYKER CORP	14,641	187.17	2,740,355.97
TELEFLEX INC	1,951	281.31	548,835.81
UNITEDHEALTH GROUP INC	41,826	230.79	9,653,022.54
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	131.70	495,192.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	133.70	550,844.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,787	137.11	793,455.57
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,377	258.77	615,096.29
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,965	124.72	1,118,114.80
ABBVIE INC	65,300	79.34	5,180,902.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,657	76.72	1,124,485.04
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,529	135.68	1,292,894.72
ALKERMES PLC	6,413	30.31	194,378.03
ALLERGAN PLC	14,642	141.49	2,071,696.58
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	87.88	343,435.04
AMGEN INC	28,043	180.48	5,061,200.64
BEIGENE LTD-ADR	1,790	120.82	216,267.80
BIOGEN INC	9,022	229.89	2,074,067.58
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	85.31	641,189.96
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	70,962	45.64	3,238,705.68
CELGENE CORP	30,503	93.92	2,864,841.76
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,022	32.39	389,392.58
ELI LILLY & CO	39,173	118.23	4,631,423.79
GILEAD SCIENCES INC	56,422	64.14	3,618,907.08
ILLUMINA INC	6,286	319.20	2,006,491.20
INCYTE CORP	7,576	73.94	560,169.44
IQVIA HOLDINGS INC	6,827	137.36	937,756.72
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	128.53	334,692.12
JOHNSON & JOHNSON	116,247	139.65	16,233,893.55
MERCK & CO. INC.	113,055	76.34	8,630,618.70
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	731.01	812,883.12
MYLAN NV	22,501	26.68	600,326.68
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	31.78	223,540.52
PERRIGO CO PLC	5,561	50.13	278,772.93
PFIZER INC	251,314	39.61	9,954,547.54

REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	349.99	1,187,166.08
SEATTLE GENETICS INC	4,290	71.09	304,976.10
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	43,466	15.14	658,075.24
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,582	269.55	4,739,228.10
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,809	102.04	184,590.36
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,111	174.61	1,940,091.71
WATERS CORP	3,459	213.38	738,081.42
ZOETIS INC	20,804	101.83	2,118,471.32
BANK OF AMERICA CORP	403,970	30.08	12,151,417.60
BB & T CORPORATION	34,052	50.21	1,709,750.92
CIT GROUP INC	4,770	52.49	250,377.30
CITIGROUP INC	106,175	68.73	7,297,407.75
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	35.72	719,472.24
COMERICA INC	7,145	77.28	552,165.60
EAST WEST BANCORP INC	6,233	50.57	315,202.81
FIFTH THIRD BANCORP	33,814	28.26	955,583.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,722	106.12	713,338.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	13.68	626,913.36
JPMORGAN CHASE & CO	144,145	113.61	16,376,313.45
KEYCORP	45,615	17.14	781,841.10
M & T BANK CORP	5,767	167.78	967,587.26
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	17.12	240,279.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,108	134.24	2,699,297.92
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,311	15.47	731,901.17
SIGNATURE BANK	2,508	131.44	329,651.52
SUNTRUST BANKS INC	19,640	64.27	1,262,262.80
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	247.36	577,090.88
US BANCORP	67,348	51.84	3,491,320.32
WELLS FARGO & COMPANY	194,421	47.51	9,236,941.71
ZIONS BANCORPORATION	8,874	48.36	429,146.64
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	112.09	252,426.68
ALLY FINANCIAL INC	17,783	29.78	529,577.74
AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,731	115.88	3,676,988.28
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,450	145.06	935,637.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,742	22.15	260,085.30
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	43,253	48.55	2,099,933.15
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,287	211.95	11,930,029.65
BLACKROCK INC	5,227	474.45	2,479,950.15
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,562	88.05	1,810,484.10
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	101.74	500,866.02
CME GROUP INC.	15,517	178.01	2,762,181.17
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,482	77.53	1,122,789.46

E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	50.19	550,433.73
EATON VANCE CORP	5,530	41.61	230,103.30
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	35.44	477,341.36
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,555	201.40	2,931,377.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,685	80.82	1,995,041.70
INVESCO LIMITED	18,328	21.94	402,116.32
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	20.25	260,921.25
KKR & CO INC -A	22,146	24.11	533,940.06
MOODY'S CORP	7,497	193.23	1,448,645.31
MORGAN STANLEY	56,688	47.29	2,680,775.52
MSCI INC-A	3,805	223.28	849,580.40
NASDAQ INC	5,459	89.44	488,252.96
NORTHERN TRUST CORP	9,144	97.57	892,180.08
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	90.21	495,252.90
S&P GLOBAL INC	11,000	219.20	2,411,200.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,994	45.31	2,401,158.14
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	53.29	312,385.98
STATE STREET CORP	16,881	67.09	1,132,546.29
SYNCHRONY FINANCIAL	27,831	33.50	932,338.50
T ROWE PRICE GROUP INC	10,303	107.66	1,109,220.98
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	52.13	614,612.70
VOYA FINANCIAL INC	7,528	54.18	407,867.04
AFLAC INC	32,950	49.18	1,620,481.00
ALLEGHANY CORPORATION	635	647.99	411,473.65
ALLSTATE CORP	14,975	96.47	1,444,638.25
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	101.18	358,076.02
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,171	45.19	1,724,947.49
AON PLC	10,438	179.61	1,874,769.18
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	32.85	585,485.55
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	82.79	628,127.73
ASSURANT INC	2,198	92.31	202,897.38
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	43.92	267,165.36
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	40.29	171,554.82
CHUBB LTD	20,144	141.71	2,854,606.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	93.57	590,520.27
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	228.50	377,025.00
FNF GROUP	10,851	39.71	430,893.21
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	50.97	775,508.55
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	65.13	598,740.09
LOEWS CORPORATION	10,639	49.68	528,545.52
MARKEL CORP	577	1,029.44	593,986.88
MARSH & MCLENNAN COS	21,899	93.91	2,056,535.09

METLIFE INC	36,314	44.71	1,623,598.94
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	55.78	663,782.00
PROGRESSIVE CORP	25,645	75.60	1,938,762.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,334	102.74	1,883,635.16
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	148.21	447,890.62
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	151.46	227,795.84
TORCHMARK CORPORATION	4,615	86.55	399,428.25
TRAVELERS COS INC(THE)	11,489	139.19	1,599,153.91
UNUM GROUP	9,769	36.46	356,177.74
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,809	60.62	352,141.58
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	180.17	983,728.20
CBRE GROUP INC-A	13,193	51.29	676,668.97
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,132	122.66	2,224,071.12
EQUINIX INC	3,520	453.89	1,597,692.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	6.99	365,577.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	153.73	308,536.11
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	199.53	954,950.58
ACCENTURE PLC-CL A	27,971	179.95	5,033,381.45
ADOBE INC	21,222	277.66	5,892,500.52
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	78.61	581,242.34
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	153.98	342,143.56
ANSYS INC	3,662	191.93	702,847.66
AUTODESK INC	9,505	175.32	1,666,416.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,060	163.86	3,123,171.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	117.06	573,594.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	67.49	790,577.86
CDK GLOBAL INC	5,003	61.20	306,183.60
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,542	119.15	660,329.30
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	99.52	562,387.52
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,483	72.93	1,858,475.19
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	64.34	761,399.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,238	111.55	1,588,248.90
FIRST DATA CORP-CLASS A	25,471	25.60	652,057.60
FISERV INC	17,328	86.30	1,495,406.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	257.22	983,609.28
FORTINET INC	5,937	92.90	551,547.30
GARTNER INC	4,011	158.04	633,898.44
GLOBAL PAYMENTS INC	6,630	143.43	950,940.90
GODADDY INC - CLASS A	8,240	80.70	664,968.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,511	138.63	5,477,409.93
INTUIT INC	10,638	263.84	2,806,729.92
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	147.30	473,127.60

LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	66.39	403,252.86
MASTERCARD INC-CL A	39,948	245.61	9,811,628.28
MICROSOFT CORP	317,048	129.15	40,946,749.20
ORACLE CORPORATION	115,301	55.01	6,342,708.01
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	245.46	961,466.82
PAYCHEX INC	14,050	83.23	1,169,381.50
PAYPAL HOLDINGS INC	49,082	110.22	5,409,818.04
PTC INC	5,462	90.83	496,113.46
RED HAT INC	7,685	182.30	1,400,975.50
SABRE CORP	9,850	22.69	223,496.50
SALESFORCE.COM, INC.	33,542	163.09	5,470,364.78
SERVICENOW INC	7,838	260.69	2,043,288.22
SPLUNK INC	6,247	135.76	848,092.72
SQUARE INC-A	13,915	72.65	1,010,924.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	65.67	593,788.14
SYMANTEC CORPORATION	27,227	24.13	656,987.51
SYNOPSYS INC	6,139	119.70	734,838.30
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,137	118.95	373,146.15
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	99.69	715,674.51
VERISIGN INC	4,603	189.18	870,795.54
VISA INC	76,412	161.02	12,303,860.24
VMWARE INC	3,612	200.16	722,977.92
WESTERN UNION COMPANY	19,054	19.18	365,455.72
WIX.COM LTD	1,874	129.95	243,526.30
WORKDAY INC-CLASS A	6,686	198.82	1,329,310.52
WORLDPAY INC-CL A	13,124	112.35	1,474,481.40
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,101	100.63	1,318,353.63
APPLE INC	206,313	205.28	42,351,932.64
ARISTA NETWORKS INC	2,260	318.11	718,928.60
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	83.76	345,928.80
CDW CORP/DE	6,306	105.25	663,706.50
CISCO SYSTEMS INC	195,468	56.33	11,010,712.44
COGNEX CORP	7,187	54.73	393,344.51
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	25.48	224,300.44
CORNING INC	34,504	33.56	1,157,954.24
DELL TECHNOLOGIES INC-C	6,212	67.00	416,204.00
F5 NETWORKS INC	2,620	162.47	425,671.40
FLEX LTD	23,204	10.78	250,139.12
FLIR SYSTEMS INC	5,286	52.03	275,030.58
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	62,873	16.01	1,006,596.73
HP INC	69,703	19.60	1,366,178.80
IPG PHOTONICS CORP	1,776	173.69	308,473.44

JUNIPER NETWORKS INC	15,026	28.11	422,380.86
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,598	87.74	666,648.52
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,507	145.54	1,092,568.78
NETAPP INC	11,136	73.51	818,607.36
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	46.07	522,065.24
TE CONNECTIVITY LTD	14,855	95.51	1,418,801.05
TRIMBLE INC	10,356	40.30	417,346.80
WESTERN DIGITAL CORP	12,583	52.95	666,269.85
XEROX CORP	9,697	32.21	312,340.37
AT&T INC	316,421	30.34	9,600,213.14
CENTURYLINK INC	40,608	11.43	464,149.44
SPRINT CORP	36,740	5.61	206,111.40
T-MOBILE US INC	15,128	72.71	1,099,956.88
VERIZON COMMUNICATIONS INC	180,419	55.85	10,076,401.15
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	30.60	282,774.60
AES CORPORATION	27,194	17.59	478,342.46
ALLIANT ENERGY CORP	11,027	46.87	516,835.49
AMEREN CORPORATION	10,336	72.26	746,879.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,663	84.83	1,837,672.29
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,199	106.53	873,439.47
ATMOS ENERGY CORP	4,697	100.98	474,303.06
CENTERPOINT ENERGY INC	22,526	30.51	687,268.26
CMS ENERGY CORPORATION	13,137	54.76	719,382.12
CONSOLIDATED EDISON INC	13,131	84.52	1,109,832.12
DOMINION ENERGY INC	32,632	76.55	2,497,979.60
DTE ENERGY COMPANY	8,162	124.17	1,013,475.54
DUKE ENERGY CORP	30,963	90.45	2,800,603.35
EDISON INTERNATIONAL	13,539	63.58	860,809.62
ENERGY CORP	8,240	95.21	784,530.40
EVERGY INC	11,852	57.19	677,815.88
EVERSOURCE ENERGY	13,730	70.84	972,633.20
EXELON CORP	42,258	50.39	2,129,380.62
FIRSTENERGY CORP	21,413	41.15	881,144.95
NEXTERA ENERGY INC	20,521	190.48	3,908,840.08
NISOURCE INC	15,794	27.84	439,704.96
NRG ENERGY INC	13,738	40.89	561,746.82
OGE ENERGY CORP	9,056	42.28	382,887.68
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	95.14	487,116.80
PPL CORPORATION	32,318	30.80	995,394.40
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,330	59.00	1,258,470.00
SEMPRA ENERGY	11,513	127.34	1,466,065.42
SOUTHERN CO	44,322	52.44	2,324,245.68

	UGI CORPORATION	7,497	53.74	402,888.78
	VISTRA ENERGY CORP	13,852	26.80	371,233.60
	WEC ENERGY GROUP INC	13,718	77.80	1,067,260.40
	XCEL ENERGY INC	22,653	55.99	1,268,341.47
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,452	27.66	1,091,242.32
	ANALOG DEVICES INC	15,993	115.02	1,839,514.86
	APPLIED MATERIALS INC	41,888	44.45	1,861,921.60
	BROADCOM INC	18,128	311.82	5,652,672.96
	INTEL CORP	198,426	57.61	11,431,321.86
	KLA-TENCOR CORPORATION	7,579	125.41	950,482.39
	LAM RESEARCH CORP	7,045	205.08	1,444,788.60
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	25.40	682,675.80
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	59.67	693,484.74
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	97.48	986,205.16
	MICRON TECHNOLOGY INC	49,314	42.75	2,108,173.50
	NVIDIA CORP	25,195	186.91	4,709,197.45
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,971	97.68	1,462,367.28
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	22.41	390,718.35
	QORVO INC	4,855	77.30	375,291.50
	QUALCOMM INC	53,148	85.07	4,521,300.36
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	88.53	702,751.14
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,115	117.17	4,934,614.55
	XILINX INC	11,291	115.86	1,308,175.26
	米ドル 小計	13,179,414		1,092,401,893.86 (122,185,151,828)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	17,074	8.82	150,592.68
	CAMECO CORP	16,384	15.12	247,726.08
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	51,907	40.71	2,113,133.97
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	13.73	568,875.09
	ENBRIDGE INC	87,692	51.05	4,476,676.60
	ENCANA CORP	66,377	9.93	659,123.61
	HUSKY ENERGY INC	14,553	14.42	209,854.26
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	39.94	519,180.06
	INTER PIPELINE LTD	18,081	22.25	402,302.25
	KEYERA CORP	8,467	31.30	265,017.10
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	49.54	1,075,067.54
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	20.31	183,561.78
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	8,534	10.55	90,033.70
	SUNCOR ENERGY INC	69,996	44.71	3,129,521.16
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	21.48	276,812.76
	TRANSCANADA CORP	39,882	64.18	2,559,626.76
	VERMILION ENERGY INC	5,586	35.76	199,755.36

AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	54.80	531,395.60
BARRICK GOLD CORP	74,120	17.33	1,284,499.60
CCL INDUSTRIES INC-CL B	7,680	56.48	433,766.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	14.65	463,994.80
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	93.45	754,328.40
KINROSS GOLD CORP	57,099	4.30	245,525.70
LUNDIN MINING CORP	28,209	7.25	204,515.25
METHANEX CORPORATION	2,452	73.02	179,045.04
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	13,955	42.74	596,436.70
NUTRIEN LTD	26,986	71.64	1,933,277.04
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	20,669	31.04	641,565.76
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.15	96,980.05
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	66.58	191,284.34
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	28.84	564,629.52
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	2.48	188,112.96
CAE INC	10,030	31.36	314,540.80
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	24.03	146,943.45
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	33.09	272,992.50
WSP GLOBAL INC	4,524	72.80	329,347.20
THOMSON REUTERS CORP	8,224	82.00	674,368.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,885	126.78	4,042,380.30
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,426	300.38	1,930,241.88
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	73.41	1,074,795.81
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	50.90	461,459.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,929	88.62	968,527.98
STARS GROUP INC/THE	6,424	25.19	161,820.56
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.81	519,550.99
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	149.07	360,302.19
DOLLARAMA INC	12,110	41.58	503,533.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,017	78.81	1,498,729.77
EMPIRE CO LTD A	7,235	29.94	216,615.90
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	65.36	558,109.04
METRO INC	11,418	49.03	559,824.54
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	100.32	312,195.84
SAPUTO INC	9,854	45.80	451,313.20
AURORA CANNABIS INC	28,563	12.22	349,039.86
BAUSCH HEALTH COS INC	14,796	32.03	473,915.88
CANOPY GROWTH CORP	8,388	65.06	545,723.28
CRONOS GROUP INC	8,026	22.34	179,300.84
BANK OF MONTREAL	27,525	105.34	2,899,483.50
BANK OF NOVA SCOTIA	53,488	72.90	3,899,275.20
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,662	111.65	2,083,612.30

	NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	63.50	934,402.50	
	ROYAL BANK OF CANADA	62,800	105.38	6,617,864.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	78,715	75.06	5,908,347.90	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	38,058	64.72	2,463,113.76	
	CI FINANCIAL CORP	11,041	19.22	212,208.02	
	IGM FINANCIAL INC	3,023	36.87	111,458.01	
	ONEX CORPORATION	4,217	78.28	330,106.76	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	626.68	722,562.04	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	33.79	479,818.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	52.62	255,259.62	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	108.33	678,579.12	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,843	24.45	2,074,411.35	
	POWER CORP OF CANADA	14,595	30.48	444,855.60	
	POWER FINANCIAL CORP	11,076	31.75	351,663.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	55.26	1,427,034.24	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.30	139,429.80	
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	12.20	317,114.60	
	CGI INC-CL A	11,470	96.00	1,101,120.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	1,176.62	997,773.76	
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	51.73	604,671.97	
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,824	295.37	1,129,494.88	
	BCE INC	6,928	60.05	416,026.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,795	66.77	1,121,402.15	
	TELUS CORPORATION	7,611	49.39	375,907.29	
	ALTAGAS LTD	9,753	17.73	172,920.69	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	46.08	139,622.40	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	36.85	270,626.40	
	EMERA INC	2,409	50.61	121,919.49	
	FORTIS INC	17,933	49.58	889,118.14	
	HYDRO ONE LTD	15,052	21.55	324,370.60	
	カナダドル 小計	1,818,255		82,357,364.42 (6,831,543,378)	
ユーロ	ENAGAS	10,471	25.33	265,230.43	
	ENI SPA	111,408	15.50	1,727,492.44	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	21,793	15.02	327,330.86	
	NESTE OYJ	16,896	32.22	544,389.12	
	OMV AG	6,314	49.20	310,648.80	
	REPSOL SA	59,389	14.89	884,302.21	
	SNAM SPA	103,665	4.50	466,803.49	
	TENARIS S.A.	18,477	12.92	238,815.22	
	TOTAL SA	105,643	49.90	5,272,113.91	
	VOPAK	3,130	40.78	127,641.40	

AIR LIQUIDE SA	18,664	119.00	2,221,016.00
AKZO NOBEL	9,650	77.00	743,050.00
ARCELORMITTAL	27,576	19.79	545,894.49
ARKEMA	3,250	92.62	301,015.00
BASF SE	40,465	72.76	2,944,233.40
COVESTRO AG	8,053	50.50	406,676.50
CRH PLC	35,595	29.57	1,052,544.15
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	26.52	171,027.48
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	38.78	130,688.60
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	71.82	472,144.68
IMERYS SA	1,384	47.76	66,099.84
KONINKLIJKE DSM NV	8,310	101.50	843,465.00
LANXESS	3,160	52.40	165,584.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,196	26.45	269,684.20
SOLVAY SA	3,263	107.70	351,425.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	11.85	292,801.65
SYMRISE AG	5,581	83.60	466,571.60
THYSSENKRUPP AG	19,367	13.05	252,739.35
UMICORE	8,730	34.36	299,962.80
UPM-KYMMENE OYJ	21,957	26.16	574,395.12
VOESTALPINE AG	5,079	29.30	148,814.70
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,705	40.49	473,935.45
AIRBUS SE	25,353	121.90	3,090,530.70
ALSTOM RGPT	6,452	39.75	256,467.00
ANDRITZ AG	2,248	42.80	96,214.40
BOUYGUES SA	11,049	34.70	383,400.30
BRENTAG AG	6,629	47.38	314,082.02
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.63	415,976.08
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	35.72	759,727.85
DASSAULT AVIATION SA	89	1,337.00	118,993.00
EIFFAGE SA	3,580	91.46	327,426.80
FERROVIAL SA	21,420	21.70	464,814.00
GEA GROUP AG	8,178	25.50	208,539.00
HOCHTIEF AG	825	132.20	109,065.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,347	45.82	336,639.54
KION GROUP AG	3,179	59.86	190,294.94
KONE OYJ-B	15,370	49.85	766,194.50
LEGRAND SA	12,541	64.10	803,878.10
LEONARDO SPA	18,310	10.51	192,529.65
METSO OYJ	3,963	34.46	136,564.98
MTU AERO ENGINES AG	2,421	205.60	497,757.60
OSRAM LICHT AG	4,588	30.50	139,934.00

PRYSMIAN SPA	9,379	16.60	155,691.40
REXEL SA	12,854	11.18	143,707.72
SAFRAN SA	14,623	125.15	1,830,068.45
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,527	76.46	1,798,874.42
SIEMENS AG-REG	33,130	105.64	3,499,853.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	15.74	180,726.68
THALES SA	4,530	110.75	501,697.50
VINCI S.A.	22,212	88.70	1,970,204.40
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	14.71	278,157.64
BIC	1,337	76.50	102,280.50
BUREAU VERITAS SA	12,626	21.98	277,519.48
EDENRED	9,497	41.89	397,829.33
RANDSTAD NV	4,694	51.30	240,802.20
TELEPERFORMANCE	2,489	170.60	424,623.40
WOLTERS KLUWER-CVA	12,856	61.88	795,529.28
AENA SME SA	2,881	160.80	463,264.80
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	181.20	243,895.20
ATLANTIA SPA	22,160	23.62	523,419.20
BOLLORE	39,433	4.16	164,277.87
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	22.06	204,275.60
DEUTSCHE POST AG-REG	43,007	31.02	1,334,292.17
FRAPORT AG	1,856	73.16	135,784.96
GETLINK	16,953	14.23	241,241.19
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	12.07	19,480.98
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,395	75.78	1,090,853.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	65.75	164,901.00
CONTINENTAL AG	4,655	149.02	693,688.10
DAIMLER AG	39,426	57.70	2,274,880.20
FAURECIA	3,127	46.12	144,217.24
FERRARI NV	5,649	121.70	687,483.30
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,785	13.73	628,719.62
MICHELIN (CGDE)-B	7,374	115.35	850,590.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	30.39	167,357.73
PIRELLI & C SPA	17,484	6.40	112,002.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	62.02	410,820.48
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	23.55	615,149.55
RENAULT SA	8,830	59.56	525,914.80
VALEO SA	9,959	30.83	307,035.97
VOLKSWAGEN AG	1,256	159.60	200,457.60
VOLKSWAGEN AG PFD	8,203	155.46	1,275,238.38
ADIDAS AG	8,007	228.75	1,831,601.25
ESSILORLUXOTTICA	12,648	107.55	1,360,292.40

HERMES INTERNATIONAL	1,455	617.80	898,899.00
HUGO BOSS AG	2,203	61.70	135,925.10
KERING	3,212	529.30	1,700,111.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,097	347.85	4,207,941.45
MONCLER SPA	7,711	36.93	284,767.23
PUMA SE	383	529.00	202,607.00
SEB SA	1,032	157.60	162,643.20
ACCOR SA	7,551	37.86	285,880.86
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,636	75.76	275,463.36
SODEXO	3,900	104.10	405,990.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	50.10	85,069.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	15.74	137,347.24
JC DECAUX SA	2,828	28.72	81,220.16
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	13.46	146,108.71
PUBLICIS GROUPE	9,116	51.34	468,015.44
RTL GROUP	1,615	50.40	81,396.00
SES	17,687	14.07	248,856.09
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	47.02	102,550.62
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	82.12	289,308.76
VIVENDI SA	43,372	25.58	1,109,455.76
DELIVERY HERO SE	3,417	39.31	134,322.27
INDITEX	47,526	26.99	1,282,726.74
ZALANDO SE	5,372	42.07	226,000.04
CARREFOUR SA	26,320	17.35	456,652.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	37.67	69,049.11
COLRUYT NV	3,100	64.28	199,268.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,719	13.88	162,659.72
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	53,314	21.25	1,132,922.50
METRO AG	8,344	14.63	122,072.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,749	77.66	2,543,287.34
DANONE	26,497	71.46	1,893,475.62
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	8.93	205,129.73
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	90.15	477,073.80
HEINEKEN NV	11,026	95.52	1,053,203.52
KERRY GROUP PLC-A	7,177	97.20	697,604.40
PERNOD-RICARD SA	9,080	156.35	1,419,658.00
REMY COINTREAU	1,273	119.40	151,996.20
BEIERSDORF AG	4,089	93.74	383,302.86
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	83.15	389,225.15
HENKEL AG & CO KGAA	7,849	88.78	696,834.22
L'OREAL	10,882	243.70	2,651,943.40
UNILEVER NV-CVA	66,846	52.68	3,521,447.28

BIOMERIEUX	1,779	69.50	123,640.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	71.74	658,644.94
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,038	49.52	942,856.95
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,641	35.92	1,459,824.72
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	160.10	209,410.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	37.47	246,702.48
BAYER AG	40,487	61.04	2,471,326.48
EUROFINS SCIENTIFIC	484	382.00	184,888.00
GRIFOLS S.A.	11,922	24.41	291,016.02
IPSEN	1,498	115.10	172,419.80
MERCK KGAA	5,705	95.12	542,659.60
ORION OYJ	4,259	29.93	127,471.87
QIAGEN N.V.	10,011	34.36	343,977.96
RECORDATI SPA	4,578	35.54	162,702.12
SANOFI	48,997	73.62	3,607,159.14
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	118.10	183,645.50
UCB SA	5,244	70.20	368,128.80
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	21.36	404,045.76
AIB GROUP PLC	36,918	4.05	149,739.40
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,783	5.36	1,570,488.01
BANCO DE SABADELL SA	235,029	0.97	228,589.20
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	715,372	4.48	3,207,370.36
BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	5.61	211,328.70
BANKIA SA	48,396	2.33	112,859.47
BANKINTER,S.A.	26,969	7.00	188,783.00
BNP PARIBAS	48,733	46.76	2,278,998.74
CAIXABANK	149,132	2.81	419,806.58
COMMERZBANK AG	46,644	7.62	355,473.92
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	12.01	595,679.67
ERSTE GROUP BANK AG	13,217	35.87	474,093.79
ING GROEP NV-CVA	167,689	11.33	1,899,916.37
INTESA SANPAOLO	629,216	2.27	1,432,724.83
KBC GROUPE SA	10,878	65.08	707,940.24
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.35	250,465.26
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	23.67	158,044.59
SOCIETE GENERALE	33,369	27.54	918,982.26
UNICREDIT SPA	88,548	12.05	1,067,534.68
AMUNDI SA	2,379	62.60	148,925.40
DEUTSCHE BANK AG -REG	85,363	7.47	638,429.87
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	117.80	969,140.60
EURAZEO	2,123	68.15	144,682.45

EXOR NV	4,683	59.26	277,514.58
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	87.54	295,447.50
NATIXIS	45,362	5.16	234,430.81
WENDEL	1,082	119.70	129,515.40
AEGON NV	74,580	4.60	343,590.06
AGEAS	9,051	46.43	420,237.93
ALLIANZ SE-REG	18,395	213.30	3,923,653.50
ASSICURAZIONI GENERALI	51,717	17.06	882,292.02
AXA SA	82,899	23.70	1,964,706.30
CNP ASSURANCES	8,978	21.38	191,949.64
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,386	135.00	322,110.00
MAPFRE SA	46,367	2.62	121,574.27
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,592	222.60	1,467,379.20
NN GROUP NV	12,995	38.55	500,957.25
POSTE ITALIANE SPA	26,562	9.22	245,007.88
SAMPO OYJ-A SHS	19,253	41.32	795,533.96
SCOR SE	7,100	39.29	278,959.00
AROUNDTOWN SA	34,226	7.22	247,180.17
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,160	40.33	651,732.80
VONOVIA SE	21,107	44.93	948,337.51
ADYEN NV	435	722.20	314,157.00
AMADEUS IT GROUP SA	18,637	71.00	1,323,227.00
ATOS SE	4,547	94.70	430,600.90
CAPGEMINI SA	7,156	114.00	815,784.00
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	142.40	787,329.60
SAP SE	42,783	115.04	4,921,756.32
WIRECARD AG	5,104	129.00	658,416.00
INGENICO S.A.	2,691	73.56	197,949.96
NOKIA OYJ	248,108	4.69	1,164,991.11
1&1 DRILLISCH AG	2,188	32.90	71,985.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	147,602	14.92	2,202,221.84
ELISA OYJ	5,909	37.51	221,646.59
ILIAD SA	1,016	91.56	93,024.96
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.68	380,064.43
ORANGE S.A.	86,822	14.31	1,242,856.93
PROXIMUS SA	6,313	24.90	157,193.70
TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.48	241,251.93
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.45	114,150.74
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.84	115,001.71
TELEFONICA S.A.	204,679	7.38	1,511,349.73
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,179	35.26	147,351.54
E.ON SE	94,119	9.66	910,036.61

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	108,125	3.37	364,381.25
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	12.40	355,111.20
	ENDESA S.A.	12,944	22.31	288,780.64
	ENEL SPA	345,715	5.53	1,914,569.67
	ENGIE	78,100	13.00	1,015,300.00
	FORTUM OYJ	19,573	18.24	357,011.52
	IBERDROLA SA	266,679	8.14	2,172,900.49
	INNOGY SE	5,851	41.30	241,646.30
	NATURGY ENERGY GROUP SA	16,170	25.11	406,028.70
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	18.28	378,627.49
	RWE AG	22,852	22.61	516,683.72
	SUEZ	17,725	12.23	216,776.75
	TERNA SPA	66,384	5.41	359,137.44
	UNIPER SE	8,953	27.00	241,731.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,481	21.20	455,397.20
	VERBUND AG	3,661	43.48	159,180.28
	ASML HOLDING NV	17,784	185.36	3,296,442.24
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	21.20	1,026,852.12
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	16.56	464,375.52
	ユーロ 小計	8,662,238		170,543,469.14 (21,212,196,691)
英債券	BP PLC	880,162	5.69	5,010,762.26
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	196,048	24.75	4,853,168.24
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	161,322	24.96	4,026,597.12
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.14	167,872.40
	ANGLO AMERICAN PLC	44,719	20.34	909,584.46
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.30	180,860.45
	BHP GROUP PLC	93,051	18.30	1,703,577.70
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,100	50.84	259,284.00
	FRESNILLO PLC	8,512	7.45	63,482.49
	GLENCORE PLC	499,559	3.21	1,605,832.40
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,294	33.59	245,005.46
	MONDI PLC	17,733	17.10	303,322.96
	RIO TINTO PLC	49,970	45.43	2,270,386.95
	ASHTREAD GROUP PLC	19,216	21.53	413,720.48
	BAE SYSTEMS PLC	147,630	4.92	727,520.64
	BUNZL PLC	13,431	23.37	313,882.47
	DCC PLC	4,734	68.56	324,563.04
	FERGUSON PLC	9,945	54.48	541,803.60
	MEGGITT PLC	36,960	5.35	197,883.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	1.97	419,314.05
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	9.27	664,464.33

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT-NEW	5,089,209	0.00	5,089.20
SMITHS GROUP PLC	18,742	15.31	287,033.73
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	17.64	162,722.19
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	5.19	59,406.86
EXPERIAN PLC	37,857	22.35	846,103.95
G4S PLC	74,291	2.22	165,000.31
INTERTEK GROUP PLC	6,794	53.52	363,614.88
RELX PLC	86,570	17.39	1,505,885.15
EASYJET PLC	7,630	11.75	89,690.65
ROYAL MAIL PLC	36,064	2.48	89,619.04
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	6.02	239,449.13
BURBERRY GROUP PLC	17,470	19.95	348,526.50
PERSIMMON PLC	13,916	22.70	315,893.20
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.81	235,965.49
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	37.82	201,807.52
CARNIVAL PLC	8,091	40.41	326,957.31
COMPASS GROUP PLC	69,382	17.56	1,218,694.83
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.61	157,595.62
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,220	49.50	357,390.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.66	119,353.96
TUI AG-DI	17,636	8.48	149,623.82
WHITBREAD PLC	7,771	47.95	372,619.45
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.75	241,888.85
INFORMA PLC	54,642	7.81	426,863.30
ITV PLC	151,064	1.36	206,655.55
PEARSON PLC	30,241	8.65	261,584.65
WPP PLC	54,571	9.06	494,413.26
KINGFISHER PLC	109,678	2.65	290,866.05
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.84	202,634.00
NEXT PLC	5,485	58.50	320,872.50
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.16	138,533.76
TESCO PLC	426,993	2.48	1,060,650.61
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.15	217,445.01
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	25.19	422,461.49
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	101,055	29.82	3,013,460.10
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	27.58	240,056.32
DIAGEO PLC	105,194	31.76	3,340,961.44
IMPERIAL BRANDS PLC	39,951	24.13	964,217.38
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,280	61.20	1,791,936.00
UNILEVER PLC	48,087	45.53	2,189,401.11
CONVATEC GROUP PLC	61,239	1.33	81,876.54
NMC HEALTH PLC	3,733	27.07	101,052.31

	SMITH & NEPHEW PLC	37,643	14.83	558,433.90
	ASTRAZENECA PLC	54,428	58.89	3,205,264.92
	GLAXOSMITHKLINE PLC	218,523	15.55	3,398,469.69
	BARCLAYS PLC	752,904	1.60	1,207,658.01
	HSBC HOLDINGS PLC	865,588	6.61	5,729,326.97
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,083,967	0.63	1,961,711.40
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.50	522,887.50
	STANDARD CHARTERED PLC	125,623	6.51	818,810.71
	3I GROUP PLC	46,773	10.79	504,914.53
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	22.25	245,595.50
	INVESTEC PLC	33,008	4.90	161,805.21
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	50.40	654,040.80
	SCHRODERS PLC	6,213	31.95	198,505.35
	ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	11.30	246,679.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.78	285,595.03
	ADMIRAL GROUP PLC	7,842	22.42	175,817.64
	AVIVA PLC	181,146	4.18	758,639.44
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.42	216,448.38
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.75	685,902.97
	PRUDENTIAL PLC	113,202	17.49	1,980,468.99
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.45	220,930.63
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	19.17	349,272.62
	SAGE GROUP PLC/THE	51,945	7.25	376,912.92
	BT GROUP PLC	365,274	2.24	821,683.86
	VODAFONE GROUP PLC	1,195,988	1.39	1,669,838.44
	CENTRICA PLC	254,915	1.04	265,493.97
	NATIONAL GRID PLC	147,017	8.31	1,222,005.30
	SEVERN TRENT PLC	9,868	20.23	199,629.64
	SSE PLC	44,560	11.40	508,206.80
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.47	281,263.29
	英ポンド 小計	18,165,603		78,260,975.77 (11,282,102,267)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	21.93	221,514.93
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	617.50	198,217.50
	GIVAUDAN-REG	413	2,605.00	1,075,865.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,578	52.16	1,073,348.48
	SIKA AG	5,281	151.85	801,919.85
	ABB LTD	81,000	20.97	1,698,570.00
	GEBERIT AG-REG	1,593	423.60	674,794.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	700	218.80	153,160.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	222.20	377,962.20
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	58.46	410,330.74

	SGS SA	255	2,649.00	675,495.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	148.50	350,757.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	22,695	75.00	1,702,125.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	313.00	416,290.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	60.30	151,714.80
	DUFREY AG-REG	1,180	102.30	120,714.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,818.00	198,162.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,795.00	305,775.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	78,100.00	312,400.00
	NESTLE SA-REGISTERED	133,100	97.26	12,945,306.00
	ALCON INC	18,997	59.57	1,131,651.29
	SONOVA HOLDING AG	2,643	203.10	536,793.30
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	844.00	367,140.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	308.60	975,176.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	94,985	81.98	7,786,870.30
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,356	264.50	8,029,162.00
	VIFOR PHARMA AG	1,781	135.35	241,058.35
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	113,020	13.67	1,544,983.40
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	49.47	472,834.26
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	79.35	148,146.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	679	768.60	521,879.40
	UBS GROUP AG	168,121	13.55	2,278,880.15
	BALOISE HOLDING AG	1,987	174.00	345,738.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	477.20	702,438.40
	SWISS RE AG	13,910	98.28	1,367,074.80
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,621	325.30	2,153,811.30
	SWISS PRIME SITE-REG	3,252	82.55	268,452.60
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,416	167.50	404,680.00
	SWISSCOM AG-REG	1,242	472.50	586,845.00
	スイスフラン 小計	768,805		53,728,037.30 (5,887,518,327)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	319.30	2,182,096.20
	BOLIDEN AB	11,543	285.30	3,293,217.90
	ALFA LAVAL AB	12,041	220.80	2,658,652.80
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	206.80	8,981,324.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,698	300.00	8,909,400.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,558	276.00	4,294,008.00
	EPIROC AB-A	30,249	101.80	3,079,348.20
	EPIROC AB-B	16,107	96.88	1,560,446.16
	SANDVIK AB	51,127	179.15	9,159,402.05
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	177.65	2,791,059.15
	SKF AB-B SHARES	16,642	174.05	2,896,540.10

	VOLVO AB-B SHS	70,432	153.00	10,776,096.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	165.20	2,021,056.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	248.80	2,748,244.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	89.92	1,671,882.56	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	167.46	6,070,090.08	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	342.90	1,217,295.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	451.00	3,407,305.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,040	278.60	7,811,944.00	
	NORDEA BANK ABP	130,401	77.50	10,106,077.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	70,758	91.42	6,468,696.36	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,140	104.20	7,204,388.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	152.35	5,946,220.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	211.70	1,326,512.20	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	443.80	8,829,401.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	262.70	2,957,213.90	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	312.20	978,434.80	
	ERICSSON LM-B SHS	136,211	94.32	12,847,421.52	
	HEXAGON AB-B SHS	11,065	528.20	5,844,533.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	548.50	1,477,659.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,857	129.25	2,437,267.25	
	TELIA CO AB	126,963	40.80	5,180,090.40	
	スウェーデンクローナ 小計	1,082,309		157,133,324.23 (1,840,031,226)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	4,085	307.40	1,255,729.00	
	EQUINOR ASA	50,025	195.80	9,794,895.00	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	38.36	2,318,248.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	370.60	2,776,535.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,466	211.80	1,157,698.80	
	MOWI ASA	19,167	186.85	3,581,353.95	
	ORKLA ASA	33,915	68.86	2,335,386.90	
	DNB ASA	44,986	167.55	7,537,404.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,997	159.70	1,117,420.90	
	TELENOR ASA	31,196	168.30	5,250,286.80	
	ノルウェークローネ 小計	263,763		37,124,959.09 (478,169,473)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	656.60	2,689,433.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	297.10	3,032,499.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	8,593	612.60	5,264,071.80	
	ISS A/S	6,409	207.70	1,331,149.30	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,250.00	1,386,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	8,818.00	2,601,310.00	
	DSV A/S	8,340	588.80	4,910,592.00	

	PANDORA A/S	4,763	279.10	1,329,353.30
	CARLSBERG AS-B	4,678	842.20	3,939,811.60
	COLOPLAST-B	4,991	689.00	3,438,799.00
	DEMANT A/S	4,455	194.80	867,834.00
	GENMAB A/S	2,773	1,105.00	3,064,165.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	278.40	806,246.40
	NOVO NORDISK A/S-B	80,049	323.40	25,887,846.60
	DANSKE BANK A/S	29,784	126.55	3,769,165.20
	TRYG A/S	5,005	202.00	1,011,010.00
	ORSTED A/S	7,645	500.00	3,822,500.00
	デンマーククローネ 小計	185,147		69,151,787.50 (1,152,068,779)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,863	27.45	380,539.35
	OIL SEARCH LTD	60,868	8.18	497,900.24
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	7.57	564,623.59
	SANTOS LTD	71,529	7.42	530,745.18
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	23.88	106,958.52
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,965	36.75	1,505,463.75
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	15.15	202,767.60
	ALUMINA LTD	106,977	2.30	246,047.10
	AMCOR LIMITED	50,321	15.97	803,626.37
	BHP GROUP LTD	128,266	38.20	4,899,761.20
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	14.14	326,478.46
	BORAL LIMITED	42,214	4.90	206,848.60
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	7.60	553,736.00
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.41	209,220.55
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	19.23	359,427.93
	NEWCREST MINING LIMITED	36,464	24.75	902,484.00
	ORICA LIMITED	17,981	19.06	342,717.86
	RIO TINTO LIMITED	15,921	98.39	1,566,467.19
	SOUTH32 LTD	223,474	3.40	759,811.60
	CIMIC GROUP LTD	4,062	50.20	203,912.40
	BRAMBLES LIMITED	67,015	12.08	809,541.20
	SEEK LIMITED	12,504	18.38	229,823.52
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.81	417,912.04
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,068	26.28	685,067.04
	CROWN RESORTS LTD	16,521	13.45	222,207.45
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,408	44.86	152,882.88
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	44.17	117,050.50	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.91	365,176.34	
REA GROUP LTD	3,067	80.50	246,893.50	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.18	85,869.74	

	WESFARMERS LIMITED	49,461	35.99	1,780,101.39
	COLES GROUP LIMITED	46,407	12.54	581,943.78
	WOOLWORTHS GROUP LTD	60,049	31.94	1,917,965.06
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	16,808	8.86	148,918.88
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	17.30	553,323.20
	COCHLEAR LIMITED	2,350	180.10	423,235.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	64.18	396,311.50
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	25.48	454,486.76
	CSL LIMITED	19,604	195.00	3,822,780.00
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	123,408	27.35	3,375,208.80
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	9.32	166,371.32
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.30	204,362.30
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	76,964	75.16	5,784,614.24
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	121,980	25.66	3,130,006.80
	WESTPAC BANKING CORPORATION	148,099	27.58	4,084,570.42
	AMP LIMITED	129,763	2.35	304,943.05
	ASX LTD	9,287	74.16	688,723.92
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	8.15	187,629.30
	MACQUARIE GROUP LTD	14,246	135.77	1,934,179.42
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	7.91	798,925.82
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.86	368,150.64
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	13.02	758,115.54
	SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.68	716,462.64
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,680	18.24	358,963.20
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.38	573,690.78
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.92	122,885.36
	AGL ENERGY LIMITED	28,043	22.44	629,284.92
	AUSNET SERVICES	85,220	1.78	152,117.70
	オーストラリアドル 小計	2,990,278		52,920,233.44 (4,149,475,504)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,032	5.26	163,228.32
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	8.00	340,268.53
	A2 MILK CO LTD	30,349	16.46	499,544.54
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	15.99	351,444.21
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	12.30	243,786.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	94,956	3.67	348,488.52
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,184	4.09	237,972.56
	ニュージーランドドル 小計	298,827		2,184,732.68 (161,997,928)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	123,424	82.30	10,157,795.20
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	16.36	1,137,020.00
	MTR CORPORATION	67,000	46.40	3,108,800.00

	MINH GROUP LTD	32,000	25.60	819,200.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	59.10	3,309,600.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	25.20	680,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	103,000	58.10	5,984,300.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	15.96	702,240.00	
	SANDS CHINA LTD	110,800	42.05	4,659,140.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.02	705,280.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	9.15	732,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	21.25	1,504,500.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	9.16	3,641,100.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	25.10	1,325,782.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	35.05	5,502,850.00	
	HANG SENG BANK LTD	33,100	204.20	6,759,020.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	50,700	270.40	13,709,280.00	
	AIA GROUP LTD	527,400	79.85	42,112,890.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	118,924	64.35	7,652,759.40	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	23.30	978,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.38	1,801,240.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,622	49.20	2,835,002.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	42.85	1,242,650.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	33.90	932,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	13.10	3,423,462.30	
	SINO LAND CO	124,200	13.94	1,731,348.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	135.20	9,464,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,000	99.95	1,799,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	31.85	1,688,050.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	22.20	1,309,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	60.35	2,896,800.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	56.05	1,849,650.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.75	921,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	62.85	1,885,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	74,100	88.15	6,531,915.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.70	854,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	397,286	18.62	7,397,465.32	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	54.75	3,285,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	94.35	1,160,505.00	
	香港ドル 小計	3,984,309		168,192,494.62 (2,398,424,973)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.91	404,926.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.72	118,918.40	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.89	265,687.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.56	140,400.00	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.64	308,088.00
	SATS LTD	26,800	5.23	140,164.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.59	240,382.94
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	0.96	270,875.50
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	46,550	2.49	115,909.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	36.26	170,422.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.29	102,544.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.61	252,339.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	27.25	2,095,525.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,700	11.77	1,585,419.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	60,500	27.04	1,635,920.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.26	258,456.00
	CAPITALAND LTD	104,500	3.56	372,020.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	9.11	146,671.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.66	166,222.00
	VENTURE CORP LTD	11,900	19.29	229,551.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	366,915	3.14	1,152,113.10
	シンガポールドル 小計	2,013,451		10,172,553.44 (834,556,284)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	20.10	577,091.10
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	499.00	401,695.00
	BANK HAPOLIM BM	44,062	25.80	1,136,799.60
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	24.80	1,626,235.20
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	79.80	434,271.60
	AZRIELI GROUP	2,140	215.20	460,528.00
	NICE LTD	2,768	498.30	1,379,294.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	2.57	257,703.73
	イスラエルシュケル 小計	249,620		6,273,618.63 (193,227,453)
	合 計	53,662,019		178,606,464,111 (178,606,464,111)

(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 600銘柄	66.0%	68.4%
カナダドル	株式 89銘柄	3.7%	3.8%
ユーロ	株式 239銘柄	11.5%	11.9%
英ポンド	株式 93銘柄	6.1%	6.3%
スイスフラン	株式 39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%	0.6%

オーストラリアドル	株式	58銘柄	2.2%	2.3%
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	0.5%	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	452,435.28	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,988	710,141.56	
		AMERICAN TOWER CORP	19,039	3,661,009.31	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	65,636	658,985.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,231,692.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,984	949,055.76	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	4,139	87,043.17	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	422,884.98	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,562	1,025,813.22	
		DUKE REALTY CORP	17,308	533,432.56	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,404	1,246,211.88	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,696	750,404.64	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	551,526.20	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	431,113.28	
		HCP, INC.	20,162	603,247.04	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	606,085.20	
		INVITATION HOMES INC	14,734	364,961.18	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	397,187.25	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	277,914.84	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	336,442.68	
		MACERICH COMPANY/THE	3,806	154,485.54	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	513,924.41	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	338,572.32	
		PROLOGIS INC	27,735	2,092,883.10	
		PUBLIC STORAGE	6,909	1,497,802.11	
		REALTY INCOME CORPORATION	13,440	941,875.20	
REGENCY CENTERS CORP	6,080	409,913.60			
SIMON PROPERTY GROUP INC	13,474	2,396,350.90			
SL GREEN REALTY CORP	3,945	344,911.35			
UDR INC	10,651	475,993.19			
VENTAS INC	16,435	977,553.80			

	VEREIT INC	44,740	367,762.80
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	526,963.93
	WELLTOWER INC	16,526	1,218,792.50
	WEYERHAEUSER CO	31,375	823,907.50
	WP CAREY INC	6,694	523,069.16
	米ドル 小計	512,478	28,902,348.88 (3,232,727,722)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	86,559.75
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	192,052.21
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	120,957.90
	カナダドル 小計	14,851	399,569.86 (33,144,319)
ユーロ	COVIVIO	2,388	230,442.00
	GECINA SA	1,738	231,675.40
	ICADE	1,265	96,393.00
	KLEPIERRE	9,305	299,993.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	922,312.95
	ユーロ 小計	20,633	1,780,816.55 (221,497,962)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	270,851.08
	HAMMERSON PLC	34,414	112,877.92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	305,184.39
	SEGRO PLC	40,873	279,816.55
	英ポンド 小計	152,952	968,729.94 (139,652,108)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	474,676.47
	DEXUS	43,102	552,998.66
	GOODMAN GROUP	75,399	998,282.76
	GPT GROUP	68,818	407,402.56
	LENDLEASE GROUP	25,262	330,426.96
	MIRVAC GROUP	140,993	401,830.05
	SCENTRE GROUP	234,290	923,102.60
	STOCKLAND	103,417	408,497.15
	SYDNEY AIRPORT	49,760	379,171.20
	TRANSURBAN GROUP	115,217	1,572,712.05
	VICINITY CENTRES	146,656	376,905.92
	オーストラリアドル 小計	1,051,301	6,826,006.38 (535,227,160)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	136,000	1,670,080.00
	LINK REIT	92,500	8,449,875.00

香港ドル 小計		228,500	10,119,955.00 (144,310,558)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	353,717.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	250,368.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	245,692.00
	SUNTEC REIT	118,000	217,120.00
シンガポールドル 小計		469,500	1,066,897.00 (87,528,229)
合計			4,394,088,058 (4,394,088,058)

(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	1.7%	73.6%
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%	5.0%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	3.2%
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%	3.3%
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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年 4月26日現在) (平成31年 4月26日現在)

資産の部		(平成30年 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
流動資産			
預金		21,659,687	40,395,507
金銭信託		1,361,774,157	819,944,438
コール・ローン		207,294,528	264,889,127
株式		1,856,620,729	2,983,396,437
投資信託受益証券		286,282,698	205,443,266
投資証券		13,237,602	16,033,917
派生商品評価勘定		136,587,696	212,613,737
現先取引勘定		-	3,000,720,000
未収配当金		1,350,655	3,196,279
前払金		99,958,286	-
差入委託証拠金		366,739,274	907,222,865
流動資産合計		4,351,505,312	8,453,855,573
資産合計		4,351,505,312	8,453,855,573

（平成30年 4月26日現在）

（平成31年 4月26日現在）

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	252,998,103	1,805,238
前受金	-	160,746,345
未払金	-	844
未払解約金	35,631,000	335,678,000
未払利息	607	776
その他未払費用	78,063	132,913
流動負債合計	288,707,773	498,364,116
負債合計	288,707,773	498,364,116
純資産の部		
元本等		
元本	2,878,626,011	5,742,636,631
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,184,171,528	2,212,854,826
元本等合計	4,062,797,539	7,955,491,457
純資産合計	4,062,797,539	7,955,491,457
負債純資産合計	4,351,505,312	8,453,855,573

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、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 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	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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,878,626,011口	5,742,636,631口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4114円 (10,000口当たりの純資産額 14,114円)	1口当たり純資産額 1.3853円 (10,000口当たりの純資産額 13,853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 4月27日 至 平成31年 4月26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、新株予約権証券、投資信託受益証券、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、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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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、投資信託受益証券、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 4月26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	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	1,967,600,096	-	1,867,641,810	99,958,286
	MSCIE 1806	1,967,600,096	-	1,867,641,810	99,958,286
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,079,000,000	-	5,215,587,696	136,587,696
	米ドル	5,079,000,000	-	5,215,587,696	136,587,696
	売建	3,582,000,000	-	3,735,039,817	153,039,817
	米ドル	3,582,000,000	-	3,735,039,817	153,039,817
合計		10,628,600,096	-	10,818,269,323	116,410,407

(平成31年 4月26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	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
	MSCIE 1906	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	米ドル	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	売建	417,000,000	-	416,865,299	134,701
	米ドル	417,000,000	-	416,865,299	134,701
合計		9,175,193,317	-	9,385,732,414	210,808,499

(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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	7,131,406,613円
同期中における追加設定元本額	3,558,112,555円
同期中における一部解約元本額	7,810,893,157円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	603,108,556円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,049,645,455円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	68,332,612円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	560,106,759円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	503,211,661円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,275,102円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,901円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	651,822円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,082,672円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	8,535,337円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,394,792円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,320,560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>	24,768,782円
合計	2,878,626,011円

（平成31年 4月26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	2,878,626,011円
同期中における追加設定元本額	4,007,992,951円
同期中における一部解約元本額	1,143,982,331円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,216,433,946円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,366,945,879円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,011,050,786円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	966,886,784円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	929,156,206円
イオン・バランス戦略ファンド	34,214,964円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,300,944円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	12,743,929円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	8,973,559円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	41,732,939円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	32,975,659円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	77,343,543円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,269,337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>	21,608,156円
合計	5,742,636,631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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	6,800	1.19	8,146.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	944	15.44	14,575.36	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	452	38.00	17,176.00	
	51JOB INC-ADR	131	92.26	12,086.06	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	1,698	19.67	33,399.66	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	697	43.82	30,542.54	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	759	92.25	70,017.75	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,890	36.17	68,361.30	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,914	44.68	85,517.52	
	58.COM INC-ADR	500	70.98	35,490.00	
	AUTOHOME INC-ADR	312	111.94	34,925.28	

	BAIDU INC - SPON ADR	1,470	167.93	246,857.10	
	IQIYI INC-ADR	665	22.97	15,275.05	
	MOMO INC-SPON ADR	770	36.87	28,389.90	
	NETEASE.COM INC -ADR	413	277.97	114,801.61	
	SINA CORP	342	63.01	21,549.42	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	483	17.20	8,307.60	
	WEIBO CORP-SPON ADR	290	69.84	20,253.60	
	YY INC-ADR	261	83.08	21,683.88	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	6,888	187.88	1,294,117.44	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	196	44.59	8,739.64	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	2,173	42.50	92,352.50	
	JD.COM INC-ADR	3,881	29.23	113,441.63	
	PINDUODUO INC-ADR	1,013	23.07	23,369.91	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	2,313	7.99	18,480.87	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	283	29.25	8,277.75	
	CREDICORP LTD	360	233.70	84,132.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	151	56.82	8,579.82	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	5,900	1.51	8,926.70	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	312	38.23	11,927.76	
	米ドル 小計	44,261		2,559,702.05 (286,302,674)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	80,400	8.82	709,128.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	18,600	56.67	1,054,062.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	740	220.14	162,903.60	
	MEXICHEM SAB DE CV	5,600	44.77	250,712.00	
	ALFA S.A.B. -A	16,100	20.12	323,932.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	2,800	73.50	205,800.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,105	313.20	346,086.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,900	194.22	369,018.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,355	189.62	256,935.10	
	ALSEA SAB DE CV	1,900	42.82	81,358.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	13,000	39.09	508,170.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	1,584	92.13	145,933.92	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	700	121.33	84,931.00	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	27,800	55.75	1,549,850.00	

	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,300	107.42	247,066.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	2,800	119.47	334,516.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	10,300	181.09	1,865,227.00	
	GRUMA S.A.B. -B	1,130	194.40	219,672.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	8,700	41.64	362,268.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	8,100	33.52	271,512.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	9,695	31.15	301,999.25	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	13,800	122.14	1,685,532.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	12,400	28.57	354,268.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	178,900	14.81	2,649,509.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	2,900	82.45	239,105.00	
	メキシコペソ 小計	424,609		14,579,493.87	(85,581,629)
ブラジルリアル	COSAN SA	900	45.96	41,364.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	15,800	30.66	484,428.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	20,800	27.80	578,240.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3,800	21.25	80,750.00	
	BRASKEM SA-PREF A	900	47.30	42,570.00	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. -CSN	3,300	14.51	47,883.00	
	GERDAU S.A. -PREF	5,500	14.58	80,190.00	
	SUZANO SA	2,915	43.34	126,336.10	
	VALE SA	16,900	50.33	850,577.00	
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	3,800	19.17	72,846.00	
	WEG SA	4,430	19.05	84,391.50	
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	6,400	11.82	75,648.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	3,200	34.30	109,760.00	
	RUMO SA	5,800	17.22	99,876.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	7,400	9.85	72,890.00	
	B2W CIA DIGITAL	961	37.14	35,691.54	
	LOJAS AMERICANAS SA	3,900	15.37	59,943.00	
	LOJAS RENNER S.A.	3,800	45.85	174,230.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	400	175.00	70,000.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	1,900	22.27	42,313.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	2,100	21.06	44,226.00	
	COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	800	98.43	78,744.00	

	RAIA DROGASIL SA	1,200	67.95	81,540.00	
	AMBEV SA	25,100	18.31	459,581.00	
	BRF-BRASIL FOODS SA	2,800	30.72	86,016.00	
	JBS SA	5,100	20.49	104,499.00	
	M DIAS BRANCO SA	400	41.89	16,756.00	
	NATURA COSMETICOS SA	1,000	49.28	49,280.00	
	HYPERMARCAS SA	1,800	25.80	46,440.00	
	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	21,384	36.07	771,320.88	
	BANCO BRADESCO SA	6,408	31.00	198,648.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	4,600	49.10	225,860.00	
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	25,800	33.72	869,976.00	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	23,480	12.04	282,699.20	
	BM&F BOVESPA SA	10,900	34.77	378,993.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	3,700	28.53	105,561.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	600	98.00	58,800.00	
	PORTO SEGURO SA	400	56.22	22,488.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	4,400	12.50	55,000.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	1,500	23.78	35,670.00	
	CIELO SA	6,500	7.93	51,545.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	2,400	46.70	112,080.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	4,500	11.77	52,965.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	1,200	33.23	39,876.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	1,200	35.72	42,864.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	4,600	14.53	66,838.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	1,800	44.30	79,740.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,050	43.85	46,042.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	900	80.75	72,675.00	
	ブラジルリアル 小計	280,428		7,766,650.72	(219,407,882)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,072	8,420.00	17,446,240.00	
	EMPRESAS CMPC SA	7,013	2,244.90	15,743,483.70	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	661	23,902.00	15,799,222.00	
	LATAM AIRLINES GROUP	1,729	6,697.00	11,579,113.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	4,174	4,968.90	20,740,188.60	
	CENCOSUD SA	8,340	1,269.00	10,583,460.00	

	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	883	9,250.10	8,167,838.30	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,886	2,425.00	4,573,550.00	
	BANCO DE CHILE	134,212	99.00	13,286,988.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	253	45,122.00	11,415,866.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	350,519	48.78	17,098,316.82	
	ITAU CORPBANCA	563,090	5.96	3,357,705.67	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	553	7,028.00	3,886,484.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	9,579	382.90	3,667,799.10	
	COLBUN SA	28,906	148.50	4,292,541.00	
	ENEL AMERICAS SA	159,519	120.00	19,142,280.00	
	ENEL CHILE SA	161,886	69.29	11,217,080.94	
	チリペソ 小計	1,435,275		191,998,157.13 (31,756,495)	
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	27,602	3,075.00	84,876,150.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	1,687	8,090.00	13,647,830.00	
	GRUPO ARGOS SA	1,064	18,500.00	19,684,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,342	41,080.00	55,129,360.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	2,521	42,340.00	106,739,140.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	20,785	1,280.00	26,604,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,345	36,400.00	48,958,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	414	34,760.00	14,390,640.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	2,669	16,020.00	42,757,380.00	
	コロンビアペソ 小計	59,429		412,787,300.00 (14,241,161)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	344	22.46	7,726.24	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	169	19.20	3,244.80	
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	
	OPAP SA	1,325	9.35	12,388.75	
	JUMBO S.A.	663	16.25	10,773.75	
	ALPHA BANK AE	5,089	1.44	7,328.16	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,414	12.30	17,392.20	
	ユーロ 小計	9,127		59,444.30 (7,393,682)	
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	717	126.30	90,557.10	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,241	8.84	72,850.44	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	2,720	4.51	12,267.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,111	20.96	44,246.56	
	KOC HOLDING AS	4,446	16.36	72,736.56	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	2,885	5.75	16,588.75	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	599	23.86	14,292.14	
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	2,022	13.73	27,762.06	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	51.20	13,158.40	
	ARCELIK AS	866	17.24	14,929.84	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	1,216	79.80	97,036.80	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	20.16	15,301.44	
	AKBANK T.A.S.	16,296	6.14	100,057.44	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	13,127	8.13	106,722.51	
	TURKIYE HALK BANKASI A.S.	2,289	5.88	13,459.32	
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	5.54	53,632.74	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	3,363	7.70	25,895.10	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	6,378	12.50	79,725.00	
	トルコリラ 小計	77,973		871,219.40	(16,387,636)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	404	899.50	363,398.00	
	MONETA MONEY BANK AS	2,580	78.90	203,562.00	
	CEZ AS	914	532.50	486,705.00	
	チェココルナ 小計	3,898		1,053,665.00	(5,099,738)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	1,960	3,402.00	6,667,920.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	743	5,800.00	4,309,400.00	
	OTP BANK PLC	1,190	12,870.00	15,315,300.00	
	ハンガリーフォリント 小計	3,893		26,292,620.00	(10,146,322)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	546	86.44	47,196.24	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,642	100.80	165,513.60	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	9,982	5.89	58,843.89	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	194	60.10	11,659.40	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	797	104.70	83,445.90	
	CCC SA	106	230.20	24,401.20	
	LPP SA	8	8,495.00	67,960.00	

	CD PROJEKT SA	387	209.90	81,231.30
	CYFROWY POLSAT SA	1,573	26.14	41,118.22
	DINO POLSKA SA	180	124.90	22,482.00
	ALIOR BANK SA	331	59.00	19,529.00
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	120	64.00	7,680.00
	BANK MILLENNIUM SA	2,222	9.64	21,431.19
	BANK PEKAO SA	954	114.30	109,042.20
	MBANK SA	79	433.20	34,222.80
	PKO BANK POLSKI SA	4,685	39.48	184,963.80
	SANTANDER BANK POLSKA SA	190	394.80	75,012.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,212	41.96	134,775.52
	ORANGE POLSKA SA	2,404	5.05	12,140.20
	PGE SA	4,933	9.85	48,590.05
	ポーランドズロチ 小計	34,545		1,251,238.51 (36,260,892)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	11,000	3.59	39,490.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	10,000	8.86	88,600.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	136,000	6.01	817,360.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	18,000	17.56	316,080.00
	CNOOC LTD	95,000	14.66	1,392,700.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	18,000	8.23	148,140.00
	PETROCHINA CO LTD	112,000	5.08	568,960.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	10,000	8.31	83,100.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	20,000	3.15	63,000.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	4,000	5.45	21,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	7,000	47.10	329,700.00
	BBMG CORPORATION - H	9,000	2.76	24,840.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	6.36	73,140.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	21,000	3.10	65,100.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	20,000	7.05	141,000.00
	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	4,000	4.88	19,520.00
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	12,000	7.85	94,200.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	8,800	4.45	39,160.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	7,000	10.78	75,460.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	6.40	38,400.00

MAANSHAN IRON&STEEL-H	6,000	3.94	23,640.00
MMG LIMITED	12,000	3.44	41,280.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	9,000	7.42	66,780.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	3.69	66,420.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	5,500	7.09	38,995.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	30,000	3.22	96,600.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	13,000	4.63	60,190.00
BOC AVIATION LTD	1,300	66.75	86,775.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	24,000	7.66	183,840.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	8,500	26.00	221,000.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	20,000	6.16	123,200.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	10,500	9.12	95,760.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	12,000	7.99	95,880.00
CITIC LIMITED	32,000	11.54	369,280.00
CRRG CORP LTD-H	23,000	7.00	161,000.00
FOSUN INTERNATIONAL	13,500	12.38	167,130.00
FULLSHARE HOLDING LTD	45,000	0.84	37,800.00
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	20.50	82,000.00
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	2.19	24,090.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	10,000	3.04	30,400.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	18.46	36,920.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	5,000	7.60	38,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	3,500	16.92	59,220.00
WEICHAI POWER CO	10,000	12.90	129,000.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,200	8.75	19,250.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H-NEW	418	8.75	3,657.50
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	2,900	40.75	118,175.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	19,000	7.62	144,780.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	6,000	14.12	84,720.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	4,000	6.75	27,000.00
AIR CHINA/HONG KONG	10,000	9.25	92,500.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	10,000	6.94	69,400.00
CAR INC	3,000	6.39	19,170.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	9,500	3.64	34,580.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	6,000	5.39	32,340.00

CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	8,140	16.08	130,891.20
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	5.10	40,800.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	6.70	80,400.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	10,000	8.56	85,600.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	6,000	10.92	65,520.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	5,500	17.06	93,830.00
SINOTRANS LIMITED	8,000	3.28	26,240.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	6,000	8.77	52,620.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	6,500	5.65	36,725.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	16,000	8.61	137,760.00
BYD CO LTD-H	3,500	53.30	186,550.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	18,000	3.34	60,120.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	14,000	7.72	108,080.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,800	28.50	79,800.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	27,000	16.06	433,620.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	16,500	6.53	107,745.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	15,200	8.83	134,216.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	5,000	12.28	61,400.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	6,000	56.55	339,300.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	7,000	21.25	148,750.00
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	120,000	0.23	27,840.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,000	103.90	415,600.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	12,000	1.82	21,840.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	70,000	1.60	112,000.00
CHINA LITERATURE LTD	1,400	35.55	49,770.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	30,400	382.80	11,637,120.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.88	34,320.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	1,800	56.25	101,250.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	3,000	21.00	63,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	12,500	7.06	88,250.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	11,000	2.56	28,160.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	15,000	28.40	426,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	8,000	34.65	277,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	11,000	5.50	60,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	10,000	12.82	128,200.00

TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	47.50	95,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	5,000	7.16	35,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	26,000	6.19	160,940.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	2,000	37.45	74,900.00	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	4,000	69.60	278,400.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	20,000	9.13	182,600.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	12,000	7.65	91,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	4,600	16.24	74,704.00	
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	6,400	31.20	199,680.00	
3SBIO INC	7,000	14.50	101,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	7,000	7.05	49,350.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	24,000	14.80	355,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	7,000	11.00	77,000.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	12,000	4.58	54,960.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	19.44	116,640.00	
LUYE PHARMA GROUP	4,500	6.98	31,410.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	3,000	27.65	82,950.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	14,000	2.05	28,700.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	37,000	7.51	277,870.00	
SSY GROUP LIMITED	10,000	7.26	72,600.00	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	3,000	10.90	32,700.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,500	78.45	196,125.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	155,000	3.60	558,000.00	
BANK OF CHINA LTD	422,000	3.72	1,569,840.00	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	47,000	6.62	311,140.00	
CHINA CITIC BANK	47,000	4.98	234,060.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	511,000	6.91	3,531,010.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	13,000	3.84	49,920.00	
CHINA MERCHANTS BANK- H	21,000	39.70	833,700.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	33,100	5.86	193,966.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	13,000	4.71	61,230.00	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	369,000	5.86	2,162,340.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	42,000	4.61	193,620.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	47,000	2.10	98,700.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	8,000	23.10	184,800.00	

CHINA EVERBRIGHT LIMITED	4,000	14.30	57,200.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO	18,500	5.29	97,865.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	53,000	1.64	86,920.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	5,600	16.96	94,976.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	12,000	17.36	208,320.00	
FAR EAST HORIZON LTD	12,000	8.64	103,680.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	7,600	10.92	82,992.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	3,200	16.66	53,312.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	17,200	10.04	172,688.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	8,600	14.86	127,796.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO.	40,000	21.70	868,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	14,000	32.55	455,700.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	1.58	47,400.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	8,600	23.90	205,540.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	4,400	43.60	191,840.00	
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	39,000	3.24	126,360.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	36,000	9.10	327,600.00	
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	27,500	92.15	2,534,125.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,200	27.85	33,420.00	
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	10,000	11.82	118,200.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	14,000	24.70	345,800.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	30,000	5.10	153,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	20,000	28.70	574,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	16,000	33.65	538,400.00	
CHINA VANKE CO LTD -H	7,000	30.40	212,800.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	18,000	5.20	93,600.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	41,000	12.40	508,400.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	12,000	9.23	110,760.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	3,000	7.17	21,510.00	
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	6,000	15.82	94,920.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	4,000	3.58	14,320.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	8,000	3.31	26,480.00	
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	8,000	9.16	73,280.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	6,000	12.30	73,800.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	8,000	28.25	226,000.00	

SHENZHEN INVESTMENT LTD	22,000	3.09	67,980.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	6,500	23.50	152,750.00	
SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.92	25,920.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	3.52	66,880.00	
SOHO CHINA LTD	7,500	2.87	21,525.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	13,000	39.80	517,400.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	44,000	1.84	80,960.00	
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	6,000	4.23	25,380.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	12,000	9.50	114,000.00	
KINGSOFT CORPORATION LTD.	4,000	18.98	75,920.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	5,000	19.36	96,800.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	4,000	52.35	209,400.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	2,500	13.40	33,500.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	5.96	59,600.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	3,500	26.30	92,050.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	8.42	58,940.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	2,000	21.45	42,900.00	
LENOVO GROUP LTD	38,000	7.23	274,740.00	
MEITU INC	4,500	2.94	13,230.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,800	96.55	366,890.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	18,200	11.98	218,036.00	
ZTE CORPORATION	4,000	25.80	103,200.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	6.51	78,120.00	
CHINA MOBILE LTD	32,500	74.15	2,409,875.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	74,000	4.07	301,180.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	210,000	2.15	451,500.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	32,000	9.49	303,680.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	2,500	42.05	105,125.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	30,000	4.88	146,400.00	
CGN POWER CO LTD-H	56,000	2.08	116,480.00	
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	9,400	25.05	235,470.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	17,000	5.31	90,270.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	16,000	2.03	32,480.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	4,000	37.50	150,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	10,000	11.32	113,200.00	

	DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	2.11	25,320.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	4,200	74.40	312,480.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	16,000	14.50	232,000.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	12,000	3.58	42,960.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	22,000	4.93	108,460.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	30,000	2.18	65,400.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	6.21	24,840.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	2,000	18.30	36,600.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	17,500	8.09	141,575.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	16,000	4.36	69,760.00	
	香港ドル 小計	4,883,958		53,326,874.70 (760,441,233)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	21,300	3.30	70,290.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	900	24.20	21,780.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	13,400	9.05	121,270.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	8,700	4.70	40,890.00	
	GAMUDA BHD	12,500	3.46	43,250.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	3,900	9.86	38,454.00	
	IJM CORP BHD	18,500	2.31	42,735.00	
	SIME DARBY BERHAD	8,700	2.36	20,532.00	
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	2.56	14,080.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	5,600	7.42	41,552.00	
	MISC BHD	4,900	6.80	33,320.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	3.80	14,060.00	
	GENTING BHD	11,300	7.05	79,665.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	17,500	3.22	56,350.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	36.62	18,310.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	500	34.12	17,060.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	10.58	9,522.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	8,100	4.51	36,531.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	2,500	24.70	61,750.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	400	146.50	58,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	3,040	18.74	56,969.60	
	QL RESOURCES BHD	2,400	6.82	16,368.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	12,600	5.09	64,134.00	

	HARTELEGA HOLDINGS BHD	8,000	5.05	40,400.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	11,700	5.55	64,935.00	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	8,700	4.82	41,934.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	3,700	4.01	14,837.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	10,100	4.45	44,945.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	26,400	5.19	137,016.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	3,500	20.00	70,000.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	800	19.24	15,392.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	21,200	9.13	193,556.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	15,700	22.60	354,820.00	
	RHB BANK BHD	5,300	5.80	30,740.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	6,100	1.36	8,296.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	8,700	1.12	9,744.00	
	SP SETIA BHD	5,500	2.28	12,540.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	15,900	3.98	63,282.00	
	DIGI.COM BHD	17,800	4.51	80,278.00	
	MAXIS BERHAD	13,500	5.34	72,090.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	4,100	2.87	11,767.00	
	PETRONAS GAS BHD	3,700	17.54	64,898.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	16,900	12.16	205,504.00	
	YTL CORP BHD	16,000	1.22	19,520.00	
	マレーシアリングット 小計	390,640		2,533,966.60	(68,518,456)
タイバーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	7,600	16.50	125,400.00	
	IRPC PCL-NVDR	53,200	5.60	297,920.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	7,400	136.50	1,010,100.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	56,300	49.50	2,786,850.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	6,600	71.75	473,550.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	9,000	46.25	416,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	11,700	69.50	813,150.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	2,000	456.00	912,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	23,300	68.00	1,584,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	39,800	10.30	409,940.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	30,800	11.50	354,200.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	13,200	37.75	498,300.00	

	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	23,900	15.80	377,620.00	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	1,800	58.75	105,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	7,300	51.00	372,300.00	
	CP ALL PCL-NVDR	27,300	76.75	2,095,275.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	20,000	26.25	525,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	7,000	18.80	131,600.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	22,700	25.25	573,175.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	2,100	176.50	370,650.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	1,300	204.00	265,200.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	6,200	193.00	1,196,600.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	3,300	193.00	636,900.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	18,600	18.90	351,540.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	9,700	130.00	1,261,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	40,100	2.02	81,002.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	2,300	51.00	117,300.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	7,700	76.25	587,125.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	11,100	11.10	123,210.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,800	76.25	137,250.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	5,500	190.00	1,045,000.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	53,200	5.10	271,320.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	500	297.00	148,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	6,900	54.00	372,600.00	
	GLOW ENERGY PLC- NVDR	3,200	91.25	292,000.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	1,600	104.00	166,400.00	
	タイパーツ 小計	546,000		21,286,377.00	(74,289,455)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	11,650	54.00	629,100.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	15,000	14.82	222,300.00	
	DMCI HOLDINGS INC	14,600	11.52	168,192.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	16,310	65.00	1,060,150.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,360	950.00	1,292,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	5,460	124.00	677,040.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	2,550	303.00	772,650.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	5,190	143.60	745,284.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	4,787	81.50	390,140.50	

	BDO UNIBANK INC	10,460	134.00	1,401,640.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	8,460	76.85	650,151.00	
	SECURITY BANK CORP	830	181.20	150,396.00	
	AYALA CORPORATION	1,340	885.00	1,185,900.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	556	852.00	473,712.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	51,900	4.44	230,436.00	
	AYALA LAND INC	40,800	49.50	2,019,600.00	
	MEGAWORLD CORP	41,000	5.59	229,190.00	
	ROBINSONS LAND CO	7,600	24.50	186,200.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	53,700	40.80	2,190,960.00	
	GLOBE TELECOM INC	120	1,780.00	213,600.00	
	PLDT INC	530	1,234.00	654,020.00	
	ABOITIZ POWER CORP	5,400	38.00	205,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,350	385.00	519,750.00	
	フィリピンベソ 小計	300,953		16,267,611.50	(34,812,688)
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	52,700	1,290.00	67,983,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	10,400	4,030.00	41,912,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	8,900	27,675.00	246,307,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	16,100	7,100.00	114,310,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	9,800	21,050.00	206,290,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	5,100	9,475.00	48,322,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	15,800	13,350.00	210,930,000.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	6,050.00	48,400,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	110,200	7,550.00	832,010,000.00	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	21,400	1,710.00	36,594,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	39,200	5,200.00	203,840,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	14,300	9,075.00	129,772,500.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	2,600	80,000.00	208,000,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	54,700	3,390.00	185,433,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	26,000	6,250.00	162,500,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	8,100	46,400.00	375,840,000.00	
	KALBE FARMA PT	112,100	1,470.00	164,787,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	39,600	9,600.00	380,160,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	2,450.00	37,975,000.00	

	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	53,100	27,975.00	1,485,472,500.00	
	PT BANK DANAMON INDONESIA TBK	12,300	8,550.00	105,165,000.00	
	PT BANK MANDIRI	102,000	7,650.00	780,300,000.00	
	PT BANK RAKYAT	300,100	4,330.00	1,299,433,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,395.00	39,339,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	730.00	57,962,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	268,300	3,830.00	1,027,589,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	7,500	3,620.00	27,150,000.00	
	PT PERUSAHAAN GAS NEGARA	65,600	2,340.00	153,504,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,487,000		8,677,281,000.00 (68,550,519)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	272	52,500.00	14,280,000.00	
	S-OIL CORPORATION	239	93,700.00	22,394,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	344	188,500.00	64,844,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	630	20,800.00	13,104,000.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	457	46,950.00	21,456,150.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	49	450,000.00	22,050,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	113	93,000.00	10,509,000.00	
	LG CHEM LTD	244	365,000.00	89,060,000.00	
	LG CHEM LTD	28	202,000.00	5,656,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	91	272,500.00	24,797,500.00	
	OCI COMPANY LTD	110	92,900.00	10,219,000.00	
	POSCO	417	260,500.00	108,628,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	86	56,300.00	4,841,800.00	
	CJ CORP	90	119,000.00	10,710,000.00	
	CJ CORP-CONVERT NEW	7	49,999.00	349,993.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	165	93,500.00	15,427,500.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	5,060.00	3,081,540.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	137	28,600.00	3,918,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	289	31,450.00	9,089,050.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	316	38,450.00	12,150,200.00	
	HANWHA CORPORATION	165	30,100.00	4,966,500.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	128	44,450.00	5,689,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	414	51,100.00	21,155,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	202	122,000.00	24,644,000.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	52	339,000.00	17,628,000.00	
KCC CORP	36	352,500.00	12,690,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	431	34,750.00	14,977,250.00	
LG CORP	504	74,500.00	37,548,000.00	
LOTTE CORPORATION	108	49,600.00	5,356,800.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	136	18,100.00	2,461,600.00	
SAMSUNG C&T CORPORATION	417	105,000.00	43,785,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	932	16,450.00	15,331,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	2,344	8,140.00	19,080,160.00	
SK HOLDINGS CO LTD	174	260,500.00	45,327,000.00	
S1 CORPORATION	106	98,700.00	10,462,200.00	
CJ LOGISTICS CORPORATION	29	155,000.00	4,495,000.00	
GLOVIS CO LTD	111	145,000.00	16,095,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	295	33,750.00	9,956,250.00	
PAN OCEAN CO LTD	783	4,635.00	3,629,205.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	395	39,950.00	15,780,250.00	
HANON SYSTEMS	993	12,350.00	12,263,550.00	
HYUNDAI MOBIS	369	228,000.00	84,132,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	747	138,000.00	103,086,000.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	194	88,700.00	17,207,800.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	87	80,400.00	6,994,800.00	
KIA MOTORS CORPORATION	1,443	42,450.00	61,255,350.00	
FILA KOREA LTD	260	79,700.00	20,722,000.00	
HLB INC	177	83,100.00	14,708,700.00	
LG ELECTRONICS INC	565	77,000.00	43,505,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	275	87,000.00	23,925,000.00	
KANGWON LAND INC	625	33,850.00	21,156,250.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	253	24,550.00	6,211,150.00	
KAKAO CORP	281	116,000.00	32,596,000.00	
NAVER CORPORATION	757	120,500.00	91,218,500.00	
NCSOFT CORP	97	510,000.00	49,470,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	149	125,500.00	18,699,500.00	
PEARLABYSS CORP	21	167,600.00	3,519,600.00	
CJ ENM CO LTD	57	216,300.00	12,329,100.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	167	107,000.00	17,869,000.00	

HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	51	98,600.00	5,028,600.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	178,000.00	10,680,000.00
SHINSEGAE CO LTD	39	321,500.00	12,538,500.00
BGF RETAIL CO LTD	32	222,000.00	7,104,000.00
E-MART INC	111	171,000.00	18,981,000.00
GS RETAIL CO LTD	99	39,400.00	3,900,600.00
CJ CHEILJEDANG CORP	44	314,000.00	13,816,000.00
KT&G CORPORATION	620	102,000.00	63,240,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	116	97,400.00	11,298,400.00
OTTOGI CORPORATION	4	724,000.00	2,896,000.00
AMOREPACIFIC CORP	171	227,000.00	38,817,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	127,000.00	4,191,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	153	79,200.00	12,117,600.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	51	1,395,000.00	71,145,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	8	822,000.00	6,576,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	267	74,100.00	19,784,700.00
CELLTRION INC	447	211,500.00	94,540,500.00
CELLTRION PHARM INC	57	58,600.00	3,340,200.00
HANMI PHARM CO LTD	34	427,000.00	14,518,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	47	72,700.00	3,416,900.00
HELIXMITH CO LTD	72	254,200.00	18,302,400.00
MEDY-TOC INC	23	575,900.00	13,245,700.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	88	338,500.00	29,788,000.00
SILLAJEN INC	315	63,800.00	20,097,000.00
YUHAN CORPORATION	48	247,000.00	11,856,000.00
BS FINANCIAL GROUP INC	1,386	6,990.00	9,688,140.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	620	8,400.00	5,208,000.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	1,637	37,300.00	61,060,100.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,339	14,300.00	19,147,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	2,146	45,750.00	98,179,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	2,305	44,450.00	102,457,250.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	2,515	14,000.00	35,210,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	222	69,100.00	15,340,200.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,099	7,750.00	16,267,250.00
SAMSUNG CARD CO LTD	106	37,550.00	3,980,300.00

	SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	332	36,000.00	11,952,000.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	13,950.00	10,434,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	263	69,400.00	18,252,200.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	3,935.00	3,753,990.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	333	39,350.00	13,103,550.00	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	120	36,100.00	4,332,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	169	304,000.00	51,376,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	372	84,400.00	31,396,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	192	221,000.00	42,432,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	1,311	19,600.00	25,695,600.00	
	LG INNOTEK CO LTD	52	121,000.00	6,292,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	312	110,500.00	34,476,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	25,399	44,650.00	1,134,065,350.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,415	36,000.00	158,940,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	292	230,000.00	67,160,000.00	
	LG UPLUS CORP	649	14,500.00	9,410,500.00	
	SK TELECOM CO LTD	113	248,000.00	28,024,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	1,410	27,850.00	39,268,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	101	46,100.00	4,656,100.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	3,095	80,200.00	248,219,000.00	
	韓国ウォン 小計	77,969		4,259,492,378.00 (411,466,963)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	7,000	115.00	805,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	12,000	41.00	492,000.00	
	CHINA STEEL CORP	69,000	25.00	1,725,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	19,000	109.50	2,080,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	24,000	110.50	2,652,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	28,000	78.00	2,184,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	25,300	41.80	1,057,540.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	437.00	437,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	18,000	32.65	587,700.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,030	297.00	305,910.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	9.66	96,600.00	
	EVA AIRWAYS CORP	7,350	15.20	111,720.00	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	7,350	13.40	98,490.00	

TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	12,000	37.50	450,000.00	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	10,000	40.40	404,000.00	
ECLAT TEXTILE CO LTD	1,000	456.50	456,500.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,000	246.50	493,000.00	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,000	36.70	110,100.00	
GIANT MANUFACTURING CO LTD	2,000	210.00	420,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	252.50	252,500.00	
POU CHEN	12,000	37.40	448,800.00	
RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	1,200	75.10	90,120.00	
TATUNG CO LTD	10,000	24.30	243,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	420.00	420,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	3,000	284.00	852,000.00	
STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	53.10	106,200.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	26,000	71.40	1,856,400.00	
TAI MED BIOLOGICS INC	1,000	164.00	164,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	28,680	18.35	526,278.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	72,000	9.96	717,120.00	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	93,000	20.60	1,915,800.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	52,082	24.25	1,262,988.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	52,340	21.60	1,130,544.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	40,170	19.70	791,349.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	58,000	28.75	1,667,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	56,760	11.70	664,092.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	52,551	14.10	740,969.10	
TAIWAN BUSINESS BANK	14,560	12.10	176,176.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	46,870	20.35	953,804.50	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	16,000	48.35	773,600.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	6,080	133.00	808,640.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	53,000	17.80	943,400.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	44,000	44.35	1,951,400.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,540	25.15	340,531.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	36,000	45.20	1,627,200.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	55,432	8.78	486,692.96	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	3,000	49.00	147,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	42.00	75,600.00	

ACER INC	18,000	21.35	384,300.00
ADVANTECH CO LTD	2,000	253.00	506,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	4,000	237.00	948,000.00
AU OPTRONICS CORP	46,000	11.10	510,600.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	260.00	1,040,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	2,010	75.30	151,353.00
COMPAL ELECTRONICS	22,000	19.80	435,600.00
DELTA ELECTRONICS INC	11,000	162.50	1,787,500.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	5,000	69.80	349,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	69,800	86.80	6,058,640.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	48,000	9.92	476,160.00
INVENTEC CORPORATION	13,000	24.70	321,100.00
LARGAN PRECISION CO LTD	380	4,760.00	1,808,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	11,000	45.10	496,100.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	4,000	86.70	346,800.00
PEGATRON CORP	10,000	59.20	592,000.00
QUANTA COMPUTER INC	14,000	59.80	837,200.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	9,000	38.00	342,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	2,000	209.00	418,000.00
WISTRON CORPORATION	15,293	25.35	387,677.55
WPG HOLDINGS CO LTD	9,520	40.30	383,656.00
YAGEO CORPORATION	1,198	321.50	385,157.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	2,000	113.00	226,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	20,000	110.50	2,210,000.00
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	8,000	75.00	600,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	9,000	112.50	1,012,500.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	19,000	73.60	1,398,400.00
GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	357.00	357,000.00
MEDIATEK INCORPORATION	8,000	288.00	2,304,000.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	6,000	65.50	393,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	3,000	204.50	613,500.00
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	298.00	298,000.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	3,000	75.60	226,800.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	207.00	414,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	131,000	267.50	35,042,500.00

	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	67,000	13.10	877,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	5,000	70.20	351,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	229.50	459,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	11,000	16.65	183,150.00	
	新台湾ドル 小計	1,731,296		103,032,958.61 (371,948,980)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	4,336	358.25	1,553,372.00	
	COAL INDIA LTD	2,537	251.65	638,436.05	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	2,265	275.05	622,988.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	10,006	152.70	1,527,916.20	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	8,177	168.85	1,380,686.45	
	PETRONET LNG LTD	2,229	236.10	526,266.90	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	15,240	1,372.40	20,915,376.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,213	220.55	488,077.15	
	ASIAN PAINTS LTD	1,600	1,447.95	2,316,720.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	1,874	924.80	1,733,075.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	6,713	196.55	1,319,440.15	
	JSW STEEL LTD	4,845	286.60	1,388,577.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	453	1,208.10	547,269.30	
	SHREE CEMENT LTD	31	19,901.80	616,955.80	
	TATA STEEL LTD	2,053	510.75	1,048,569.75	
	ULTRATECH CEMENT LTD	531	4,619.00	2,452,689.00	
	UPL LTD	2,010	965.10	1,939,851.00	
	VEDANTA LTD	7,509	170.45	1,279,909.05	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	4,350	89.85	390,847.50	
	HAVELLS INDIA LTD	1,471	772.90	1,136,935.90	
	LARSEN & TOUBRO LTD	2,611	1,355.15	3,538,296.65	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,056	389.25	1,189,548.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	770	492.20	378,994.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	343	1,483.65	508,891.95	
BAJAJ AUTO LTD	480	3,088.05	1,482,264.00		
BHARAT FORGE LTD	778	480.55	373,867.90		
BOSCH LIMITED	27	17,996.35	485,901.45		
EICHER MOTORS LTD	76	20,340.20	1,545,855.20		
HERO MOTOCORP LTD	186	2,612.25	485,878.50		

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	4,116	665.15	2,737,757.40
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	576	6,905.25	3,977,424.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	3,519	148.15	521,339.85
TATA MOTORS LTD	8,995	221.85	1,995,540.75
TITAN CO LTD	1,748	1,141.30	1,994,992.40
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	2,766	416.10	1,150,932.60
AVENUE SUPERMARTS LTD	731	1,328.05	970,804.55
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	339	2,969.25	1,006,575.75
ITC LIMITED	18,582	304.15	5,651,715.30
NESTLE INDIA LTD	132	10,846.45	1,431,731.40
UNITED SPIRITS LTD	1,080	547.65	591,462.00
DABUR INDIA LIMITED	3,045	395.10	1,203,079.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,052	650.35	1,334,518.20
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	3,508	1,734.20	6,083,573.60
MARICO LTD	1,679	356.45	598,479.55
AUROBINDO PHARMA LIMITED	1,539	795.55	1,224,351.45
CADILA HEALTHCARE LTD	761	323.95	246,525.95
CIPLA LTD	2,022	555.60	1,123,423.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	298	1,716.30	511,457.40
DR.REDDY'S LABORATORIES	646	2,924.90	1,889,485.40
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	514	641.20	329,576.80
LUPIN LTD	1,307	869.20	1,136,044.40
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	481	2,555.10	1,229,003.10
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	4,688	461.00	2,161,168.00
AXIS BANK LIMITED	10,107	740.90	7,488,276.30
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	8,733	1,955.15	17,074,324.95
ICICI BANK LIMITED	12,662	395.40	5,006,554.80
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,624	733.30	1,190,879.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,106	492.55	544,760.30
STATE BANK OF INDIA	9,486	306.20	2,904,613.20
YES BANK LTD	9,092	237.05	2,155,258.60
BAJAJ FINANCE LIMITED	921	3,081.00	2,837,601.00
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	1,125	416.40	468,450.00
REC LTD	2,568	149.30	383,402.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	871	1,153.10	1,004,350.10

	BAJAJ FINSERV LTD	219	7,669.50	1,679,620.50	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	2,883	1,133.70	3,268,457.10	
	INFOSYS LIMITED	18,708	728.55	13,629,713.40	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	4,835	2,195.00	10,612,825.00	
	TECH MAHINDRA LTD	2,623	816.50	2,141,679.50	
	WIPRO LTD	8,014	295.20	2,365,732.80	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	7,746	328.50	2,544,561.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED-RIGHTS	2,196	100.81	221,378.76	
	BHARTI INFRA TEL LTD	1,237	270.70	334,855.90	
	VODAFONE IDEA LTD	7,287	16.85	122,785.95	
	GAIL INDIA LIMITED	4,493	343.10	1,541,548.30	
	NTPC LTD	13,459	132.90	1,788,701.10	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	10,278	191.55	1,968,750.90	
	TATA POWER CO LTD	4,120	67.70	278,924.00	
	インドルピー 小計	300,287		178,472,423.91 (287,340,602)	
エジプトポンド	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	15.41	84,061.55	
	EASTERN TOBACCO	3,310	18.47	61,135.70	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	6,979	74.55	520,284.45	
	エジプトポンド 小計	15,744		665,481.70 (4,325,631)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	920	164.50	151,340.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	313	749.59	234,621.67	
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	2,290	181.25	415,062.50	
	GOLD FIELDS LIMITED	4,709	54.91	258,571.19	
	KUMBA IRON ORE LTD	236	433.18	102,230.48	
	MONDI LTD	684	320.03	218,900.52	
	SAPPI LIMITED	2,041	70.53	143,951.73	
	SASOL LTD.	3,024	482.06	1,457,749.44	
	BIDVEST GROUP LTD	1,887	216.66	408,837.42	
	MULTICHOICE GROUP LTD	1,630	122.35	199,430.50	
	MR PRICE GROUP LTD	1,454	209.70	304,903.80	
	NASPERS LIMITED-N SHS	2,337	3,664.39	8,563,679.43	
	THE FOSCHINI GROUP	1,308	183.95	240,606.60	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	1,619	72.80	117,863.20		

WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	5,717	47.34	270,642.78	
BID CORP LTD	1,848	302.03	558,151.44	
CLICKS GROUP LTD	1,455	197.30	287,071.50	
PICK N PAY STORES LTD	1,342	71.71	96,234.82	
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	2,472	174.27	430,795.44	
SPAR GROUP LIMITED	1,121	193.50	216,913.50	
OCEANA GROUP LTD-NEW	240	74.00	17,760.00	
TIGER BRANDS LTD	929	243.85	226,536.65	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	4,865	26.47	128,776.55	
NETCARE LTD	7,009	23.95	167,865.55	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	2,200	106.53	234,366.00	
ABSA GROUP LTD	3,937	158.19	622,794.03	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	230	1,359.22	312,620.60	
NEDBANK GROUP LTD	2,194	266.14	583,911.16	
STANDARD BANK GROUP LIMITED	6,979	194.53	1,357,624.87	
FIRSTRAND LIMITED	18,182	66.41	1,207,466.62	
INVESTEC LTD	1,024	91.96	94,167.04	
PSG GROUP LTD	877	264.75	232,185.75	
REINET INVESTMENTS SCA	546	234.98	128,299.08	
REMGRO LTD	2,908	194.28	564,966.24	
RMB HOLDINGS LTD	3,993	81.78	326,547.54	
DISCOVERY LTD	2,052	145.46	298,483.92	
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	103.66	48,927.52	
MMI HOLDINGS LTD	3,464	17.68	61,243.52	
OLD MUTUAL LTD	27,099	23.07	625,173.93	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	2,502	35.54	88,921.08	
SANLAM LTD	9,731	77.41	753,276.71	
NEPI ROCKCASTLE PLC	2,150	121.22	260,623.00	
MTN GROUP LIMITED	9,244	102.33	945,938.52	
TELKOM SA SOC LTD	965	83.00	80,095.00	
VODACOM GROUP LIMITED	3,584	117.21	420,080.64	
南アフリカランド 小計	155,783		24,466,209.48 (189,123,799)	
合 計	12,263,068		2,983,396,437 (2,983,396,437)	

(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 30銘柄	3.6%	9.6%
メキシコペソ	株式 25銘柄	1.1%	2.9%
ブラジルリアル	株式 49銘柄	2.8%	7.4%
チリペソ	株式 17銘柄	0.4%	1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	0.2%	0.5%
ユーロ	株式 7銘柄	0.1%	0.2%
トルコリラ	株式 18銘柄	0.2%	0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.1%	0.3%
ポーランドズロチ	株式 20銘柄	0.5%	1.2%
香港ドル	株式 205銘柄	9.6%	25.5%
マレーシアリングット	株式 44銘柄	0.9%	2.3%
タイバーツ	株式 36銘柄	0.9%	2.5%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	0.4%	1.2%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	0.9%	2.3%
韓国ウォン	株式 114銘柄	5.2%	13.8%
新台湾ドル	株式 87銘柄	4.7%	12.5%
インドルピー	株式 78銘柄	3.6%	9.6%
エジプトポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
南アフリカランド	株式 45銘柄	2.4%	6.3%

(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
投資信託受益証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,178	9,518.24	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	15,000	286,500.00	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	30,510	1,088,596.80	
		ISHARES MSCI UAE ETF	13,671	213,677.73	
	米ドル 小計			60,359	1,598,292.77 (178,769,046)
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	40,600	1,609,790.00	
			40,600	1,609,790.00	

		中国元（オフショア）小計		(26,674,220)	
投資信託受益証券合計				205,443,266	
				(205,443,266)	
投資証券	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	18,700	515,185.00	
		メキシコペソ 小計	18,700	515,185.00	(3,024,135)
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	2,200	100,518.00	
		KLABIN SA-UNIT	3,700	63,344.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	1,100	35,189.00	
	ブラジルリアル 小計		7,000	199,051.00	(5,623,190)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	3,905	76,186.55	
		FORTRESS REIT LTD-B	2,984	31,869.12	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	16,578	409,476.60	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	910	65,884.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	31,094	309,385.30	
		RESILIENT REIT LTD	1,090	62,773.10	
	南アフリカランド 小計		56,561	955,574.67	(7,386,592)
投資証券合計				16,033,917	(16,033,917)
合計				221,477,183	(221,477,183)

（注1）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。

（注2）上記以外に現先取引勘定に含まれる国債証券3,000,720,000円があります。

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資信託受益証券 4銘柄	2.2%	-	80.7%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	1.4%
ブラジルリアル	投資証券 3銘柄	-	0.1%	2.5%
南アフリカランド	投資証券 6銘柄	-	0.1%	3.3%
中国元（オフショア）	投資信託受益証券 1銘柄	0.3%	-	12.0%

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。

Jリート・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 4月26日現在）	（平成31年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	108,875,237	119,389,113
コール・ローン	16,573,410	38,569,538
投資証券	9,855,017,840	12,718,162,720
未収入金	131,337,696	156,274,541
未収配当金	102,876,162	111,852,741
流動資産合計	10,214,680,345	13,144,248,653
資産合計	10,214,680,345	13,144,248,653
負債の部		
流動負債		
未払金	-	14,383,851
未払解約金	112,115,901	200,090,000
未払利息	48	113
その他未払費用	10,761	6,468
流動負債合計	112,126,710	214,480,432
負債合計	112,126,710	214,480,432
純資産の部		
元本等		
元本	5,131,265,092	5,748,282,368
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,971,288,543	7,181,485,853
元本等合計	10,102,553,635	12,929,768,221
純資産合計	10,102,553,635	12,929,768,221
負債純資産合計	10,214,680,345	13,144,248,653

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 4月27日 至 平成31年 4月26日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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. 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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,131,265,092口	5,748,282,368口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.9688円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 19,688円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.2493円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 22,493円)</p>

(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 4月27日 至 平成31年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
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

リスク	<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、投資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>
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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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(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)

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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	6,864,702,791円
同期中における追加設定元本額	2,340,084,364円
同期中における一部解約元本額	4,073,522,063円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	278,763,514円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	431,657,987円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	382,042,477円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	253,215,357円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,719,012円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	142,638円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	476,408円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,932,871円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,087,211円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	7,895,831円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,546,422円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	850,204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)	2,042,384,122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)	1,177,011,982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>	21,532,121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>	209,987,752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>	100,670,910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>	215,348,273円
合計	5,131,265,092円

(平成31年 4月26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	5,131,265,092円
同期中における追加設定元本額	4,291,910,342円
同期中における一部解約元本額	3,674,893,066円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	924,366,881円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	870,273,854円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	832,359,678円
イオン・バランス戦略ファンド	119,998,945円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	634,337,452円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,309,201円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	7,582,448円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,477,505円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	17,206,371円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,219,373円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,827,257円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,636,404円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	449,196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)	983,874,679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)	578,315,919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>	78,756,375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>	23,779,298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>	241,284,470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>	115,538,605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>	284,688,457円
合計	5,748,282,368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
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	140	14,294,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	130	14,495,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	450	256,050,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,532	156,264,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,553	230,309,900	
	産業ファンド投資法人	1,581	200,154,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,322	410,481,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	840	151,116,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	712	331,080,000	
	GLP投資法人	3,359	402,408,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	561	165,102,300	
	日本プロロジスリート投資法人	1,820	434,980,000	
	星野リゾート・リート投資法人	206	111,240,000	
	Oneリート投資法人	198	54,628,200	
	イオンリート投資法人	1,394	187,632,400	
	ヒューリックリート投資法人	1,096	200,020,000	
	日本リート投資法人	439	182,404,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	8,047	136,477,120	
	日本ヘルスケア投資法人	61	10,510,300	
	積水ハウス・リート投資法人	3,499	280,969,700	
	トーセイ・リート投資法人	260	29,952,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	499	134,530,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	285	32,433,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	272	27,580,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,222	688,608,200	
	いちごホテルリート投資法人	237	30,596,700	
	ラサールロジポート投資法人	1,021	121,805,300	
スターアジア不動産投資法人	420	45,570,000		
マリモ地方創生リート投資法人	116	13,328,400		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	328	115,948,000		
大江戸温泉リート投資法人	219	19,074,900		
さくら総合リート投資法人	294	25,783,800		

投資法人みらい	1,464	71,662,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	316	43,292,000	
三菱地所物流リート投資法人	143	36,693,800	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	134	15,182,200	
ザイマックス・リート投資法人	125	14,850,000	
タカラレーベン不動産投資法人	202	18,927,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	209	21,046,300	
日本ビルファンド投資法人	1,314	942,138,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,357	837,269,000	
日本リテールファンド投資法人	2,564	546,132,000	
オリックス不動産投資法人	2,703	528,436,500	
日本プライムリアルティ投資法人	858	381,810,000	
プレミア投資法人	1,289	177,753,100	
東急リアル・エステート投資法人	909	159,075,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	935	120,147,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,993	532,155,400	
森トラスト総合リート投資法人	968	162,527,200	
インヴィンシブル投資法人	4,684	263,709,200	
フロンティア不動産投資法人	462	213,906,000	
平和不動産リート投資法人	845	106,301,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	886	210,956,600	
福岡リート投資法人	702	121,586,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	419	312,155,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,124	115,322,400	
大和証券オフィス投資法人	313	235,063,000	
阪急阪神リート投資法人	613	90,907,900	
スターツプロシード投資法人	216	37,454,400	
大和ハウスリート投資法人	1,821	465,265,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,367	396,086,900	
日本賃貸住宅投資法人	1,527	131,169,300	
ジャパンエクセレント投資法人	1,213	193,352,200	
合計	74,788	12,718,162,720	

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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（平成30年 4月26日現在）

（平成31年 4月26日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	37,943,931	24,025,748
金銭信託	3,434,490	85,127,412
コール・ローン	522,811	27,501,041
投資証券	4,013,265,189	5,377,489,103
未収入金	126,519	47,435
未収配当金	5,070,631	5,509,720
流動資産合計	4,060,363,571	5,519,700,459
資産合計	4,060,363,571	5,519,700,459
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,421,000	110,000,000
未払利息	1	80
その他未払費用	1,243	1,437
流動負債合計	3,422,244	110,001,517
負債合計	3,422,244	110,001,517
純資産の部		
元本等		
元本	2,192,135,055	2,475,122,234
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,864,806,272	2,934,576,708
元本等合計	4,056,941,327	5,409,698,942
純資産合計	4,056,941,327	5,409,698,942
負債純資産合計	4,060,363,571	5,519,700,459

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年 4月27日 至平成31年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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. 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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,192,135,055口	2,475,122,234口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8507円 (10,000口当たりの純資産額 18,507円)	1口当たり純資産額 2.1856円 (10,000口当たりの純資産額 21,856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 4月27日 至 平成31年 4月26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、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、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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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(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)

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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	2,517,086,687円
同期中における追加設定元本額	1,335,510,241円
同期中における一部解約元本額	1,660,461,873円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	158,048,622円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	101,106,811円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	72,762,326円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	673,507,529円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	708,755円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	225,428円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	669,752円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	3,946,220円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	3,958,310円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	10,585,400円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,035,354円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	897,738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）	1,152,168,202円
SMA・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>	8,514,608円
合計	2,192,135,055円

（平成31年 4月26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	2,192,135,055円
同期中における追加設定元本額	2,055,570,269円
同期中における一部解約元本額	1,772,583,090円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	78,329,005円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	78,891,404円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	80,027,060円
イオン・バランス戦略ファンド	21,338,148円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	1,487,090,193円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,374,240円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,100,758円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,627,470円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	22,566,359円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,381,573円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,162,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,839,613円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	459,604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)	585,081,246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>	43,080,884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>	14,772,093円
合計	2,475,122,234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
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,108	88,857.72	
		AGREE REALTY CORP	1,153	77,078.05	
		ALEXANDER'S INC	136	50,987.76	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,643	661,023.91	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,000	46,080.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,299	251,437.55	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,086	20,150.76	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,283	267,068.61	
		AMERICOLD REALTY TRUST	6,218	198,976.00	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	5,984	294,352.96	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,002	163,432.68	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	31,863.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,504	1,100,524.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	6,690.00	

BOSTON PROPERTIES INC	6,319	858,688.91	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	8,078.84	
BRANDYWINE REALTY TRUST	8,718	132,949.50	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,502	205,310.70	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	4,987	104,876.61	
BRT APARTMENTS CORP	500	7,035.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,079	406,635.51	
CARETRUST REIT INC	4,198	99,492.60	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	7,201.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	6,752.10	
CHATHAM LODGING TRUST	706	13,774.06	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	65,458.00	
CITY OFFICE REIT INC	600	6,816.00	
CLIPPER REALTY INC	800	10,360.00	
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	110,300.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	102,015.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	10,950.00	
CORECIVIC INC	5,301	107,822.34	
CORESITE REALTY CORPORATION	1,682	185,591.88	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	120,926.44	
COUSINS PROPERTIES INC	19,083	180,334.35	
CUBESMART	8,150	256,317.50	
CYRUSONE INC	4,095	230,220.90	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,330	110,840.90	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,458	1,013,352.98	
DOUGLAS EMMETT INC	5,906	242,795.66	
DUKE REALTY CORP	13,816	425,809.12	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	1,099	19,529.23	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,502	169,605.84	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	76,850.00	
EPR PROPERTIES	2,875	224,508.75	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,608	147,179.52	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,467	401,825.30	
EQUITY RESIDENTIAL	14,541	1,104,679.77	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	1,346	26,893.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,610	726,467.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,955	505,608.20	
FARMLAND PARTNERS INC	300	1,884.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,809	375,619.48	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,394	154,580.92	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	94,093.02	

FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	28,083.00
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	19,800.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,880	313,860.40
GEO GROUP INC	5,536	106,346.56
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	45,924.48
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	30,340.80
GLADSTONE LAND CORP	600	7,446.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	10,010.00
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	64,815.04
HCP, INC.	19,739	590,590.88
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,720	175,375.20
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	8,986	248,732.48
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	18,018.60
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,629	204,462.93
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,445	195,059.00
HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,423	556,094.70
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,905	207,619.80
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	48,684.09
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,254	44,922.22
INFREIT INC	2,200	46,442.00
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	200	17,320.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	323	18,840.59
INVITATION HOMES INC	13,613	337,194.01
IRON MOUNTAIN INC	11,379	371,524.35
JBG SMITH PROPERTIES	4,364	185,208.16
KILROY REALTY CORP	3,892	299,839.68
KIMCO REALTY CORPORATION	16,855	299,007.70
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	50,969.43
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	64,356.81
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,652	276,552.36
LIFE STORAGE INC	2,102	199,479.80
LTC PROPERTIES INC	1,576	69,848.32
MACERICH COMPANY/THE	4,415	179,204.85
MACK-CALI REALTY CORPORATION	2,370	54,130.80
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	54,841.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,500	15,960.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14,704	256,731.84
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,525	488,654.75
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	48,124.96
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	128,208.96

NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,862	362,107.74
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,600	45,824.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	15,512.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	18,650.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	38,757.84
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,919	52,043.28
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	7,746	278,081.40
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	26,900.00
PARAMOUNT GROUP INC	8,400	120,708.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	7,300	229,439.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,931	185,758.92
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	14,219.10
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,507	154,827.40
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	112,698.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	43,558.00
PROLOGIS INC	25,047	1,890,046.62
PS BUSINESS PARKS INC/CA	947	142,968.59
PUBLIC STORAGE	6,087	1,319,600.73
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,700	77,571.00
REALTY INCOME CORPORATION	12,401	869,062.08
REGENCY CENTERS CORP	6,656	448,747.52
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	72,160.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,355	126,952.30
RETAIL VALUE INC	594	19,803.96
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,197	155,960.52
RLJ LODGING TRUST	7,377	134,040.09
RPT REALTY	2,740	32,496.40
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,074	166,189.62
SABRA HEALTH CARE REIT	7,500	145,050.00
SAFEHOLD INC	600	15,258.00
SAUL CENTERS INC	703	37,652.68
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,696	87,493.28
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	64,875.00
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,277	2,183,464.45
SITE CENTERS CORP	5,797	76,694.31
SL GREEN REALTY CORP	3,568	311,950.24
SPIRIT MTA REIT	1,580	10,775.60
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,849	115,669.40
STAG INDUSTRIAL INC	4,981	144,249.76
STORE CAPITAL CORP	7,400	244,570.00

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	49,450.00
	SUN COMMUNITIES INC	3,636	444,464.64
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	138,896.42
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	70,535.68
	TAUBMAN CENTERS INC	2,883	146,139.27
	TERRENO REALTY CORP	2,200	96,492.00
	TIER REIT INC	1,800	50,184.00
	UDR INC	10,951	489,400.19
	UMH PROPERTIES INC	800	11,080.00
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	215	16,638.85
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	71,580.78
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	9,578.14
	VENTAS INC	14,153	841,820.44
	VEREIT INC	41,292	339,420.24
	VICI PROPERTIES INC	15,411	348,134.49
	VORNADO REALTY TRUST	6,695	464,030.45
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	27,094.60
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,270	91,560.00
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,598	163,461.60
	WELLTOWER INC	15,825	1,167,093.75
	WHITESTONE REIT	200	2,492.00
	WP CAREY INC	6,706	524,006.84
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	84,920.00
	米ドル 小計	936,909	34,938,042.57 (3,907,820,061)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,306	109,488.88
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,068	52,707.20
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	28,422.45
	CAN APARTMENT PROP	2,821	134,674.54
	CHOICE PROPERTIES REIT	5,671	77,295.73
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	36,133.44
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	21,450.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	45,440.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,714	51,253.20
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	42,513.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	34,390.80
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	61,590.00

	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,012	136,051.56
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,332	58,048.80
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	18,590.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	5,778.21
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,755.00
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	29,224.56
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	17,100.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,362	138,393.22
	SLATE OFFICE REIT	1,000	5,810.00
	SLATE RETAIL REIT	500	6,320.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,202	74,295.48
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	17,535.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	1,000	6,640.00
	カナダドル 小計	60,246	1,210,901.07 (100,444,243)
ユーロ	AEDIFICA	732	57,388.80
	AEDIFICA SA-RTS-NEW	732	2,488.80
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,573	92,810.76
	ALTAREA	80	15,104.00
	BEFIMMO SCA	744	38,316.00
	COFINIMMO	838	97,208.00
	COVIVIO	2,501	241,346.50
	EUROCOMMERCIAL	2,211	56,424.72
	GECINA SA	2,344	312,455.20
	GREEN REIT PLC	27,000	45,792.00
	HAMBORNER REIT AG	2,840	26,840.84
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	35,378.00
	ICADE	1,612	122,834.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	22,833.60
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	12,558	119,677.74
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,025	25,368.75
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	15,877.20
	KLEPIERRE	8,926	287,774.24
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	18,497.20
	MERCIALYS	2,280	29,047.20
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	11,605	141,464.95
	MONTEA	302	22,619.80
	NSI NV	727	26,099.30
	RETAIL ESTATES	200	16,820.00
		5,477	850,851.95

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED		
	VASTNED RETAIL	925	29,322.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	838	113,130.00
	WERELDHAVE NV	595	14,744.10
	ユーロ 小計	135,063	2,878,516.55 (358,029,888)
英債券	ASSURA PLC	116,800	67,627.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	69,448.16
	BRITISH LAND CO PLC	37,600	226,502.40
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	4,760.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19,661	17,124.73
	DERWENT LONDON PLC	4,972	159,800.08
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	18,880.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13,270	100,958.16
	HAMMERSON PLC	27,400	89,872.00
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	10,588.50
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	27,485.40
	LAND SECURITIES GROUP PLC	31,795	296,710.94
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	36,987	74,787.71
	LXI REIT PLC	4,000	5,112.00
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	40,488.39
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	15,000	13,875.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	22,148	29,235.36
	RDI REIT PLC	8,020	10,265.60
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,300.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,700	49,434.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	8,520.00
	SEGro PLC	44,637	305,584.90
	SHAFTESBURY PLC	7,700	66,682.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	9,300.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	64,900	97,739.40
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	30,870.00
	UNITE GROUP PLC	11,494	108,273.48
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	64,068.15
	英債券 小計	650,127	2,009,293.56 (289,659,759)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	8,942	33,264.24
	APN INDUSTRIA REIT	1,000	2,850.00
	ARENA REIT	3,100	8,897.00
	BWP TRUST	26,090	97,576.60
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	7,100	26,128.00

	CHARTER HALL GROUP	21,855	218,987.10
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	5,000	23,300.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	54,994.70
	CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	92,250.00
	DEXUS	42,764	548,662.12
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	25,830.00
	GOODMAN GROUP	66,206	876,567.44
	GPT GROUP	66,437	393,307.04
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	18,930	79,884.60
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	336.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	25,314.60
	MIRVAC GROUP	143,584	409,214.40
	NATIONAL STORAGE REIT	11,000	19,195.00
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	22,600.00
	SCENTRE GROUP	219,893	866,378.42
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	110,150.04
	STOCKLAND	95,730	378,133.50
	VICINITY CENTRES	124,829	320,810.53
	VIVA ENERGY REIT	18,000	44,640.00
	オーストラリアドル 小計	1,052,469	4,679,271.33 (366,901,664)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	38,700.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	58,540	101,274.20
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	67,809.57
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44,000	69,960.00
	STRIDE STAPLED GROUP	23,000	46,920.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	40,660.00
	ニュージーランドドル 小計	219,447	365,323.77 (27,088,757)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	475,920.00
	FORTUNE REIT	58,000	586,960.00
	LINK REIT	86,100	7,865,235.00
	PROSPERITY REIT	60,000	202,800.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	213,860.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,000	126,240.00
	香港ドル 小計	337,100	9,471,015.00 (135,056,673)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	33,370.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	22,750.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	103,100	308,269.00

	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	48,000.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	20,115.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	126,700	243,264.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	124,900	298,511.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	30,200.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	53,929.50	
	ESR REIT	57,552	29,927.04	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	30,360.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	26,740.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	36,800	87,216.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	67,648.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	7,450.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	59,000	69,030.00	
	KEPPEL DC REIT	24,000	36,000.00	
	KEPPEL REIT	43,400	52,514.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	7,425.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	82,000	154,980.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	49,800	103,086.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	87,250	127,385.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	112,050.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	36,000	25,740.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	13,000	37,700.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	13,175.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	15,860.00	
	SPH REIT	16,000	16,640.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	40,770.00	
	SUNTEC REIT	96,000	176,640.00	
	シンガポールドル 小計	1,481,152	2,296,744.54 (188,424,922)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	131,920.00	
	イスラエルシュケル 小計	8,000	131,920.00 (4,063,136)	
	合計		5,377,489,103 (5,377,489,103)	

(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 158銘柄	72.2%	72.7%
カナダドル	投資証券 25銘柄	1.9%	1.9%

ユーロ	投資証券	28銘柄	6.6%	6.7%
英ポンド	投資証券	28銘柄	5.4%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券	24銘柄	6.8%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券	6銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券	6銘柄	2.5%	2.5%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	3.5%	3.5%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	0.1%	0.1%

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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	530,333,373	312,110,255
金銭信託	185,518,848	1,047,385,769
コール・ローン	28,240,396	338,365,735
国債証券	179,501,148,876	160,094,281,169
未収入金	-	50,372,692
未収利息	1,525,595,859	1,301,526,987
前払費用	38,534,730	45,707,890
流動資産合計	181,809,372,082	163,189,750,497
資産合計		
	181,809,372,082	163,189,750,497
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,461	-
未払解約金	79,143,754	420,072,631
未払利息	82	991
その他未払費用	35,662	18,100
流動負債合計	79,207,959	420,091,722
負債合計		
	79,207,959	420,091,722
純資産の部		
元本等		
元本	104,217,368,782	92,111,667,202
剰余金		
剰余金又は欠損金()	77,512,795,341	70,657,991,573
元本等合計	181,730,164,123	162,769,658,775
純資産合計		
	181,730,164,123	162,769,658,775
負債純資産合計		
	181,809,372,082	163,189,750,497

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 4月27日 至平成31年 4月26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 4月26日現在)	(平成31年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	104,217,368,782口	92,111,667,202口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7438円 (10,000口当たりの純資産額 17,438円)	1口当たり純資産額 1.7671円 (10,000口当たりの純資産額 17,671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 4月27日 至 平成31年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
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

リスク	<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 (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会議をそれぞれ設け、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議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会議にて、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 4月26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) 「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)

(平成30年 4月26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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	72,760,539	-	72,789,000	28,461
	米ドル	32,816,163	-	32,826,000	9,837
	ユーロ	39,944,376	-	39,963,000	18,624
合計		72,760,539	-	72,789,000	28,461

(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 4月26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 4月27日 至 平成31年 4月26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 4月26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	125,322,708,862円
同期中における追加設定元本額	5,722,372,000円
同期中における一部解約元本額	26,827,712,080円
平成30年 4月26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	9,668,652,987円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	496,733,438円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,398,272,783円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	720,332,583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)	22,179,954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)	8,683,996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)	30,529,246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)	80,071,471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)	75,807,533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)	38,010,912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)	99,079,120円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	12,943,803円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,402,108円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	232,152,798円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	367,591,210円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,169,319円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	878,468円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,866,926円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,715,853円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,614,875円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,761,245円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	7,106,192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>	1,814,319,430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>	645,912,821円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,077,424,363円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,528,378,446円
S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,558,454,265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 >	43,495,798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 >	117,273,174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 >	953,417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 >	909,331,302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 >	130,176,295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 >	1,413,798,037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 >	1,712,577,611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 >	2,691,135,759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 >	7,657,103,435円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	88,717,938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 >	12,533,173,156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)	1,107,396,539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 >	220,662,348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 >	43,471,582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 >	14,667,943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 >	171,087,626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 >	629,568,293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 >	192,369,373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 >	185,753,722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 >	55,155,762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 >	7,151,827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 >	1,566,334,259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 >	24,063,953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 >	4,486,876,371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 >	2,052,684,983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 >	6,986,825,036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 >	1,678,789,460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 >	29,026,520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 >	265,457,486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 >	127,190,307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 >	271,815,747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 >	19,211円
合計	104,217,368,782円

(平成31年 4月26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	104,217,368,782円
同期中における追加設定元本額	8,079,804,274円

同期中における一部解約元本額	20,185,505,854円
平成31年 4月26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	11,016,273,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	591,416,375円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,606,544,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	811,289,304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)	91,821,119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)	8,821,430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)	29,870,669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)	83,335,203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)	103,813,269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)	54,778,231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)	127,497,633円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,013,381円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	278,321,489円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	284,675,131円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	277,435,529円
イオン・バランス戦略ファンド	51,896,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,457,849円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,042,841円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,931,733円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	77,885,818円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,430,283円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,131,556円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	24,104,917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>	1,736,006,800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>	73,408,505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>	11,541,133,932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>	5,789,213,731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>	13,034,779,889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>	105,186,441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>	558,437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>	762,181,383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>	122,817,278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>	1,275,375,766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>	1,583,991,812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>	2,038,275,666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>	6,652,838,286円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <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>	11,134,953,111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)	535,979,423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)	1,245,644,030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>	186,677,195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>	242,900,447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)	1,494,332,748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>	152,344,874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>	40,322,301円

SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	142,814,622円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	551,798,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	171,602,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,401,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,978,475円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,651,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,348,834,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,153,877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>	3,670,504,123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>	1,616,384,536円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,185,538,375円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	693,320,307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>	44,399,157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>	40,044,700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>	410,598,751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>	196,656,702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>	484,437,893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>	824,402,719円
合計	92,111,667,202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	2,800,000.00	2,766,968.76	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,961,328.14	
		US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,716,281.25	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,925,234.39	

US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,381,875.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,626,382.82	
US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,042,085.94	
US TREASURY N/B 1.25	2,400,000.00	2,376,000.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,526,312.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,408,945.33	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,869,921.89	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,955,078.15	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,960,000.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,957,500.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,965,312.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,946,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,254,882.82	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,957,812.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,644,789.08	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,948,671.89	
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,354,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,921,562.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,367,656.25	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,401,562.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,880,468.75	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,970,234.39	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	989,843.75	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,978,125.00	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,934,609.39	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,910,000.00	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,908,593.75	
US TREASURY N/B 1.5	4,800,000.00	4,497,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,985,625.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,467,187.50	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,970,468.75	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,458,984.37	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,935,078.14	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,911,875.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,418,789.08	

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,920,546.89	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,918,437.50	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,909,531.25	
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,280,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,221,234.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,700,000.00	3,666,179.70	
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,979,531.26	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,957,578.14	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,953,828.14	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,772,015.63	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,360,812.51	
US TREASURY N/B 1.75	800,000.00	786,937.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,949,609.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,950,312.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,944,687.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,939,062.50	
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,573,531.25	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,981,250.00	
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,371,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,976,562.50	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,962,031.25	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,961,093.75	
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,676,757.82	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,944,062.52	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,955,703.14	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,756,828.13	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,984,296.89	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,287,601.57	
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,270,187.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,981,015.64	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,980,312.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,980,312.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,978,203.14	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,977,265.64	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,268,421.87	

US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,473,476.58	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,075,539.07	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,970,937.50	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	494,765.62	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,967,890.64	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,436,835.96	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,967,656.26	
US TREASURY N/B 2	4,200,000.00	4,131,750.00	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,457,617.20	
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,482,750.00	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,196,531.25	
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	6,005,765.65	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,989,218.75	
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,688,609.37	
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,692,960.94	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,983,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,986,406.25	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,985,937.50	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,982,656.25	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,973,437.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,071,906.25	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,980,312.50	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,960,625.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,460,898.45	
US TREASURY N/B 2.125	4,400,000.00	4,347,406.27	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,777,078.13	
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	4,823,054.71	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,991,875.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,994,375.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,996,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,795,406.26	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,988,984.39	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,179,687.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,491,328.12	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,257,179.71	

US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,079,898.45	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,959,062.52	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,119,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,104,531.27	
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	6,078,421.90	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,652,031.25	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,000,312.50	
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	5,001,953.15	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,000,937.50	
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,608,437.50	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,202,437.50	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,605,250.00	
US TREASURY N/B 2.375	6,900,000.00	6,850,406.25	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,518,320.33	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,035,156.25	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,743,640.62	
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,629,828.14	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,406,125.00	
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,697,179.71	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	2,662,335.95	
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,493,835.96	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,010,312.52	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,518,906.25	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	502,812.50	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,025,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,025,937.52	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,024,843.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,045,000.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,355,429.70	
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	5,870,687.50	
US TREASURY N/B 2.625	3,800,000.00	3,829,390.63	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,038,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,414,218.75	
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000.00	6,097,968.78	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,034,531.26	

US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,206,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,311,406.25	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,194,828.12	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,039,843.76	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,098,828.15	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	611,812.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	4,890,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,948,906.26	
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	2,724,312.50	
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,308,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,441,406.25	
US TREASURY N/B 2.875	7,200,000.00	7,298,437.53	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,047,968.76	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,258,953.13	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,129,390.62	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,568,554.70	
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,629,726.58	
US TREASURY N/B 2.875	7,300,000.00	7,510,445.34	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,978,671.89	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,956,875.00	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,557,250.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,138,125.00	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,207,531.25	
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,831,781.25	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,052,187.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,052,187.52	
US TREASURY N/B 3	4,800,000.00	4,862,625.02	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,531,445.32	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,224,921.88	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,129,304.70	
US TREASURY N/B 3	1,500,000.00	1,514,296.87	
US TREASURY N/B 3	3,200,000.00	3,232,750.01	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,047,109.39	
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	5,985,445.32	
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,144,601.56	

US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,078,281.26	
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,451,953.13	
US TREASURY N/B 3.125	5,100,000.00	5,279,296.87	
US TREASURY N/B 3.125	1,200,000.00	1,241,062.50	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,320,937.52	
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,364,710.93	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,549,921.87	
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	888,375.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,110,937.50	
US TREASURY N/B 3.625	3,800,000.00	4,271,734.39	
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,048,593.76	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,718,203.12	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,586,875.00	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,749,960.94	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,225,937.50	
US TREASURY N/B 4.25	1,800,000.00	2,210,484.38	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	620,781.25	
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	872,484.37	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,745,296.88	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,248,312.50	
US TREASURY N/B 4.5	900,000.00	1,119,585.94	
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	252,296.87	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,265,781.25	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,702,273.44	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,966,640.62	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	663,593.75	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	614,648.44	
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	410,725.00	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	622,890.62	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,221,953.13	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,277,421.88	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	927,812.50	
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	638,242.19	
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,481,390.62	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,081,328.13	

米ドル 小計		668,720,000.00	671,633,445.02 (75,122,200,825)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,941,800.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,900,000.00	1,876,934.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,971,698.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,962,600.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	949,180.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,996,500.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,996,340.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,189,200.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,108,448.00
	CANADA-GOV'T 2	500,000.00	513,130.00
	CANADA-GOV'T 2.25	400,000.00	413,360.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,453,326.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,406,766.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,300,000.00	1,348,230.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,600,000.00	1,868,800.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	619,145.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,034,740.00
	CANADA-GOV'T 3.5	3,900,000.00	3,976,167.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,959,900.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,034,060.00
CANADA-GOV'T 5	1,200,000.00	1,757,172.00	
CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	822,558.00	
CANADA-GOV'T 5.75	900,000.00	1,335,987.00	
CANADA-GOV'T 8	500,000.00	738,385.00	
カナダドル 小計		34,300,000.00	37,274,426.00 (3,091,913,636)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	34,000,000.00	37,130,720.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,590,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	5,000,000.00	4,799,200.00
	MEXICAN BONOS 7.5	21,000,000.00	20,232,450.00
	MEXICAN BONOS 8	47,000,000.00	47,029,140.00
	MEXICAN BONOS 8	22,000,000.00	22,036,740.00
	MEXICAN BONOS 8.5	36,000,000.00	36,796,320.00

	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	39,901,600.00
	メキシコペソ 小計	225,000,000.00	225,516,770.00 (1,323,783,439)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	984,704.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,368,367.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	732,333.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	520,220.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,913,360.00
	BELGIAN 0304 5	1,800,000.00	2,874,888.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,697,235.00
	BELGIAN 0318 3.75	1,600,000.00	1,697,760.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,671,278.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,451,047.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,309,350.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,974,805.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,664,295.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	572,560.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	649,040.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,035,430.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	572,655.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	421,392.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,491,616.00
	BELGIAN 1	1,300,000.00	1,349,842.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	422,796.00
	BELGIAN 1.6	800,000.00	824,976.00
	BELGIAN 1.9	700,000.00	787,703.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	553,300.00
	BELGIAN 3.75	900,000.00	1,368,216.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	989,210.00
	BTPS 0.35	500,000.00	500,845.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,481,970.00
	BTPS 0.45	1,500,000.00	1,493,985.00
	BTPS 0.65	1,600,000.00	1,606,624.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,926,720.00
	BTPS 0.7	2,000,000.00	2,010,440.00
	BTPS 0.9	800,000.00	792,240.00

BTPS 0.95	2,000,000.00	1,967,620.00	
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,003,410.00	
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,877,660.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,013,940.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,014,920.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,760,544.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	969,070.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,625,750.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,159,680.00	
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,754,120.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,005,040.00	
BTPS 2	2,300,000.00	2,292,548.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,555,152.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,468,020.00	
BTPS 2.15	500,000.00	515,535.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	992,340.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,072,080.00	
BTPS 2.3	600,000.00	620,550.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,037,212.00	
BTPS 2.5	600,000.00	619,428.00	
BTPS 2.5	500,000.00	512,125.00	
BTPS 2.7	1,700,000.00	1,498,448.00	
BTPS 2.8	300,000.00	306,960.00	
BTPS 2.8	900,000.00	754,416.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	956,030.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,458,480.00	
BTPS 3.35	300,000.00	308,406.00	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,393,826.00	
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,035,926.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,646,200.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,123,020.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,411,552.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,190,020.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,623,150.00	
BTPS 4	2,100,000.00	2,331,945.00	

BTPS 4.5	2,300,000.00	2,571,216.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,384,600.00	
BTPS 4.5	1,700,000.00	1,954,779.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,834,416.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,832,875.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,502,948.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	1,931,376.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,219,600.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,166,970.00	
BTPS 5	2,070,000.00	2,549,929.50	
BTPS 5	2,000,000.00	2,476,520.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,340,591.00	
BTPS 5.25	1,900,000.00	2,344,391.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,277,500.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,286,540.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	2,875,642.00	
BTPS 6	2,700,000.00	3,563,163.00	
BTPS 6.5	3,000,000.00	3,943,050.00	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,345,670.00	
BTPS 9	300,000.00	396,513.00	
BUNDESOBL-171 0	1,300,000.00	1,307,293.00	
BUNDESOBL-172 0.25	2,000,000.00	2,025,080.00	
BUNDESOBL-173 0	2,500,000.00	2,530,150.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,044,130.00	
DEUTSCHLAND REP 0	700,000.00	713,377.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,500,000.00	2,591,825.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,450,000.00	3,550,498.50	
DEUTSCHLAND REP 0.25	900,000.00	922,959.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,600,000.00	2,735,278.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	949,698.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,584,090.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,109,640.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,399,281.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,650,000.00	2,877,582.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	400,000.00	464,944.00	

DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,675,475.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,696,150.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,165,620.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,198,620.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,364,978.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,215,500.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,663,620.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,558,140.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,494,570.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,580,745.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,195,060.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,099,558.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,128,250.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	1,920,816.00	
DEUTSCHLAND REP 4	2,200,000.00	3,576,738.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,607,420.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,100,000.00	1,594,395.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,178,833.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,179,493.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,474,308.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,507,180.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,581,900.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	700,000.00	1,171,597.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,553,810.00	
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	405,628.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	410,408.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	517,720.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	215,004.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,075,950.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,070,870.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,114,860.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	695,390.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	741,324.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	726,635.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,079,750.00	

FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,260,890.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,300,000.00	2,313,639.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,246,914.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,014,070.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,028,580.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,012,060.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,329,440.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,043,470.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,009,649.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,300,000.00	2,381,949.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,447,609.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,770,499.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,194,648.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,675,075.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,811,129.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	2,103,100.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,400,000.00	3,774,646.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,346,840.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,100,000.00	3,436,660.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,574,566.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	1,035,120.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,299,540.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,900,000.00	3,172,136.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000.00	4,848,852.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,660,440.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	2,700,000.00	3,295,782.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,800,000.00	4,639,572.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,521,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,722,592.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,300,000.00	3,313,196.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	3,000,000.00	3,120,780.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,800,000.00	3,498,824.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,692,400.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,536,572.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,984,951.80	

FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,612,280.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,623,790.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,100,000.00	5,170,335.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,300,000.00	3,671,743.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,536,780.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,663,456.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,187,760.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	814,506.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	404,596.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	723,828.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	730,793.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,058,990.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	325,818.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,133,190.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	711,948.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,174,330.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	582,400.00	
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,038,213.00	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,081,530.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,975,215.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,500,000.00	1,522,215.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,751,595.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,570,005.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,489,054.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	425,000.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,747,968.00	
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,122,420.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,635,255.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,300,000.00	1,672,970.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,400,000.00	2,130,926.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	868,744.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,574,805.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,159,980.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,171,884.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,236,206.00	

NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,037,575.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,995.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,068,240.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	600,000.00	612,444.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,477,728.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	210,040.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	434,956.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	208,334.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	300,000.00	330,546.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,214,884.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,095,620.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	749,166.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	890,904.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	682,854.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,097,030.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,123,570.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	930,675.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,581,000.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,039,232.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,341,760.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,508,340.00	
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,106,325.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,034,400.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,046,060.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,037,780.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,092,440.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,250,448.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,659,968.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	629,862.00	
SPANISH GOV'T 1.45	800,000.00	827,328.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,583,535.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,360,512.00	
SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	407,400.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,400,000.00	1,530,396.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,151,120.00	

	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,213,380.00	
	SPANISH GOV'T 2.35	1,400,000.00	1,543,234.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	400,000.00	439,312.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,384,445.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,609,636.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,364,957.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,242,076.00	
	SPANISH GOV'T 4	1,800,000.00	1,879,254.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,275,152.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,388,860.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,269,278.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	2,685,978.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,442,760.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,156,860.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,600,000.00	2,432,880.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,066,040.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,922,928.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,013,250.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,012,768.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,900,000.00	2,905,366.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,567,774.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,433,175.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,224,012.00	
	ユーロ 小計	425,230,000.00	493,987,965.80 (61,442,223,186)	
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,190,220.00	
	UK TSY GILT 0.75	300,000.00	299,115.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,700,000.00	1,726,520.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,938,280.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,900,000.00	1,971,497.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,631,575.00	
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	463,959.00	
	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,459,066.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,097,500.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,300,000.00	1,328,496.00	

	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	305,079.00
	UK TSY GILT 2	600,000.00	609,336.00
	UK TSY GILT 2	1,800,000.00	1,922,346.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,865,753.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,090,944.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,867,909.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,104,704.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	2,755,160.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,324,240.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,081,880.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	535,505.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,473,728.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,639,380.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,934,030.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,391,148.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,882,902.00
	UK TSY GILT 4.25	1,350,000.00	1,893,834.00
	UK TSY GILT 4.25	850,000.00	1,237,914.50
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,917,812.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,660,976.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,269,246.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,945,539.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	1,910,088.00
	UK TSY GILT 4.5	1,550,000.00	2,410,064.00
	UK TSY GILT 4.75	1,000,000.00	1,376,750.00
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,992,250.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,974,752.00
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,732,536.00
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,868,491.80
	英bond 小計	57,870,000.00	73,080,525.30 (10,535,288,527)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	10,100,000.00	10,834,169.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,576,730.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,794,400.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,974,640.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,894,618.00

	SWEDISH GOVRMNT 5	7,800,000.00	8,491,080.00	
スウェーデンクローナ 小計		42,500,000.00	48,565,637.00	(568,703,609)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,967,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,058,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,500,000.00	6,642,675.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,098,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,283,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,292,200.00	
ノルウェークローネ 小計		30,500,000.00	31,341,075.00	(403,673,046)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,549,000.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	1,900,000.00	1,998,800.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,446,500.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	9,000,000.00	10,211,400.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,648,200.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	11,500,000.00	20,731,050.00	
デンマーククローネ 小計		37,900,000.00	49,584,950.00	(826,085,267)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,000,000.00	1,976,000.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,006,600.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,011,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,459,950.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	2,946,000.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,900,000.00	6,136,000.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,880,900.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,105,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,390,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,729,662.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,252,920.00	
	ポーランドズロチ 小計		34,300,000.00	35,894,032.00
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	3,016,590.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,018,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	413,220.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,300,000.00	2,393,150.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	800,000.00	853,280.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,664,717.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,379,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,952,532.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,634,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	874,960.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,227,347.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,090,760.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,153,460.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,162,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,486,764.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,000,000.00	3,525,900.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	600,000.00	617,930.94
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,836,240.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,500,000.00	3,073,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,200,000.00	2,556,180.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,047,940.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,419,250.00
	オーストラリアドル 小計	38,900,000.00	43,397,771.44 (3,402,819,258)
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	1,031,900.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	415,800.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	726,047.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	425,400.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	735,700.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	831,040.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	814,476.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	563,730.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,200,000.00	1,321,800.00
	シンガポールドル 小計	7,600,000.00	7,974,143.00 (654,198,691)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	5,000,000.00	4,979,446.25
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,100,000.00	8,872,775.36
	MALAYSIA GOVT 3.955	1,000,000.00	1,008,671.50

		MALAYSIA GOVT 4.378	5,500,000.00	5,532,863.60	
		MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,192,135.00	
		MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,051,112.20	
	マレーシアリングット 小計		28,600,000.00	28,637,003.91	(774,344,585)
	南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,210,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	15,955,840.00	
		REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	50,202,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	9,205,000.00	
	南アフリカランド 小計		146,000,000.00	117,572,840.00	(908,838,053)
合計				160,094,281,169	(160,094,281,169)

(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 214銘柄	46.2%	46.9%
カナダドル	国債証券 24銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 266銘柄	37.7%	38.4%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.2%	0.3%
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%
マレーシアリングット	国債証券 6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。

iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

(純資産計算書)

区分	2018年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	14,469,132
短期金融資産	62,171
投資総額	14,531,303
その他資産及び負債	213,427
純資産額	14,744,730

(1口当たり情報)

(2018年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 104.57米ドル

【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4期中間計算期間(平成31年4月27日から令和1年10月26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。

【イオン・バランス戦略ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期中間計算期間 (令和1年10月26日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	1,216,018
金銭信託	2,861,960
コール・ローン	42,128,051
投資信託受益証券	9,871,852
親投資信託受益証券	2,416,273,998
流動資産合計	2,472,351,879
資産合計	2,472,351,879
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,930,720
未払受託者報酬	388,165
未払委託者報酬	10,998,010
未払利息	158
その他未払費用	77,799
流動負債合計	15,394,852
負債合計	15,394,852
純資産の部	
元本等	
元本	2,380,510,711
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	76,446,316
元本等合計	2,456,957,027
純資産合計	2,456,957,027
負債純資産合計	2,472,351,879

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第4期中間計算期間 自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
営業収益	
受取配当金	2,836,865
受取利息	1,835
有価証券売買等損益	74,845,272
為替差損益	7,405,296
営業収益合計	70,278,676
営業費用	
支払利息	12,352
受託者報酬	388,165
委託者報酬	10,998,010
その他費用	126,339
営業費用合計	11,524,866
営業利益又は営業損失（ ）	58,753,810
経常利益又は経常損失（ ）	58,753,810
中間純利益又は中間純損失（ ）	58,753,810
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（ ）	3,856,603
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	16,772,702
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,427,622
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	6,427,622
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,651,215
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,651,215
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（ ）	76,446,316

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間 自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、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. 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. 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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第4期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,380,510,711口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0321円
	(10,000口当たりの純資産額 10,321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4期中間計算期間 (令和 1年10月26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（投資信託受益証券、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4期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
期首元本額	2,310,908,333円
期中追加設定元本額	282,207,883円
期中一部解約元本額	212,605,505円

（参考）

イオン・バランス戦略ファンドは、「日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、および「iシェアーズ」J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
（令和 1年10月26日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,745,573,428
国債証券	7,952,210,715
未収入金	635,668,000
未収利息	6,477,880
前払費用	3,173,071
流動資産合計	13,343,103,094
資産合計	13,343,103,094
負債の部	
流動負債	
未払金	237,787,800
未払利息	8,971
その他未払費用	39,517
流動負債合計	237,836,288
負債合計	237,836,288
純資産の部	
元本等	
元本	10,876,139,614
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,229,127,192
元本等合計	13,105,266,806
純資産合計	13,105,266,806
負債純資産合計	13,343,103,094

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年10月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		10,876,139,614口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2050円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,050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10月26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） 「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10月26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	11,545,167,174円
同期中における追加設定元本額	1,063,805,122円
同期中における一部解約元本額	1,732,832,682円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	801,220,673円
S M A M ・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	9,420,942,726円

(令和 1年10月26日現在)	
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>	653,976,215円
合計	10,876,139,614円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	162,581,112
コール・ローン	81,023,065
国債証券	25,338,616,990
未収入金	5,700,854
未収利息	196,281,031
前払費用	13,744,225
流動資産合計	25,797,947,277
資産合計	25,797,947,277
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	440,398,662
未払解約金	67,000,000
未払利息	153
その他未払費用	2,212
流動負債合計	507,401,027
負債合計	507,401,027
純資産の部	
元本等	
元本	17,157,118,552
剰余金	
剰余金又は欠損金()	8,133,427,698
元本等合計	25,290,546,250
純資産合計	25,290,546,250
負債純資産合計	25,797,947,277

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26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10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		17,157,118,552口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4741円
	(10,000口当たりの純資産額	14,741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10月26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10月26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)

(令和 1年10月26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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,374,177,838	-	25,814,576,500	440,398,662
	米ドル	12,243,797,256	-	12,322,997,500	79,200,244
	カナダドル	464,603,409	-	473,556,000	8,952,591
	メキシコペソ	205,760,995	-	214,514,000	8,753,005
	ユーロ	9,595,952,021	-	9,825,791,000	229,838,979
	英ポンド	1,579,214,728	-	1,661,716,000	82,501,272
	スウェーデンクローナ	86,806,780	-	88,954,000	2,147,220
	ノルウェークローネ	59,243,500	-	59,350,000	106,500
	デンマーククローネ	134,237,950	-	137,360,000	3,122,050
	ポーランドズロチ	145,379,664	-	152,172,000	6,792,336
	オーストラリアドル	502,466,970	-	511,152,000	8,685,030
	シンガポールドル	218,498,000	-	223,104,000	4,606,000
	南アフリカランド	138,216,565	-	143,910,000	5,693,435
合計	25,374,177,838	-	25,814,576,500	440,398,662	

(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。

(その他の注記)

(令和 1年10月26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	20,968,888,985円
同期中における追加設定元本額	5,495,078,177円
同期中における一部解約元本額	9,306,848,610円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,550,679,255円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,904,933,318円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	729,040,475円
イオン・バランス戦略ファンド	649,348,987円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	49,064,685円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,912,620円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,181,032円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	4,571,549円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,087,212円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	10,628,391円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,245,923,775円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,957,251円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,026,026,511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>	77,518,149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>	364,711,921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>	523,533,421円
合計	17,157,118,552円

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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,207,506,492
株式	167,728,630,910
派生商品評価勘定	53,241,420
未収入金	8,709,840
未収配当金	1,611,312,783

(令和 1年10月26日現在)

流動資産合計	170,609,401,445
資産合計	170,609,401,445
負債の部	
流動負債	
前受金	53,375,000
未払金	8,985,000
未払解約金	445,091,005
未払利息	2,282
その他未払費用	16,240
流動負債合計	507,469,527
負債合計	507,469,527
純資産の部	
元本等	
元本	64,685,704,148
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	105,416,227,770
元本等合計	170,101,931,918
純資産合計	170,101,931,918
負債純資産合計	170,609,401,445

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26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10月26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	2,992,800,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		64,685,704,148口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.6297円
	(10,000口当たりの純資産額)	26,297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10月26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10月26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	1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420
	東証株価指数先物	1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420
合計		1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420

（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10月26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	68,808,381,443円
同期中における追加設定元本額	5,341,961,262円
同期中における一部解約元本額	9,464,638,557円
令和 1年10月26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	10,151,843,641円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	884,182,364円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,183,011,248円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,992,025,716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)	124,943,684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)	7,056,540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)	24,943,610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)	66,546,333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)	110,464,724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)	70,365,034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)	157,448,517円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,758,274,706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	11,140,385,871円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	618,603,170円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	634,445,526円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	517,153,532円
イオン・バランス戦略ファンド	48,100,552円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,912,963円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,879,134円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	45,339,698円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	125,124,624円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	71,923,495円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	95,618,033円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	12,600,123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)	80,525円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	141,272円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	202,283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)	4,012,700,692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>	22,019,252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>	218,475,561円
S M A M ・バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	3,210,831,471円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,378,640,210円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,713,571,444円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	58,224,066円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	218,959,028円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	794,882円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	908,494,350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>	56,544,959円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	378,569,673円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,106,018,298円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	888,237,600円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,905,203,061円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,158,682円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	61,193,764円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	88,043,237円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	45,801,688円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,678,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	190,920,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	362,575,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	42,874,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	115,646,200円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	60,142,141円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,363,931円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	74,004,445円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	919,193,597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）	195,800,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,874,254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>	1,242,973,034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>	195,532,883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
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	114,936,447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>	13,800,187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>	87,168,514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>	125,175,129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>	139,630,462円
合計	64,685,704,148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10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	1,775,017,663
コール・ローン	2,367,253,844
株式	209,001,707,070

(令和 1年10月26日現在)

投資証券	5,949,725,528
派生商品評価勘定	63,841,995
未収入金	2,639,128
未収配当金	197,958,044
差入委託証拠金	1,474,767,863
流動資産合計	220,832,911,135
資産合計	220,832,911,135
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,146,888
前受金	62,306,938
未払金	171,343
未払解約金	260,483,369
未払利息	4,475
その他未払費用	4,507
流動負債合計	325,117,520
負債合計	325,117,520
純資産の部	
元本等	
元本	59,477,422,867
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	161,030,370,748
元本等合計	220,507,793,615
純資産合計	220,507,793,615
負債純資産合計	220,832,911,135

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26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>

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
	(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。
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	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,477,422,867口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.7074円 (10,000口当たりの純資産額 37,074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10月26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10月26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	5,486,773,742	-	5,549,080,680	62,306,938
	SPMINI 1912	3,962,792,791	-	4,001,789,673	38,996,882
	DJ EUR 1912	943,324,815	-	963,223,417	19,898,602
	FTSE 1912	334,926,305	-	336,769,910	1,843,605
	SPI200 1912	245,729,831	-	247,297,680	1,567,849
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,041,084,631	-	2,040,472,800	611,831
	米ドル	1,412,632,000	-	1,413,230,000	598,000
	カナダドル	73,107,760	-	73,172,000	64,240
	ユーロ	244,284,660	-	243,814,000	470,660
	英ポンド	115,036,160	-	114,554,000	482,160
	スイスフラン	66,876,740	-	66,801,100	75,640
	スウェーデンクローナ	19,948,254	-	19,930,200	18,054
	ノルウェークローネ	4,759,880	-	4,752,000	7,880
	デンマーククローネ	13,114,467	-	13,089,600	24,867
	オーストラリアドル	50,570,240	-	50,401,600	168,640
	ニュージーランドドル	1,394,400	-	1,386,400	8,000
	香港ドル	25,778,670	-	25,779,600	930
	シンガポールドル	9,574,800	-	9,570,000	4,800
	イスラエルシェケル	4,006,600	-	3,992,300	14,300
	合計	7,527,858,373	-	7,589,553,480	61,695,107

(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10月26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	50,156,918,145円
同期中における追加設定元本額	17,597,791,759円
同期中における一部解約元本額	8,277,287,037円
令和 1年10月26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	23,988,644,918円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	319,900,475円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,268,733,114円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	842,664,043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)	78,667,934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)	2,230,162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)	8,805,522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)	24,250,262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)	49,818,720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)	35,858,348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)	84,498,995円
外国株式指数ファンド	518,821,440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	4,463,218,648円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	383,641,247円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	390,701,353円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	317,907,624円
イオン・バランス戦略ファンド	14,934,063円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,567,880円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	36,272,187円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,400,907円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	88,434,058円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	50,673,683円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	67,363,743円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,994,520円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	56,291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)	1,510,998,304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>	7,733,190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>	73,969,974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>	1,504,940,221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>	1,460,709,925円

（令和 1年10月26日現在）	
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>	20,735,530円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,934,006円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	419,448円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	734,759,494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>	60,167,094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>	767,803,553円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	628,702,300円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,544,314,843円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	807,485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）	300,344,466円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	130,007,149円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	20,478,960円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	12,859,940円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,751,404円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	44,823,065円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	109,633,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	30,346,977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>	883,202,518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>	138,400,774円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,822,528,466円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	264,988,176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>	3,563,705,816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>	9,674,740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>	54,990,620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>	79,129,569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>	181,514,844円
合計	59,477,422,867円

Jリート・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10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	80,797,333
投資証券	7,411,590,080
未収配当金	55,345,187
流動資産合計	7,547,732,600
資産合計	7,547,732,600
負債の部	

（令和 1年10月26日現在）

流動負債	
未払解約金	30,000,000
未払利息	152
その他未払費用	949
流動負債合計	30,001,101
負債合計	30,001,101
純資産の部	
元本等	
元本	2,774,543,656
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,743,187,843
元本等合計	7,517,731,499
純資産合計	7,517,731,499
負債純資産合計	7,547,732,600

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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. 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10月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,774,543,656口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7095円 (10,000口当たりの純資産額 27,095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10月26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（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（令和 1年10月26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	5,748,282,368円
同期中における追加設定元本額	964,854,305円
同期中における一部解約元本額	3,938,593,017円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	376,799,307円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	484,393,600円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	385,787,478円
イオン・バランス戦略ファンド	66,663,605円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,066,895,524円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,171,229円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	10,770,192円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	8,049,068円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	21,689,309円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	12,697,517円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	11,522,248円

(令和 1年10月26日現在)	
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,007,023円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	397,582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>	40,647,409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>	17,150,036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>	108,080,622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>	153,821,907円
合計	2,774,543,656円

外国リート・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10月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	39,745,277
コール・ローン	12,137,957
投資証券	6,583,541,063
派生商品評価勘定	2,991
未収入金	66,089
未収配当金	6,196,254
流動資産合計	6,641,689,631

資産合計

6,641,689,631

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	2,224
未払解約金	2,400,000
未払利息	22
その他未払費用	26
流動負債合計	2,402,272

負債合計

2,402,272

純資産の部

元本等

元本	2,845,386,218
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,793,901,141
元本等合計	6,639,287,359

純資産合計

6,639,287,359

負債純資産合計

6,641,689,631

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
----	-------------------------------

1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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.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10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,845,386,218口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.3334円
	(10,000口当たりの純資産額)	23,334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10月26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。	

2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(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)

(令和 1年10月26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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	7,500,000	-	7,501,089	1,089
	米ドル	6,500,000	-	6,502,991	2,991
	ユーロ	1,000,000	-	998,098	1,902
	売建	1,000,000	-	1,000,322	322
	米ドル	1,000,000	-	1,000,322	322
合計		8,500,000	-	8,501,411	767

(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。

（その他の注記）

（令和 1年10月26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	2,475,122,234円
同期中における追加設定元本額	1,229,656,387円
同期中における一部解約元本額	859,392,403円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	118,897,836円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	102,141,804円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	75,557,817円
イオン・バランス戦略ファンド	56,191,028円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,338,993,778円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,476,851円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	12,638,783円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	9,459,202円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	25,553,273円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	14,932,495円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	13,491,825円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,447,155円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	439,498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>	38,667,840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>	15,497,033円
合計	2,845,386,218円

i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

（純資産計算書）

区分	2018年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	14,469,132
短期金融資産	62,171
投資総額	14,531,303
その他資産及び負債	213,427
純資産額	14,744,730

（1口当たり情報）

（2018年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 104.57米ドル	

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

イオン・バランス戦略ファンド

2019年11月29日現在

資産総額	2,469,332,291円
負債総額	9,833,666円
純資産総額（ - ）	2,459,498,625円
発行済口数	2,387,433,712口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0302円
（1万口当たり純資産額）	（10,302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ます。

へ 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11月29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11月29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	762	8,210,104
単位型株式投資信託	118	645,445
追加型公社債投資信託	1	29,929
単位型公社債投資信託	187	517,762
合計	1,068	9,403,241

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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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、第34期（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、第35期中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）の中間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 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	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)
(単位：千円)		
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)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
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
固定負債		
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
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	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	-
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		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	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います。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います。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(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)
その他有価証券 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

その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)その他有価証券」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		
その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	㈱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㈱	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いません。
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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和1年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		31,390,396
顧客分別金信託		120,015
前払費用		518,120
未収委託者報酬		9,224,857
未収運用受託報酬		2,518,829
未収投資助言報酬		300,807
未収収益		49,098
その他		251,169
流動資産合計		44,373,295
固定資産		
有形固定資産	1	1,165,925
無形固定資産		
のれん		35,720,818
顧客関連資産		18,841,803
その他		1,287,309
無形固定資産合計		55,849,931
投資その他の資産		
投資有価証券		19,980,993
関係会社株式		11,208,183
その他		2,725,272
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		33,893,699
固定資産合計		90,909,555
資産合計		135,282,851
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,568
顧客からの預り金		3,725
その他の預り金		117,464
未払金		4,558,058
未払費用		4,003,445
未払法人税等		1,108,639
前受収益		37,155
賞与引当金		1,620,047
資産除去債務		248,260
その他	2	262,615
流動負債合計		11,960,980
固定負債		
リース債務		1,045
退職給付引当金		5,317,984
賞与引当金		2,537
その他		218,125
繰延税金負債		3,515,376
固定負債合計		9,055,069
負債合計		21,016,049
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245

その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	19,373,541
利益剰余金合計	21,194,745
株主資本合計	113,750,729
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	516,072
評価・換算差額等合計	516,072
純資産合計	114,266,801
負債純資産合計	135,282,851

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			28,593,570
運用受託報酬			4,633,054
投資助言報酬			661,581
その他の営業収益			118,885
営業収益計			34,007,092
営業費用			21,567,446
一般管理費	1		11,224,956
営業利益			1,214,689
営業外収益	2		258,897
営業外費用	3		41,920
経常利益			1,431,666
特別損失	4		11,471
税引前中間純利益			1,420,194
法人税、住民税及び事業税			950,377
法人税等調整額			118,269
法人税等合計			832,107
中間純利益			588,086

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30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	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		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	21,255,054
当中間期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,881,513
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,373,541

	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	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			77,989	77,989	77,989
当中間期変動額合計	1,881,513	80,045,486	77,989	77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（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（リース資産を除く）

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 2～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(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。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れ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。

(2)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中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職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、当中間会計期間にお

いて発生していると認められる額を計上しております。

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中間会計期間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. その他中間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)

(中間損益計算書)

当社は当中間会計期間より、「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「特別利益」ではなく「営業外収益」として、「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「特別損失」ではなく「営業外費用」として表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当中間会計期間から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。

この結果、従来の方法に比較して、「特別利益」は23,677千円減少し、「営業外収益」は同額増加しており、「特別損失」は30,023千円減少し、「営業外費用」は同額増加しております。また、「経常利益」は6,346千円減少しております。

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,557,220千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.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。当中間会計期間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。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) 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150,945千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自平成31年4月1日至令和1年9月30日)	
1.のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	287,191千円
無形固定資産	1,187,351千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	209,815千円
投資有価証券償還益	5,197千円
投資有価証券売却益	18,480千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	11,810千円
投資有価証券償還損	22,585千円
投資有価証券売却損	7,437千円
4.特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	6,094千円
合併関連費用は、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等であります。	
固定資産除却損	5,377千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

(変動事由の概要)

合併に伴う普通株式の発行による増加 16,230,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	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	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)

第35期中間会計期間 (自平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,675,025千円
1年超	6,419,696千円
合計	8,094,721千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間(令和1年9月30日)

令和1年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。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、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	31,390,396	31,390,396	-
(2)顧客分別金信託	120,015	120,015	-
(3)未収委託者報酬	9,224,857	9,224,857	-
(4)未収運用受託報酬	2,518,829	2,518,829	-
(5)未収投資助言報酬	300,807	300,807	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	19,935,624	19,935,624	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,528,392	2,528,392	-
資産計	66,018,923	66,018,923	-
(1)顧客からの預り金	3,725	3,725	-
(2)未払金			
未払手数料	4,192,554	4,192,554	-
負債計	4,196,280	4,196,280	-

(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おります。

(6)投資有価証券

その他有価証券

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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(7) 投資その他の資産

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おります。

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 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

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	11,208,183
合計	11,208,183

その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) その他有価証券」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。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間（令和1年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 11,208,183千円）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、記載していません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,082,796	11,176,487	906,308
小計	12,082,796	11,176,487	906,308
(2) 中間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	7,852,827	8,004,506	151,679
小計	7,852,827	8,004,506	151,679
合計	19,935,624	19,180,994	754,629

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 45,369千円）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、記載していません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(企業結合等関係)

(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その事業の内容

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) 企業結合を行った主な理由

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D S 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31年1月16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31年1月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年4月1日から令和1年9月30日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	企業結合日に交付した当社の普通株式の時価	81,927,000千円
取得原価		81,927,000千円

4. 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E Y 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P w C 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

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1) 発生したのれんの金額

37,043,811千円

(2) 発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	24,546,329千円
固定資産	34,001,531千円
資産合計	58,547,860千円
流動負債	5,406,939千円
固定負債	8,257,731千円
負債合計	13,664,671千円

（資産除去債務関係）

当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

当中間会計期間 （自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）	
期首残高	-
合併による増加額（注）	248,260
中間期末残高	248,260

（注）合併に伴い主として霞ヶ関オフィスの不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、資産除去債務の金額を計上しております。

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。

（セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30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	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

(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中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、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、中間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

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

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。

（1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,373円68銭
1株当たり中間純利益	17円36銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

（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 榮 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） XBRL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
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	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	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	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		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	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	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	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>

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(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 その他有価証券	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 その他有価証券	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

(単位：千円)

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. その他有価証券

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	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(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	第47期
	(平成30年3月31日)	(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主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(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 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 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 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 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9月末現在)

- (八) 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9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。

□ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
株式会社イオン銀行	51,250百万円	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	

資本金の額は、2019年9月末現在。

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。)
該当ありません。

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旨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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月4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」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの平成30年4月27日から平成31年4月26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、イオン・バランス戦略ファンドの平成31年4月26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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年11月22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 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 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の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の令和1年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月10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」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの平成31年4月27日から令和1年10月26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、イオン・バランス戦略ファンドの令和1年10月26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4月27日から令和1年10月26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。